

#### 1) Указания на ноябрь, полученные от научного руководителя

Предоставить файл с частью текста курсовой (титульный лист, введение, обзор литературы, постановка задачи, результаты, которые удалось получить, список литературы).

#### 2) Мой План работы на ноябрь 2020

Обобщить основной результат статьи: проделать вычисления для несимметричной функции абсолютных потерь, то есть когда недостаточная и избыточная премии учитываются с разными весами. Потом выбрать какую-нибудь принципиально другую функцию потерь и посчитать для нее.

#### 3) Что конкретно сделано за ноябрь 2020 из намеченного

Проделаны вычисления для несимметричной функции потерь. Проверено, что результат разумный, то есть при одинаковых весах получается то же самое, что и для симметричной функции. Проделаны вычисления для квадратичной функции потерь.

#### 4) Что не сделано за ноябрь 2020 из намеченного

Все намеченное на ноябрь 2020 сделано.

#### 5) Причины

Все сделано.

#### 6) Что сделано из того, что не было запланировано

Прочитана глава про различные меры риска в книге Modern Actuarial Risk Theory, Rob Kaas, Marc Goovaerts, Jan Dhaene, Michiel Denuit, ISBN: 978-3-540-70992-3

#### 7) План работы на декабрь 2020

- Понять, разумные ли результаты получены в случае квадратичной функции потерь.
- Сравнить получаемые премии со случаем абсолютной функции потерь.
- Прочитать статью ROCKAFELLAR, R. and URYASEV, S. (2002) Conditional Value at Risk for General Loss Distributions, Journal of Banking and Finance 26, 1443-1471.
- Выбрать оттуда какую-нибудь другую функцию потерь и попробовать посчитать для нее.