

Irmina Czarna

Uniwersytet Wrocławski, Instytut Matematyczny

Zbigniew Palmowski

Uniwersytet Wrocławski, Instytut Matematyczny

Paryskie dywidendy dla spektralnie ujemnych procesów Lévy'ego

Referat będzie dotyczył problemu wyboru optymalnej dywidendy dla firmy ubezpieczeniowej, której rezerwy ewoluują jak spektralnie ujemny proces Lévy'ego. Funkcja wypłaty jest równa łącznym zdyskontowanym dywidendą płaconym do momentu ruiny. Dodatkowo zakładamy, że są możliwe dwa rodzaje opóźnień. W pierwszym przypadku będziemy mówić o ruinie, kiedy proces pozostaje poniżej zera dłużej niż ustalony okres czasu. W drugim przypadku będziemy przyjmować, że istnieje opóźnienie pomiędzy decyzją o wypłacie a samą wypłatą dywidend. Ponadto przeanalizujemy dwa szczególne przypadki:

- Przypadek dużych roszczeń modelowanych przez klasyczny proces Craméra-Lundberga;
- Przypadek małych roszczeń modelowanych przez ruch Browna.

Bibliografia

[1] Czarna, I. and Palmowski Z. (2010) Dividend problem with Parisian delay for a spectrally negative Lévy risk process, <http://arxiv.org/abs/1004.3310>.