



Universidad de San Carlos de Guatemala
Escuela de Ciencias Físicas y Matemáticas
Departamento de Matemática

TEORÍA DE JUEGOS

Emilene Analí Romero Marroquín

Asesorado por Hugo Allan García

Guatemala, de 2017

UNIVERSIDAD DE SAN CARLOS DE GUATEMALA



ESCUELA DE CIENCIAS FÍSICAS Y MATEMÁTICAS

TEORÍA DE JUEGOS

TRABAJO DE GRADUACIÓN
PRESENTADO A LA JEFATURA DEL
DEPARTAMENTO DE MATEMÁTICA
POR

EMILENE ANALÍ ROMERO MARROQUÍN
ASESORADO POR HUGO ALLAN GARCÍA

AL CONFERÍRSELE EL TÍTULO DE
LICENCIADA EN MATEMÁTICA APLICADA

GUATEMALA, DE 2017

UNIVERSIDAD DE SAN CARLOS DE GUATEMALA
ESCUELA DE CIENCIAS FÍSICAS Y MATEMÁTICAS



CONSEJO DIRECTIVO

DIRECTOR	M.Sc. Edgar Anibal Cifuentes Anléu
SECRETARIO ACADÉMICO	Ing. José Rodolfo Samayoa Dardón

TRIBUNAL QUE PRACTICÓ EL EXAMEN GENERAL PRIVADO

EXAMINADOR	Perengano
EXAMINADOR	Zutano
EXAMINADOR	Fulano 2

1. Teoría Preliminar

1.1. Teoría de Probabilidad

1.1.1. Probabilidad

Definición 1.1. (Experimento). Es el proceso por medio del cual se hace una observación.

Definición 1.2. (Espacio Muestral). Sea S un conjunto finito cuyos elementos son los posibles resultados de un experimento. A S se le llamara *espacio muestral*. A cada elemento de S se llamarán *puntos muestrales*.

Definición 1.3. (Evento). Si S es un espacio muestral, entonces un *evento* es cualquier subconjunto de S .

Definición 1.4. (Unión). Si $A_1, A_2 \subseteq S$ son eventos, entonces $A_1 \cup A_2$ es la *unión* de los conjuntos A_1 y A_2 que consiste de todos los puntos muestrales asociados a A_1 o A_2 . El evento $A_1 \cup A_2$ ocurre si alguno de los eventos A_1 o A_2 ocurre.

Definición 1.5. (Intersección). Si $A_1, A_2 \subseteq S$ son eventos, entonces $A_1 \cap A_2$ es la intersección de los conjuntos A_1 y A_2 que consiste de todos los puntos muestrales en A_1 y A_2 . El evento $A_1 \cap A_2$ ocurre si los eventos A_1 y A_2 ocurren simultáneamente.

Definición 1.6. (Mutuamente Excluyentes). Dos eventos $A_1, A_2 \subseteq S$ se dice que son *mutuamente excluyentes* si y solo si $A_1 \cap A_2 = \emptyset$.

Definición 1.7. (Función de Distribución de Probabilidad (Discreta)). Dado un espacio muestral discreto S , sea $\tilde{\mathcal{A}}$ el conjuntos de todos los eventos en S . Una *función de probabilidad discreta* es una aplicación $P: \tilde{\mathcal{A}} \rightarrow [0, 1]$ con las siguientes propiedades:

1. $P(S)=1$
2. Si $A, B \in \tilde{\mathcal{A}}$ y $A \cap B = \emptyset$, entonces $P(A \cup B)=P(A)+(B)$.

Definición 1.8. (Espacio de Probabilidad Discreto). La tripleta $(S, \tilde{\mathcal{A}}, P)$ se conoce como *espacio de probabilidad* de S .

Lema 1.1. Sea $(S, \tilde{\mathcal{A}}, P)$ un espacio de probabilidad discreto. Entonces $P(\emptyset) = 0$.

