

Предметный указатель

- Алгоритм Неддера–Ведерберна 245
– разреженного вектора 79
Аппроксимация нормально-степенная (НС-аппроксимация) 61, 96
– с помощью центральной предельной теоремы 98
– смещенным гамма-распределением 58
Более опасная случайная величина 282
– рискованный риск 270
Большой риск 270, 274
Вероятность неразорения за бесконечное время 113
– разорения 112, 121
– – для дискретных распределений 136
– – – показательных распределений 134
– – – смесей показательных распределений 135
– – за конечное время 113
– – , методы аппроксимации 137
– – , рекуррентная формула 133
– – , явное выражение 134
Верхняя граница Лундберга 113, 119
– – Фреше–Хёфдинга 309
Внешний средний квадрат 180
Внешняя сумма квадратов 180
Внутренний средний квадрат 180
Внутренняя сумма квадратов 180
Выборочное среднее пуассоновских случайных величин 213
Выпуклый порядок 283, 306
– – , условия 307
Дивиденды 148
Дисперсионная функция 214
Дисперсионное отношение (F -отношение) 180
Дисперсионный анализ 179
– параметр 213
Доверительная теория 177, 178
– – наиболее точная 178
Естественные веса 193
Жажда бонуса 172, 173
Зависимость отрицательная 273
– положительная 273
ЗНУУ, Заявленные, но Не Урегулированные Убытки 250
ЗПК-пары 317
Иенсена неравенство 22
Интенсивность поступления премий 114
Канонический параметр 241
Капитал в момент разорения 129
Комонотонное множество 309
– распределение 309
Комонотонный случайный вектор 309
Концентрация вероятностной массы 298
Копула 318
Косвенное отношение тяжести хвостов 280
Коэффициент асимметрии 55
– доверия 178
– Кендалла 328
– корреляции Пирсона 318
– Лундберга 113, 117, 120, 289
– несклонности к риску 24
– рискованной надбавки 117
Кросс-фактор 218
Лица, не склонные к риску 19
Мартингал 120

- Метод арифметического разделения 258
- Бейли–Саймона 219, 221
 - взвешенных маргинальных сумм 246
 - геометрического разделения 259
 - маргинальных сумм 221
 - наименьших квадратов 223
 - – – де Вийлдера 260
 - последовательной подстановки 220
 - прямой 224
 - Фишера скоринговый 245
 - цепной лестницы 253, 255
- Модель Бюльмана 179
- – классическая 181
 - – сбалансированная 182, 183, 186
 - Бюльмана–Штрауба 190, 192, 194
 - Де Вилдера доверительная 192
 - Джуэлла иерархическая 191
 - индивидуального риска 38
 - коллективного риска 69, 112
 - – – открытая 89
 - компонент дисперсии 181
 - кросс-классификации 191
 - лог-линейная 217
 - открытого портфеля 89
 - отрицательная биномиальная 200
 - полная 215, 226
 - псевдоправдоподобия 228
 - пустая 215
 - разорения с дискретным временем 113, 125
 - Хахмайстера регрессионная 192
 - «хороший водитель/плохой водитель» 201
- Модуль GenMod 212
- МЦКА, Модель определения Цен Капитальных Активов 277
- Начальный капитал** 114
- Неймана и Моргенштерна экономическая теория 20
- Неравенство Бонферрони 318, 327
- Вербека 305
 - Иенсена 22
 - Лундберга 113, 119
- Несклонность к риску 19
- Нетто-премия 18
- Нормированное отклонение модели 226
- Обобщенная линейная модель** 178, 211
- Ожидаемая полезность 18
- Оптимальное перестрахование 293
- Оптимальность по Парето 34
- Остатки 216
- Открытый портфель 89
- Относительная рискованная надбавка 117
- Относительный ущерб 178
- Отсутствие памяти 114
- Пакет S-Plus** 212
- Панджера рекуррентное соотношение 80
- Перестрахование стоп-лосс 19, 28, 95
- – , оптимальность 31
 - эксцедента убытка 287
- Петербургский парадокс 20
- ПНЗУ, Произошедшие, но Не Заявленные Убытки 250
- Показательная оценка Лундберга 289–290
- Показательное дисперсионное семейство 213
- – – плотностей 234, 240
- Показательный порядок 283
- Порядок стоп-лосс 282, 284
- Предельная полезность 22
- – убывающая 22
- Предиктор 182
- линейный 214
- Премия доверительная 178
- максимальная 19
 - минимальная 19
 - , неоднородность 20
 - нулевой полезности 23, 151
 - показательная 25, 147
 - рискованная 187
 - стационарная 173
 - стоп-лосс 29, 99, 100, 281
 - – максимальная 303
 - – минимальная 303
- Преобразование Эшера 240
- Принцип дисперсии 33, 147, 150
- квантильный 152
 - максимального убытка 152
 - математического ожидания 150
 - нулевой полезности 151
 - ожидаемой полезности 28
 - показательный 151
 - среднего значения 151

- стандартного отклонения 148, 151
- эквивалентности 150
- Эшера 152
- Программа GLIM 212
- Производящая функция кумулянтов (п.ф.к.) 54
- – моментов (п.ф.м.) 52–53
- – распределения (п.ф.р.) 54
- Пропорциональное перестрахование 19, 287
- – , оптимальность 33
- Процесс рискового резерва 114
- Пуассоновский процесс 116
- Пуассоновское кратное 213
- ПЧЗУ, Произошедшие и Частично Заявленные Убытки 250

- Разорение** 112
- Ранговая корреляция Спирмена 318
- Распределение логнормальное 91
- безгранично делимое 77
- Вальда 92
- гамма 90
- , комбинация показательных 93
- Кокса 93
- логарифмическое 76
- обратное нормальное 91
- отрицательное биномиальное 76
- Парето 91
- сложное 71
- – отрицательное биномиальное 69, 76
- – пуассоновское 69, 76, 78
- – , свертка 73
- структурное 76, 182
- Фишера 180
- F*-распределение 180
- Рассеяние вероятностной массы 298
- Рекуррентное соотношение Панджера 80
- Риск 270
- более рискованный 270
- больший 270, 274
- нестрахуемый 27

- Свертка** 49, 132, 284
- Система SAS 212
- бонус-малус 163, 168
- – голландская 165
- – , марковский анализ 168
- Систематическая компонента 214
- Смесь 44, 92–93, 284
- Собственное удержание 29
- Статистическая компонента 213
- Стохастический порядок 276
- Структурные параметры 182
- Сумма под риском 38, 59

- Таблицы сопряженности** 229
- Теорема разделения для порядка стоп-лосс 282
- Рао–Блекуэлла 295
- Склера 328
- Теория полезности 18
- Треугольник исчерпания (урегулирования, развития) 250

- Упорядочение по среднему–дисперсии** 270, 277
- Уравнение для коэффициента Лундберга 118

- Формула Бикмана** 132
- Франшиза 37
- Функциональная инвариантность 287, 321
- Функция полезности 18, 19, 282
- – квадратичная 25
- – линейная 25
- – логарифмическая 25
- – показательная 25
- – степенная 25
- распределения абсолютно непрерывная 41
- – дискретная 40
- – смешанного типа 43
- Функция связи 214
- – каноническая 214, 241

- Характеристическая функция** 53
- Хвосты более тяжелые 278, 280, 281

- Центральная предельная теорема (ЦПТ)** 56

- Экономическая теория Неймана и Morgenштерна** 20
- Экспозиция 218
- Эффективность Лоймаранты 171