

Incurred But Not Reported (IBNR)

Seguros Generales y Modelos de Riesgo

Ignacio Campón & Joaquín Viola



FACULTAD DE
CIENCIAS ECONÓMICAS
Y DE ADMINISTRACIÓN

IESTA 80

INSTITUTO
DE ESTADÍSTICA



UNIVERSIDAD
DE LA REPÚBLICA
URUGUAY

Índice

1	Introducción	3
2	Metodología	3
2.0.1	P	3
	Bibliografía	4
	Material adicional	4

1 Introducción

2 Metodología

Huang y Nguyen (2018)

2.0.1 P

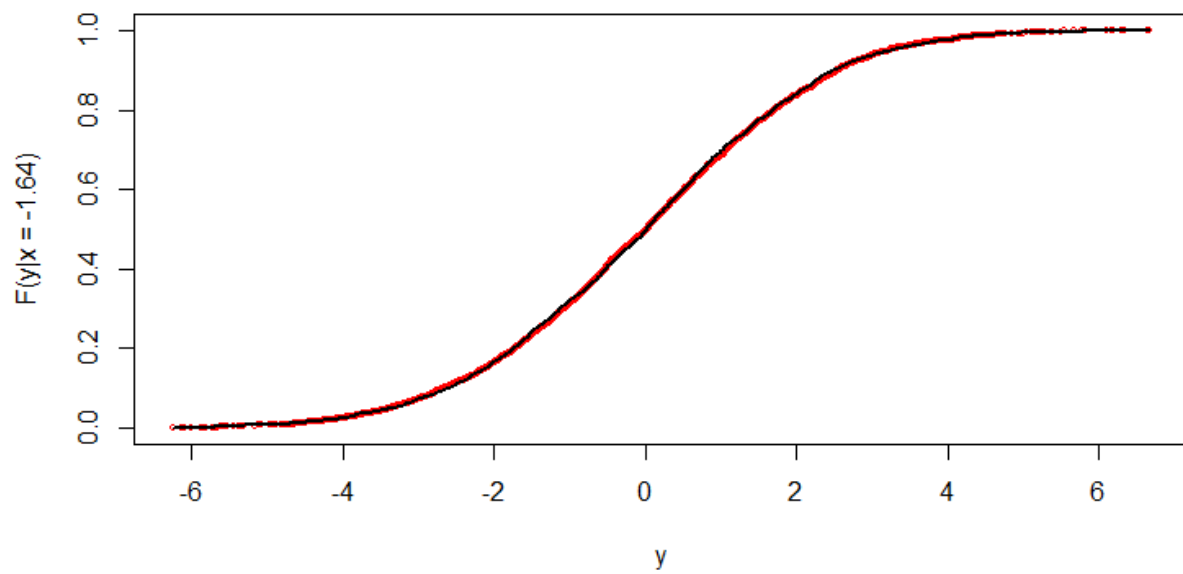


Figura 1: Función de distribución condicional de una normal bivariada, en negro la distribución real y en rojo la estimada para $n=5000$.

Nadaraya-Watson.

Bibliografía

- Amat Rodrigo, Joaquín. s. f. «Regresión Cuantílica (Quantile Regression)». https://rpubs.com/Joaquin_AR/291106.
- Huang, Mei Ling, y Christine Nguyen. 2018. «A nonparametric approach for quantile regression». *Journal of Statistical Distributions and Applications* 5:3. <https://doi.org/10.1186/s40488-018-0084-9>.

Material adicional

La entrega del informe viene acompañado de 2 scripts, que contienen la implementación de cada método presentado junto con las aplicaciones realizadas:

- `quantile_regression_by_huang-nguyen.R`
- `quantile_regression_by_yu-jones.R`