

ПРЕЗЕНТАЦИ

Я 9

К вопросу, заданному в конце 8-й презентации (о выборе невесты для

принца)

Одна из трудностей ответа на этот вопрос заключается в том, что в условиях задачи указано количество возможных вариантов (4) и результаты изучения их свойств, но не содержится точное описание **критерия**, в соответствии с которым следует оценивать предпочтительность вариантов. Правда, по характеру задаваемого вопроса можно предположить, что принца интересует уровень математической грамотности невест (хотя трудно объяснить, зачем это нужно человеку, в распоряжении которого и без того имеется целый штат мудрецов и математиков).

Вторая, и главная, трудность заключается в отсутствии **ре** соответствии с которым следует делать выбор.

Вообще говоря, это обстоятельство делает невозможным

Правильный ответ: принц выбрал самую красивую

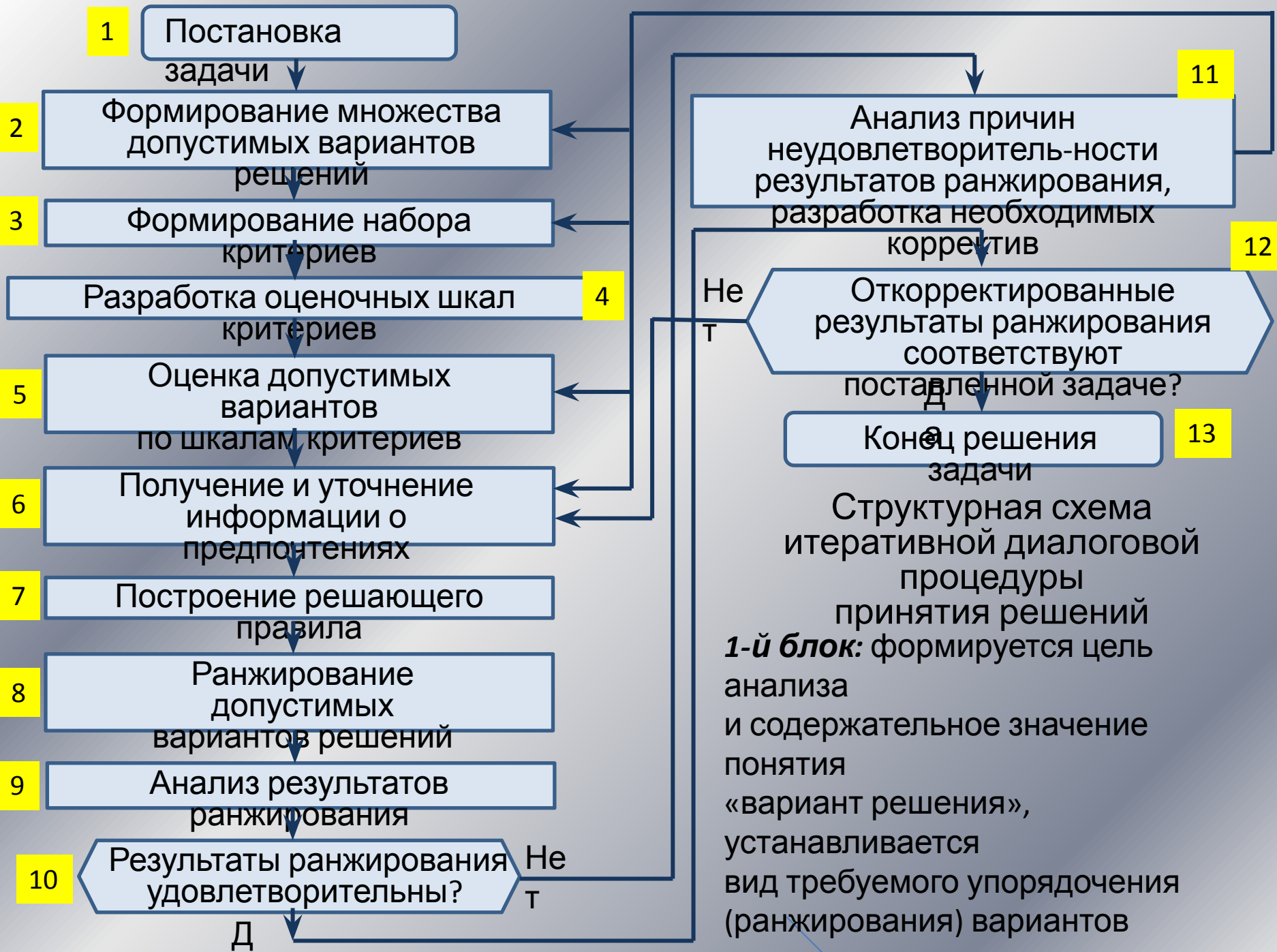
девушку поставленной задачи. Что делать, развести руки и

