

## Preferencje i funkcja użyteczności

Wartości prawdopodobieństw obliczane przy pomocy sieci przekonań dostarczają informacji o względnych prawdopodobieństwach różnych zdarzeń, wariantów, itp. Jednak nie mówią jaką należy podjąć decyzję w oparciu o te wartości. Czy plan działania gwarantujący uzyskanie 90% celów z prawdopodobieństwem 0.95 jest lepszy niż plan gwarantujący uzyskanie 95% celów z prawdopodobieństwem 0.90 ?

Inteligentny agent musi mieć reprezentację swoich **preferencji** dla podejmowania decyzji. W tym celu będziemy stosowali pojęcie **funkcji użyteczności** (*utility*)  $U(S)$  określającej które stany są korzystniejsze dla agenta. W oczywisty sposób, użyteczność jest pojęciem względnym, które można określić dla konkretnego agenta.

Podjęmowanie decyzji na podstawie użyteczności — funkcje użyteczności

1

## Zasada MEU

Agent, posiadający preferencje wyrażone wartościami użyteczności i posługujący się prawdopodobieństwem dla określania faktów o świecie i możliwych konsekwencji, działa racjonalnie jeśli wybiera akcję dającą najwyższą oczekiwaną użyteczność (MEU = *Maximum Expected Utility*) uśrednioną po wszystkich możliwych wynikach tych akcji.

**Oczekiwana użyteczność**  $EU(A)$  niedeterministycznej akcji  $A$  ze zbiorem możliwych wyników  $\{Result_i(A)\}$  z prawdopodobieństwami  $P(Result_i(A)|Do(A), E)$ , gdzie  $E$  zawiera całą dostępną wiedzę agenta o świecie, a  $Do(A)$  jest stwierdzeniem wykonania akcji  $A$ , jest dana jako:

$$EU(A|E) = \sum_i P(Result_i(A)|Do(A), E) \times U(Result_i(A))$$

Jednak wybieranie akcji według zasady MEU nie jest łatwe. Aby tego dokonać należałoby określić wartości  $P(Result_i(A)|Do(A), E)$ , co wymaga NP-zupełnych obliczeń na sieci przekonań. Wyznaczenie wszystkich wartości  $U(Result_i(A))$  często może wymagać nakładu pracy ze strony agenta, ponieważ może on nie znać z góry własności danego stanu, a więc i jego przydatności dla swoich celów.

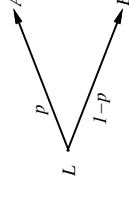
Podjęmowanie decyzji na podstawie użyteczności — funkcje użyteczności

2

## Loterie i preferencje

Sytuacje agenta podejmującego decyzje w warunkach niepewności będziemy nazywali **loterią** dla podkreślenia różnych możliwych wyników zdarzających się z różnymi prawdopodobieństwami. Wynik loterii może być konkretnym stanem lub kolejną loterią.

Na przykład, loterię  $L$  z dwoma możliwymi wynikami:  $A$  z prawdopodobieństwem  $p$  i  $B$  z prawdopodobieństwem  $1 - p$  możemy zapisać:



$$L = [p, A; 1 - p, B]$$

Jako podstawę wyboru między loteriami lub stanami agent stosuje preferencje:

$A \succ B$  —  $A$  jest preferowane nad  $B$

$A \sim B$  — nie ma wyraźnej preferencji między  $A$  i  $B$

$A \lesssim B$  —  $A$  jest preferowane nad  $B$  lub nie ma preferencji

Podjęmowanie decyzji na podstawie użyteczności — funkcje użyteczności

3

## Aksjomaty teorii użyteczności

Przyjmujemy, że preferencje agenta muszą spełniać następujące własności, zwane aksjomatami teorii użyteczności:

### porządek

$$(A \succ B) \vee (B \succ A) \vee (A \sim B)$$

### przechođniość

$$(A \succ B) \wedge (B \succ C) \Rightarrow (A \succ C)$$

### ciągłość

$$A \succ B \succ C \Rightarrow \exists p [p, A; 1 - p, C] \sim B$$

(Ciągłość oznacza, że jeśli  $B$  ma preferencje pomiędzy  $A$  i  $C$  to istnieje pewne prawdopodobieństwo  $p$ , dla którego agent nie ma preferencji pomiędzy wyborem  $B$  (na pewno), a loterią pomiędzy  $A$  i  $C$ .)

