

Фундаментальные научные исследования в соответствии с Программой  
фундаментальных научных исследований государственных академий  
наук  
на 2013-2020 годы

«Разработка методов построения оптимальных дележей  
рисков для статической модели и процесса риска с  
использованием методов теории моментов»

- К.ф.-м.н. Голубин А.Ю.
- Предложена новая форма скаляризации критериев как метода для решения многокритериальных задач оптимизации, основанная на угловом расстоянии между единичным вектором и точками пространства полезностей. На этой основе найдены необходимые и достаточные условия оптимальности в отношении Эвклидова конуса предпочтений заданного углового радиуса. Используя описание двойственного конуса предпочтений, полученного в работе, выведены необходимые условия оптимальности первого порядка.