торопитесь

Ну, с девушками разобрались, давайте в таких случаях полезно включить свою смекалку и внимательно рассмотреть условия задачи в поисках дополнительной

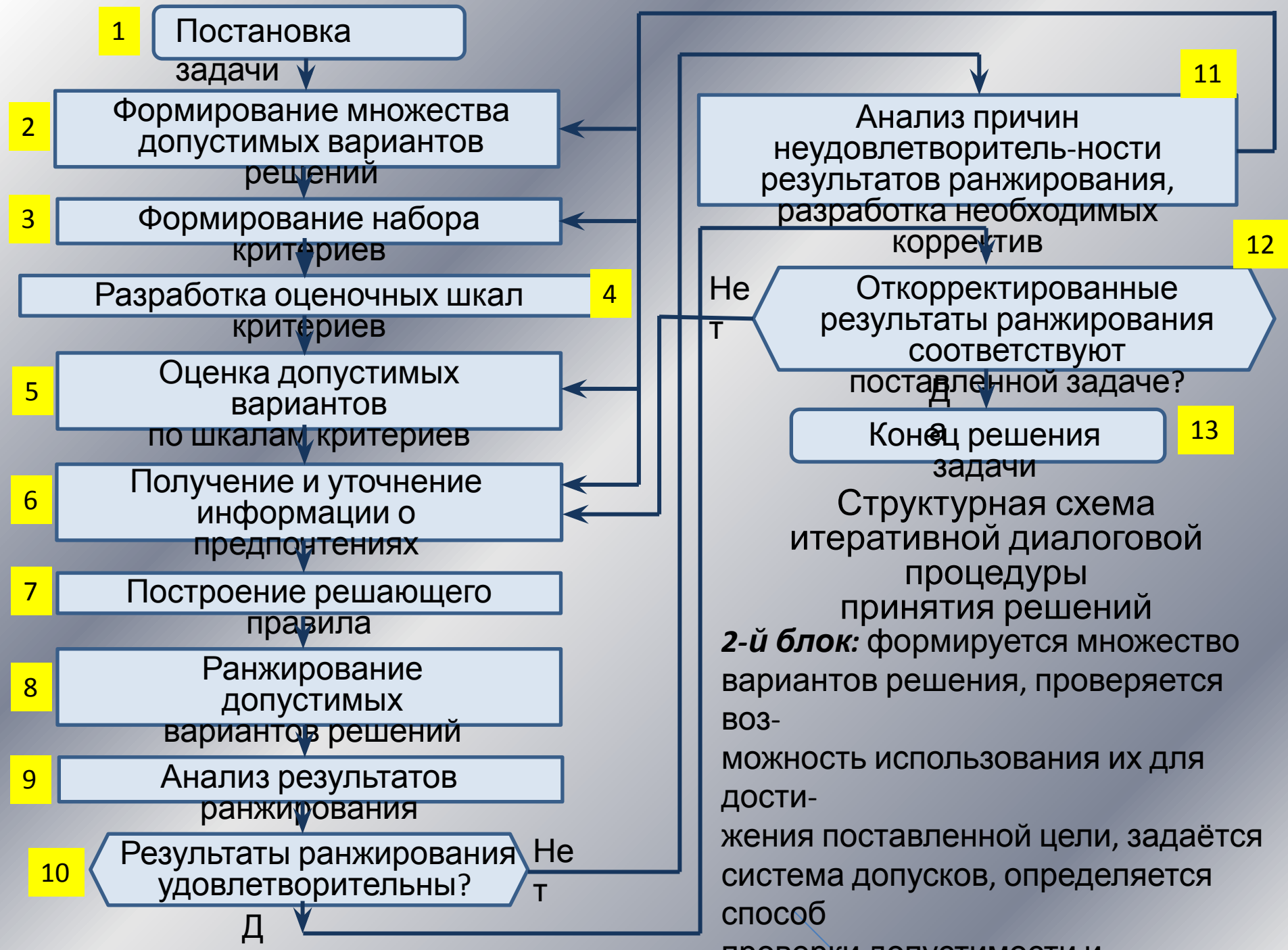
займемся более серьезными проблемами.





