

Otázky k přednášce Přístup k interním modelům v pojišťovnách:

1. Co musí splňovat interní model podle definice v Solventnosti 2?
2. Popište jednotlivé fáze cyklu vývoje interního modelu.
3. Jaká jsou hlavní rizika pro neživotního pojistitele?
4. V čem spočívá riziko rezerv?
5. Jaké typy škod je třeba zohlednit při modelování rizika pojistného?

Otázky k přednášce Aktuár a provozní systém pojišťovny:

6. Jaké jsou hlavní moduly provozního systému pojišťovny?
7. Jaké varianty podílů na zisku lze uvažovat v rámci definice produktu životního pojištění?
8. Jaké typy technických změn mohou být součástí modulu produktů a v čem spočívají?
9. Jakými událostmi je ovlivněn životní cyklus pojistné smlouvy a kdy je smlouva považována za „živou“?

Otázky k přednášce Zajišťování pojistného rizika:

10. Co znamená termín retrocese?
11. Co zohledňují pojišťovny při sestavování zajistného programu?
12. Jaké subjekty působí na zajistném trhu a jaké jsou jejich role?
13. Popište proces obnovy zajistných smluv.

Otázky k přednáškám o vícerozměrné teorii extrémů:

14. Vícerozměrná rozdělení extrémních hodnot (MEVD) – konvergence normovaných vícerozměrných maxim, souvislost s jednorozměrnou Fisher-Tippetovou větou.
15. Definice kopuly extrémních hodnot.
16. Ukažte, že kopula nezávislosti a kopula monotonie jsou kopuly extrémních hodnot.
17. Charakterizace sféry přitažlivosti MEVD (Věta 3.)
18. Popište aproximaci sdruženého rozdělení na pravém chvostu ( $\mathbf{x} > \mathbf{u}$ ) pomocí jednorozměrného zobecněného Paretova rozdělení a kopuly extrémních hodnot.
19. Popište příspěvek do věrohodnostní funkce pozorování třírozměrných dat, ve kterém první složka překročí zvolenou prahovou hodnotu a zbývající dvě složky jsou pod prahovými hodnotami.
20. Definice dolní prahové kopuly (lower threshold copula) a limitní dolní prahové kopuly (limiting lower threshold copula).