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: .

В критерии Сэвиджа от матрицы потерь переходят к матрице сожалений: .

Тогда, имея платежное множество K, переходим к множеству сожалений. Для этого нужно перенести параллельно оси координат до прикосновения с множеством K. И тогда по оси абсцисс будут сожаления при первом состоянии природы, а по оси ординат – при втором. Затем в системе применяем минимаксный критерий.

Алгоритм:

1. Строим по матрице потерь платежное множество K;
2. Переносим оси координат до прикосновения с множеством K;
3. Строим клин по новой системе координат;
4. Применяем минимаксный критерий.