

Аннотация дипломной работы

Тема: Оценка вероятности разорения при эксцедентном перестраховании

Студент: Давыдовский Николай Иванович

Научный руководитель: Сечко Владимир Владимирович, доцент, кандидат технических наук

Кафедра теории вероятностей и математической статистики, специальность актуарная математика, специализация математика финансового рынка.

Объем 50 страниц, 14 рисунков, 5 использованных источников литературы. Дипломная работа состоит из введения, пяти глав, заключения и одного приложения.

Ключевые слова: фонд страховой компании, совокупный иск, вероятность разорения, эксцедентное перестрахование.

Цель работы – изучение эксцедентного перестрахования, исследование вероятности разорения, разработка соответствующего программного обеспечения

В дипломной работе рассмотрено эксцедентное перестрахование, разработано программное обеспечение, позволяющее оценить вероятности разорения аналитически и путем статистического моделирования для различных распределений величин индивидуальных исков при эксцедентном перестраховании. В качестве вероятностных распределений рассмотрены следующие распределения: экспоненциальное, гамма, Парето, Вейбулла.