

经济研究

保费与理赔相关的复合Poisson风险模型

赵金娥¹; 张元华²; 王贵红²

(1.红河学院 数学学院, 云南 蒙自 661100;
2.玉溪农业职业技术学院 计科系, 云南 玉溪 653106)

收稿日期 2008-10-5 修回日期 2008-10-26 网络版发布日期 接受日期

摘要

研究一类相依风险过程, 其中保费收入为复合Poisson过程, 且索赔产生时以概率的可能性同时产生一次续保。运用鞅方法得出破产概率满足的Lundberg不等式和一般公式, 给出当收取的保费和索赔额及续保保费均为指数分布时破产概率的具体表达式, 并通过数值计算分析了初始资本、期望理赔额及续保率对保险公司破产概率的影响。

关键词 [稀疏过程](#); [Poisson过程](#); [破产概率](#); [Lundberg不等式](#)

分类号 [F 840](#)

DOI:

通讯作者:

作者个人主页: [赵金娥¹](#); [张元华²](#); [王贵红²](#)

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF\(427KB\)](#)

▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)

▶ [参考文献\[PDF\]](#)

▶ [参考文献](#)

服务与反馈

▶ [把本文推荐给朋友](#)

▶ [加入我的书架](#)

▶ [加入引用管理器](#)

▶ [引用本文](#)

▶ [Email Alert](#)

▶ [文章反馈](#)

▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

▶ [本刊中 包含“稀疏过程; Poisson过程; 破产概率; Lundberg不等式”的 相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

• [赵金娥](#)

• [张元华](#)

• [王贵红](#)