

# 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*

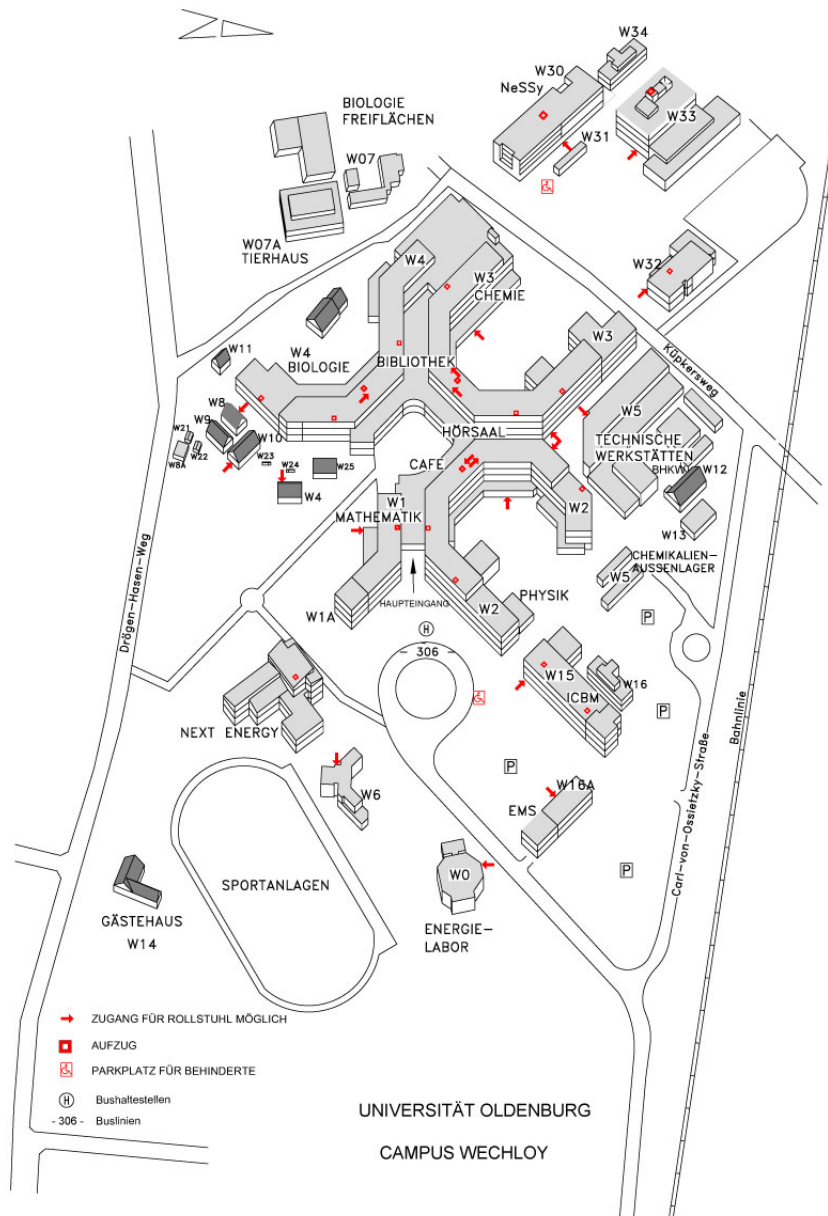
Klaus D. Schmidt, TU Dresden

## **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