

学术论文

经典风险模型的推广

永霞,尹传存

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 本文将经典风险模型的盈余过程推广为一谱正L\`evy过程与一从属L\`evy过程的差,利用L\`evy过程的性质和鞅方法,得到破产概率的一些结果.对一类谱负的L\`evy过程研究了它的首达时的性质并得出了生存概率的Pollaczek-Khinchin公式.

关键词 [L\`evy过程](#), [破产概率](#), [生存概率](#), [鞅](#), [首达时](#).

分类号

DOI:

通讯作者:

永霞

作者个人主页: [永霞;尹传存](#)

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF](#)(215KB)

▶ [\[HTML全文\]](#)(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

▶ [&zazhimc=应用概率统计' target="\\_blank"> 本刊中 包含 “L\`evy过程, 破产概率, 生存概率, 鞅, 首达时.” 的 相关文章](#)

▶ [本文作者相关文章](#)