

Inhaltsverzeichnis

Einleitung.....	1
1. Kapitel. Stochastische Grundlagen.....	8
1.1. Zufallsvariable, Verteilungen und Momente.....	8
1.2. Transformierte von Verteilungen.....	22
1.3. Transformationen von Zva und von Verteilungen.....	29
1.4. Beispiele von Verteilungen.....	34
1.5. Folgen von Zva.....	45
2. Kapitel. Der Risikoprozeß.....	74
3. Kapitel. Numerische Verfahren.....	79
3.1. Einfache Verfahren für diskrete Verteilungen.....	79
3.2. Einfache Anpassungen.....	90
3.3. Approximation mit Hilfe orthogonaler Polynome.....	91
3.4. Die Edgeworth-Approximation.....	96
3.5. Die Esscher-Approximation.....	99
3.6. Die Normal Power-Approximation.....	102
3.7. Die Fast Fourier-Methode.....	105
3.8. Die Sparse Vector-Methode.....	107
3.9. Konzentration und Dispersion von Verteilungen.....	108
3.10. Vergleichende Bemerkungen.....	109

4. Kapitel. Prämienkalkulationsprinzipien.....	110
4.1. Auf dem Nettorisikoprinzip basierende Prämienprinzipien.....	111
4.2. Implizit definierte Prämienprinzipien.....	112
4.3. Eigenschaften von Prämienkalkulationsprinzipien.....	123
4.4. Vergleichende Bemerkungen.....	135
5. Kapitel. Credibility - Theorie.....	138
5.1. Ein statistisches Entscheidungsmodell.....	139
5.2. Ein Bayessches Entscheidungsmodell.....	141
5.3. Exkurs: Klassen konjugierter Verteilungen.....	143
5.4. Credibility - Prämien.....	145
5.5. Ein Minimax - Modell.....	150
6. Kapitel. Selbstbehalte und Rückversicherung.....	153
6.1. Franchisen.....	154
6.2. Rückversicherung.....	156
6.3. Induzierte Zva und Verteilungen.....	159
6.4. Einige spezielle Aspekte.....	169
6.5. Obere Schranken für Stop loss-Prämien.....	177
7. Kapitel. Ruinwahrscheinlichkeiten.....	182
7.1. Der Begriff Ruinwahrscheinlichkeit.....	182
7.2. Der Sicherheitsindex.....	189
7.3. Eine klassische Ruinformel.....	195
7.4. Eine Formel für die Verlustwahrscheinlichkeit.....	197

Symbolverzeichnis.....	200
Literaturverzeichnis.....	204
Sachverzeichnis.....	207