

ОГЛАВЛЕНИЕ

Введение	5
Глава 1. Модели числа страховых событий	9
§ 1. Основные числовые характеристики случайных величин	9
§ 2. Биномиальная и пуассоновская модели	15
§ 3. Смешанные распределения	20
Примеры упражнений с решениями	27
Упражнения	28
Глава 2. Модели размера страховых претензий	35
§ 1. Составная модель совокупной суммы претензий . .	35
§ 2. Распределение величины претензий	43
§ 3. Перестрахование	53
Примеры упражнений с решениями	59
Упражнения	62
Глава 3. Моделирование функции распределения суммарного риска	71
§ 1. Рекуррентная формула для функции распределения	71
§ 2. Аппроксимация функции распределения	76
§ 3. Моделирование распределений	78
§ 4. Имитационное моделирование составных переменных	83
Примеры упражнений с решениями	88
Упражнения	92

Глава 4. Оценка и оптимизация моделей риска	103
§ 1. Оценка рискового капитала	103
§ 2. Оценка достоверности модели	111
§ 3. Оптимальные условия перестрахования	118
§ 4. Понятия полезности и выгоды	124
Примеры упражнений с решениями	127
Упражнения	128
Предметный указатель	131
Список литературы	133