

LA TEORIA DELLA SCELTA RAZIONALE/ 13

ALTRA CREPA – L'INCERTEZZA ED IL PARADOSSO DI ELLSBERG (1961)

Si supponga un'urna contenente 90 palline, 30 delle quali rosse e 60 o blu o verdi, in proporzione sconosciuta. Si consideri ora il seguente gioco:

Opzioni	Valore della vincita per tipo di pallina estratta		
	<i>Rosso</i>	<i>Blu</i>	<i>Verde</i>
<i>F</i>	€ 100	€ 0	€ 0
<i>G</i>	€ 0	€ 100	€ 0
<i>F'</i>	€ 100	€ 0	€ 100
<i>G'</i>	€ 0	€ 100	€ 100

per $0 < p < 1$

$$F = 0,33 * u(100) + p * 0,66 * u(0) + (1-p) * 0,66 * u(0)$$

$$G = 0,33 * u(0) + p * 0,66 * u(100) + (1-p) * 0,66 * u(0)$$

se *F* è preferita a *G*, significa che $0,33 * u(100) > p * 0,66 * u(100)$ (quindi $p < 0,5$)

$$F' = 0,33 * u(100) + p * 0,66 * u(0) + (1-p) * 0,66 * u(100)$$

$$G' = 0,33 * u(0) + p * 0,66 * u(100) + (1-p) * 0,66 * u(100)$$

se *G'* è preferita a *F'*, significa che $0,33 * u(100) + (1-p) * 0,66 * u(100) < 1 * 0,66 * u(100)$ (quindi $p > 0,5$, con **paradosso**).