

mgr Sebastian Baran  
Uniwersytet Ekonomiczny w Krakowie  
prof. Zbigniew Palmowski  
Wydział Matematyki Politechniki Wrocławskiej

## 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.

### Literatura

- [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 Cramér–Lundberg risk process*. Applicationes Mathematicae, przyjęte do publikacji.