

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

Аннотация к дипломной работе

«Вероятность разорения страховой компании»

Токарская Виктория Александровна

Научный руководитель – кандидат физ.-мат. наук,
доцент П.М. Лаппо

2017

РЕФЕРАТ

Дипломная работа, 57с., 3рис., 4 источника.

ВРЕМЯ НАСТУПЛЕНИЯ ИСКОВ, ПРОЦЕСС ПУАССОНА, РАСПРЕДЕЛЕНИЕ ВЕЛИЧИН ИСКОВ, ВЕРОЯТНОСТИ РАЗОРЕНИЯ СТРАХОВОЙ КОМПАНИИ, ЭКСПОНЕНЦИАЛЬНОЕ РАСПРЕДЕЛЕНИЕ, ГАММА-РАСПРЕДЕЛЕНИЕ, РАСПРЕДЕЛЕНИЕ ВЕЙБУЛЛА, МЕТОД ВЕРХНИХ И НИЖНИХ ГРАНИЦ, КОМБИНАЦИИ ЭКСПОНЕНЦИАЛЬНЫХ РАСПРЕДЕЛЕНИЙ, МОДЕЛИРОВАНИЕ

Объект исследования – фонд страховой компании.

Цель работы: произвести моделирование динамики фонда страховой компании различными указанными в задании способами.

Основные методы исследования: моделирование с помощью составного пуассоновского процесса, метод верхних и нижних границ, комбинации экспоненциальных распределений.

Результаты работы: произведено моделирование динамики фонда страховой компании. Проведены некоторые сравнительные характеристики.

ABSTRACT

Diploma work, 57 p., 3 fig., 4 sources.

ACQUISITION TIME OF CLAIMS, POISSON PROCESS, CLAIM VALUE DISTRIBUTION, RUIN PROBABILITY OF INSURANCE COMPANY, EXPONENTIAL DISTRIBUTION, GAMMA DISTRIBUTION, WEIBULL DISTRIBUTION, METHOD OF UPPER AND LOWER BORDERS, COMBINATION OF EXPONENTIAL DISTRIBUTIONS, MODELING.

Object of research – insurance company fund.

The aim of the work: simulate the dynamics of the insurance company's fund by various ways indicated in the task.

Basic research methods: modeling with the help of a composite Poisson process, the method of upper and lower boundaries, combinations of exponential distributions.

Results of work: simulation of the dynamics of the fund of the insurance company is done. Some comparative characteristics were taken.