

ACT-11302 Cálculo Actuarial III

Licenciatura en Actuaría

ITAM

Agosto-Diciembre 2015

Agenda de Estudio

Hasta ahora, hemos revisado:

- Revisión de estadística (funciones de supervivencia, de riesgo y transformación de variables)
- Independencia estocástica e intercambiabilidad
- Enfoque frecuentista y bayesiano de inferencia
- Distribuciones mixtas y distribuciones tipo mezcla
- Convolución y distribución de la suma de variables aleatorias
- Aproximaciones para la suma de variables aleatorias
- Deducibles, coaseguros y otras transformaciones actuariales sobre montos de reclamos
- Criterios de información para la selección de modelos
- Principios de los modelos de riesgo individual y riesgo colectivo

En lo que resta del curso, cubriremos los siguientes temas:

Jueves 24 de Septiembre	Distribución para la frecuencia de reclamos: Distribuciones paramétricas
Martes 29 de Septiembre	Distribución para la frecuencia de reclamos: Distribuciones (a,b,0)
Jueves 01 de Octubre	Distribuciones compuestas
Martes 06 de Octubre	Distribución para el monto de reclamos: Distribuciones paramétricas
Jueves 08 de Octubre	1er. Examen Parcial
Martes 13 de Octubre	Distribución para el monto de reclamos: Distribuciones tipo mezcla y segmentadas
Martes 15 de Octubre	Distribución para el monto de reclamos: Propiedades de la cola de su distribución
Martes 20 de Octubre	Efectos de las condiciones de cobertura
Jueves 22 de Octubre	Modelos de pérdida agregada: Modelo de riesgo individual
Martes 27 de Octubre	Banff (por reponer)
Jueves 29 de Octubre	2do. Examen Parcial
Jueves 05 de Noviembre	Modelos de pérdida agregada: Modelo de riesgo colectivo
Martes 10 de Noviembre	Reaseguro y modificaciones de cobertura
Jueves 12 de Noviembre	Estudio de caso: Modelo individual de riesgo
Martes 17 de Noviembre	Estudio de caso: Modelo colectivo de riesgo
Jueves 19 de Noviembre	Teoría de ruina: Medidas de riesgo de capital y VaR
Martes 24 de Noviembre	Teoría de ruina: Medidas de prima riesgo de capital y funciones de distorsión
Jueves 26 de Noviembre	Teoría de ruina: Tiempo discreto
Martes 01 de Diciembre	Entrega Trabajo Final
Jueves 03 de Diciembre	Teoría de ruina: Tiempo continuo
	Temas selectos

Nota: Los temas contemplados en este curso les servirán para preparar el Examen C de la SOA.