

$Y = Ax_1^\alpha x_2^\beta$ , конкретный вид которой может быть получен при помощи нелинейной регрессионной модели, построенной на основании статистических данных прошлых лет.

## **Эмпирическое оценивание возмущенных мер риска**

*А.Т. Семенов*

*НГУЭУ, г. Новосибирск*

Вопросы, связанные с понятием риска, его измерения и построения «хороших» (так называемых когерентных) мер риска рассматривались во многих работах (см., например, [1–3]).

Риск – это характеристика выбора и реализации решения субъектом риска в условиях неопределенности исхода решения. Такое понимание риска согласуется со сформулированной в 1921 г. Ф.Х. Найтом [1] трактовкой риска как измеримой неопределенности. Мы будем рассматривать измеримость неопределенности в вероятностном смысле. На современном языке это означает, что с риском ассоциируется некоторая случайная величина, закон распределения которой известен или может быть каким-то образом определен. Соответственно, собственно неопределенность означает отсутствие какого-либо способа формирования соответствующего распределения вероятностей или она не поддается объективному измерению. Несмотря на некоторую условность подобных формулировок, подход Ф. Найта определяет математическую базу для количественного измерения и моделирования рисков, которой является аппарат теории вероятностей.

В докладе представлены математические результаты реализации данного подхода.

### **Библиографический список**

1. Найт Ф.Х. Риск, неопределенность и прибыль. – М.: Дело, 2003.
2. Семенов А.Т. Введение в общую теорию риска. – Новосибирск: НГУЭУ, 2009.
3. Семенов А.Т. О некоторых мерах риска и их свойствах // Экономика, психология, бизнес. – Красноярск: КГТЭИ. – 2004. – №5.