

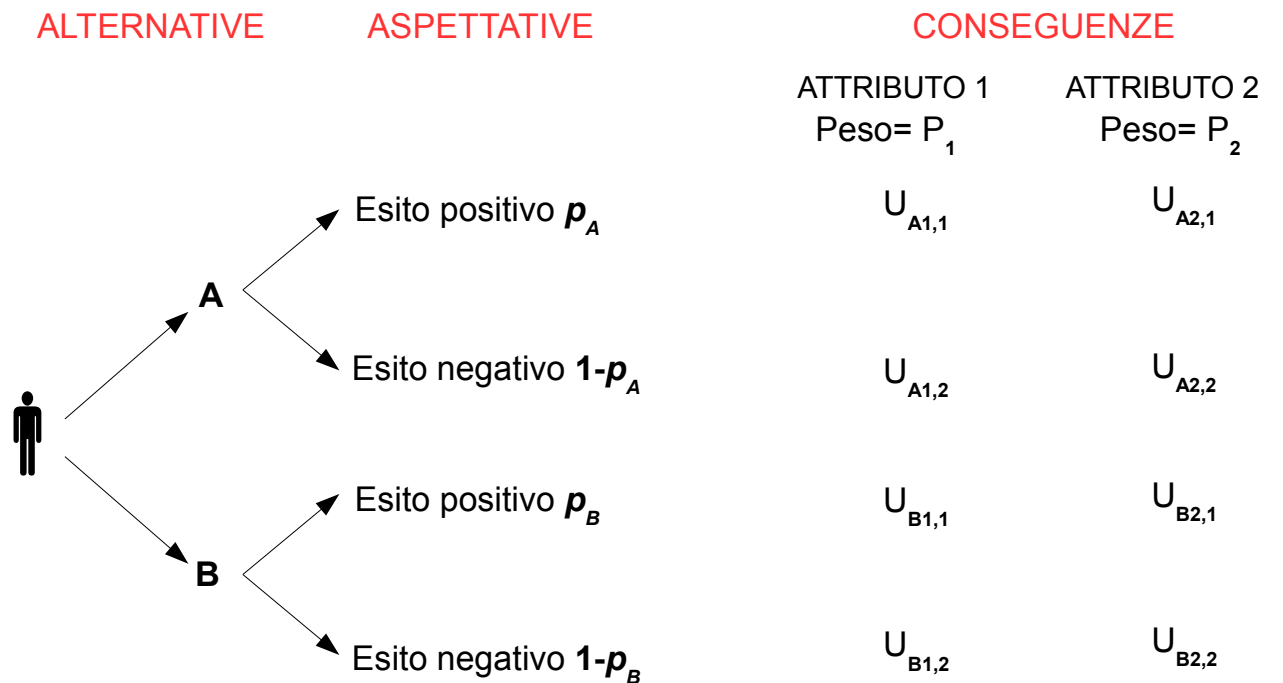
LA TEORIA DELLA SCELTA RAZIONALE/ 10

L'UTILITA' SOGGETTIVA ATTESA DI LEONARD SAVAGE (1954)

Il modello fino a qui visto si applica a situazioni caratterizzate solo da rischio, cioè dotate di probabilità oggettive (lotterie). Savage ha generalizzato il modello alle **situazioni di incertezza**, dove cioè non vi sono ragioni oggettive di assegnare una certa probabilità agli stati del mondo.

Passiamo così dalla EU alla **SEU - SUBJECTIVE EXPECTED UTILITY**, o teoria dell'utilità attesa soggettiva.

L'utilità attesa soggettiva di un corso d'azione è la somma dei prodotti delle probabilità di un esito per l'utilità soggettiva associata a ciascun esito.



$$\text{Utilità soggettiva A: } p_a * (P_1 * U_{A1,1} + P_2 * U_{A2,1}) + (1-p_a) * (P_1 * U_{A1,2} + P_2 * U_{A2,2})$$

$$\text{Utilità soggettiva B: } p_b * (P_1 * U_{B1,1} + P_2 * U_{B2,1}) + (1-p_b) * (P_1 * U_{B1,2} + P_2 * U_{B2,2})$$