

<<保险风险理论模型>>

图书基本信息

书名：<<保险风险理论模型>>

13位ISBN编号：9787513602211

10位ISBN编号：7513602212

出版时间：2011-2

出版时间：中国经济出版社

作者：龚日朝

页数：340

字数：230000

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## <<保险风险理论模型>>

### 内容概要

保险问题是一个非常重要的理论和现实问题。

自20世纪初Harald Cramer和Filip

Lundberg运用随机过程理论研究保险问题开始，保险理论飞速发展，如今已经成为了一门重要的交叉学科。

本书在收集和整理国内外新成果的基础上。

运用概率统计、随机过程、组合数学、矩阵，博弈论，以及经济学等理论和方法，从解决保险理论中经典的复合二项风险模型和Poisson，[风险模型的破产概率计算的显示解或渐近解等问题出发，结合保险的本质属性和保险经营的基本特征，对经典风险模型进行合理的推广，以及在研究模型性质的基础上，解决相应的破产概率显示解和渐近解。

解决破产概率的计算难题。

同时，针对巨灾保险，在索赔分布服从重尾分布的条件下，对经典风险模型、更新风险模型及其推广模型等研究它们的破产概率，为保险公司经营巨灾保险提供新的理论基础。

## <<保险风险理论模型>>

### 作者简介

龚日朝，男，1966年12月出生，湖南安化人，理学博士，湖南科技大学教授，湖南省骨干教师培养对象，湖南科技大学首届教学名师。

1989年本科毕业于湘潭大学数学专业，2000年研究生毕业于湖南师范大学概率论与数理统计专业，2007年博士生毕业于中南大学概率论与数理统计专业。

一直从事金融与保险风险理论研究，主持国家社科基金项目、教育部人文社科规划项目、湖南省科技厅软科学重点项目，湖南省教育厅优秀青年项目和湖南省社科基金项目等8项；参与完成国家自然科学基金项目2项和国家社科基金项目1项。

获得湖南省第三届哲学社会科学基金项目优秀成果三等奖1项和教育部高等学校科学研究成果二等奖1项。

在《系统科学与数学》、《应用数学学报》、《自然灾害学报》和《中国安全科学学报》等核心刊物发表学术论文5

0余篇。

同时主持教育部教育科学“十五”规划重点课题和湖南省教育科学“十五”、“十一五”规划课题等省部级教研教改课题4项。

获得湖南省优秀教学成果二等奖1项。

# <<保险风险理论模型>>

## 书籍目录

- 第一章 绪论
- 第二章 风险理论中的索赔分布
  - 第一节 索赔分布的分类及其判别方法
  - 第二节 次指数分布族
  - 第三节 M分布族
  - 第四节  $s(v)$ 分布族
- 第三章 复合二项风险模型
  - 第一节 复合二项模型简介
    - 一、二项计数过程
    - 二、复合二项风险模型的定义
    - 三、复合二项风险模型的性质
  - 第二节 复合二项风险模型破产概率
    - 一、一般情形复合二项风险模型破产概率
    - 二、完全离散复合二项风险模型破产概率
    - 三、破产时刻的索赔分布
  - 第三节 有限时间内的生存概率
    - 一、完全离散模型有限时间内的生存概率
    - 二、生存到某时刻且盈余至少达到某水平的概率
- .....
- 第四章 Poisson风险模型
- 第五章 更新风险模型
- 参考文献
- 后记

## <<保险风险理论模型>>

### 章节摘录

《保险风险理论模型》是在作者近十年研究成果的基础上，特别是基于博士学位论文和硕士学位论文的基础上，并结合近几年所主持的课题成果而完成的。

主要研究金融风险理论中保险模型，以及巨灾风险及保险管理问题，本书从内容上大致分为两部分：

第一部分主要是研究风险损失概率分布。

该部分主要对风险损失进行分类，分为一般损失风险和巨灾损失风险。

相应的，它们的概率分布分为轻尾分布和重尾分布。

对此，本书给出这些分布的定义、性质，特别是分类的方法，其中对描述巨灾损失事件的重尾分布作了比较详细研究。

最后给出了一些常见的具体分布。

第二部分主要研究金融保险数学模型。

该部分分为三大块：第一块是离散风险模型中的复合二项风险模型理论问题；第二块是Poisson风险模型理论问题；第三块是更新风险模型理论问题。

对于这些模型主要的研究工作可以分为两个方面：一是对经典的模型进行研究，在前人研究成果的基础上，研究他们不完善的理论问题。

<<保险风险理论模型>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>