

Oldenburger Nachwuchsworkshop für Versicherungs- und Finanzmathematik

Carl von Ossietzky Universität Oldenburg

Verein zur Förderung der Versicherungs- und
Finanzmathematik – Universität Oldenburg e.V.

11.-12. Februar 2020

Willkommen

Liebe Teilnehmer*innen,

willkommen an der Universität Oldenburg zum Nachwuchsworkshop 2020, welcher Ihnen die Gelegenheit bietet, moderne Forschungsfelder der Versicherungs- und Finanzmathematik kennenzulernen und diese mit jungen Nachwuchsforscher*innen aus dem deutschsprachigen Raum zu diskutieren.

Vortragende

*Nachwuchsforscher*innen*

Jörg Thomas Best, Uni Oldenburg
Frank Bosserhoff, Uni Ulm
Maximilian Diehl, TU Kaiserslautern
Maximilian Klein, Uni Augsburg
Felix Liebrich, LMU München
Marius Pluhar, Uni Oldenburg
Tino Werner, Uni Oldenburg
Dorothee Westphal, TU Kaiserslautern

*Seniorforscher*innen*

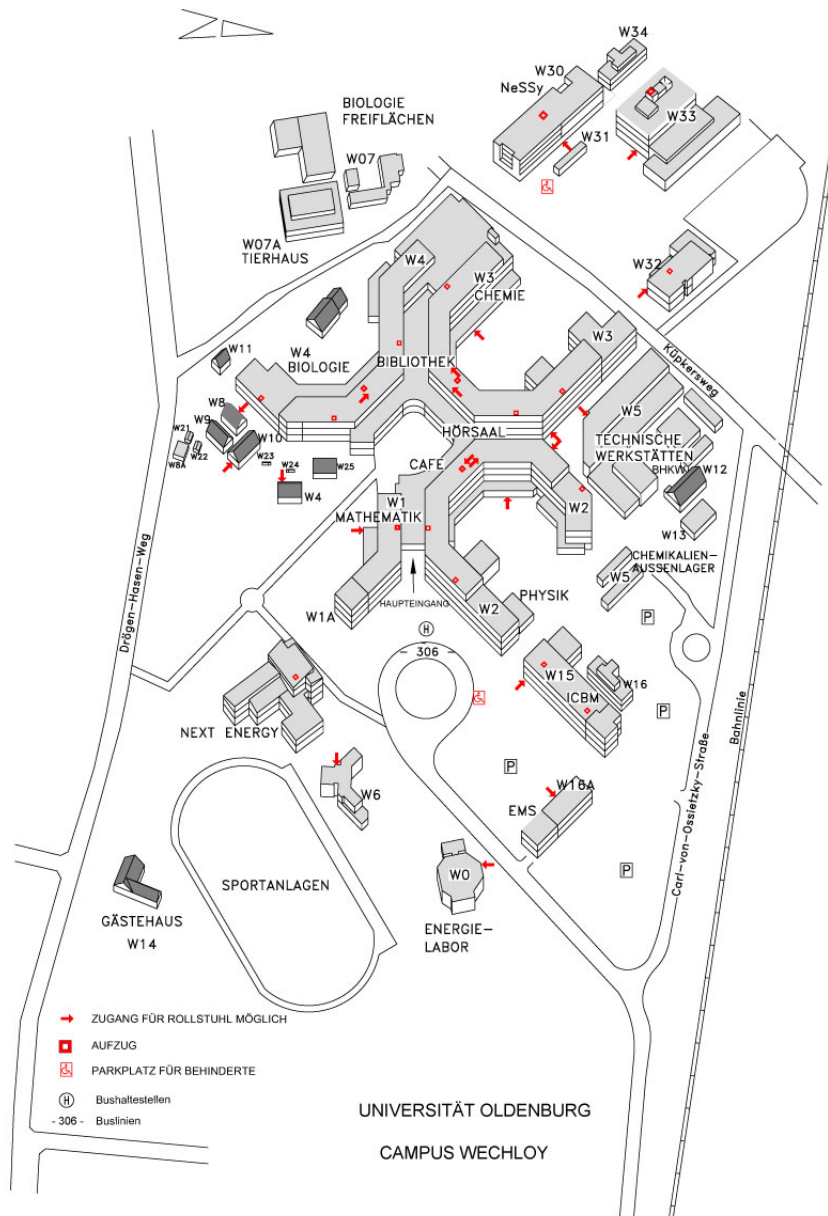
Klaus D. Schmidt, TU Dresden

Organisatoren

Marcus Christiansen, Uni Oldenburg
Angelika May, Uni Oldenburg
Peter Ruckdeschel, Uni Oldenburg

Tagungsort

Alle Vorträge finden im **Seminarraum W1 1-117** statt. Das Gebäude W1 befindet sich auf dem **Campus Wechloy** der Universität Oldenburg. Parkplätze stehen kostenfrei in der Carl-von-Ossietzky Straße zur Verfügung. Die Buslinie 306 verkehrt regelmäßig zwischen dem Campus Wechloy und der Innenstadt von Oldenburg.



Programm

Dienstag, 11. Februar 2020

15:00 Kaffee & Tee

15:30 – 15:45 Eröffnung

15:45 – 16:15 **Marius Pluhar**, Uni Oldenburg

*Time-inhomogeneous Variable Length Markov Chains
in Insurance*

16:15 – 16:45 **Tino Werner**, Uni Oldenburg

*Boosting for non-regular loss functions in
high-dimensional data*

17:00 – 17:30 **Maximilian Emanuel Klein**, Uni Augsburg

*On Almost Sure Convergence for Nested
Monte-Carlo Simulations*

17:30 – 18:00 **Maximilian Diehl**, TU Kaiserslautern

Development of a Life Insurer's Balance Sheet

19:00 Abendessen in der Oldenburger Innenstadt

Mittwoch, 12. Februar 2020

09:00 – 09:45 Special Guest

Klaus D. Schmidt, TU Dresden

*Das abstrakte kollektive Modell in Tarifierung und
Reservierung*

10:00 – 10:30 **Frank Bosserhoff**, Uni Ulm

*Mean-variance hedging of unit linked life insurance
in a jump-diffusion model*

10:30 – 11:00 **Dorothee Westphal**, TU Kaiserslautern

*Robust Utility Maximization in Continuous-Time
Financial Markets*

11:15 – 11:45 **Felix Liebrich**, LMU München

*Function Spaces under Model Uncertainty: Order and
Aggregation*

11:45 – 12:15 **Jörg Thomas Best**, Uni Oldenburg

*Examination of the L^p -Closedness of Spaces of
Stochastic Integrals*

12:30 Mittagessen in der Mensa