

Ασκήσεις Απαλλακτικής Εργασίας στο μάθημα Έντασφάλισή -Ιούνιος 2025

9 Ιουνίου 2025

1. Να οριστούν με εκρίβεια τη συνεπή μέτρα κινδύνου και να περιγραφεί ο ρόλος τους στην αντασφάλιση.
2. Να οριστεί με λεπτομέρεια το δεξί άκρο (endpoint) μιας κατανομής με τιμές στους θετικούς πραγματικούς αριθμούς.
3. Να υπολογιστεί το Value-at -Risk και το Expected Shortfall για μία τυχαία μεταβλητή που ακολουθεί ομοιόμορφη κατανομή στο $[0, 1]$ σε επίπεδο σημαντικότητας $\alpha = 0.75$.
4. Να περιγραφούν οι quota -share και stop-loss συμβάσεις αντασφάλισης.
5. Να δοθούν παραδείγματα κατανομών τυχαίων μεταβλητών στις οποίες η εκ-θετική αρχή ασφαλίστρου είναι καλά ορισμένη.