

1) Указания на май 2021, полученные от научного руководителя

Прочитать статью Харди и понять, чем отличаются значения, придаваемые случайным величинам в финансовых и в актуарных приложениях.

Написать программу, которая численно находит минимум функции V и сравнить его с теоретически вычисленным минимумом.

Исправить недочеты в тексте, указанные научным руководителем.

2) Мой План работы на май 2021

Прочитать статью Харди и понять, чем отличаются значение, придаваемое случайным величинам в финансовых и в актуарных приложениях.

Написать программу, которая численно находит минимум функции V и сравнить его с теоретически вычисленным минимумом.

Исправить недочеты в тексте, указанные научным руководителем.

3) Что конкретно сделано за май 2021 из намеченного

Прочитана статья Харди и разобрано, чем отличаются значение, придаваемое случайным величинам в финансовых и в актуарных приложениях. Это добавлено во введение.

Исправлена путаница с аргументами CTE и VaR .

Во введении убран сравнительный анализ $CVaR$ и VaR , потому что моя работа не про них, а про CTE .

Также во введении убран сравнительный анализ CTE , $TVaR$, $CVaR$.

Написан раздел 4: это легкое и быстрое мое доказательство той теоремы, которая была доказана Rockafellar & Uryasev (2000)!

Написан раздел 6: это программа, которая вычисляет минимум функции V . И показано, что теоретический минимум совпадает с реальным!

4) Что не сделано за май 2021 из намеченного

Все намеченное на май 2021 сделано.

5) Причины

Все сделано.

6) Что сделано из того, что не было запланировано

Я придумала и записала в раздел 6 очень легкое и понятное доказательство теоремы про альтернативное вычисление CTE : не по определению, а через минимизацию функции $U(\alpha)$!