



**Programm Workshop am 12. Mai 2016 –
Bergische Universität Wuppertal
Arbeitsgruppe Stochastik - Raum G.16.08**

Dr. P. Jin – Bergische Universität Wuppertal
Dr. V. Krafft – Versicherungsgesellschaft Debeka
Dr. B. Koehler - Versicherungsgesellschaft Debeka
Prof. Dr. F. Russo – Universität ENSTA – Paris
Prof. Dr. B. Rüdiger – Bergische Universität Wuppertal

Zeit	Vortragender	Vortragstitel
ab 11:00 Kaffee und Tee		
11:30 – 12:15	Dr. B. Koehler	„Unspanned volatility in speziellen affinen Zinsmodellen“
12:30 – 13:15	Prof. Dr. F. Russo	„Backward SDEs, càdlàg martingale problems and mean-variance hedging under basis risk“
13:30 – 14:15	Mittagessen in der Mensa	
14:15 – 15:00	Dr. Peng Jin	“Exponential ergodicity of an affine two-factor model”
ab 15:00 Diskussionsforum		