

<<风险统计模型>>

图书基本信息

书名：<<风险统计模型>>

13位ISBN编号：9787509509258

10位ISBN编号：7509509254

出版时间：2008-11

出版时间：中国财经

作者：李晓林

页数：262

字数：410000

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

<<风险统计模型>>

内容概要

本书是高等学校同名课程教材，也是非寿险精算基础课程教材。本书是1993年开始的中英精算教育合作项目的成果之一，于2002年被立项为北京市精品教材。

风险统计模型，又称风险模型，旨在为不确定事件的财务后果提供数量化意见。它包括多种模型，以概率统计为基础，刻画了多种损失变量的规律及其影响。

本书的主要内容包括数据的整理、损失分布、概率母函数和矩母函数、风险模型、破产分析理论、贝叶斯统计推断、置信度理论、无赔款优待、递推三角形等；涵盖了非寿险精算中主要的风险统计模型。

<<风险统计模型>>

书籍目录

- 第一章 数据的整理
 - 第一节 数据的描述
 - 第二节 数据分布位置的度量
 - 第三节 数据分布密集与分散程度的度量
 - 第四节 对称与偏斜度
- 第二章 随机变量与随机向量
 - 第一节 随机事件与概率
 - 第二节 随机变量的分布和数字特征
 - 第三节 二维随机向量的分布
 - 第四节 随机向量的数字特征
 - 第五节 n 维随机向量
 - 第六节 随机变量的条件分布
- 第三章 概率母函数和矩母函数
 - 第一节 母函数
 - 第二节 概率母函数
 - 第三节 矩母函数
 - 第四节 独立随机变量的线性组合
- 第四章 大数定律和中心极限定理
 - 第一节 切比雪夫不等式
 - 第二节 中心极限定理
 - 第三节 大数定律
- 第五章 统计推断
 - 第一节 抽样分布
 - 第二节 点估计
 - 第三节 区间估计
 - 第四节 正态总体均值和方差的假设检验
 - 第五节 分布拟合检验
 - 第六节 一元线性回归
- 第六章 风险模型
 - 第一节 概述
 - 第二节 集合风险模型
 - 第三节 复合风险模型 $G(x)$ 的计算
- 第七章 破产分析理论
 - 第一节 基本概念
 - 第二节 泊松分布和复合泊松分布
 - 第三节 调整系数和兰德伯格不等式
 - 第四节 变化的参数值对有限和无限时间破产概率的影响
 - 第五节 再保险与破产
- 第八章 贝叶斯统计推断
 - 第一节 先验分布和后验分布
 - 第二节 简单情况下后验分布的推导
 - 第三节 误差函数
- 第九章 置信度理论
 - 第一节 基本思想
 - 第二节 贝叶斯置信度

<<风险统计模型>>

第三节 经验贝叶斯置信理论：模型1

第四节 经验贝叶斯置信度理论：模型2

第十章 无赔款优待

第一节 背景介绍

第二节 无赔款优待法的定义

第三节 稳定状态分析

第四节 NCD机制对索赔倾向的影响

第十一章 递推三角形

第一节 背景

第二节 运用递推因子进行预测

第三节 针对通货膨胀的调整

附录

附录 常见随机变量分布

附录 概率分布表

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>