Структурная схема итеративной диалоговой процедуры принятия решений

1-й блок: формируется цель анализа и содержательное значение понятия «вариант решения», устанавливается вид требуемого упорядочения (ранжирования) вариантов решения



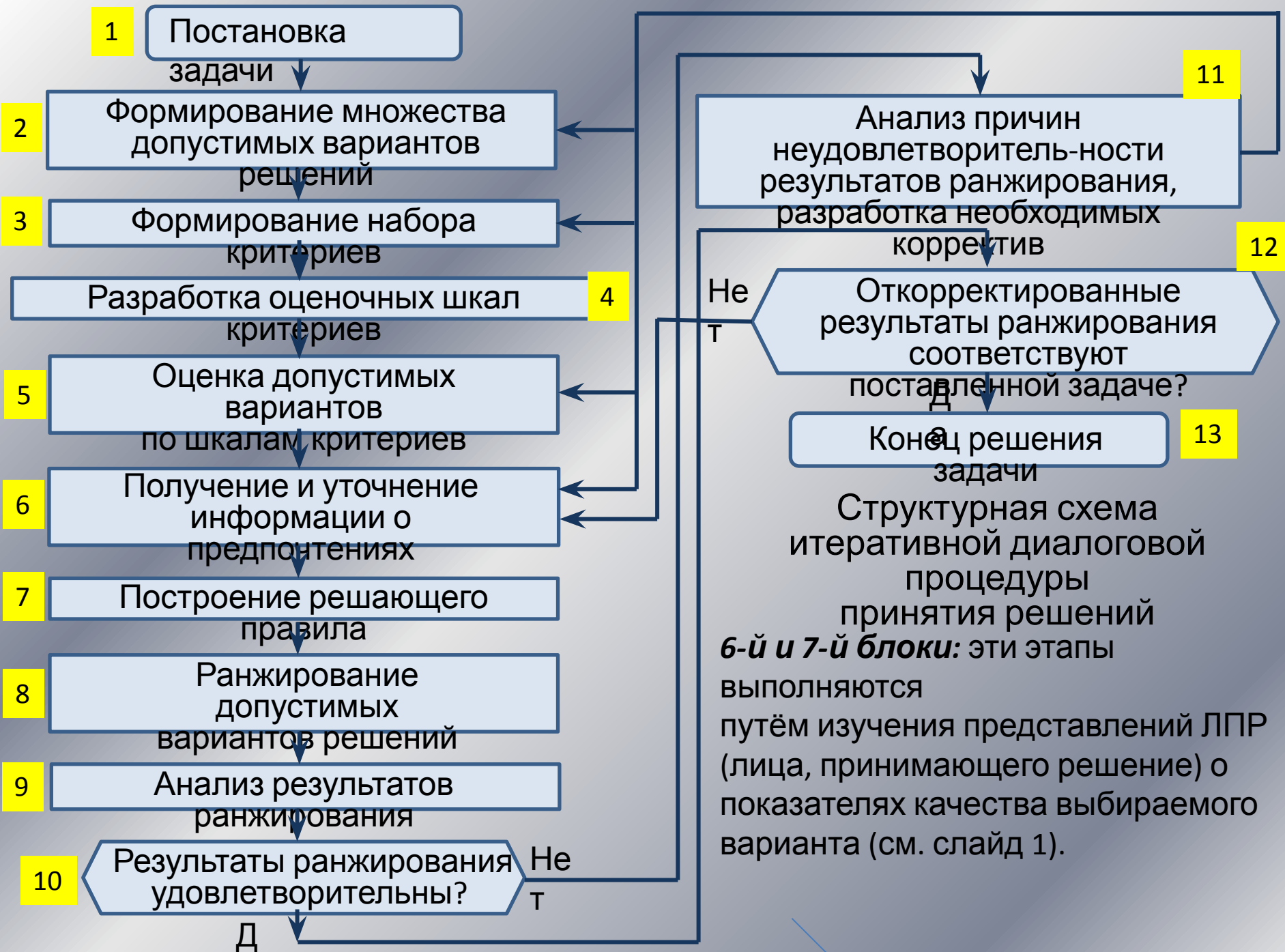


