

mgr Sebastian Baran
Uniwersytet Ekonomiczny w Krakowie
prof. Zbigniew Palmowski
Instytut Matematyczny Uniwersytetu Wrocławskiego

Optymalizacja oczekiwanej użyteczności wypłat dywidend w modelu Craméra–Lundberga

Referat będzie dotyczył problemu maksymalizacji oczekiwanej użyteczności wypłat dywidend w firmie ubezpieczeniowej. F. Hubalek oraz W. Schachermayer w swojej pracy [1] rozważali przedstawiony problem przy założeniu, że proces ryzyka jest modelowany ruchem Browna z dryfem. W referacie skoncentrujemy się na sytuacji, gdy proces nadwyżki finansowej jest opisany przez klasyczny model Craméra–Lundberga.

Bibliografia

- [1] F. Hubalek, W. Schachermayer, *Optimizing expected utility of dividend payments for a Brownian Risk process and a peculiar nonlinear ODE*, Insurance: Mathematics and Economics 34 (2004), 193–225.
- [2] S. Baran, Z. Palmowski, *Optimizing expected utility of dividend payments for a classical risk process with exponential claims*, wysłane do druku, 2014.