



Versicherungs- und Finanzmathematik

LUH Kolloquium

Im Forschungskolloquium des Leibniz Lab of Insurance and Financial Mathematics und des Instituts für Mathematische Stochastik tragen Wissenschaftler und Praktiker über aktuelle Themen aus dem Bereich Versicherungs- und Finanzmathematik vor. Das Kolloquium richtet sich gleichermaßen an Studierende und Wissenschaftler sowie Praktiker und bietet ein Forum für den Austausch zwischen Wissenschaft und Wirtschaft.

Zeit:

Donnerstag, 8.07.2010
17.30 - 18.30 Uhr

Ort:

Institut für Mathematische Stochastik
Leibniz Universität Hannover
Welfengarten 1
30167 Hannover
Hörsaal F428



Organisation:

Prof. Dr. Ludwig Baringhaus
Prof. Dr. Rudolf Grübel
Prof. Dr. Stefan Weber
Dr. Thomas Knispel

Kontakt:

Dr. Thomas Knispel
knispel@stochastik.uni-hannover.de
Tel.: 0511/762 4249

Nächster Vortrag:

Prof. Dr. Michael Kupper (HU Berlin)

spricht zum Thema

Risk Preferences and their Robust Representation

Inhalt: Due to the plurality of interpretations of risk, we concentrate on context invariant features related to this notion: diversification and monotonicity. We define and study general properties of three key concepts, risk order, risk measure and risk acceptance family and their one-to-one relations. Our main result is a uniquely characterized dual robust representation of lower semi continuous risk orders. We then illustrate this approach in different settings. In the setup of random variables, where risk perception can be interpreted as a model risk, we give a robust representation for numerous risk measures: various certainty equivalents, or a general version of Aumann and Serrano's economic index. In the setup of lotteries where risk perception can be seen as a distributional risk, we show that the Value at Risk is a risk measure on this level (not for random variables) and give a robust representation. Finally risk perception on state dependent lotteries à la Anscombe and Aumann, where results clarifying the interplay between model risk and distributional risk are given, in particular for the Cerreia-Vioglio, Maccheroni, Marinacci, and Montrucchio uncertainty preferences or Maccheroni, Marinacci, and Rustichini variational preferences. It is based on joint work with Samuel Drapeau.

Interessenten sind herzlich eingeladen !

Ab 17.00 Uhr findet im Raum F 448 ein Empfang bei Kaffee und Gebäck statt.

Weitere Informationen zum Kolloquium und zur Anfahrt:

www.stochastik.uni-hannover.de

Weitere Informationen zum Leibniz Lab:

www.leibniz-lab.de

Versicherungs- und Finanzmathematik

Vorträge im Sommersemester 2010

- 22.04.2010 **Dr. Stefan Jaschke**
(Munich Re)
- 07.05.2010 **Prof. Dr. Axel Munk**
(Georg-August-Universität Göttingen)
- 07.05.2010 **Prof. Dr. Markus Reiß**
(Humboldt-Universität zu Berlin)
- 03.06.2010 **Prof. Dr. Moritz Kaßmann**
(Universität Bielefeld)
- 17.06.2010 **Prof. Dr. Christian Hipp**
(Universität Karlsruhe)
- 07.07.2010 **Prof. Dr. Holger Drees**
(Universität Hamburg)
- 08.07.2010 **Prof. Dr. Michael Kupper**
(Humboldt-Universität zu Berlin)

Interessenten sind herzlich eingeladen !

Weitere Informationen zu den Vorträgen:

www.stochastik.uni-hannover.de