

《风险理论》

图书基本信息

书名：《风险理论》

13位ISBN编号：9787300093444

10位ISBN编号：7300093442

出版时间：2008-5

出版社：中国人民大学出版社

作者：肖争艳

页数：276

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu111.com

《风险理论》

内容概要

书籍目录

第1章 预备知识1.1 概率空间、随机变量及分布1.2 随机变量的数字特征1.3 条件概率和条件期望1.4 独立性1.5 矩母函数和母函数第2章 个别保单的理赔额2.1 几种常见的理赔形式2.1.1 保单限额2.1.2 免赔额2.1.3 相对免赔额2.1.4 比例分担免赔2.1.5 通货膨胀对理赔额分布的影响2.2 理赔额分布选择和拟合2.2.1 整理记录数据2.2.2 选择分布类型, 估计参数2.2.3 分布的拟合检验2.2.4 选择合适的分布2.2.5 综合例子习题第3章 个体风险模型3.1 S 的数字特征3.2 独立随机变量和的分布3.3 矩母函数和母函数法3.4 S 分布近似算法习题第4章 集体风险模型4.1 理赔次数的分布4.1.1 常见的理赔次数分布4.1.2 理赔次数分布的混合模型4.2 S 的分布性质4.2.1 S 的数字特征4.2.2 如何计算 S 的分布4.3 复合泊松分布及其性质4.3.1 复合泊松分布的性质4.3.2 个体风险模型的复合泊松分布近似4.4 S 的近似分布4.5 S 分布的数值计算方法4.6 集体风险模型的应用4.6.1 相关性保单组合的理赔次数的分布4.6.2 免赔额对理赔次数的影响4.6.3 限额损失再保险4.6.4 团体保险的红利模型习题第5章 长期聚合风险模型5.1 盈余过程和破产概率5.1.1 盈余过程5.1.2 泊松盈余过程5.1.3 破产概率5.2 连续时间模型破产概率的计算5.2.1 微积分方程5.2.2 最大损失过程5.3 离散时间模型的破产概率的计算5.4 调节系数与破产概率5.4.1 调节系数5.4.2 破产概率的计算5.4.3 离散时间盈余过程的调节系数习题第6章 风险决策理论6.1 效用理论与风险决策6.1.1 期望值原理与风险决策6.1.2 效用理论6.2 保费定价与效用理论6.2.1 保费定价原理6.2.2 最优保险习题习题解答第2章第3章第4章第5章第6章模拟题及解答模拟题1模拟题1解答模拟题2模拟题2解答模拟题3模拟题3解答模拟题4模拟题4解答附录 常用概率分布及其性质参考文献

章节摘录

第1章 预备知识 一个精算模型总是试图描述未来可能发生的随机性损失。损失的随机性有三个含义：损失发生的次数是随机的；损失发生的时间是随机的；损失的大小是随机的。对一份特定的保单而言，这三种随机性至少满足一种。而在概率论里，这三种随机性都能用相应的随机变量来刻画。为了后面叙述的方便，本章将对本书经常用到的概率论基本知识进行简要的回顾。

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:www.tushu111.com