

A viszontbiztosítás matematikai módszerei

Bognár Katalin

Tartalomjegyzék

| | |
|---|----|
| Előszó | 7 |
| Bevezetés | 9 |
| 1. Viszontbiztosítási formák | 11 |
| Viszontbiztosítás rögzített viszontbiztosítási tiszta díj mellett. Kártöbblet- viszontbiztosítás | 12 |
| Viszontbiztosítás a viszontbiztosításba adott állomány szórásnégyzetének rögzítése mellett | 14 |
| 2. Kockázati helyzetek közötti rendezés, hasznosság | 16 |
| Eloszlások közötti preferencia-rendezés | 17 |
| A hasznossági index (hasznosság) | 18 |
| Példák | 20 |
| Kvadratikus pénz-hasznossági függvény | 21 |
| Alkalmazások | 22 |
| Optimális kártöbblet-viszontbiztosítás | 22 |
| Kölcsönös biztosító társaság kvóta-viszontbiztosítással | 24 |
| Egy numerikus példa | 26 |
| 3. Viszontbiztosítás két társaság között, reciprok viszontbiztosítás | 28 |
| Kvóta-viszontbiztosítás mint optimális reciprok viszontbiztosítás | 28 |
| Nash-megoldás | 36 |
| Numerikus példák | 37 |
| 4. Általános hasznossági függvények, optimális viszontbiztosítás | 40 |
| Példák | 45 |
| Megjegyzések a használt modell korlátairól | 49 |
| 5. Viszontbiztosítási szerződések n társaság között | 51 |
| Példa (nem optimális viszontbiztosítás) | 55 |
| Példák (optimális viszontbiztosítás) | 56 |
| Irodalom | 59 |