

# 目 次

第 1 章	クレーム頻度の分析	1
1.1	ポアソン分布	1
1.2	ポアソン分布の推定	24
1.3	負の二項分布	40
第 2 章	クレーム額の分析	59
2.1	ガンマ分布	59
2.2	免責金額：例題と解答	70
2.3	対数正規分布	82
2.4	逆ガウス型分布	92
第 3 章	クレーム総額の分析	109
3.1	複合分布	110
3.2	複合ポアソン分布	118
3.3	複合負の二項分布：例題と解答	128
第 4 章	破産問題	137
4.1	逆三項分布	137
4.1.1	ランダムウォーク	137
4.1.2	確率関数	138
4.1.3	モーメント	141
4.2	逆二項分布	145
4.2.1	確率関数と確率母関数	145
4.2.2	分布関数	148

iv 目 次

4.2.3	下降階乗モーメント	150
4.2.4	逆二項分布の逆ガウス型分布への収束	152
4.2.5	一般化負の二項分布	153
<b>第 5 章</b>	<b>リスクモデルにおける離散確率分布の漸化式</b>	<b>155</b>
5.1	はじめに	155
5.2	確率関数の漸化式	157
5.2.1	二項漸化式	157
5.2.2	三項漸化式	163
5.3	一般化 Charlier 級数分布	175
5.3.1	定義	176
5.3.2	性質	177
5.4	複合分布	180
5.4.1	定義と性質	180
5.4.2	ベルヌーイ分布による一般化合流型超幾何分布	184
5.4.3	Minkova による古典離散分布の一般化	187
5.4.4	漸化式	188
	参考文献	195
	参考書	197
	和英索引	199
	英和索引	204