



两相依聚集索赔风险模型的生存概率

杨善兵^{1,2}, 房厚庆³

- 1. 南京航空航天大学, 理学院, 江苏, 南京, 210016;
- 2. 盐城工学院, 基础部, 江苏, 盐城, 224003;
- 3. 江苏大学, 理学院, 江苏, 镇江, 212013

Survival probability of two correlated aggregate claims risk model

YANG Shan-bing^{1,2}, FANG Hou-qing³

- 1. School of Science Nanjing University of Aeronautics and Astronautics, Nanjing 220016, China;
- 2. Department of fundamental Science Teaching, Yancheng Institute of Technology, Yancheng 224003, China;
- 3. School of Science, Jiangsu University, Zhenjiang 212013, China

- 摘要
- 参考文献
- 相关文章

全文: PDF (225 KB) HTML (KB) 输出: BibTeX | EndNote (RIS) 背景资料

摘要 介绍了2个具有相依关系的聚集索赔的风险模型,求出了模型的生存概率满足的积分微分方程,借助于林德伯格系数,获得了模型的生存概率满足的拉普拉斯变换及其初始盈余为零时的精确值的表达式.

关键词: 相依的聚集索赔 生存概率 积分微分方程组 Erlang(2)过程

Abstract: It is considered that two correlated aggregate claims risk model. In this model the two claims number processes are correlated. We derive system of integro-differential equations of survival probability, and obtain Laplace transforms of survival probability and explicit results when the initial reserve is zero by the coefficient of Generalized Lundberg.

Key words: correlated aggregate claims survival probability system of integro-differential equations Erlang(2) processes

收稿日期: 2005-02-23;

基金资助: 国家自然科学基金资助项目(10271090)

引用本文:

杨善兵,房厚庆. 两相依聚集索赔风险模型的生存概率[J]. 云南大学学报(自然科学版), 2006, 28(1): 16-19,26.

YANG Shan-bing, FANG Hou-qing. Survival probability of two correlated aggregate claims risk model[J]. , 2006, 28(1): 16-19,26.

没有本文参考文献

没有找到本文相关文章

服务

- ▶ 把本文推荐给朋友
- ▶ 加入我的书架
- ▶ 加入引用管理器
- ▶ E-mail Alert
- ▶ RSS

作者相关文章

- ▶ 杨善兵
- ▶ 房厚庆

版权所有 © 《云南大学学报(自然科学版)》编辑部

编辑出版：云南大学学报编辑部（昆明市翠湖北路2号，650091）

电话：0871-5033829(传真) 5031498 5031662 E-mail: yndxxb@ynu.edu.cn yndxxb@163.com