

Kolloquium
Finanz- und Versicherungsmathematik
08.05.2015

Ort

Vormittag: *Seminarraum Geometrie*, Kopernikusgasse 24, 4. Stock

Nachmittag: *Seminarraum C208*, Steyrergasse 30, 2. Stock

Programm

- 11:30 Eröffnung durch Univ.Prof. Dr. Robert Tichy
- 11:35 Univ.Prof. Dr. **Thorsten Rheinländer** (TU Wien)
Financial markets with a large trader
- 12:20 Mittagspause
- 14:00 Assoz.Univ.Prof. Dr. **Gunther Leobacher** (JKU Linz)
A numerical method for SDEs with discontinuous drift
- 14:45 MScAS. **Arian Cani** (Université de Lausanne)
Maximizing the expected discounted surplus
- 15:15 Pause
- 15:30 Dr. **Markus Hofer** (ING Amsterdam)
Wrong way risk in credit valuation adjustments
- 16:10 Ende

Stefan Thonhauser, Robert Tichy