

О ВОЗМОЖНОЙ РАЗРЫВНОСТИ БАЗОВОЙ ФУНКЦИИ ТЕОРИЙ ПОЛЕЗНОСТИ И ПЕРСПЕКТИВ

Харин А.А.

Современная гуманитарная академия, Россия, 109029, Москва,
ул. Нижегородская, д. 32, (495)944-56-49, aaharin@yandex.ru

В [1] отмечено, что экономической теорией до сих пор адекватно не решен ряд фундаментальных проблем теорий полезности и перспектив. Существенная часть этих проблем связана с функцией (probability weighting) веса вероятности $W(p)$, которая является одной из основных, базовой для данных теорий.

Позднее была доказана теорема (см., напр., [2]) о существовании ограничений (разрывов) для вероятности у границ шкалы вероятностей в присутствии шумов.

В [3] выявлено базовое экспериментальное противоречие ведущей экспериментальной системы (random-lottery incentive system) современных теорий полезности и перспектив. В этой системе выбор гарантированных, определенных результатов стимулируется неопределенными лотереями. Это противоречие может скрывать новые принципиальные особенности $W(p)$.

В докладе рассмотрена область шкалы вероятностей $p \sim 1$. При естественных предположениях о том, что для верхней части шкалы, например для $p > 3/4$, справедливо $W(p) \leq p$ и для гарантированного исхода функцию $W(p)$ можно считать равной единице, показано, что эта функция может иметь разрыв в точке $p = 1$.

Разрывность является не только качественной, но и топологической особенностью $W(p)$. Поэтому, существование разрыва в $W(p)$ может привести к качественному изменению существующих на сегодняшний день теорий полезности и перспектив, по меньшей мере, в их математических аспектах.

Литература

1. *Kahneman D., Thaler R. Anomalies: Utility Maximization and Experienced Utility // Journal of Economic Perspectives* **20**, 1, 2006. Стр. 221-34.
2. *Харин А.А. Data dispersion in economics (II) – Inevitability and Consequences of Restrictions // Review of Economics & Finance*, **2**, 4, 2012. Стр. 24-36.
3. *Харин А.А. The random-lottery incentive system. Can $p \sim 1$ experiments deductions be correct? // 16th conference on the Foundations of Utility and Risk, Rotterdam, 2014.*