

精算建模 Chap 2: 主观题考前押题

庄源

2023/12/17

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。

- 试说明，为什么帕累托分布在建模赔付通货膨胀和免赔额时具有很好的效果？
- 试说明重参数化（Reparametrization）在参数估计中的作用？
- 试说明分位数估计（Method of Percentile）的步骤？
- 试说明，如何求得参数极大似然估计的方差。
- 试列出评价分布拟合效果的定量方法（至少两种）并说明其原理。
- 试说明 K-S 检验与 A-D 检验的不同。
- 试说明，如何使用均匀分布生成指数分布的随机数？
- 试说明混合分布（Mixture distributions）的含义，并给出一个例子。
- 在本课程中，讲到了三种再保险方式：比例再保险、超额损失再保险、停止损失再保险。说明一下这三者的概念。