

带干扰风险模型中破产概率的Feller表示及可微性

王过京(1), 吴荣(2)

(1)苏州大学数学系, 苏州 215006; (2)南开大学数学系, 天津 300071

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 给出带干扰风险模型中破产概率的Feller表示, 并证明带干扰风险模型的破产概率的二次连续可微性.

关键词 [风险模型](#), [破产概率](#), [Feller表示](#)

分类号

THE FELLER EXPRESSION AND DIFFERENTIABILITY OF THE RUIN PROBABILITY IN THE RISK MODEL PERTURBED BY DIFFUSION

Guo Jing WANG(1), Rong WU(2)

(1)Department of Mathematics, Suzhou University, Suzhou 215006, P.R.China; (2)Department of Mathematics, Nankai University, Tianjin 300071, P.R.China

Abstract in this paper, we present the Feller expression for the ruin probability of the classical risk model that is perturbed by diffusion. Basing on the Feller expression, we prove the twice continuous differentiability of the ruin probability under certain conditions.

Key words [Risk model](#) [ruin probability](#) [Feller expression](#)

DOI:

通讯作者

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(0KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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](#)
- ▶ [复制索引](#)
- ▶ [Email Alert](#)
- ▶ [文章反馈](#)
- ▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“\[风险模型, 破产概率, Feller表示\]\(#\)”的 \[相关文章\]\(#\)](#)
- ▶ [本文作者相关文章](#)

- [王过京](#)
- [吴荣](#)