Demostración. Se tiene que $S \cap \emptyset = \emptyset$ entonces para $P(S \cup \emptyset = S) = P(S) + P(\emptyset)$, donde $P(S) = 1$, entonces $P(\emptyset) = 0$. \square

Lema 1.2. Sea $(S, \tilde{\mathcal{A}}, P)$ un espacio de probabilidad discreto y sean $A, B \in \tilde{\mathcal{A}}$. Entonces:

$$P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A \cap B) \quad (1.1)$$

Demostración. Si $A \cap B = \emptyset$ es trivial por definición (de función de distribución de probabilidad (discreta)) y lema anterior. Ahora supóngase que $A \cap B \neq \emptyset$, entonces sean:

$$E' = \omega \in E | \omega \notin F$$

$$F' = \omega \in F | \omega \notin E$$

De donde se tiene lo siguiente:

$$E' \cap F' =$$

$$E' \cap (E \cap F) =$$

$$F' \cap (E \cap F) =$$

$$E = E' \cup (E \cap F) \text{ y}$$

$$F = F' \cup (E \cap F)$$

Entonces por definición de función de distribución de probabilidad (discreta) se tiene que:

$$P(E \cup F) = P(E' \cup F' \cup (E \cap F)) = P(E') + P(F') + P(E \cap F) \quad (1.2)$$

$$P(E) = P(E' \cup (E \cap F)) = P(E') + P(E \cap F) \implies P(E') = P(E) - P(E \cap F) \quad (1.3)$$

$$P(F) = P(F' \cup (E \cap F)) = P(F') + P(E \cap F) \implies P(F') = P(F) - P(E \cap F) \quad (1.4)$$

entonces al combinar las ecuaciones anteriores se tiene:

$$P(E \cup F) = P(E) - P(E \cap F) + P(F) - P(E \cap F) + P(E \cap F) + P(E \cup F) = P(E) + P(F) - P(E \cap F) \quad (1.5)$$

a donde se queria llegar. \square

Lema 1.3. Sea $(S, \tilde{\mathcal{A}}, P)$ un espacio de probabilidad discreto y sean $A, B \subseteq \tilde{\mathcal{A}}$. Entonces:

$$P(A) = P(A \cap B) + P(A \cap B^c) \quad (1.6)$$

Demostración. \square

Lema 1.4. Sea $(S, \tilde{\mathcal{A}}, P)$ un espacio de probabilidad y supongase que A, B_1, \dots, B_n son subconjuntos de S . Entonces:

$$A \cap \bigcup_{i=1}^n B_i = \bigcup_{i=1}^n (A \cap B_i) \quad (1.7)$$

Es decir, la distribución de la intersección respecto de la unión.

Teorema 1.1.1. Sea $(S, \tilde{\mathcal{A}}, P)$ un espacio de probabilidad discreto y sean $A \in \tilde{\mathcal{A}}$. Sean B_1, \dots, B_n cualquier colección de conjuntos disjuntos entre si que particionan a S . Es decir:

$$S = \bigcup_{i=1}^n B_i \quad (1.8)$$

y $B_i \cap B_j = \emptyset$ si $i \neq j$. Entonces:

$$P(A) = \sum_{i=1}^n P(A \cap B_i) \quad (1.9)$$

1.1.2. Variables Aleatorias y Valores Esperados

Definición 1.9. Sea $(S, \tilde{\mathcal{A}}, P)$ un espacio de probabilidad discreto. Sea $D \subseteq \mathbb{R}$ un subconjunto discreto finito de números reales. Una variable aleatoria X es una función que mapea cada elemento de S en un elemento de D . Formalmente $X : S \rightarrow D$.

