

**Workshop Hannover - Oldenburg**  
**29. & 30.11.2013**  
**Hauptgebäude der Leibniz Universität, Welfengarten 1, Raum f 442**

**Freitag, 29.11.2013**

- 14:30 Uhr            Empfang Raum f448
- 15:00 Uhr            **Dietmar Pfeifer, Carl von Ossietzky Universität Oldenburg**  
*Correlation and Diversification - New Aspects for a High-Dimensional Risk Environment*
- 15:45 Uhr            **Anna-Maria Hamm, Leibniz Universität Hannover & KVV**  
*An Introduction to Asset Liability Management: Issues of a Life Insurance*
- 16:30 Uhr            Pause
- 16:45 Uhr            **Stefan Tappe, Leibniz Universität Hannover & KVV**  
*On the Geometry of HJM Interest Rate Models and Perspectives to Infinite Dimensional Affine Processes*
- 17:30 Uhr            **Tahiri Rahantamialisoa, Leibniz Universität Hannover**  
*Stochastic Equations with Martingale-valued Measures in Hilbert Space*
- 18:15 Uhr            Diskussion
- 19:30 Uhr            Gemeinsames Abendessen: „Zwischenzeit“, Schaufelder Straße 11, Hannover-Nordstadt

**Samstag, 30.11.2013**

- 09:15 Uhr            **Zachary Feinstein, Princeton University**  
*Set-valued Risk Measures and Their Application to Systemic and Liquidity Risk*
- 10:00 Uhr            Pause
- 10:15 Uhr            **Lena Reh, Carl von Ossietzky Universität Oldenburg**  
*Measuring and Estimating Multivariate Tail Dependence*
- 11:00 Uhr            **Dominic Lauterbach, Carl von Ossietzky Universität Oldenburg**  
*Singular Mixture Copulas*
- 11:45 Uhr            Mittagessen
- 13:00 Uhr            **Thomas Salfeld, Leibniz Universität Hannover**  
*Stochastic Root Finding for Optimized Certainty Equivalents*
- 13:45 Uhr            **Matthias Fahrenwaldt, Leibniz Universität Hannover & KVV**  
*A PDE Approach to Option Pricing under Liquidity Risk and Large Trader Models*
- 14:30 Uhr            Ende der Veranstaltung