

学术论文

一类Sparre Andersen风险模型的Gerber-Shiu函数

范庆祝~~尹传存

石河子大学商学院统计与金融系

曲阜师范大学数学科学学院

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 本文考虑了一类相邻两次索赔的时间间隔服从Erlang( $n$ )和Erlang( $m$ )的混合分布的Sparre Andersen风险模型.

主要目的是研究Gerber-Shiu函数 $\phi_\Delta(u)$ ,

首先证明了 $\phi_\Delta(u)$ 满足一个高阶的积分微分方程,

然后讨论了广义Lundberg方程根的性质,

在此基础上导出了 $\phi_\Delta(u)$ 的拉普拉斯变换并且证明了 $\phi_\Delta(u)$ 满足一个更新方程,

最后给出了一个例子.

关键词 [Sparre Andersen风险模型](#), [Erlang\( \$n\$ \)](#), [Gerber-Shiu函数](#), [破产概率](#).

分类号

DOI:

通讯作者:

范庆祝

作者个人主页: [范庆祝~~尹传存](#)

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF](#) (257KB)

▶ [\[HTML全文\]](#) (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“Sparre Andersen 风险模型, Erlang\( \$n\$ \), Gerber-Shiu函数, 破产概率.” 的相关文章](#)

▶ [本文作者相关文章](#)