Definición 1.10. Sea $(S, \tilde{\mathcal{A}}, P)$ una distribución de probabilidad discreta y sea $X : S \rightarrow D$ una variable aleatoria. Entonces el *valor esperado* de X es:

$$\mathbb{E}(X) = \sum_{x \in D} xP(x) \quad (1.10)$$

1.1.3. Probabilidad Condicional

Lema 1.5. Sea $(S, \tilde{\mathcal{A}}, P)$ un espacio de probabilidad discreto y supóngase un evento $A \subseteq S$. Entonces $(A, \tilde{\mathcal{A}}_A, P_A)$ es un espacio de probabilidad discreta cuando:

$$P_A(B) = \frac{P(B)}{P(A)} \quad (1.11)$$

para todo $B \subseteq A$ y $P_A(\omega) = 0$ para todo $\omega \notin A$.

Definición 1.11. (Probabilidad Condicional) dado un espacio de probabilidad discreto $(S, \tilde{\mathcal{A}}, P)$ y un evento $A \in \tilde{\mathcal{A}}$, la probabilidad condicional del evento $B \in \tilde{\mathcal{A}}$ dado el evento A es:

$$P(B | A) = \frac{P(B \cap A)}{P(A)} \quad (1.12)$$

Definición 1.12. (Independencia). Sea $(S, \tilde{\mathcal{A}}, P)$ un espacio de probabilidad discreto. Dos eventos $A, B \in \tilde{\mathcal{A}}$ se dice que son independientes si $P(A | B) = P(A)$ y $P(B | A) = P(B)$

Teorema 1.1.2. Sea $(S, \tilde{\mathcal{A}}, P)$ un espacio de probabilidad discreto. Si $A, B \in \tilde{\mathcal{A}}$ son eventos independientes, entonces $P(A \cap B) = P(A)P(B)$

1.1.4. Regla de Bayes

Lema 1.6. (Teorema 1 de Bayes). Sea $(S, \tilde{\mathcal{A}}, P)$ un espacio de probabilidad discreto y supóngase que $A, B \in \tilde{\mathcal{A}}$, entonces:

$$P(B | A) = \frac{P(A | B)P(B)}{P(A)} \quad (1.13)$$

Teorema 1.1.3. (Teorema 2 de Bayes). Sea $(S, \tilde{\mathcal{A}}, P)$ un espacio de probabilidad discreto y supóngase que $A, B_1, \dots, B_n \in \tilde{\mathcal{A}}$ con B_1, \dots, B_n una colección de conjuntos disjuntos y

$$S = \bigcup_{i=1}^n B_i$$

Entonces:

$$P(B_i | A) = \frac{P(A | B_i)P(B_i)}{\sum_{j=1}^n P(A | B_j)P(B_j)} \quad (1.14)$$

1.2. Teoría de la Utilidad

1.2.1. Funciones de Utilidad

Se tiene un conjunto X , el cual consta de posibles alternativas, mutuamente excluyentes, entre las cuales debe de elegir un agente.

Definición 1.13. (Preferencia). Sea \succsim una relación binaria definida en X , llamada relación de preferencia, tal que, para $x, y \in X$, $x \succsim y$ quiere decir que la alternativa x es preferida o indiferente ante la alternativa y .

Definición 1.14. (Preferencia Estricta). La relación de preferencia estricta se denota por el símbolo " \succ ":

$$x \succ y \Leftrightarrow x \succsim y, \text{ pero no } y \succsim x$$

que se lee " x es preferido a y ".

Definición 1.15. (Indiferencia). La relación de indiferencia se denota por el símbolo " \sim ":

$$x \sim y \Leftrightarrow x \succsim y, y \succsim x$$

que se lee " x es indiferente a y ".

Definición 1.16. (Preferencia Racional). La relación de preferencia \succsim es racional si se verifica lo siguiente:

- Completitud: dadas dos alternativas cualesquiera x, y son comparables entre sí, en el sentido que es preferida x , es preferida y o son indiferentes.

$$\forall x, y \in X, \text{ se tiene que } x \succsim y \text{ o } y \succsim x \text{ o } x \sim y$$

- Transitividad: dadas alternativas cualesquiera x, y, z si x es preferida que y e y es preferida que z , entonces x se prefiere que z .

$$\forall x, y, z \in X, \text{ si } x \succsim y \text{ y } y \succsim z, \text{ entonces } x \succsim z.$$

Definición 1.17. (Función de Utilidad). La función U que asigna números a alternativas es la función de utilidad del agente sobre X . $U : X \rightarrow \mathbb{R}$ es una función de utilidad que representa la relación de preferencia \succsim , si para todo $x, y \in X$, $x \succsim y \Leftrightarrow U(x) \geq U(y)$.

