Отражает психологию крайнего пессимиста. Находясь на этой позиции человек, будет ожидать наибольшие потери max lij . Тогда лучшим решением будет то решение, при котором максимально возможные потери будут минимальными. Для двух состояний природы критерий оптимальности имеет вид:

.

Обозначим через (L1, L2) .

Очевидно, что max (L1, L2) =

Данное решение есть уранением прямоугольного клина. То есть, чтобы найти рандомизированное решение по данному критерию не обходимо двигать прямоугольный клин по биссектриссе первой четверти координатной плоскости (L1 = L2) до первого пересечения с платежным множеством. Полученная точка и будет решением.

***Алгоритм:***1. Построить платежное множество по матрице потерь.

2. Построить прямоугольный клин и двигать его по прямой L1 = L2 до первого пересечения с платежным множеством. Определить точки αi и αj , что задают отрезок платежного множества, с которым пересекся клин.

3. Записать выпуклую комбинацию концов отрезка, а именно

Или учитывая, что :

4. Учитывая что, L1 = L2, получим уравнение относительно х, которое необходимо решить.

5.Рандомизированнное решением будет (0; …;0; х; 0; ….; (1 - х);0; ….;0)

Где х – на і месте, а (1 – х) – на j месте.

***Замечание:***

Если клин касается платежного множества в вершине, то рандомизированное решение будет совпадать с нерандомизированным.