



Рис. Зависимости $\lg P(D)$ от порогового уровня A : а) $|R_X| = 1$; б) $|R_X| = 0$.

Видим, что увеличение размерности m и тесноты корреляционной связи между компонентами случайного вектора \mathbf{X} приводит к резкому росту вероятности неблагоприятного исхода. Эффект усиливается с увеличением значений A_j , что соответствует менее вероятным, но более опасным неблагоприятным исходам. Поэтому при моделировании риска в сложных системах нужно учитывать, как фактор многомерности, так и тесноту корреляционных связей.

Работа выполнена при поддержке РФФ (проект № 14-18-00574).

СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ

1. Акимов В. А., Лесных В. В., Радаев Н. Н. Риски в природе, техносфере, обществе и экономике. М.: Деловой экспресс, 2004, 352 с.