

国家自然科学基金：最优再保险与投资精算师考试 PDF转换
可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/549/2021_2022__E5_9B_BD_

[E5_AE_B6_E8_87_AA_E7_c50_549623.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/549/2021_2022__E5_9B_BD_E5_AE_B6_E8_87_AA_E7_c50_549623.htm) 本项目着力于随机过程理论和随机控制理论在保险精算方面的应用研究。在保险精算中我们用一个随机过程来刻画保险公司未来不确定的资产值，然后加入投资和再保险环境，建立模型。通过最优化用某个风险测度来度量的目标函数，利用马尔可夫决策过程以及随机控制理论中的理论和方法，来寻找最优的投资和再保险策略。该项目在模型方面集中在三个方面进行创新研究，使之更符合实际情况。一是在风险测度方面寻找更符合保险市场风险的测度，如VaR, CTE等。二是对再保险策略拓展到实际应用比较广泛的Excess of loss再保险以及一些组合再保险策略之中，投资策略推广到多个资产组合的情形。三是对刻画资产的随机过程一般化。在这样的模型下，我们重点研究可以使某一风险测度最优化的投资策略与再保险策略的具体形式。该项目研究的问题属于当前保险精算理论研究中一个热点领域，其成果将在理论创新和实际应用方面有很重要的意义。百考试题收集整理 设百考试题为首页吧！100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com