Критерий минимаксного сожаления (критерий Сэвиджа)

Этот критерий отражает психологию постоянно сомневающегося человека. Предположим, человек надеется, что природа будет находиться в состоянии . Тогда ему нужно выбрать решение, которое при приведет к наименьшим потерям: .

Если человек, сомневаясь в правильности выбранного решения, отойдет от предположения, что природа будет находиться в состоянии и выберет какое-то другое решение, а природа окажется в состоянии , то человек испытает сожаление, величина которого оценивается разностью между полученными потерями и ожидаемыми потерями : . Поэтому в критерии Сэвиджа от матрицы потерь переходят к матрице сожалений.

,

.

Затем к матрице S применяем минимаксный критерий:

Алгоритм:

1. Находим в каждом столбце матрицы L минимальный элемент и отнимаем от каждого элемента матрицы соответствующий минимальный элемент по столбцу, тем самым образуя матрицу S;
2. Применяем к матрице S минимаксный критерий.