

Εργασία στο μάθημα 'Αντασφάλιση' -Σεπτέμβριος 2024

11 Σεπτεμβρίου 2024

1. Να δοθεί παράδειγμα απαριθμήτριας στοχαστικής διαδικασίας μίας ασφαλιστικής εταιρίας η οποία αναλαμβάνει την ασφάλιση ζημιών μιας άλλης εταιρίας κατά ποσοστό $p = 0.15$.
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 $\alpha = 0.95$.
4. Να περιγραφούν οι quota -share και stop-loss συμβάσεις αντασφάλισης.
5. Να δοθούν παραδείγματα κατανομών τυχαίων μεταβλητών στις οποίες η εκθετική αρχή ασφαλίστρου είναι καλά ορισμένη.