

# Εργασία στο μάθημα 'Αντασφάλιση' -Ιούνιος 2024

31 Μαΐου 2024

1. Να δοθεί παράδειγμα απαριθμήτριας στοχαστικής διαδικασίας μίας ασφαλιστικής εταιρίας η οποία αναλαμβάνει την ασφάλιση ζημιών μιας άλλης εταιρίας κατά ποσοστό  $p = 0.10$ .
2. Να δοθεί παράδειγμα μείξης δύο κατανομών που οι τιμές τους λαμβάνονται 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  $a = 0.97$ .
4. Να περιγραφούν οι quota -share και stop-loss συμβάσεις αντασφάλισης.
5. Να δοθούν παραδείγματα κατανομών τυχαίων μεταβλητών στις οποίες η εκθετική αρχή ασφαλίστρου δεν είναι καλά ορισμένη.