

索赔次数为复合Poisson-Geometric过程的风险模型及破产概率

毛泽春(1, 2), 刘锦萼(2)

北大学商学院金融系, 武汉; 山东经济学院概率统计与保险精算研究所, 济南

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 本文引入一类复合Poisson-Geometric分布, 这类分布包括两个参数, 是普通Poisson分布的一种推广,

并在保险中有其实际的应用背景; 基于此分布产生一个计数过程, 称之为复合Poisson-Geometric过程. 本文

着重研究了索赔次数为复合Poisson-Geometric过程的风险模型, 这种模型是经典风险模型的一个推广.

针对此模型, 本文给出了破产概率公式及更新方程. 作为特例, 当索赔额服从指数分布时,

给出了破产概率的显式表达式.

关键词 [复合Poisson-Geometric过程](#) [索赔过程](#) [破产概率](#) [更新方程](#)

分类号

索赔次数为复合Poisson-Geometric过程的风险模型及破产概率

毛泽春(1,2),刘锦萼(2)

Abstract

Key words

DOI:

通讯作者 maozechun@sina.com

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(0KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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](#)
- ▶ [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“复合Poisson-Geometric过程”的 相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章

- [毛泽春](#)
-
- [刘锦萼](#)