

Ασκήσεις στην "Αντασφάλιση"

1) Η συνέλιξη δύο ανεξάρτητων
τ.μ X, Y που ακολουθούν Pareto
κατανομή με παραμέτρους
 $(1, 1)$ και $(1, 2)$ αντίστοιχα,
είναι κατανομή Pareto ?

2) Έστω $a_i = \frac{1}{n}$, $i=1, 2, \dots, n$ και
 X_i είναι εκθετικές κατανομές
με παράμετρο λ (για κάθε
 $i=1, 2, \dots, n$

Τι κατανομή ακολουθεί η μίξη

$$S_n = \sum_{i=1}^n \frac{1}{n} X_i \quad ?$$