

中国精算师短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_84309.htm 【复习题】

1. 什么是短期聚合风险模型? 2. 叙述泊松分布的定义及性质。 3. 为什么说负二项分布是泊松分布的一种推广? 4. 什么样类型的分布可作为理赔次数分布? 5. 什么样类型的分布可作为理赔额分布? 6. 了解 $E(S)=E(E(s|N))=E(N)E(C)$ 的推导过程。 7. 了解 $Var(S)=E^2(C)Var(N)+E(N)Var(C)$ 的推导过程。 8. 了解理赔总额的矩母函数与理赔次数和个别理赔额的矩母函数之间的关系。 9. 写出复合分布的密度函数和分布函数公式。 10. 什么是复合泊松分布? 矩母函数是怎样的? 11. 若干个复合泊松分布随机变量和的分布是什么分布? 来源

: www.examda.com 12. 在复合泊松分布模型下，个别索赔额为正整数 $m_1, m_2, m_3, \dots, m_n$ 时， m_i 的发生次数 N_i 服从什么分布? 13. 写出上题中理赔总额的密度函数。 14. 在复合泊松分布的模型下，个别理赔额在办理停止损失再保险时，再保险后原保险人的泊松参数有什么变化? 个别理赔额有什么变化? 15. 在复合泊松分布的模型下，在什么情况下，理赔总额可用正态分布近似? 在复合负二项分布的条件下的情况又怎样? 16. 什么是平移伽马分布? 如何用平移伽马分布来近似复合泊松分布? 17. 在每个保险标的只发生一次的情况下，个别风险模型与聚合风险模型有什么关系? 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