Структурная схема итеративной диалоговой процедуры принятия решений

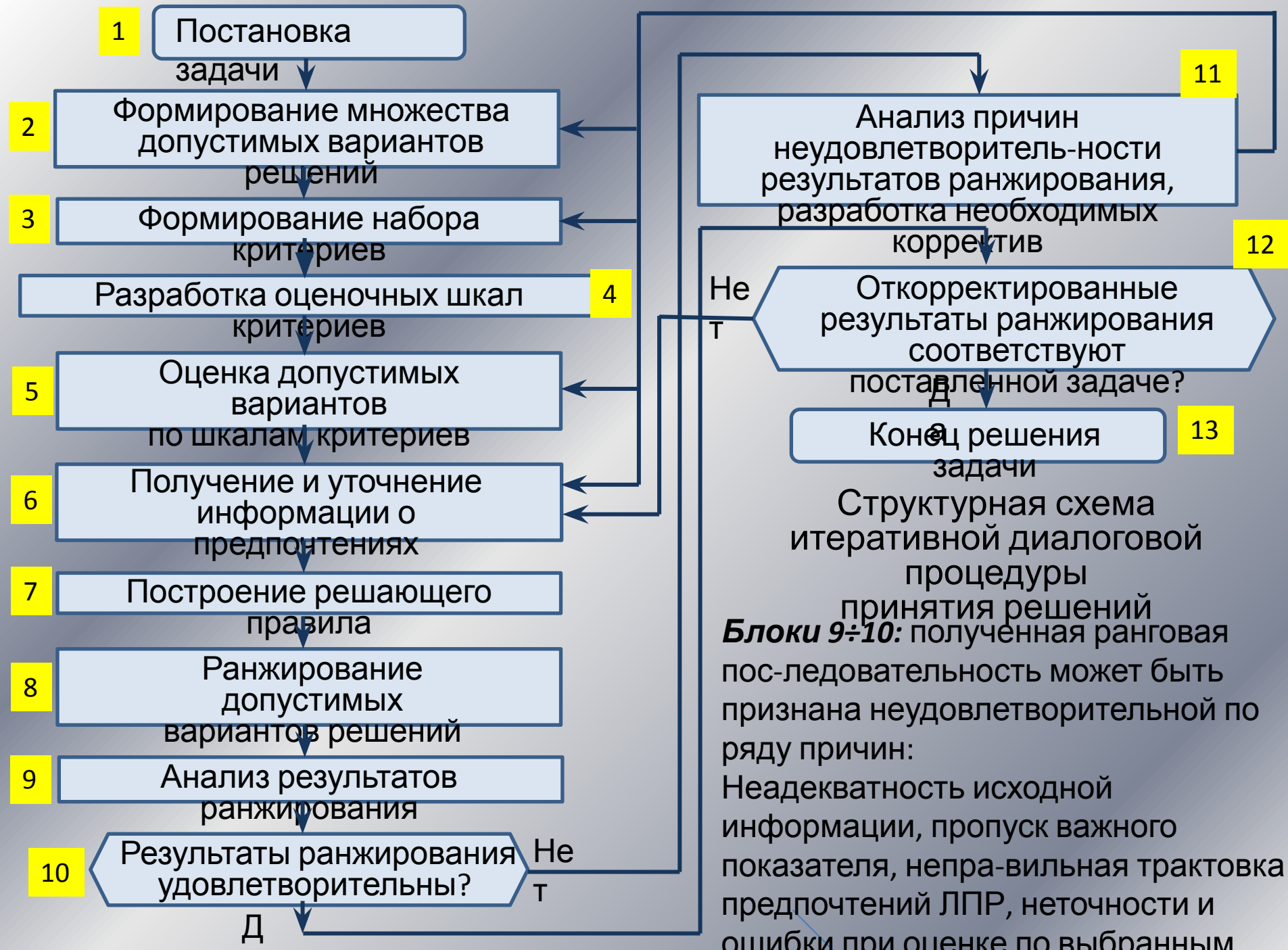
3-й блок: проводят анализ возможных последствий реализации выделенных вариантов и определяют перечень показателей (критериев), характеризующих эти последствия.

