

不確実性下の選好と効用

講義担当：浅野貴央 慶應義塾大学経済学部

講義概要：「不確実性」下の意思決定理論について、「リスク」とは異なる「(ナイト流)不確実性」という概念を解説し、「ナイト流不確実性」が意思決定者の選択に与える効果を概説する。特に、期待効用理論およびその一般化である非期待効用理論のモデルに基づいて解説する。さらに、時間が許せば、期待効用理論（および非期待効用理論）とは異なる視点から「不確実性」に直面した意思決定者の行動をモデル化した事例ベース意思決定理論についても解説する

授業予定（全6回）

11月13日

von-Neumann=Morgenstern

Savage

Anscombe=Aumann

上記3つのモデルを中心に期待効用理論について概説する。

11月20日

1回目に解説した期待効用理論について、公理およびその表現（representation）について概説する。

また、いくつかのパラドックス（特に Ellsberg's Paradox）に基づいて期待効用理論の問題点を概説する。

11月27日

Choquet Expected Utility (CEU)

Multiple Prior Expected Utility (MEU)

1980年代後半から研究が進展した非期待効用理論について、公理および representation について概説する。

12月4日

一般的には異なる理論モデルである CEU と MEU が一致する条件について概説する。

また、非期待効用理論の応用論文を通じて、「リスク」とは異なる「不確実性」が意思決定者にどのような影響を与えるかを概説する。

さらに、「リスク」「不確実性」とは異なる「曖昧さ (Ambiguity)」という概念について概説する。

12月11日

時間に関して加法的な効用理論 (time additive utility) の問題点、およびその問題点を克服すべく提唱された再帰的効用理論 (recursive utility) について概説する。

12月18日

事例ベース意思決定理論 (Case Based Decision Theory) について概説し、期待効用理論 (EU) との相違点を詳説する。