

论文

干扰条件下复合Poisson-Geometric过程的多险种风险模型下的破产概率

于文广¹, 黄玉娟²

1. 山东经济学院统计与数学学院, 山东 济南 250014; 2. 山东交通学院数理系, 山东 济南 250023

摘要:

对索赔到达为复合Poisson-Geometric过程的风险模型进行了推广, 研究了带有干扰条件下保单到达为参数 α 的Poisson过程, 运用鞅论的方法得出了多险种风险模型下破产概率满足的Lundberg不等式和一般公式。

关键词: 破产概率 鞅 复合Poisson-Geometric过程 维纳过程

Ruin probability for a compound Poisson-Geometric process of multi-risk model with interference

YU Wen-guang¹, HUANG Yu-juan²

1. School of Statistics and Mathematics, Shandong Economic University, Jinan 250014, Shandong, China; 2. Department of Mathematics and Physics, Shandong Jiaotong University, Jinan 250023, Shandong, China

Abstract:

A risk model, which the compensation arrives to the compound Poisson-Geometric process, was generalized. The arrival of term policies with interference, which was a Poisson process with intensity α , was studied. Applying the martingale theory, the Lundberg inequality and the formula for the ruin probability were concluded.

Keywords: ruin probability martingale compound Poisson-Geometric process Wiener process

收稿日期 1900-01-01 修回日期 1900-01-01 网络版发布日期 2006-10-24

DOI:

基金项目:

通讯作者: 于文广

作者简介:

本刊中的类似文章

1. 于文广¹, 于红彬². 带扩散扰动项的保费随机收取的再保险与最终破产概率[J]. 山东大学学报(理学版), 2009, 44(4): 84-87
2. 周绍伟, 赵明清, 朱柘癯. 理赔额服从指数分布的多险种的风险模型[J]. 山东大学学报(理学版), 2007, 42(1): 28-30

扩展功能

本文信息

Supporting info

PDF(198KB)

[HTML全文](OKB)

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

本文关键词相关文章

▶ 破产概率

▶ 鞅

▶ 复合Poisson-Geometric过程

▶ 维纳过程

本文作者相关文章

▶ 于文广

▶ 黄玉娟