

Εργασία στο μάθημα 'Αντασφάλιση'

26 Ιανουαρίου 2024

1. Να γραφούν οι εξισώσεις προσδιορισμού ασφαλίστρου για μια ασφαλίστρια και μία αντασφαλίστρια εταιρία χρησιμοποιώντας συναρτήσεις ωφελιμότητας που είναι κινδυνόφιλες.
2. Να υπολογιστεί το Value-at -Risk και το Expected Shortfall για μία τυχαία μεταβλητή που ακολουθεί ομοιόμορφη κατανομή στο $[0, 1]$ σε επίπεδο σημαντικότητας $\alpha = 0.95$.
3. Να περιγραφούν οι quota -share και stop-loss συμβάσεις αντασφάλισης.
4. Να δοθούν παραδείγματα κατανομών τυχαίων μεταβλητών στις οποίες η εκ-θετική αρχή ασφαλίστρου δεν είναι καλά ορισμένη.