

## عنوان مقاله:

یافتن روشی بهینه برای بیمه اتکایی و سرمایه گذاری در بازار سهام با استفاده از فرایند ارنشتاین-اولن بک

## محل انتشار:

دومین همایش منطقه ای علوم ریاضی و کاربردها (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 4

## نویسندگان:

رامین اقبال زاده - دانشگاه شهید بهشتی

چیمین محمدنژاد - دانشگاه شهید بهشتی

## خلاصه مقاله:

با توجه به پیشرفت روزافزون صنعت بیمه و نقش آن در رشد و توسعه ی اقتصادی، مطالعه ی استراتژی سرمایه ی گذاری بهینه و نیز بیمه ی اتکایی بهینه برای شرکت های بیمه ، از اهمیت ویژه ای برخوردار است. در اینمقاله، ماکسیم کردن امید ریاضی تابع مطلوبیت نمایی نسبت به سرمایه نهایی بررسی شده است. همچنین با شبیهسازی نمودارهای حرکت براونی و ارنشتاین اولن بک و محاسبه واریانس نمونه ای آن سعی در مقایسه این دوفرایند با هم را داشته ایم. با فرض اینکه نرخ آبی بازده سرمایه گذاری شده از فرایند ارنشتاین-اولن بک پیرویم یکنند ، استراتژی بهینه برای دو حالت مدل مخاطره ی پواسون مرکب و حرکت براونی در نظر گرفته شده است. این هدف با استفاده از نظریه ی کنترل تصادفی و معادله ی همیلتون-ژاکوبی-بلمن به عنوان دو ابزار اساسی صورت پذیرفته است. همچنین در صورتی که تمام اطلاعات در دسترس نباشد ، یک استراتژی بهینه بررسی شده است

## کلمات کلیدی:

کلیدی: کنترل تصادفی، معادله ی همیلتون-ژاکوبی-بلمن، فرایند ارنشتاین اولن بک، فرایند پواسون مرکب، حرکت براونی، پالایش، مشاهدات جزئی

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/309029>

