

Gastvortrag und Forschungsaufenthalt „Principal/Agent Problem: a BSDE approach“

12.-17. Juni 2016

Thibaut Mastrolia wurde an die Universität Innsbruck eingeladen, um gemeinsam mit dem Institut für Mathematik bzw. den dort ansässigen Forschungsinteressierten für stochastische Analysis (Florian Baumgartner, Tijana Levjakovic, David Cohen) und im Speziellen mit Dipl.-Ing. Alexander Steinicke Forschung über 'Stochastische Rückwärtsgleichungen' (Backward Stochastic Differential Equations, BSDEs) sowie 'Malliavin calculus' zu betreiben. Diesen Forschungsarbeiten liegt ein schriftlicher Entwurf (ein Preprint) zugrunde, an dem weitergearbeitet wurde. Es wurde ein vorläufiger Fortschritt auf dem Gebiet der „backward stochastic differential equations mit Poisson noise“ erreicht.

Des Weiteren hielt Dr. Mastrolia einen öffentlichen Vortrag über sein Forschungsgebiet am Technik Campus, der für ein breiteres Publikum als Spezialisten der Materie zugänglich war.

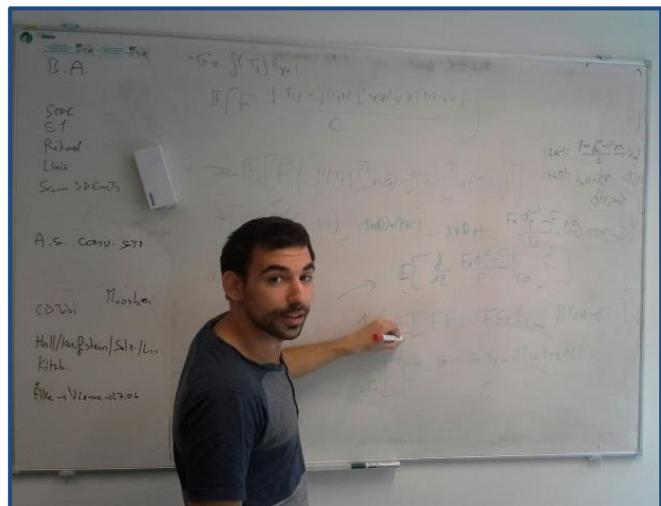


Foto: Thibaut Mastrolia (Foto: Alexander Steinicke).

Kooperationspartner/in: Thibault Mastrolia, PhD
Universität: Université Paris-Dauphine, Paris IX
Institut: CEREMADE

Antragsteller/in: Dipl.-Ing. Alexander Steinicke
Universität: Universität Innsbruck
Institut: Institut für Mathematik