



吉首大学学报自然科学版 » 2007, Vol. 28 » Issue (4): 12-15 DOI:

数学 [最新目录](#) | [下期目录](#) | [过刊浏览](#) | [高级检索](#) ◀◀ Previous Articles | Next Articles ▶▶

## 利率具有二阶自回归结构的复合二项风险模型

(盐城工学院基础教学部, 江苏 盐城 224003)

### Compound Binomial Risk Model Under Rates of Interest with Autoregressive Structure of Order 2

(Department of Fundamental Science Teaching, Institute of Technology, Yancheng 224003, Jiangsu China)

- 摘要
- 参考文献
- 相关文章

全文: PDF (1410 KB) HTML (1 KB) 输出: BibTeX | EndNote (RIS) [背景资料](#)

**摘要** 研究了具有利率是二阶自回归结构的复合二项的风险模型,利用递归的方法得到最终破产概率的积分方程,并利用这些方程获得了最终破产概率的上界.

**关键词:** 风险模型 利率 破产概率的上界 二阶自回归结构

**Abstract:** The compound binomial risk model under rates of interest with autoregressive structure of order 2 is studied. The integral equations of the ultimate ruin probability are obtained by the recursive method. Upper bound for the ultimate ruin probability is obtained from these equations.

**Key words:** risk model rate of interest upper bound for the ultimate ruin probability autoregressive structure of order 2

#### 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
- ▶ 季红蕾
- ▶ 朱亚萍

#### 引用本文:

杨善兵,季红蕾,朱亚萍. 利率具有二阶自回归结构的复合二项风险模型[J]. 吉首大学学报自然科学版, 2007, 28(4): 12-15.

YANG Shan-Bing,JI Hong-Lei,ZHU Ya-Ping. Compound Binomial Risk Model Under Rates of Interest with Autoregressive Structure of Order 2[J]. Journal of Jishou University (Natural Sciences Edit, 2007, 28(4): 12-15.

[1] SUNDT B, TEUGELS J L.Ruin Estimates Under Interest Force [J].Insurance Math. Econom., 1995, 16: 7-22.

[2] SUNDT B, TEUGELS J L.The Adjustment Function in Ruin Estimates Under Interest Force [J].Insurance Math. Econom., 1997, 19: 85-94.

[3] YANG H.Non-Exponential Bounds for Ruin Probability with Interest Effect Included [J].Scand. Actuarial J., 1999,19: 66-79.

[4] CAI J.Discret Time Risk Models Under Rates of Interest [J].Prob. Eng. Inf. Sci., 2002, 16: 309-324.

[5] CAI J.Ruin Probabilities with Dependent Rates of Interest [J].J. Appl. Prob., 2002, 39: 312-323.

[1] 包振华,殷明娥,张绍华. 重尾索赔下带干扰复合Poisson-Geometric模型的破产概率[J]. 吉首大学学报自然科学版, 2012, 33(2): 16-18.

[2] 周俊. 巨灾指数模型及其衍生品套利定价方法[J]. 吉首大学学报自然科学版, 2007, 28(5): 29-33.

[3] 徐俊科,刘再明. 交替变化利率下的风险模型[J]. 吉首大学学报自然科学版, 2007, 28(4): 16-19.

[4] 钟朝艳,何树红. 一类风险模型破产概率上界估计及随机分析[J]. 吉首大学学报自然科学版, 2007, 28(3): 35-39.

版权所有 © 2012《吉首大学学报（自然科学版）》编辑部  
通讯地址：湖南省吉首市人民南路120号《吉首大学学报》编辑部 邮编：416000  
电话传真：0743-8563684 E-mail：xb8563684@163.com 办公QQ：1944107525  
本系统由北京玛格泰克科技发展有限公司设计开发 技术支持：support@magtech.com.cn