

精算建模 Chap 3: 主观题考前复习

庄源

2023/12/22

以下为主观题。客观题请参考平时作业，一些必须要计算机和数值算法才能求得的题目不会出现在考试中。

- 设 S 有 Compound Poisson distribution, 试写出 $E(S)$, $Var(S)$, $M_S(t)$ 的表达式。
- 试说明离散情形下, collective risk model 的 Panjer 递推公式, 并说明这个公式具有何种意义?
- 试说明个体风险模型的设定, 并写出 $E(S)$, $Var(S)$ 的表达式。
- 为何要使用复合 Poisson 模型对个体风险模型近似? 近似之后的均值和方差相对于原来的个体风险模型有什么变化?
- 试列举两个在本课程中学到的保费原则。
- 在本课程中, 对比例再保险、超额损失再保险, 分别从盈利性和安全性两方面加以讨论。
- 什么是 LEV 函数?