

Modelos Actuarios No Vida: Enfoque Riesgo Individual

Implementación Modelo Jerárquico para cálculo de primas

Gibrán Peniche González-Carpio

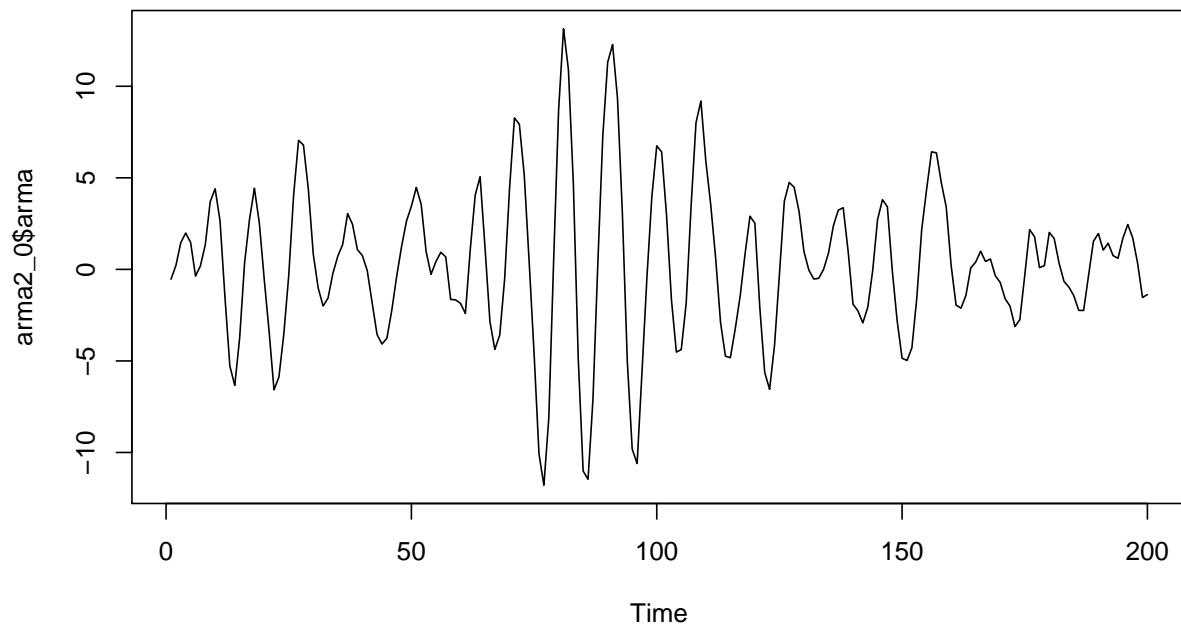
Otoño 2019

Contents

1	ARMA(2,0)	1
1.1	Simulación	1
1.2	ACF y PACF	2
1.3	Ajuste	4
2	ARMA(0,1)	5
2.1	Simulación	5
2.2	ACF y PACF	6
2.3	Ajuste	8
3	Portafolio	8
3.1	Importación	8

