

Seminar Versicherungs- und Finanzmathematik

Themen- und Terminübersicht

Freitag, 10. Januar 2014

- 14.00-15.00 Uhr David Kohn: **Risikomaße und ihre Akzeptanzmengen**
15.00-16.00 Uhr Christopher Demuth: **Konvexe Risikomaße auf L^∞ und Value at Risk (V@R)**
16.00-16.15 Uhr *Pause*
16.15-17.15 Uhr Thorge Thies: **Bedingte Risikomaße und ihre robuste Darstellung**
17.15-18.15 Uhr Philipp Popp: **Zeitkonsistenz dynamischer Risikomaße**

Samstag, 11. Januar 2014

- 09.15-10.15 Uhr Pascal Schoppe: **Grundlagen der Theorie Stochastischer Partieller Differentialgleichungen und Anwendungen in der Zinsmodellierung (HJM)**
10.15-11.15 Uhr Michael Fiedler: **Endlich-dimensionale Realisierungen von HJM-Modellen**
11.15-11.30 Uhr *Pause*
11.30-12.30 Uhr Judith Gottschalk: **Individual Post-retirement Longevity Risk Management under Systematic Mortality Risk**
12.30-13.45 Uhr *Mittagessen*
13.45-14.45 Uhr Anna Netenjakob-Hinterding: **Ein Modell zur Berechnung systemischer finanzieller Risiken**
14.45-15.45 Uhr Alexander Hinterding: **Die Auswirkungen von Schocks auf Finanzsysteme**
15.45-16.00 Uhr *Pause*
16.00-17.00 Uhr Nicolas Bettels: **Optimierung des Average Value at Risk (AV@R)**
17.00-18.00 Uhr Lisa Marie Subke: **Optimale Cat-Bond-Portfolios**
18.00-18.15 Uhr *Pause*
18.15-19.15 Uhr Svenja Eriksen: **Extreme Value Analysis of Actuarial Risks: Estimation and Model Validation**
19.15-20.15 Uhr Mark Felker: **Modelling Dependencies in Large Claims**

Sonntag, 12. Januar 2014

- 09.15-10.15 Uhr Sebastian Rychlewski: **Commodity Markets**
10.15-11.15 Uhr Sebastian König: **Electricity Markets and Structural Models**
11.15-11.30 Uhr *Pause*
11.30-12.30 Uhr Lukas Nolte: **A Multi-Fuel Structural Model for Electricity Pricing**
12.30-13.00 Uhr *Mittagessen*
13.00-14.00 Uhr Patrick Kobs: **Coherence and Elicitability**
14.00-15.00 Uhr Thorsten Weßling: **Das Eulerprinzip**
15.00-15.15 Uhr *Pause*
15.15-16.15 Uhr Alexander Labutin: **Asset Liability Management in der Lebensversicherung: Mögliche Modellierungsansätze**
16.15-17.15 Uhr Vincent Wegner: **Asset Liability Management in der Lebensversicherung: Numerische Betrachtung**

Hinweise:

- Das Seminar findet an der Leibniz Universität Hannover in Raum F 442 statt.
- Für den Vortrag stehen Ihnen Tafeln, ein Overhead-Projektor sowie ein Beamer zur Verfügung. Sie können wahlweise einen Tafelvortrag gestalten, eine Beamerpräsentation erstellen oder eine Mischform wählen.
- Der Vortrag sollte 50-60 Minuten dauern.
- Der Erwerb des Seminarscheins setzt einen gelungenen Vortrag voraus. Außerdem wird erwartet, dass Sie ein Handout erstellen, das die wesentlichen Erkenntnisse sowie wichtige Bezeichnungen zusammenfasst. Hierbei können Sie natürlich erstellte Vortragsfolien als Handout verwenden.