

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

Факультет прикладной математики и информатики

Кафедра математического моделирования и анализа данных

Аннотация к дипломной работе

Анализ процессов коллективного риска

Конецпольский Захар Геннадьевич

Научный руководитель – доцент кафедры ТВиМС, кандидат физ.-мат. наук
Меленец Ю.В.

Минск 2024

Реферат

Дипломная работа, 59 страниц, 26 рисунков, 6 источников, 2 приложения.

Ключевые слова: РИСК, КОЛЛЕКТИВНЫЙ РИСК, ПРОЦЕСС РИСКА, ВЕРОЯТНОСТЬ РАЗОРЕНИЯ, ДИНАМИЧЕСКАЯ МОДЕЛЬ, СЛУЧАЙНЫЙ ПРОЦЕСС, РАЗОРЕНИЕ, ПОДСТРОЕЧНЫЕ КОЭФФИЦИЕНТЫ, СОВОКУПНЫЕ ПОТЕРИ.

Объект исследования – модель коллективного риска, вероятность разорения страховой компании.

Цель работы - изучить модель коллективного риска.

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

Результат - изучена модель коллективного риска, произведена и изучена симуляция игры с коллективным риском

Область применения - финансовые рынки страховых компаний.

Abstract

Diploma work, 59 pages, 26 drawings, 6 sources, 2 annexes

Key words: RISK, COLLECTIVE RISK, RISK PROCESS, PROBABILITY OF RUIN, DYNAMIC MODEL, RANDOM PROCESS, RUIN, ADJUSTMENT COEFFICIENTS, CUMULATIVE LOSSES.

Object of research: collective risk model, probability of bankruptcy of an insurance company.

Purpose of the work: to study the collective risk model.

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

Result: a collective risk model has been studied, a simulation of a game with collective risk has been produced and studied.

Scope of application: financial markets of insurance companies.