

Příklad 7.1. V Cramér-Lundbergově modelu má velikost jednotlivé škody hustotu $f(x) = e^{-2x} + \frac{1}{2}e^{-x}$ a $\theta = 0.2$. Najděte velikost počátečního kapitálu tak, aby pravděpodobnost zruinování byla menší než 0.005.

Příklad 7.2. V Cramér-Lundbergově modelu má velikost jednotlivé škody rozdělení $Exp(1)$. Počáteční kapitál je 1000. Najděte velikost bezpečnostní přírážky tak, aby pravděpodobnost zruinování byla menší než 0.01.

Příklad 7.3. Dokažte vztah (4) z přednášky.

Příklad 7.4. Dokažte Větu 7.7. z přednášky.