

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

https://www.100test.com/kao_ti2020/84/2021_2022__E4_B8_AD_E5_9B_BD_E7_B2_BE_E7_c50_84306.htm 【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 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。来源

: www.examda.com 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