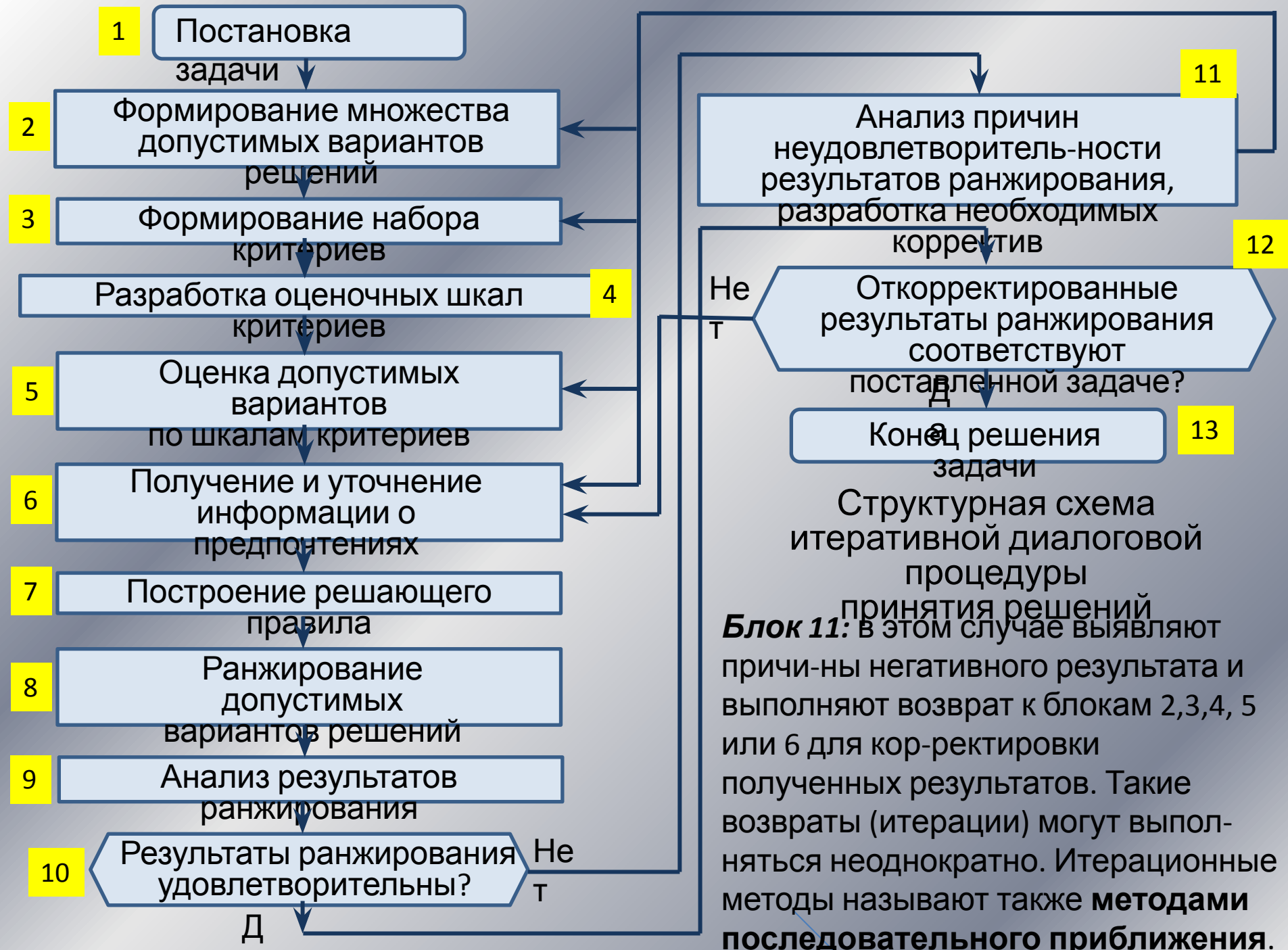














ПРИНЯТИЕ РЕШЕНИЙ В УСЛОВИЯХ НЕОПРЕДЕЛЁННОСТИ

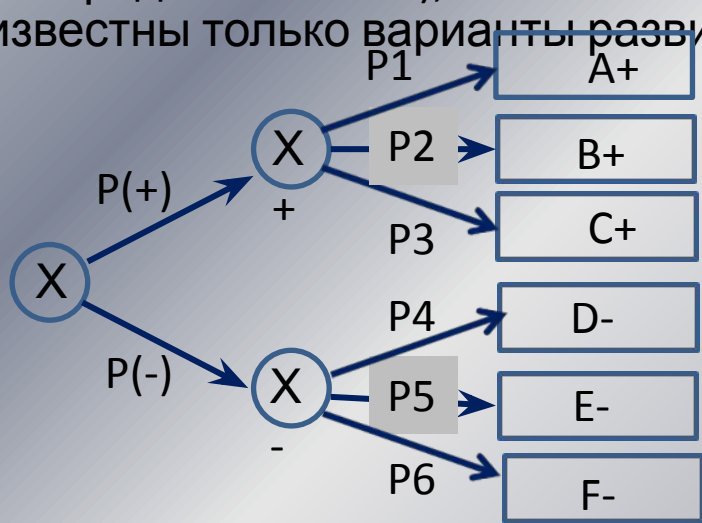
Когда говорят о неопределённости условий задачи, имеют в виду, разумеется, **частичную**

неопределённость. При полном отсутствии информации о свойствах анализируемого объекта и системе предпочтений никакие активные действия и решения рекомендовать

невозможно. В теории принятия решений принято различать два вида неопределённости, который не знает, что из них наступит, а возможности реализации

