

11. Dezember 2017



Verleihung des Frommknecht-Preises 2017 und Kolloquium zur Versicherungsmathematik

Die Fakultät für Mathematik und der Verein der Freunde der Fakultät laden ein:

16.30 Uhr, Begrüßung

Verleihung des Frommknecht-Preises für Versicherungsmathematik
durch Heinrich und Christa Frommknecht

im Anschluss:

Prof. Dr. Alfred Müller, Universität Siegen

Expektile, Omega ratios und stochastische Dominanz

In der Theorie von Risikomaßen hat in letzter Zeit das Konzept von Expektilen vermehrt Interesse gefunden. Diese sind nämlich die einzigen Risikomaße, welche gleichzeitig die wünschenswerten Eigenschaften Kohärenz und Elizitierbarkeit haben.

Wenn man Expektile vergleicht, so ist das mathematisch äquivalent zum Vergleich von Omega ratios, welche ein bekanntes Performancemaß für Investitionsstrategien sind.

In diesem Vortrag werden wir Expektile und Omega ratios vorstellen und ihren Zusammenhang erklären. Außerdem wird darauf eingegangen, inwieweit diese Konzepte konsistent sind mit stochastischer Dominanz.

Montag, 11. Dezember 2017, 16.30 Uhr, Hörsaal E28, Mathematikgebäude

Eine Nachsitzung ist vorgesehen.

Anmeldungen zur Nachsitzung bitte per Mail an:
ilona.rzepka@mathematik.tu-dortmund.de

<http://www.mathematik.tu-dortmund.de/de/index/veranstaltungen.html>

Fakultät für Mathematik
TU Dortmund
Vogelpothsweg 87
44221 Dortmund
Tel. 0231 / 755 - 3062