

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

Факультет прикладной математики и информатики

Кафедра теории вероятностей и математической статистики

Аннотация к дипломной работе

«Анализ процессов SL-перестрахования»

Лагута Денис Сергеевич

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

Минск, 2024

РЕФЕРАТ

Дипломная работа: 54 страницы, 18 рисунков, 9 источников, 2 приложения.

Ключевые слова: Перестрахование, перестрахование Стоп-Лосс, Полу-Марковский процесс, процесс Леви.

Объект исследования: Убытки страховых компаний

Предмет исследования: Вероятность разорения страховой компании.

Цель работы: Исследование взаимодействия Стоп-Лосс перестрахования, процесса Леви и полу-Марковского процесса.

Методы исследования: Методы теории вероятностей и математической статистики, методы статистического моделирования, анализ графиков.

Результат: Изучены процессы SL-перестрахования, проведен анализ процесса перестрахования для страховых компаний в совокупности с процессом Леви и полу-Марковским процессом.

Областью применения: Финансовые рынки страховых компаний.

РЭФЕРАТ

Дыпломная праца: 54 старонкі, 18 малюнкаў, 9 крыніц, 2 дадаткі.

Ключавыя словы: Перастрахаванне, перастрахаванне Стоп-Лос, Паў-Маркаўскі працэс, працэс Леві.

Аб'ект даследавання: Страты страхавых кампаній

Прадмет даследавання: Верагоднасць спусташэння страхавой кампаніі.

Мэта працы: Даследаванне ўзаемадзеяння Стоп-Лос перастрахавання, працэсу Леві і паў-Маркоўскага працэсу.

Метады даследавання: Метады тэорыі імавернасцей і матэматычнай статыстыкі, метады статыстычнага мадэлявання, аналіз графікаў.

Вынік: Вывучаны працэсы SL-перастрахавання, праведзены аналіз працэсу перастрахавання для страхавых кампаній у сукупнасці з працэсам Леві і паў-Маркаўскім працэсам.

Вобласцю прымянення: Фінансавыя рынкі страхавых кампаній.

ABSTRACT

Thesis: 54 pages, 18 figures, 9 sources, 2 appendices.

Keywords: Reinsurance, Stop-Loss reinsurance, Semi-Markov process, Levy process.

Object of the research: Losses of insurance companies

Subject of research: Probability of insurance company ruin.

Purpose of the work: The study of interaction of Stop-Loss Reinsurance, Levy process and Semi-Markov process.

Research methods: methods of probability theory and mathematical statistics, methods of statistical modeling, graph analysis.

Result: SL reinsurance processes are studied, reinsurance process for insurance companies in conjunction with the Levy process and semi-Markov process is analyzed.

The area of application: Financial markets of insurance companies.