



吉首大学学报自然科学版 » 2006, Vol. 27 » Issue (4): 1-4 DOI:

数学

[最新目录](#) | [下期目录](#) | [过刊浏览](#) | [高级检索](#)

« | [Next Articles](#) »

## 常利率环境双险种离散时间风险模型破产问题

(云南大学数学系, 云南 昆明 650091)

### Ruin Problems for the Double Risk Model of Discrete Time with Constant Interest Force

(Department of Mathematics, Yunnan University, Kunming 650091, China)

- [摘要](#)
- [参考文献](#)
- [相关文章](#)

全文: [PDF \(1149 KB\)](#) [HTML \(1 KB\)](#) 输出: [BibTeX](#) | [EndNote \(RIS\)](#) [背景资料](#)

**摘要** 应用概率论研究了常利率环境下双险种的离散时间风险模型的破产问题, 得到了破产前盈余分布和破产持续时间分布的递推公式.

**关键词:** 常利率 双险种 离散时间风险模型 破产前盈余分布 破产持续时间分布

**Abstract:** The applying probability theory discusses about ruin problems under the discrete time double risk model with constant interest. From the research, the recursion formulae of the distribution of the surplus immediately before ruin and of the distribution of the time in the red which describe the severity of ruin have been gotten.

**Key words:** constant interest double risk; discrete time risk model distribution of the surplus immediately before ruin distribution of the time

#### 基金资助:

国家自然科学基金资助项目(10561009)

**作者简介:** 何树红 (1966-), 男, 云南省玉溪市人, 云南大学数学系教授, 博士, 主要从事金融数学研究.

#### 引用本文:

何树红, 马丽娟, 赵金娥. 常利率环境双险种离散时间风险模型破产问题[J]. 吉首大学学报自然科学版, 2006, 27(4): 1-4.

HE Shu-Hong, MA Li-Juan, ZHAO Jin-E. Ruin Problems for the Double Risk Model of Discrete Time with Constant Interest Force[J]. Journal of Jishou University (Natural Sciences Edit, 2006, 27(4): 1-4.

[1] 孙立娟, 顾岚. 离散时间保险风险模型的破产问题 [J]. 应用概率统计, 2002, 18(3): 293-299.

[2] 成世学. 破产论研究综述 [J]. 数学进展, 2002, 31(5): 403-422.

[3] GERBER H U(著). 成世学, 严颖(译). 数学风险论导引 [M]. 北京: 世界图书出版公司北京公司, 1997.

[4] 刘家有, 刘再明. 保险公司在固定利率下的离散型破产概率 [J]. 数学理论与应用, 2004, 24(3): 101-104.

[1] 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.

#### 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

- ▶ [何树红](#)
- ▶ [马丽娟](#)
- ▶ [赵金娥](#)

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