

ПАРИЖСКОЕ РАЗОРЕНИЕ СО СЛУЧАЙНЫМИ ЗАВИСЯЩИМИ ОТ ДЕФИЦИТА ЗАДЕРЖКАМИ ДЛЯ СПЕКТРАЛЬНО-ОТРИЦАТЕЛЬНЫХ ПРОЦЕССОВ ЛЕВИ

Боровков Константин Александрович

✧ *Email: borovkov@unimelb.edu.au; Мельбурнский Университет, Школа Математики и Статистики, Мельбурн, Австралия.*

Мы рассматриваем интересное естественное обобщение задачи о парижском разорении в предположении, что динамика резерва риска задаётся спектрально-отрицательным процессом Леви. Отличительная особенность такого обобщения состоит в том, что распределение случайных длин для окон задержки реализации процесса может зависеть от дефицита в те моменты времени, когда процесс резерва риска становится отрицательным, тем самым начиная новый отрицательный цикл. Модель включает в себя возможность мгновенного разорения, когда дефицит достигает определенного подмножества. В такой общей постановке мы выведем аналитическое выражение для вероятности парижского разорения и совместного преобразования Лапласа для времени парижского разорения и дефицита в момент разорения. Доклад основан на совместной работе с Duy Phat Nguyen.