

1) Указания на декабрь, полученные от научного руководителя

Устранить в курсовой работе те ошибки, которые были указаны научным руководителем.

Добавить описание процесса преобразования формул в доказательстве теорем.

2) Мой План работы на декабрь 2020

Устранить в курсовой работе те ошибки, которые были указаны научным руководителем.

Добавить описание процесса преобразования формул в доказательстве теорем.

Понять, как можно по-другому использовать результаты полученных теорем, если считать премию заданной (например, если премия диктуется условиями рынка).

3) Что конкретно сделано за декабрь 2020 из намеченного

Устранены фактические и стилистические ошибки в тексте.

Добавлено описание процесса преобразования формул в доказательствах теорем 1, 2 и 3.

Замечено отсутствие доказательства и затем добавлено доказательство того факта, что в доказательстве теоремы 3 корректна подстановка бесконечности в

выражения типа $2Px(1 - F(x)) \Big|_{P + \sqrt{\alpha}}^{+\infty}$, ведь формально получается

неопределенность ноль на бесконечность.

Добавлен пункт 7, содержащий альтернативное применение полученных в теореме 1 результатов.

4) Что не сделано за декабрь 2020 из намеченного

Все намеченное на декабрь 2020 сделано.

5) Причины

Все сделано.

6) Что сделано из того, что не было запланировано

Я подала заявку, прошла отбор и собираюсь принять участие в зимней школе по Современной стохастической финансовой математике. Мне интересно посмотреть, что там будут рассказывать, и полезно ли это.

7) План работы на январь 2021

Понять, почему для экспоненциального распределения получилось такое странное значение риска.

Взять какое-нибудь другое распределение и посчитать риск для него, и убедиться, что это значение получится разумным.

Взять реальный портфель и посмотреть, какая функция дает для него лучший результат: функция абсолютных потерь или квадратичная.