Podjęmowanie decyzji na podstawie użyteczności — funkcje użyteczności

4

$$A \sim B \Rightarrow [p, A; 1 - p, C] \sim [p, B; 1 - p, C]$$

(Jeśli nie ma preferencji pomiędzy dwoma loteriami  $A$  i  $B$ , to nie ma ich również pomiędzy dwoma innymi, bardziej złożonymi loteriami, które różnią się między sobą tylko wystąpieniem  $A$  i  $B$ . Własność ta zachodzi niezależnie od treści i prawdopodobieństw w tych innych loteriach.)

**monotoniczność**

$$A \succ B \Rightarrow (p \geq q \Leftrightarrow [p, A; 1 - p, B] \succ [q, A; 1 - q, B])$$

(Jeśli agent preferuje  $A$  względem  $B$ , to dla dwóch loterii z wynikami  $A$  i  $B$  preferuje również loterię, która z większym prawdopodobieństwem daje wynik  $A$  niż  $B$ .)

**dekompozycja**

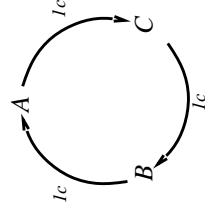
$$[p, A; 1 - p, [q, B; 1 - q, C]] \sim [p, A; (1 - p)q, B; (1 - p)(1 - q), C]$$

(Złożone loterie można zredukować do prostszych, stosując prawa prawdopodobieństwa.)

**Znaczenie aksjomatów**

Aksjomaty są tak skonstruowane, że ich naruszenie musi być związane z zachowaniem jawnie irracjonalnym.

Wyobraźmy sobie agenta z systemem preferencji naruszającym aksjomat przechodniości:  $A \succ B \succ C$  i jednocześnie  $C \succ A$ :



Jeśli  $B \succ C$ , to agent posiadający  $C$  powinien być skłonny zapłacić 1 (euro) centa aby osiągnąć  $B$ .

Jeśli  $A \succ B$ , to agent posiadający  $B$  powinien być skłonny zapłacić 1 (euro) centa aby osiągnąć  $A$ .

Jeśli  $C \succ A$ , to agent posiadający  $A$  powinien być skłonny zapłacić 1 (euro) centa aby osiągnąć  $C$ .

Takiego agenta można by zatem skłonić do oddania wszystkich pieniędzy jako konsekwencji posiadanych przez niego preferencji.

**Funkcje użyteczności**

Przedstawione aksjomaty teorii użyteczności w rzeczywistości nic nie mówią o użytecznościach, a jedynie o preferencjach agenta. Pojęciem wyjściowym do rozważań na temat podejmowania decyzji przez agentów będą ich preferencje spełniające powyższe aksjomaty.

Wiadomo że, jeśli zestaw preferencji agenta spełnia aksjomaty teorii użyteczności, to istnieje funkcja rzeczywista określona na zbiorze stanów  $U : S \rightarrow \Re$ , taka, że:

$$U(A) > U(B) \Leftrightarrow A \succ B$$

$$U(A) = U(B) \Leftrightarrow A \sim B$$

Ta funkcja użyteczności przyjmuje dla loterii o określonych wynikach  $S_1, \dots, S_n$  i ich prawdopodobieństwach  $p_1, \dots, p_n$  wartość:

$$U([p_1, S_1; \dots; p_n, S_n]) = \sum_i p_i U(S_i)$$

**Model racjonalnego agenta**

Ponieważ wynikiem niedeterministycznych akcji agenta są loterie, zatem powyższy wzór może być użyty do obliczenia oczekiwanej użyteczności tych akcji, i jest realizacją zasady MEU wprowadzonej wcześniej wzorem:

$$EU(A|E) = \sum_i P(Result_i(A)|Do(A), E) \times U(Result_i(A))$$

Istnienie tej zasady i teorii użyteczności nie oznacza, że racjonalnie zachowujący się (czyli: maksymalizujący oczekiwaną wartość użyteczności) inteligentni agenci **jawnie** obliczają tę funkcję i jej maksima. Agenci mogą posługiwać się różnymi reprezentacjami wiedzy i sposobami obliczania swoich strategii. Jednak obserwując poczynania racjonalnie zachowującego się agenta, można zamodelować jego preferencje i funkcję użyteczności.

## Teoria użyteczności w odniesieniu do pieniędzy

Rozważmy różne możliwe funkcje użyteczności w odniesieniu do stanów opisanych przez ilość posiadanych pieniędzy. Jest sensowne przyjąć, że funkcje użyteczności będą w tym przypadku monotoniczne dla konkretnych (pewnych) sum pieniędzy.

