





   

Системный анализ и управление в аэрокосмической технике

**Авторы:**  [Лебедев](https://www.mai.ru/content/people/index.php?ID=5915) / [Малышев](https://www.mai.ru/content/people/index.php?ID=5133) / [Карп](https://www.mai.ru/content/people/index.php?ID=5916)   
**Издательство:**  [Издательство МАИ](https://www.mai.ru/content/org/index.php?ID=5361)

В 1991 году Ю.С. Кан защитил кандидатскую диссертацию, а в 2001 — докторскую диссертацию на тему «Игровые методы оптимизации вероятностных функционалов и их применение к решению аэрокосмических и экономических задач» по специальности 05.13.01.

Задача оптимизации производства для наземных космических комплексов с критериями в форме квантили и интегральной квантили

**Журнал:** [Труды МАИ](https://www.mai.ru/publications/index.php?ID=7341)  
**Тэги (англ.):**  stochastic programming, quantile, quantile integraL quasi-gradient algorithm, stochastic approximation Information about the authors   
**Авторы:**  [Кибзун](https://www.mai.ru/content/people/index.php?ID=7065) / [Чернобровов](https://www.mai.ru/content/people/index.php?ID=29588)   
**Выпуск № (Вверх):**  [52](https://www.mai.ru/publications/index.php?ID=29414)   
**Файл:**  [Скачать](https://www.mai.ru/bitrix/redirect.php?event1=news_out&event2=%2Fupload%2Fiblock%2F3a7%2Fzadacha-optimizatsii-proizvodstva-dlya-nazemnykh-kosmicheskikh-kompleksov-s-kriteriyami-v-forme-kvantili-i-integralnoy-kvantili.pdf&event3=%D0%97%D0%B0%D0%B4%D0%B0%D1%87%D0%B0+%D0%BE%D0%BF%D1%82%D0%B8%D0%BC%D0%B8%D0%B7%D0%B0%D1%86%D0%B8%D0%B8+%D0%BF%D1%80%D0%BE%D0%B8%D0%B7%D0%B2%D0%BE%D0%B4%D1%81%D1%82%D0%B2%D0%B0+%D0%B4%D0%BB%D1%8F+%D0%BD%D0%B0%D0%B7%D0%B5%D0%BC%D0%BD%D1%8B%D1%85+%D0%BA%D0%BE%D1%81%D0%BC%D0%B8%D1%87%D0%B5%D1%81%D0%BA%D0%B8%D1%85+%D0%BA%D0%BE%D0%BC%D0%BF%D0%BB%D0%B5%D0%BA%D1%81%D0%BE%D0%B2+%D1%81+%D0%BA%D1%80%D0%B8%D1%82%D0%B5%D1%80%D0%B8%D1%8F%D0%BC%D0%B8+%D0%B2+%D1%84%D0%BE%D1%80%D0%BC%D0%B5+%D0%BA%D0%B2%D0%B0%D0%BD%D1%82%D0%B8%D0%BB%D0%B8+%D0%B8+%D0%B8%D0%BD%D1%82%D0%B5%D0%B3%D1%80%D0%B0%D0%BB%D1%8C%D0%BD%D0%BE%D0%B9+%D0%BA%D0%B2%D0%B0%D0%BD%D1%82%D0%B8%D0%BB%D0%B8.pdf&goto=%2Fupload%2Fiblock%2F3a7%2Fzadacha-optimizatsii-proizvodstva-dlya-nazemnykh-kosmicheskikh-kompleksov-s-kriteriyami-v-forme-kvantili-i-integralnoy-kvantili.pdf)

## Моделирование и оптимизация экономических систем

Кибзун А.И. (рук.), Кан Ю.С., Панков А.Р., Кузнецов Е.А., Платонов Е.Н., Семенихин К.В.

Изучаются вопросы применения теоретико-вероятностных методов для решения задач принятия экономических решений в условиях неопределенности с учетом риска. Основное внимание уделяется разработке специальных математических моделей учета риска и методов определения оптимальных решений. Исследования концентрируются в основном вокруг проблемы формирования и управления инвестиционных портфелей. Для моделирования риска используются вероятностные и квантильные критерии оптимальности, а также вероятностные ограничения. Учитывается также то, что распределение случайных параметров, ассоциируемых обычно со случайными доходностями финансовых инструментов, известно не точно. К настоящему времени получены точные и приближенные решения ряда конкретных прикладных задач и разработана методология исследования проблемы формирования портфеля в стохастически-неопределенной постановке.

Исследования выполняются при поддержке Российского фонда фундаментальных исследований и Минобрнауки РФ.