

中国精算师风险与精算随机模拟复习题 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_84312.htm

1. 什么是Monte Carlo方法? 2. 列举出用统计试验法的五个理由? 来源: www.examda.com 3. 模拟的基本步骤有哪几步? 4. 用均匀分布的随机数近似计算的原理是什么? 5. 产生随机数有哪些要求? 6. 产生均匀分布的随机数常见的有哪几种方法? 7. 什么是伪随机数? 8. 什么是平方取中法? 9. 什么是倍积取中法? 10. 什么是乘同余法? 12. 为什么用反函数法可产生概率分布的随机数? 13. 什么是取舍法? 为什么取舍法能产生相应分布的随机数? 来源: www.examda.com 14. 用BoxMuller方法产生四个标准正态分布的随机数。 15. 用极方法产生四个 $N(0, 1)$ 分布的随机数。 来源: www.examda.com 16. 用反函数法产生 $e(4)$ 分布的四个随机数。 17. 如何用正态分布表产生 $N(0, 1)$ 分布的随机数? 18. 用中心极限定理产生 $N(0, 1)$ 分布的随机数。 23. 如何生成二项分布的随机数? 24. 如何用分数乘积法生成 $P(0.4)$ 分布的四个随机数? 来源: www.examda.com 25. 分数乘积法生成泊松分布随机数的原理是什么? 26. 如何用中心极限定理生成 $P(4)$ 分布的随机数? 27. 用两种方法生成参数 $k=10, p=0.6$ 的负二项分布的四个随机数。 28. 如何生成复合二点分布的三个随机数? 其中二点分布是, 个别理赔额分布为 $e(10)$ 。 29. 在前面的难点解析例10中, 若一旦当基金超过25万元时, 就将超过部分分配给股东, 则破产概率及破产前签发的保单数为多少?(提示: 用随机模拟方法, 只需将源程序中的第120行语句改为: “ 120 IF CAPITAL>250000

THEN LET CAPITAL= 250000"。) 30 . 在前面的难点解析例10中,若保险人签发的前6份保单中,有3份引起理赔,问保险人是否还有偿付能力?此时用随机模拟法模拟破产发生的概率是多少?来源: www.examda.com 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