

アクチュアリーのレポート問題

YI Ran-21122200512

2025 年 1 月 24 日

解答

proof 1. 二つの独立なポアソン過程 N^1 と N^2 、それぞれのレートが λ^1 と λ^2 。

$T_n^i = \sum_{j=1}^n \tau_j^i$ で、 τ_j^i は独立である。

N^1 と N^2 は独立

□