

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ФАКУЛЬТЕТ ПРИКЛАДНОЙ МАТЕМАТИКИ И ИНФОРМАТИКИ
Кафедра теории вероятностей и математической статистики

Аннотация к дипломной работе

«Перестрахование потерь типа Stop-loss»

Кишкар Антон Игоревич

Научный руководитель –
кандидат физико-математических наук, доцент Ю.В. Меленец

РЕФЕРАТ

Дипломный проект, 39 с, 19 рисунков, 12 таблиц, 14 источников, 1 приложения.

ПЕРЕСТРАХОВАНИЕ, ПЕРЕСТРАХОВАНИЕ ПОТЕРЬ ТИПА STOP-LOSS.

Объект исследования – перестрахование потерь типа stop-loss.

Цель работы – изучить перестрахование потерь типа stop-loss при предположении определенных видов распределения величины каждого иска.

В ходе работы, получена формула характеризующая распределение потерь перестраховщика, проверена гипотеза о распределении потерь перестраховщика. Аналитически исследованы средние значения выплат. Реализована модель, проверена достоверность теоретических материалов.

Результатами является полученная формула для распределения потерь перестраховщика, когда величина исков имеет экспоненциальное распределение.

Областью применения является анализ активов страховых компаний, использующих инструменты перестрахования.

Abstract

Degree project, 39 p, 19 figures, 12 tables, 14 sources, 1 applications.

REINSURANCE, REINSURANCE LOSSES OF THE STOP-LOSS TYPE

Object of study – reinsurance losses the stop-loss type.

Purpose – explore the reinsurance losses of the stop-loss type under the assumption of certain types of distribution of the value of each claim.

The paper considers the formula characterizing the distribution of losses of the reinsurer is obtained, the hypothesis of the distribution of losses of the reinsurer is tested. The average values of payouts are analyzed. The model is implemented, the reliability of theoretical materials is checked.

The result are formula for allocation distribution of losses of the reinsurer in the case where the exponential value of claims distribution.

The scope of application is the analysis of assets of insurance companies using reinsurance tools.