



Der Wissenschaftsfonds.



Institut f. Analysis und Zahlentheorie

Finanzmathematisches Kolloquium

Freitag, 11. 11. 2016, 14:00 Uhr

Seminarraum Analysis-Zahlentheorie (NT02008), Kopernikusgasse 24/II

Stochastische Steuerung für Versicherungen: Alte und neue Ansätze und Probleme.

CHRISTIAN HIPPE

(Karlsruhe Institute of Technology)

Abstract: Stochastische Steuerung für Versicherungen ist mittlerweile ein lebendiges Teilgebiet der Mathematik, es hat sich nach anfänglichen Versuchen, Methoden aus dem Finance zu adaptieren, etwas eigenständiger weiterentwickelt. Dazu gehören Methoden zur Lösung von Integro-Differentialgleichungen, von Nebenbedingungen, von Modifizierungen der Argumente für Viskositätslösungen und nicht-stationäre Ansätze für Mischungsmodelle. Schwerpunkt liegt in der numerischen Umsetzung und der Interpretation der numerischen Resultate.

S. Thonhauser, R. Tichy