Rozważmy przykład: wygraliśmy teleturniej i mamy do wyboru nagrodę jednego miliona złotych, lub rzut monetą, i wtedy w przypadku orła otrzymamy trzy miliony, ale w przypadku reszki nic. Większość ludzi wybrałaby pewny milion na rękę (tylko co z podatkiem?), ale jeśli policzyć oczekiwaną wartość pieniężną (EMV) wariantu z rzutem monetą otrzymamy:

$$\frac{1}{2}(0\text{zł}) + \frac{1}{2}(3,000,000\text{zł}) = 1,500,000\text{zł}$$

podczas gdy EMV dla wariantu pewnego wynosi 1,000,000zł.

Podjęcie decyzji na podstawie użyteczności — użyteczność pieniędzy

9

Co wynika z tego przykładu? Spróbujmy policzyć użyteczności możliwych stanów wynikowych. Oznaczając przez  $S_k$  stan, w którym posiadamy początkowo  $k$  złotych mamy:

$$\begin{aligned} EU(\text{rzut_moneta}) &= \frac{1}{2}U(S_k) + \frac{1}{2}U(S_{k+3,000,000}) \\ EU(\text{milion_na_rękę}) &= U(S_{k+1,000,000}) \end{aligned}$$

By określić użyteczność posiadania różnych sum pieniędzy, możemy przyjąć, że początkowo większa suma gotówki jest dla nas bardziej użyteczna, np.:  $U(S_k) = 5$ ,  $U(S_{k+1,000,000}) = 8$ ,  $U(S_{k+3,000,000}) = 10$ . Wtedy otrzymamy  $EU(\text{rzut_moneta}) = 7.5$  i mamy podstawę by przyjąć oferowany nam pewny milion.

Z drugiej strony, gdybyśmy posiadali już wiele milionów, to może te wartości wyszłyby inne, i wtedy optacaloby się może przyjąć rzut monetą w powyższej loterii.

Podjęcie decyzji na podstawie użyteczności — użyteczność pieniędzy

10

## Paradoks St. Petersburga

Otrzymujemy propozycję udziału w grze (Bernoulli, 1738), w której rzucamy monetą tak długo aż wyrzucimy reszkę, i gdy nastąpi to w  $n$ -tym rzucie to wygramy  $2^n$  złotych. Na pewno opłaca się grać w tę grę. Pytanie jednak brzmi: ile byłibyśmy gotowi zapłacić za możliwość wzięcia w niej udziału? Prawdopodobieństwo wyrzucenia reszki w  $n$ -tym rzucie wynosi  $1/2^n$ , więc:

$$EMV(St.P.) = \sum_i P(\text{Reszka}_i) MV(\text{Reszka}_i) = \sum_i \frac{1}{2^i} 2^i = \frac{2}{2} + \frac{4}{4} + \dots = \infty$$

Czy to oznacza, że powinniśmy zapłacić dowolną (skończoną) sumę pieniędzy za możliwość udziału w takiej grze? Nie brzmi to poprawnie, i nie brzmiało również dla Bernoulliego, który zaproponował zastosowanie logarytmicznej funkcji użyteczności dla pieniędzy,  $U(S_k) = \log_2 k$ , dzięki czemu otrzymujemy:

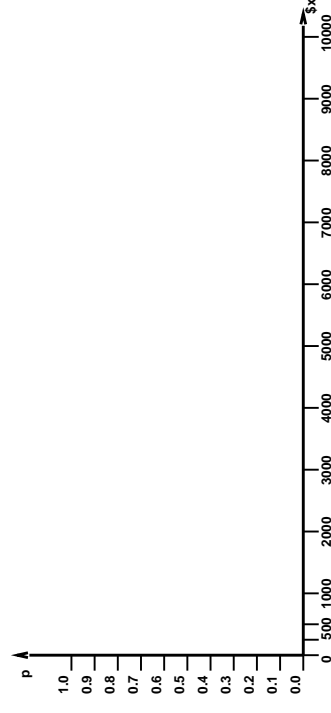
$$EU(St.P.) = \sum_i P(\text{Reszka}_i) U(\text{Reszka}_i) = \sum_i \frac{1}{2^i} \log_2 2^i = \frac{1}{2} + \frac{1}{4} + \dots = 1$$

Podjęcie decyzji na podstawie użyteczności — użyteczność pieniędzy

11

## Użyteczność pieniędzy dla studenta

Dla każdej wartości  $x$ , określmy przez głosowanie, prawdopodobieństwo  $p$ , przy którym pobowa grupie studenckiej preferuje loterię  $[p, \$10,000; (1-p), \$0]$  ponad pewną wypłatę kwoty  $\$x$ :

