

学术论文

# 混合指数更新模型下平均折现惩罚函数

李俊海, 刘再明

中南大学数学学院概率统计研究所 河南工业大学理学院

收稿日期 修回日期 网络版发布日期:

**摘要** 本文讨论了以混合指数分布为点间间距的更新风险模型下平均折现惩罚函数, 在简单条件下, 利用 Dickson and Hipp (2001) 中引入的变换方法, 得到了平均折现惩罚函数的 Laplace 变换的精确表达式.

**关键词** [混合指数分布](#), [更新过程](#), [惩罚函数](#), [破产概率](#).

分类号

## Expected Discounted Penalty of Mixed Exponential Renewal Process

LI JUNHAI, LIU ZAIMING

School of Mathematics, Central South University; College of Science, Henan University of Technology

**Abstract** In this paper, the expected discounted penalty of mixed exponential renewal risk process was considered. Under some simple conditions, the explicit expression of Laplace transform of the expected discounted penalty is obtained.

### Key words

DOI

通讯作者 李俊海

### 扩展功能

#### 本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(342KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [参考文献](#)

#### 服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [复制索引](#)
- ▶ [Email Alert](#)
- ▶ [文章反馈](#)
- ▶ [浏览反馈信息](#)

#### 相关信息

- ▶ [本刊中 包含“混合指数分布, 更新过程, 惩罚函数, 破产概率.” 的相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
  - [李俊海](#)
  - [刘再明](#)