1 ARMA(2,0)

1.1 Simulación



1.2 ACF y PACF

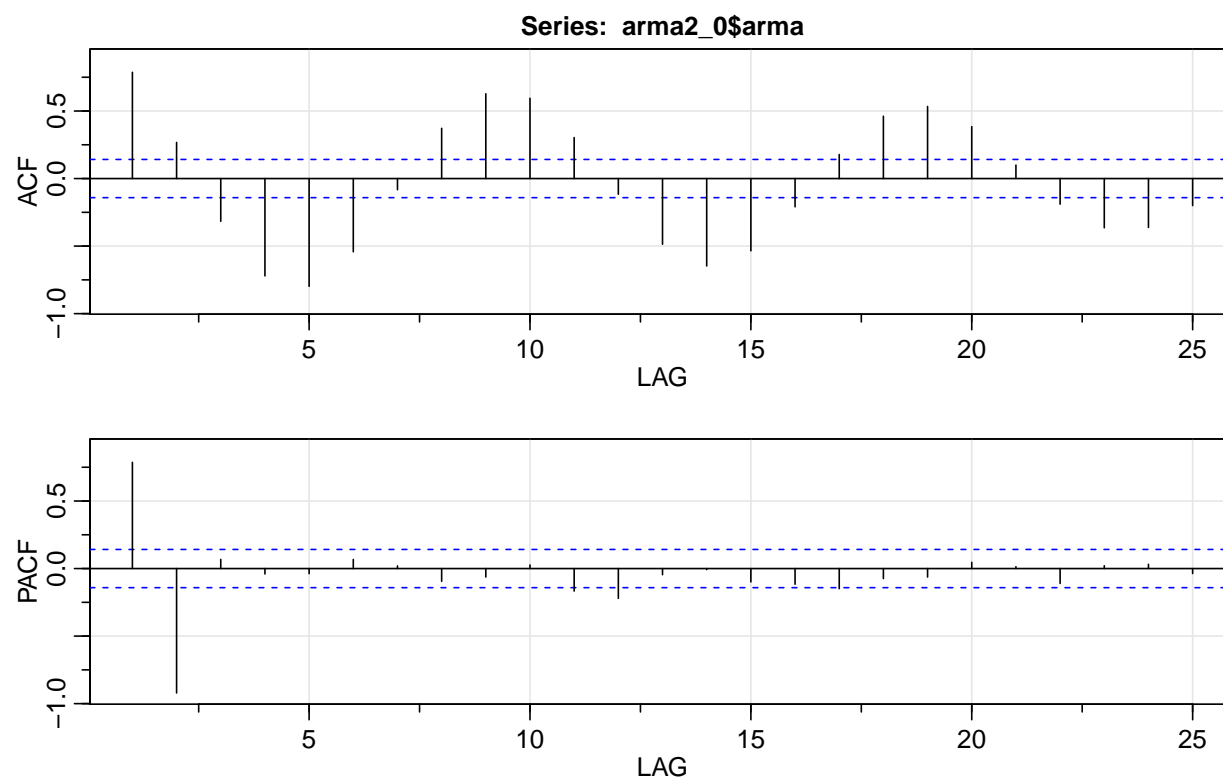
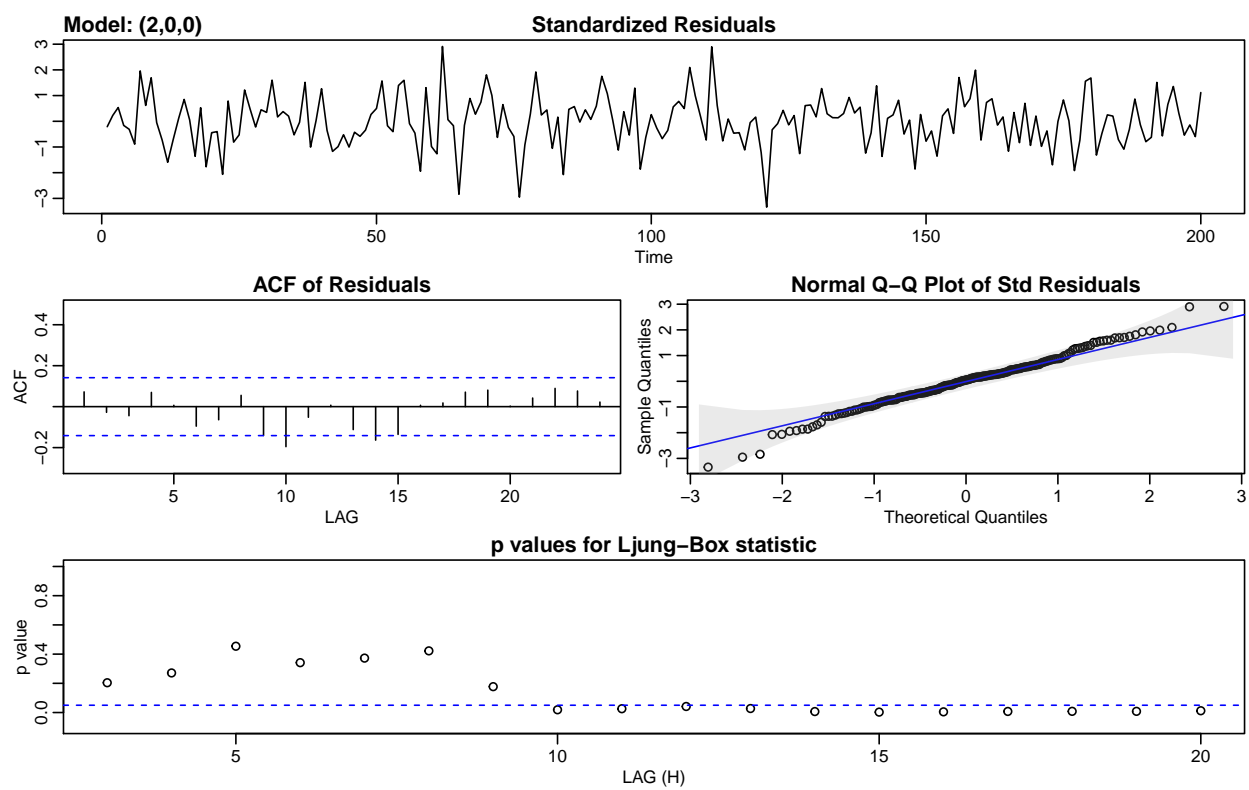


