

dr hab. Marek Męczarski, prof. SGH
Szkoła Główna Handlowa w Warszawie, Instytut Ekonometrii

Porządek stop-loss w ujęciu bayesowskim

Referat dotyczy problematyki przenoszenia porządków stochastycznych rozkładów *a priori*, a także rozkładów obserwacji, na rozkłady *a posteriori* oraz rozkłady predyktywne w odniesieniu do ważnego dla matematyki aktuariałnej porządku rosnącego wypukłego (*stop-loss*).

Literatura

- [1] J. Bartoszewicz, *On a representation of weighted distributions*, Statist. Prob. Letters 79 (2009), 1690–1694.
- [2] J. Bartoszewicz, M. Skolimowska, *Preservation of classes of life distributions and stochastic orders under weighting*, Statist. Prob. Letters 76 (2006), 587–596.
- [3] M. Denuit, R. Kaas, M. J. Goovaerts, J. Dhaene, *Actuarial Theory for Dependent Risks: Measures, Orders and Models*, Wiley, New York 2005.
- [4] M. Męczarski, *Stochastic orders and classes of prior distributions*, Statistics in Transition 6 (2004), 1121–1129.
- [5] A. Müller, D. Stoyan, *Comparison Methods for Stochastic Models and Risks*, J. Wiley, Chichester 2002.
- [6] M. Shaked, J. G. Shanthikumar, *Stochastic Orders*, Springer, New York 2007.