1.2.2. Toma de Decisiones con Seguridad

Sea $X = x_1, x_2, \dots, x_n$ un conjunto finito de alternativas en un ambiente de riesgo.

Definición 1.18. (Lotería). L es una lotería simple en X , si:

$$L = \langle x_1, x_2, \dots, x_n, P \rangle$$

es decir, el conjunto de alternativas

1.3. Teoría de Juegos

1.3.1. Conceptos Básicos

Definición 1.19. (Juego). Sean X, Y dos jugadores con intereses opuestos. Un juego es definido como el curso de eventos que consisten de una sucesión de acciones por parte de X, Y . Para que dicho juego sea susceptible de análisis matemático, debe tener un sistema de reglas bien definidas, es decir, un sistema de condiciones que establezcan las acciones permisibles para cada jugador en cada etapa del juego. (Molina, 2007)

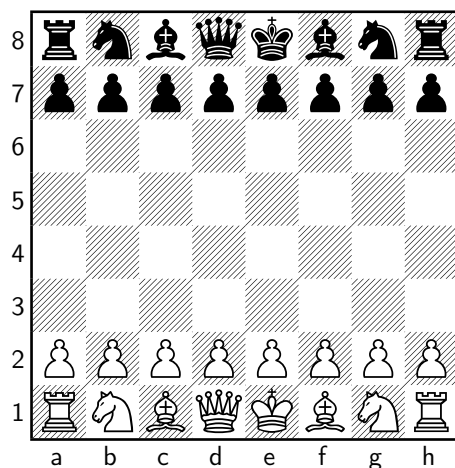


Figura 1.1. El juego del ajedrez es objeto de análisis matemático en la Teoría de Juegos.

Definición 1.20. (Jugadores). Son los participantes en el juego que toman decisiones con el fin de maximizar su utilidad. Pueden ser dos o más.

Definición 1.21. (Jugadas). Son las decisiones que puede tomar cada jugador en cada momento en que le toquen jugar. El conjunto de jugadas en cada momento del juego puede ser finito o infinito.

Definición 1.22. (Jugada Personal). Es una elección y ejecución consciente, por parte de uno de los jugadores, de una de las jugadas que sean posibles en la situación dada.

Definición 1.23. (Jugada Aleatoria). Es la elección de una posibilidad de entre un cierto número de ellas, no por la decisión de un jugador, sino por el resultado de algún evento aleatorio.

Definición 1.24. (Resultados del Juego). Son los distintos modos en que puede concluir un juego. Cada resultado lleva aparejadas unas consecuencias para cada jugador.

Definición 1.25. (Pago). Es la valoración que obtiene un jugador al final del juego, la cual está asociada a las consecuencias de alcanzar un determinado resultado.

Definición 1.26. (Estrategia). Es el conjunto completo de las reglas que determinan sus elecciones para todas las situaciones que se presentan en el curso de un juego.

Definición 1.27. (Perfiles de Estrategias). Es un conjunto de estrategias, uno por cada jugador.