вариантов заданы вероятностными оценками (так называемая «добротная неопределённость»);

– известны только варианты развития событий и их последствие.



Рассмотрим типичную задачу для «добротной неопределённости»

Допустим, Вы решаете: стоит ли

инвестировать в изучение этого проекта

Некий проект X?

Невозможно сделать вывод, что он может быть

прибыльным с вероятностью $P(+)$ или

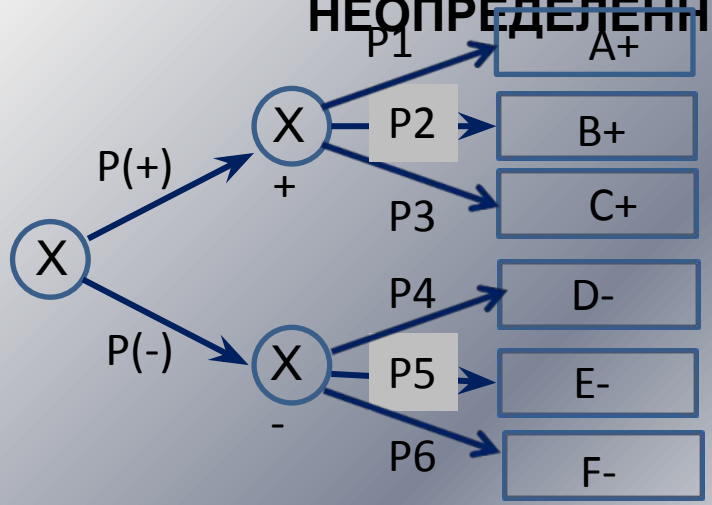
убыточным

с вероятностью $P(-)$.

