

ACT-11302 Cálculo Actuarial III
Primavera 2019

Tarea 06

Fecha de entrega: 11/Abr/2019

Nombre: _____

C.U.: _____

09/Abr/2019

Consideren la clase del martes 9 de abril de 2019.

1. Calcula la probabilidad de ruina $\Psi(C_0)$ cuando $X \sim \text{Exp}(x|1/\mu)$, con $\mathbb{E}(X) = \mu$.
2. Considera $F_X(x) = \text{Pa}(x|\alpha)$, con densidad $f_X(x) = (1+x)^{-\alpha}\mathbb{I}(0,\infty)(x)$, y $\alpha > 0$. Muestra que para valores de $\alpha > 0$ (caso con colas pesadas) la integral de la Sección 2.4. de las notas no está definida.