

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

Аннотация к дипломной работе

**«Вероятность разорения при перестраховании»**

Козлов Максим Владимирович

Научный руководитель – кандидат технических наук,  
доцент В.В. Сечко

2017

## РЕФЕРАТ

Дипломная работа, 41 с., 33 рис., 8 источников.

**Ключевые слова:** ПРОПОРЦИОНАЛЬНОЕ ПЕРЕСТРАХОВАНИЕ, ЭКСЦЕДЕНТНОЕ ПЕРЕСТРАХОВАНИЕ, ПРОЦЕССЫ ИСКОВ, МОДЕЛЬ РАЗОРЕНИЯ, РАСПРЕДЕЛЕНИЕ ВЕЙБУЛЛА, РАСПРЕДЕЛЕНИЕ ПАРЕТО, ЭКСПОНЕНЦИАЛЬНОЕ РАСПРЕДЕЛЕНИЕ, ГАММА-РАСПРЕДЕЛЕНИЕ.

**Объект исследований:** вероятность разорения страховой и перестраховочной компании.

**Цель работы:** Оценка вероятности разорения при пропорциональном и эксцедентном перестраховании.

**Методы исследования:** методы страховой математики, математической статистики и теории вероятности.

**Результаты исследования:** формула для подсчёта вероятности разорения страховой и перестраховочной компаний, графики и таблицы вероятности разорения страховой и перестраховочной компании при пропорциональном и эксцедентном перестраховании.

**Область применения:** страховые и перестраховочные компании.

## ABSTRACT

**Diploma thesis,** 41 p., 33 pic., 8 sources.

**Keywords:** PROPORTIONAL REINSURANCE, EXCEDENT REINSURANCE, RISK PROCESSES, MODEL OF DISCRIMINATION, WEBBULL DISTRIBUTION, PARETO DISTRIBUTION, EXPONENTIAL DISTRIBUTION, GAMMA DISTRIBUTION

**The object of study:** the probability of ruin of an insurance and reinsurance company.

**The purpose of the research:** estimation of the probability of ruin for proportional and extraordinary reinsurance.

**Methods:** methods of the financial mathematics, methods of the mathematical statistics and probability theory.

**Results:** a formula for calculating the probability of ruin of insurance and reinsurance companies, Graphics and tables for probability of ruin of an insurance and reinsurance company for proportional and extraordinary reinsurance.

**Scope:** Insurance and reinsurance companies.