(понятно, что сумма вероятностей $P(+)$ + $P(-)$ = 1,

поскольку это полный набор событий)

ПРИНЯТИЕ РЕШЕНИЙ В УСЛОВИЯХ НЕОПРЕДЕЛЁННОСТИ



Рассмотрим типичную задачу для «добротной неопределённости»

Допустим, Вы решаете вопрос: **стоит ли инвестировать некий проект X?**

Предварительное изучение этого проекта позволяет сделать вывод, что он может быть прибыльным с вероятностью P(+) или убыточным с вероятностью P(-). (понятно, что сумма вероятностей P(+) и P(-) равна 1).

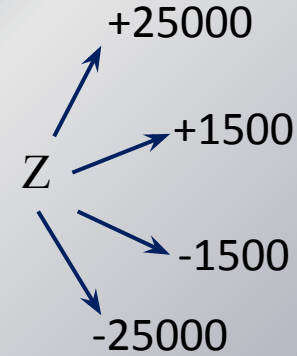
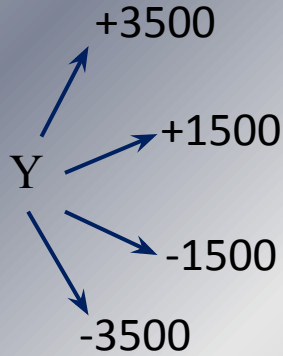
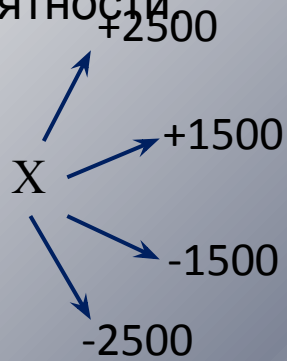
Если проект окажется прибыльным с вероятностью P(+), то с вероятностью P1, P2 и P3 вы получите набор возможностей получения прибыли в размере A+, B+ и C+.

Если проект окажется убыточным с вероятностью P(-), то с вероятностями P4, P5 и P6 вы получите набор возможностей убытков в размере D-, E- и F-.

Какие можно сделать оценки?

1. Можно оценить ожидаемую прибыль: $\Pi = P(+)\cdot\{(P1\cdot A+) + (P2\cdot B+) + (P3\cdot C+)\}$
2. Можно оценить ожидаемый ущерб: $Y = P(-)\cdot\{(P4\cdot D-) + (P5\cdot E-) + (P6\cdot F-)\}$
3. Можно оценить ожидаемую рентабельность проекта: $R = \Pi - Y$. Если таких проектов несколько, можно выбрать проект с наибольшей ожидаемой рентабельностью.
4. Если Вы человек осторожный, можно оценить по той же схеме ожидаемую величину минимальной прибыли и максимального ущерба.

Теперь рассмотрим ситуацию, когда вероятности возможных исходов не известны! Допустим, для трёх проектных вариантов (X, Y и Z) известны размеры возможных позитивных и негативных эффектов, но не известны их вероятности



Надо выбрать наилучший вариант следующими способами: с позиции восторженного оптимиста, с позиции убеждённого пессимиста (принцип МИНИМАКСа), с позиции осмотрительного оптимиста (по критерию Вальда).

Оптимист выбирает вариант с максимальным позитивом (т. е. вариант Z).
Пессимист – с минимальным размером максимального ущерба (т. е. вариант X).
Осмотрительный менеджер сначала назначает меру своего оптимизма коэффициентом K ($0 \leq K \leq 1$). Затем вычисляет значение критерия Вальда (а может быть Уальда):

$$W = K \cdot (\text{суммарный позитив}) - (1-K) \cdot (\text{суммарный негатив})$$

После этого выбирается тот из рассмотренных вариантов, который соответствует максимальному значению критерия.

Господа магистранты!

В этом мире всё рано или поздно заканчивается. Исчерпан на этом

и лимит нашего заочного общения. Надеюсь, вы понимаете, что

предложенными вам презентациями далеко не исчерпывается содержание «Теории принятия решений». Учиться их

принимать

вам придётся всю

известное

четверостишие О

Тех, кто жизнь прожив,

От жизни не научится

уму,

Никакой учитель в мире

Не научит ничему!

а при этом

Теперь о хлебе насущном: вместо 10-й презентации посылаю вам задание на

контрольную работу. Выполнение работы и оформление результатов будет для

вас поводом для получения итоговой оценки.

С уважением, А.А. Равин