

学术论文

稀疏风险模型的期望折扣罚金函数

潘洁~~王过京

安徽理工大学理学院数学系

苏州大学数学系

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 本文考虑了一类风险模型, 其中保费到达过程是一个参数为 $\lambda > 0$ 的Poisson过程, 而理赔过程是保费到达过程的稀疏过程. 在该模型下, 我们得到了期望折扣罚金函数所满足的积分方程, 积分--微分方程以及递推公式, 并且当保费和理赔额均为指数分布时, 我们使用积分--微分方程获得了破产时刻的Laplace变换和在破产时刻的赤字的闭式表达式.

关键词 [稀疏](#), [Poisson过程](#), [期望折扣罚金函数](#).

分类号

DOI:

通讯作者:

潘洁

作者个人主页: [潘洁~~王过京](#)

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF](#) (197KB)

▶ [\[HTML全文\]](#) (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“稀疏, Poisson过程, 期望折扣罚金函数.” 的相关文章](#)

▶ [本文作者相关文章](#)