

ТЕОРИЈА РИЗИКА

Теме за семинарски рад

1. Алгоритми за симулацију процеса из класе Хоуксових процеса

Jang J, Oh R. A review on Poisson, Cox, Hawkes, shot-noise Poisson and dynamic contagion process and their compound processes (2021)

2. Примена Пуасоновог процеса са шумом случајних удара у актуарству

Weng, C., Zhang, Y. Tan, K.S. Tail Behavior of Poisson Shot Noise Processes under Heavy-tailed Shocks and Actuarial Applications (2013)

3. Примена Хоуксових процеса у финансијама

Embrechts P, Liniger T, Lin L. Multivariate Hawkes processes: an application to financial data. Journal of Applied Probability

4. Моделовање телекомуникационих система Пуасоновим кластер процесима

Fajj, Gilles Gonzalez-Arevalo, Barbara Mikosch, Thomas Samorodnitsky, Gennady. (2006). Modeling teletraffic arrivals by a Poisson cluster process.

5. Вероватноћа разарања у нестандартним процесима ризика

Claudio Macci, Gabriele Stabile Giovanni Luca Torrisi Lundberg parameters for non standard risk processes (2005)

6. Трансформације процеса обнављања ради симулације нестационарних процеса долазака

Ira Gerhardt Barry L. Nelson, "Transforming Renewal Processes for Simulation of Non-stationary Arrival Processes (2009)

7. Gerber-Shiu теорија ризика

Andreas E. Kyprianou, Gerber-Shiu Risk Theory (2013)

8. Елементи теорије обнављања за тачкасте процесе са кластерима

Marina Dajaković, Elements of renewal theory for cluster point processes - (2022)

9. Предвиђање у chain-ladder моделу

Di Kuang Bent Nielsen Jens Perch Nielsen, Forecasting in an extended chain-ladder-type model (2010)

10. Статистичке методе у теорији екстремних вредности

P. Embrechts C. Kluppelberg T. Mikosch- Modelling Extremal Events (1997)