

12 בספטמבר 2016

מיומנו של אקטואר: התפלגות חזקה (Power)

התפלגות חזקה קשורה להתפלגות המעריכית על ידי זה שההסתברות לקבלת תוצאות קטנות הינה גדולה אך דועכת אקספוננציאלית ככל שערך התוצאה עולה. האלפא (הידועה גם כפרמטר הצורה) הינה הפרמטר ההתפלגותי היחיד.

התנאים המתמטיים של התפלגות חזקה הינם כדלקמן:

$$f(x) = \alpha x^{\alpha-1}$$

$$F(x) = x^\alpha$$

$$Mean = \frac{\alpha}{1+\alpha}$$

$$Standard\ Deviation = \sqrt{\frac{\alpha}{(1+\alpha)^2(2+\alpha)}}$$

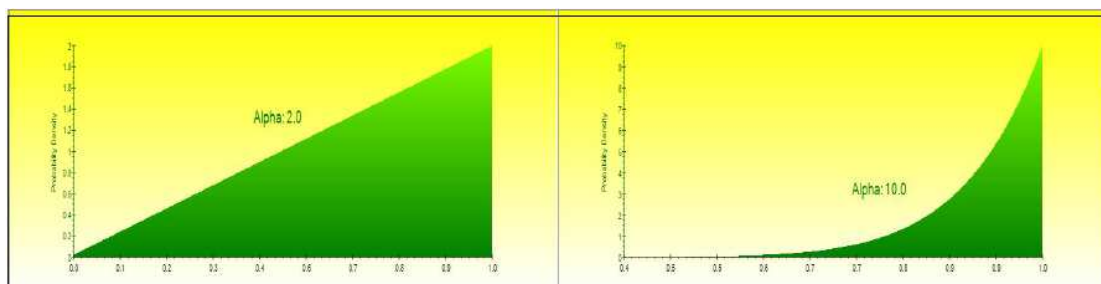
$$Skew = \sqrt{\frac{\alpha+2}{\alpha}} \left(\frac{2(\alpha-1)}{\alpha+3} \right)$$

Excess Kurtosis is a complex function and cannot be readily computed

האלפא הינה הפרמטר ההתפלגותי היחיד.

התשומות הדרושות:

אלפא > 0



 WWW.IAVFA.ORG



רחוב נתן ברניצקי 5, ראשון לציון 7524205, ישראל



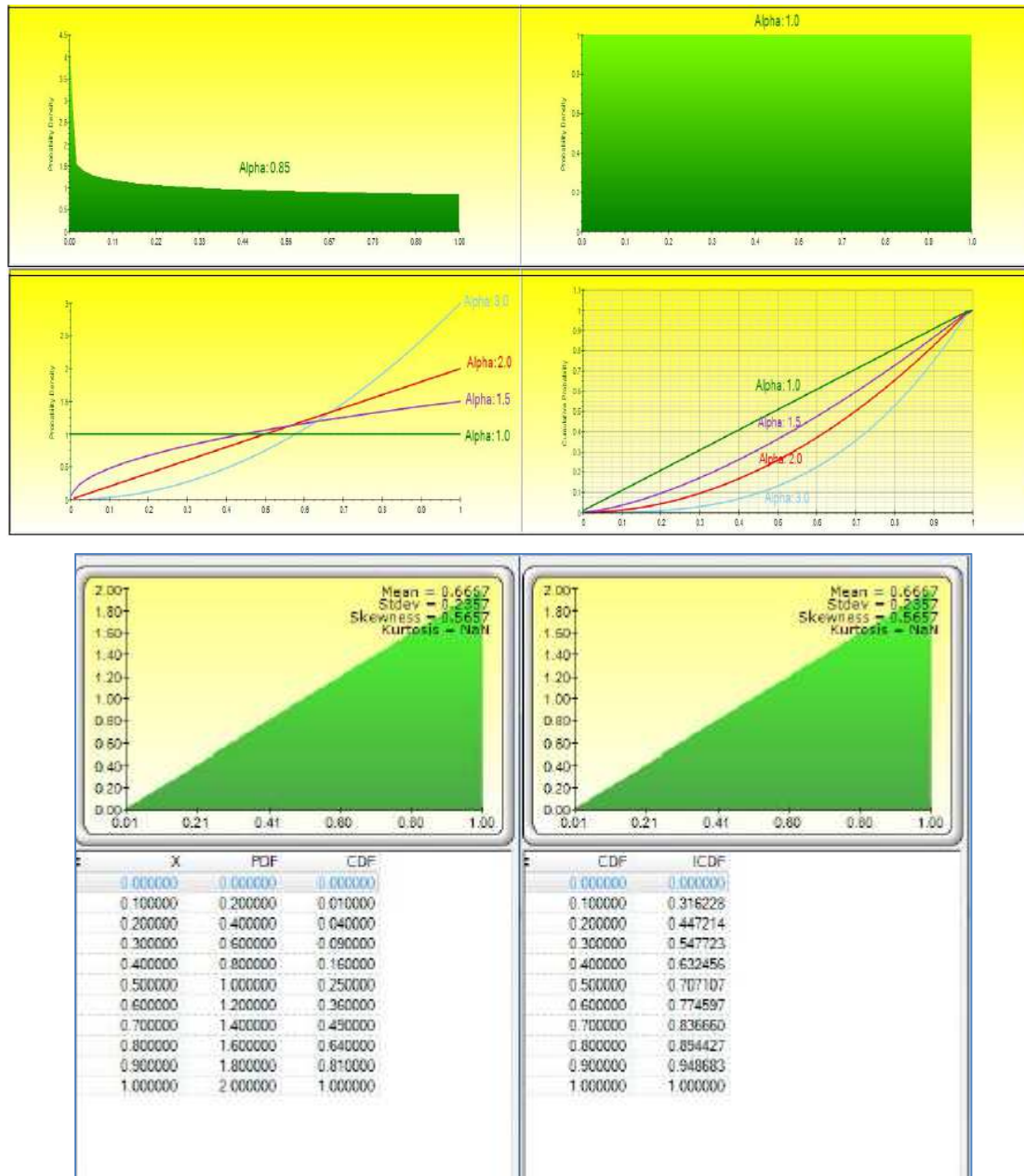
077-5070590



153-77-5070590



IAVFA1020@GMAIL.COM



בכבוד רב,

רועי פולניצר

יו"ר ומנכ"ל לשכת מעריכי השווי והאקטוארים הפיננסיים בישראל

 WWW.IAVFA.ORG



רחוב נתן ברניצקי 5, ראשון לציון 7524205, ישראל



077-5070590



153-77-5070590



IAVFA1020@GMAIL.COM