

ASIGNATURA B5: MODELOS LINEALES GENERALIZADOS Y TARIFICACIÓN

Parte I - Introducción a los GLM

Parte II - Diseño de Tarifas con GLM

T1 INTRODUCCIÓN A LOS MODELOS LINEALES GENERALIZADOS

1. Concepto: Incumplimiento de las condiciones del MRL. Modelos aditivos y multiplicativos.
2. Distribuciones de la familia exponencial.
 - Distribuciones para Conteo.
 - Distribuciones para Cuantía.
3. Funciones Link
4. Regresión de Poisson. Regresión Gamma.

T2 LOS MODELOS LINEALES GENERALIZADOS en SAS

1. SAS EG: Tarea Regresión GLM
2. SAS Base: PROC GENMOD, PROC GLM, PROC GLMMOD

T3 SELECCIÓN DE VARIABLES

1. SAS Base: PROC GLMSELECT

T4 CONSTRUCCIÓN DE UNA TARIFA

1. Selección de factores
2. Evaluación de modelos con SAS Miner
Poisson Z-Inflada, Tweedy, Binomial Negativa.
3. SAS Base: PROC COUNTREG, PROC GLMMIX
4. Construcción de una tarifa.

Módulo M2: PROGRAMACIÓN SAS APLICADA A SEGUROS Y FINANZAS-
ASIGNATURA B5: MODELOS LINEALES GENERALIZADOS Y TARIFICACIÓN

Profesores: Antonio Heras - María Pérez.

MÁSTER PROPIO UCM ONLINE EN PROGRAMACIÓN SAS Y VBA CON EXCEL APLICADA A SEGUROS Y FINANZAS

Universidad Complutense de Madrid