

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

Аннотация к дипломной работе

«Аппроксимации для премий СЛ перестрахования»

Михалькевич Владислав Андреевич

Научный руководитель — кандидат физико-математических наук,
доцент кафедры теории вероятностей и математической статистики
Ю. В. Меленец

РЕФЕРАТ

Дипломная работа, 55 страниц, 7 рисунков, 9 источников.

Ключевые слова: АППРОКСИМАЦИЯ, ПЕРЕСТРАХОВАНИЕ, СТОП-ЛОСС, ЭКСЦЕДЕНТ УБЫТОЧНОСТИ, РАСПРЕДЕЛЕНИЕ РАЗМЕРА ИСКОВ, ПОРОГ УДЕРЖАНИЯ, ЭКСЦЕСС, ЦЕДЕНТ, ПРЕМИЯ.

Объект исследования: премии СЛ перестрахования.

Цели работы: рассмотрение Стоп-Лосс перестрахования, построение и наглядная реализация различных аппроксимаций для независимой и зависимой моделей и определение факторов, влияющих на точность аппроксимаций.

Методы исследования: методы теории вероятностей и математической статистики, страховой математики, моделирования.

Результат: получение основных аппроксимаций; графическое представление аппроксимаций с различными комбинациями параметров.

Областью применения являются страховые рынки.

ABSTRACT

Graduate work, 55 pages, 7 figures, 9 sources.

Key words: APPROXIMATION, REINSURANCE, STOP-LOSS, EXCESS OF LOSS, CLAIMS SIZE DISTRIBUTION, RETENTION LEVELS, KURTOSIS, REINSURER, PREMIUM.

Object of study: reinsurance premiums.

Objectives: consideration of Stop-loss reinsurance, construction and visual implementation of various approximations for independent and dependent models and determination of factors affecting the accuracy of approximations.

Methods of research: methods of probability theory and mathematical statistics, insurance mathematics, modeling.

Result: obtaining basic approximations; graphical representation of approximations with various parameters combinations.

The area of application is insurance markets.