

中国精算师长期聚合风险模型复习资料 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

[https://www.100test.com/kao\\_ti2020/219/2021\\_2022\\_\\_E4\\_B8\\_AD\\_E5\\_9B\\_BD\\_E7\\_B2\\_BE\\_E7\\_c50\\_219216.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/219/2021_2022__E4_B8_AD_E5_9B_BD_E7_B2_BE_E7_c50_219216.htm)

【思考题】在成数再保险与停止损失再保险情况下，怎样计算原保险人与再保险人的Lundberg系数？

【复习题】

1. 盈余过程是一个怎样的模型？此过程与理赔过程有何关系？
2. 什么是破产概率？终极破产概率与有限时间段上的破产概率有何关系？
3. 破产概率有哪些性质？来源：[www.examda.com](http://www.examda.com)
4. 什么是泊松过程？泊松过程有哪些性质？
5. 什么是复合泊松过程？与复合泊松分布的关系是怎样的？
6. 在复合泊松过程下，写出关于终极破产概率  $(u)$  的微分方程式。
7. 在复合泊松过程中，个别理赔额随机变量服从参数为  $a$  的指数分布，此时的终极破产概率表达式是什么？
8. 在理赔总额过程为复合泊松过程时，盈余  $u(t)$  首次落到  $u$  以下，其值落在  $u-y$  到  $u-y+dy$  间的概率表达式是什么？
9. 不管个别理赔随机变量的分布如何，初始资产为 0 时，终极破产概率的表达式是什么？
10. 最大损失随机变量与终极破产概率的关系是怎样的？
11. 盈余  $u(t)$  首次降到初始资产以下的损失随机变量的密度函数是什么？矩母函数是什么？
12. 最大总体损失随机变量的矩母函数是什么？
13. Lundberg 系数是怎么回事？在复合泊松过程情况下，它是如何定义的？
14. 在复合泊松过程中，当附加保费系数  $>0$  时，Lundberg 系数存在吗？

100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。  
详细请访问 [www.100test.com](http://www.100test.com)