

Teorija rizika-ispitna pitanja

1. Osnovni model homogenog portfolija neživotnog osiguranja. Pojam procesa prebrojavanja kao modela broja šteta u portfoliju
2. Homogeni i nehomogeni Puasonov process kao modeli broja šteta u portfoliju neživotnog osiguranja
3. Procesi obnavljanja kao modeli broja šteta u portfoliju neživotnog osiguranja; Homogeni Puasonov proces kao proces obnavljanja
4. Raspodele dolaznih i medjudolaznih vremena nehomogenog Puasonovog procesa
5. Osobine procesa ukupne štete portfolija neživotnog osiguranja u Cramer-Lundbergovom modelu
6. Osobina statistika poretka Puasonovog procesa
7. Simetrične funkcije i njihova primena u neživotnom osiguranju
8. Zakon velikih brojeva za proces obnavljanja
9. Osnovna teorema za procese obnavljanja
10. Mešoviti Puasonov proces
11. Uticaj ukupne štete na visinu premije neživotnog osiguranja; Asimptotska svojstva procesa ukupne štete u portfoliju neživotnog osiguranja
12. Klasični principi izračunavanja premija

13. Osnovni pojmovi o raspodelama sa teškim i lakim repom i njihova uloga kao modela iznosa šteta u portfoliju neživotnog osiguranja
14. Mešovite raspodele i njihove primene u kontekstu neživotnog osiguranja
15. Osnovni pojmovi teorije propasti
16. Lundbergov koeficijent: definicija egzistencija i jedinstvenost
17. Lundbergova nejednakost koju zadovoljava verovatnoća propasti portfolija neživotnog osiguranja
18. Osnovni pojmovi teorije obnavljanja (Teorema Blackwella, Ključna teorema obnavljanja i Smithova teorema obnavljanja)
19. Fundamentalna integralna jednačina verovatnoće izbegavanja propasti
20. Kramerova granica verovatnoće propasti
21. Verovatnoća izbegavanja propasti kao složena geometrijska suma
22. Reosiguranje