

Contactforum*

2nd Actuarial and Financial Mathematics Day

jointly organised by
Universiteit Gent, Universiteit Antwerpen, Vrije Universiteit Brussel
and Katholieke Universiteit Leuven

February 6, 2004

Auditorium Rubens
Paleis der Academiën
Hertogstraat 1, B-1000 Brussel



PROGRAMME

8u30 - 9u00 *Registration and Welcome*

9u00 - 9u45 **Prof.dr. Michel Denuit**, Université Catholique de Louvain-la-Neuve
[How to deal with correlated risks in actuarial science?](#)

9u45 - 10u15 **Steven Vanduffel**, Katholieke Universiteit Leuven
[Comonotonic approximations for optimal portfolio selection problems](#)

10u15 - 10u45 *Coffee break*

10u45 - 11u15 **Ingrid Vreven**, Generali Belgium
[Integration of a priori segmentation in bonus-malussystems](#)

11u15 - 11u45 **Inge Koch**, Universiteit Antwerpen
[Approximations of the distribution of general annuities in the case of truncate stochastic interest rates](#)

11u45 - 12u15 **Jessica Cariboni**, Joint Research Centre - European Commission – KULeuven
[Sensitivity Analysis for Credit Risk Models](#)

12u15 - 14u15 *Lunch* (zaal Félicien Cattier, Universitaire Stichting, Egmontstraat 11)

14u15 - 15u00 **Prof. dr. Hansjörg Albrecher**, Graz University of Technology, Oostenrijk
[On Asian Option Pricing for Exponential Levy Processes](#)

15u00 - 15u30 **Jan Liinev**, Universiteit Gent
[Modelling swap rates in Levy setting](#)

15u30 - 16u00 *Coffee break*

16u00 - 16u30 **Marc Decamps**, Katholieke Universiteit Leuven
[A self exciting threshold term structure model](#)

16u30 - 17u00 **Michel Verschuere**, Technische Universitat Wien, Oostenrijk
[On the anomalous price behavior of power futures](#)

17u00 - 17u30 **Liesbeth Thomassen**, Universiteit Antwerpen
[The compound option: an overview](#)



* Dit contactforum wordt gesteund door het Vlaams Kennis- en Cultuurforum van de Koninklijke Vlaamse Academie van België voor Wetenschappen en Kunsten.