Table 1: ACF Y PACF

ACF	PACF
0.79	0.79
0.27	-0.92
-0.32	0.07
-0.72	-0.04
-0.8	-0.04
-0.54	0.07
-0.08	0.02
0.37	-0.09
0.63	-0.06
0.59	0.03
0.3	-0.17
-0.12	-0.22
-0.49	-0.05
-0.65	-0.01
-0.54	-0.1
-0.21	-0.12
0.18	-0.15
0.46	-0.07
0.53	-0.06
0.38	0.05
0.1	0.01
-0.19	-0.11
-0.36	0.02
-0.36	0.03

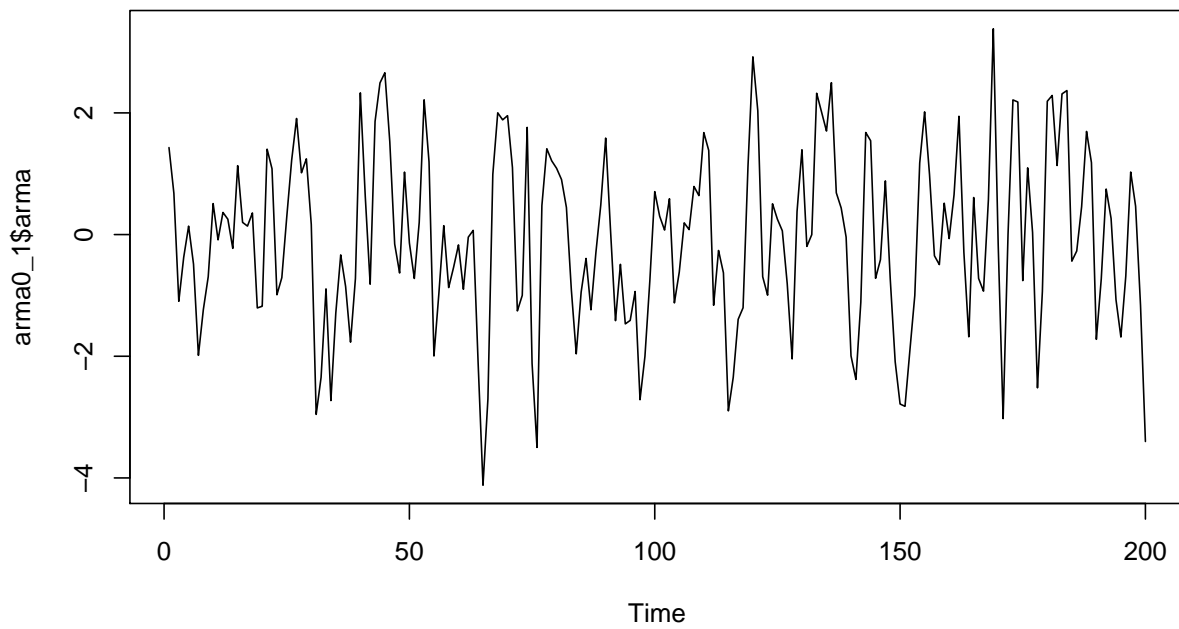
ACF	PACF
-0.2	-0.04

1.3 Ajuste



2 ARMA(0,1)

2.1 Simulación



2.2 ACF y PACF

