|  |  |
| --- | --- |
| **Работа защищена с оценкой** | **отлично** |
| Подписи членов экзаменационной комиссии |  |

**МОСКОВСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ имени М.В.ЛОМОНОСОВА**

**МЕХАНИКО-МАТЕМАТИЧЕСКИЙ ФАКУЛЬТЕТ**

**ОТЗЫВ НА КУРСОВУЮ РАБОТУ**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| студентки | **4** | курса, | **409** | группы, кафедра | **теории вероятностей** |
| **Токаевой Александры Александровны** | | | | | |
| Руководитель | | | Фалин Геннадий Иванович, доктор физ-мат наук, профессор | | |
| Тема | Условное математическое ожидание абсолютных потерь и оптимальная премия | | | | |
| (на англ.) | The conditional tail expectation of the absolute losses and the optimal premium | | | | |
| *В отзыве должны быть отмечены достоинства курсовой работы, ее недостатки и дана обоснованная оценка.* | | | | | |

В работе изучается задача поиска премии, которая минимизирует среднее значение условного математического ожидания потерь страховщика (при условии, что потери превысят VaR) в случаях, когда в качестве функции потерь рассматривается несимметричная абсолютная разность между премией и убытком, а также квадрат этой разности. Теоретические рассмотрения дополнены результатами численных расчётов, которые представлены в наглядной графической форме. Полагаю, работа заслуживает оценки «отлично».

/ Фалин Г.И.