

O supremu Levyjevog procesa i primjena u teoriji rizika

Sažetak: Najstariji i najpoznatiji model procesa rizika u osiguranju je Cramer-Lundbergov model. Odgovor na osnovno pitanje vjerojatnosti propasti u tom modelu dan je Pollaczek-Hincinovou formulom. U ovom predavanju objasnit ću strukturu te formule, te pokazati kako je ta struktura očuvana u raznim generalizacijama Cramer-Lundbergovog modela. Svi promatrani modeli zasnivaju se na jednodimenzionalnim Levyjevim procesima. Osnovni tehnički problem o kojem ću govoriti je način na koji Levyjev proces dostiže svoj supremum.