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.