

索赔次数为复合Poisson-Geometric过程下破产概率的显式表达

毛泽春^{1,2}, 刘锦萼²

1. 湖北大学商学院金融系 湖北武汉430062;
2. 山东经济学院概率统计与保险精算研究所 山东济南250014

The Expression of Ruin Probability under Claim Numbers with Compound Poisson-Geometric Process

MAO Ze-chun^{1,2}, LIU Jin-e²

1. School of Business, Hubei University, Wuhan 430062, China;
2. Institute of Statistics and Actuary, Shandong Economics University, Ji'nan 250014, China

- [摘要](#)
- [参考文献](#)
- [相关文章](#)

Download: [PDF \(0KB\)](#) [HTML \(1KB\)](#) Export: [BibTeX](#) or [EndNote \(RIS\)](#) [Supporting Info](#)

摘要 本文研究索赔次数为复合Poisson-Geometric过程下的风险模型;当个体索赔额服从相位(Phase-Type)分布时,得到了破产概率的显式表达式及数值结果。

关键词: [复合Poisson-Geometric过程](#) [破产概率](#) [相位分布](#)

Abstract: A risk model with compound Poisson-geometric claim numbers process has been studied. The renewal equation of ruin probability has been studied and the expression of ruin probability has been given in case of the individual claim size distributed in phase-type.

收稿日期: 2006-03-05;

基金资助:

国家自然科学基金资助项目(10471076);山东省自然科学基金资助项目(Y2004A07,Y2004A05);湖北省教育厅科学研究计划重点项目(D200610002)

作者简介: 毛泽春(1964-),男(汉族),湖北大冶人,湖北大学商学院教授,博士,山东经济学院概率统计与保险精算研究所副所长,研究方向:概率统计、保险精算。

引用本文:

毛泽春, 刘锦萼. 索赔次数为复合Poisson-Geometric过程下破产概率的显式表达[J]. 中国管理科学, 2007, V15(5): 23-28

Service

- [把本文推荐给朋友](#)
- [加入我的书架](#)
- [加入引用管理器](#)
- [Email Alert](#)
- [RSS](#)

作者相关文章

- [毛泽春](#)
- [刘锦萼](#)

没有本文参考文献

- [1] 孙树旺, 江涛. 具扩散项的带免赔额的Erlang(2)问题的破产概率[J]. 中国管理科学, 2007, 15(5): 36-41
- [2] 江涛. 具扩散项的停止-损失再保问题的破产概率[J]. 中国管理科学, 2006, (6): 11-15
- [3] 李健伦, 方兆本. 估算我国保监会对产险业的容许破产概率[J]. 中国管理科学, 2006, (4): 6-12
- [4] 江涛. Erlang风险模型有限时间的破产概率[J]. 中国管理科学, 2006, (1): 112-116

