

dr Sebastian Baran

Uniwersytet Ekonomiczny w Krakowie

Optymalizacja oczekiwanej użyteczności wypłat dywidend firmy ubezpieczeniowej

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. Przedstawione zostaną rezultaty z prac [2] oraz [3].

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, *Optymalizacja oczekiwanej użyteczności wypłat dywidend firmy ubezpieczeniowej*, Rozprawa Doktorska, 2019.
- [3] S. Baran, Z. Palmowski, *Optimizing the expected utility of dividend payments for a Cramér–Lundberg risk process*, Applicationes Mathematicae 44 (2017), 247–265.