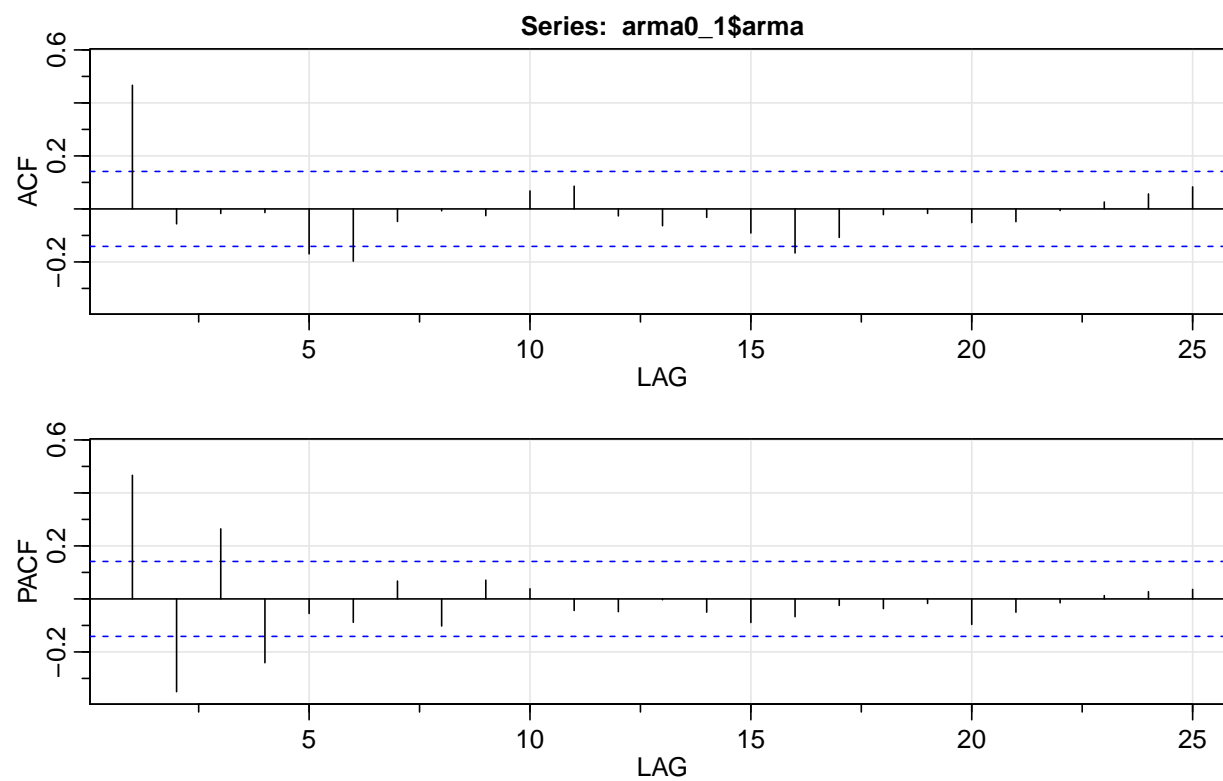
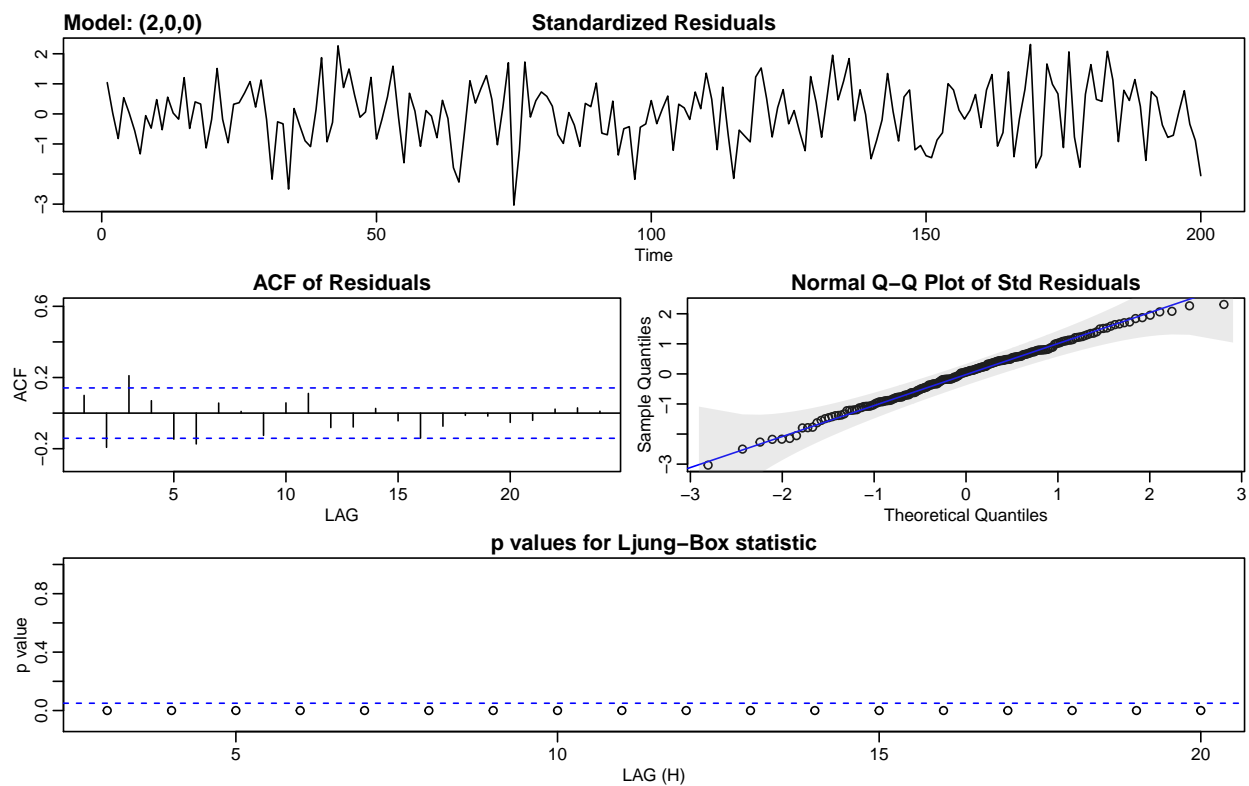


Table 2: ACF y PACF

ACF	PACF
0.47	0.47
-0.06	-0.35
-0.02	0.26
-0.01	-0.24
-0.17	-0.05
-0.2	-0.09
-0.05	0.07
-0.01	-0.1
-0.03	0.07
0.07	0.04
0.09	-0.04
-0.03	-0.05
-0.06	0
-0.03	-0.05
-0.09	-0.09
-0.17	-0.07
-0.11	-0.02
-0.02	-0.04
-0.02	-0.02
-0.05	-0.1
-0.05	-0.05
-0.01	-0.01
0.03	0.01
0.06	0.03

ACF	PACF
0.08	0.04

2.3 Ajuste



3 Portafolio

3.1 Importación