CONCLUSIONES

1. Conclusión 1.
2. Conclusión 2.
3. Conclusión 3.

RECOMENDACIONES

1. Recomendación 1.
2. Recomendación 2.
3. Recomendación 3.

Referencias

- Cichon, M., Hagemeyer, K., y Scholtz, W. (2000). *Social budgeting*. Brookings Inst Pr. Descargado de <https://www.amazon.com/Social-Budgeting-Michael-Cichon/dp/9221108619%3FSubscriptionId%3D0JYN1NVW651KCA56C102%26tag%3Dtechkie-20%26linkCode%3Dxm2%26camp%3D2025%26creative%3D165953%26creativeASIN%3D9221108619>
- Cichon, M., Scholz, W., van de Meerendonk, A., Hagemeyer, K., Bertranou, F., y Plamondon, P. (2005). *Financing social protection (quantitative methods in social protection)*. International Labor Office. Descargado de <https://www.amazon.com/Financing-Social-Protection-Quantitative-Methods/dp/9221151220%3FSubscriptionId%3D0JYN1NVW651KCA56C102%26tag%3Dtechkie-20%26linkCode%3Dxm2%26camp%3D2025%26creative%3D165953%26creativeASIN%3D9221151220>
- Cichon, M., Yamabana, H., Weber, A., Newbrander, W. C., Normand, C., Dror, D., y Preker, A. (1999). *Modelling in health care finance: A compendium of quantitative techniques for health care financing*. International Labor Office. Descargado de <https://www.amazon.com/Modelling-Health-Care-Finance-Quantitative/dp/9221108627%3FSubscriptionId%3D0JYN1NVW651KCA56C102%26tag%3Dtechkie-20%26linkCode%3Dxm2%26camp%3D2025%26creative%3D165953%26creativeASIN%3D9221108627>
- E. Cerdá Tena, J. L. J. P., J. Pérez Navarro. (Madrid, 2004). *Teoría de juegos* (D. F. Aragón, Ed.). Pearson Educación, S.A.
- Fudenberg, D., y Tirole, J. (s.f.). *Game theory*. The MIT Press. Descargado de http://www.ebook.de/de/product/3241100/drew_fudenberg_jean_tirole_game_theory.html
- Gibbons, R. (1992). *Game theory for applied economists*. PRINCETON UNIV PR. Descargado de http://www.ebook.de/de/product/2519019/robert_gibbons_game_theory_for_applied_economists.html
- Griffin, C. (2010-2012). *Game theory: Penn state math 486 lecture notes*.

- The ilo pension model a technical guide [Manual de software informático]. (2002, agosto).
- The ilo population projection model (ilo-pop) a technical guide [Manual de software informático]. (2002, agosto). Financial, Actuarial and Statistical Services Branch Social Protection Sector International Labour Office 4 route des Morillons CH-1211 Geneva 22 Switzerland.
- Introduction to social security*. (1984). International Labour Org. Descargado de <https://www.amazon.com/Introduction-to-Social-Security/dp/9221036383%3FSubscriptionId%3D0JYN1NVW651KCA56C102%26tag%3Dtechkie-20%26linkCode%3Dxm2%26camp%3D2025%26creative%3D165953%26creativeASIN%3D9221036383>
- Iyer, S. (1999). *Actuarial mathematics of social security pensions*. International Labour Org. Descargado de <https://www.amazon.com/Actuarial-Mathematics-Social-Security-Pensions/dp/922110866X%3FSubscriptionId%3D0JYN1NVW651KCA56C102%26tag%3Dtechkie-20%26linkCode%3Dxm2%26camp%3D2025%26creative%3D165953%26creativeASIN%3D922110866X>
- Molina, R. S. (2007). Los grandes hitos de la teoría de juegos. *Revista Digital de Educación, Volumen I*.
- Plamondon, P., Drouin, A., Binet, G., Cichon, M., McGillivray, W. R., Bedard, M., y Perez-Montas, H. (2003). *Actuarial practice in social security (quantitative methods in social protection)*. International Labor Office. Descargado de <https://www.amazon.com/Actuarial-Practice-Security-Quantitative-Protection/dp/9221108635%3FSubscriptionId%3D0JYN1NVW651KCA56C102%26tag%3Dtechkie-20%26linkCode%3Dxm2%26camp%3D2025%26creative%3D165953%26creativeASIN%3D9221108635>
- Starr, R. M. (2011). *General equilibrium theory*. Cambridge University Press. Descargado de http://www.ebook.de/de/product/19924820/ross_m_starr_general_equilibrium_theory.html