

Zbigniew Palmowski

Instytut Matematyczny Uniwersytetu Wrocławskiego

H. Albrecher, C. Constantinescu, G. Regensburger, M. Rosenkranz

## **Prawdopodobieństwo ruiny dla procesu ryzyka z intensywnością składek zależną od stanu rezerw**

W komunikacie pokażemy, jak znajdować dokładne i asymptotyczne wyrażenia funkcji Gerbera–Shiu dla procesu ryzyka z procesem odnowy zgłoszenia szkód i funkcją intensywności wpłat zależną od obecnego stanu rezerw. Analiza oparta jest o analizę pewnego liniowego równania różniczkowego. Komunikat będzie oparty o pracę [1].

### **Bibliografia**

- [1] H. Albrecher, C. Constantinescu, Z. Palmowski, G. Regensburger, M. Rosenkranz, *Exact and asymptotic results for insurance risk models with surplus-dependent premiums*, SIAM Journal on Applied Mathematics 73 (2013), 47–66.