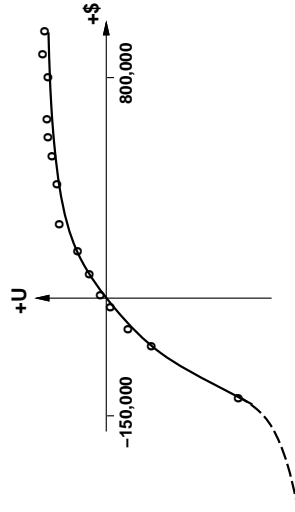


Podjęcie decyzji na podstawie użyteczności — użyteczność pieniędzy

12

## Krzywe użyteczności pieniędzy

Przyjmuje się, że użyteczność pieniędzy jest logarytmopodobną funkcją, która jest wklęsła dla dodatnich wartości monetarnych. W badaniach z lat 1960-tych wyznaczono doświadczalnie funkcję użyteczności pieniędzy dla pewnej konkretnej osoby  $U(S_k) = -263.31 + 22.09 \log(k + 150,000)$ :



Dla małych wartości ujemnych funkcja jest nadal wklęsła, ponieważ posiadanie długu powoduje zwykle u ludzi stan paniki. Jednak dla bardzo dużych wartości długu funkcja ta zdaje się mieć charakter wypukły, ponieważ „przykrość” z posiadania ogromnego zadłużenia nie wzrasta liniowo z poziomem tego zadłużenia.

Podjęcie decyzji na podstawie użyteczności — użyteczność pieniędzy

13

Wracając do dodatnich wartości monetarnych, można stwierdzić, że agenci z wklęsłą funkcją użyteczności ogólnie będą preferować otrzymanie sumy oczekiwanego wygranej z loterii (na pewno), niż brać udział w tej loterii:

$$U(S_L) < U(S_{EMV}(L))$$

Takie zachowanie można nazwać **ryzyko-fobią**. Obszar wypukłości funkcji użyteczności dla wielkich wartości długu można nazwać zachowaniem **ryzyko-lubnym**. W małych przedziałach funkcja użyteczności jest na ogół liniowa, i odpowiednie zachowanie jest nazywane **ryzyko-obojętnym**.

Podjęcie decyzji na podstawie użyteczności — użyteczność pieniędzy

14

## Nieracjonalność

Przyjęcie wklęsłej, logarytmopodobnej funkcji użyteczności pieniędzy nie wyjaśnia całej psychologii podejmowania decyzji finansowych przez ludzi. Okazuje się, że systematycznie naruszają oni aksjomaty użyteczności. Na przykład, mając wybór między loteriami  $A$  i  $B$ , oraz  $C$  i  $D$ :

- $A$ : 80% wygrania \$4000       $C$ : 20% wygrania \$4000  
 $B$ : 100% wygrania \$3000       $D$ : 25% wygrania \$3000

większość ludzi wybiera  $B$  ponad  $A$ , ale  $C$  ponad  $D$ . Jednak jeśli przyjmujemy  $U(\$0) = 0$ , to pierwszy wybór oznacza, że  $0.8 \times U(\$4000) < U(\$3000)$ , natomiast drugi wybór oznacza coś dokładnie przeciwnego.

Jednym możliwym wyjaśnieniem tego wyniku jest zwykła niezgodność zachowania się ludzi z aksjomatami użyteczności. Jednak inne wyjaśnienie jest oparte na uwzględnieniu poczucia **żału**. Ludzie wiedzą, że w przypadku loterii  $A$  będą się czuli idiotycznie jeśli wybiorą, i następnie przegrają tę loterię, wiedząc, że mogli dokonać bezpiecznego i opłacalnego (choćby mniej) wyboru loterii  $B$ . W drugim przypadku to poczucie nie wystąpi, więc zachowanie jest racjonalne.

Podjęcie decyzji na podstawie użyteczności — użyteczność pieniędzy

15

## Znormalizowane funkcje użyteczności

Zauważmy, że aksjomaty użyteczności nie określają funkcji użyteczności jednoznacznie na podstawie samych preferencji. Na przykład, agent posługujący się funkcją użyteczności:  $U'(S) = k_1 + k_2 U(S)$  gdzie  $k_1$  i  $k_2$  są stałymi ( $k_2 > 0$ ), będzie zachowywał się identycznie do agenta z funkcją  $U(S)$ , jeśli obaj agenci posiadają te same przekonania.

Funkcję użyteczności można zatem przeskalować liniowo i przesunąć o dowolną wartość w górę lub w dół, i zachowanie agenta nie zmieni się. Dlatego można posługiwać się **znormalizowaną funkcją użyteczności**.

Oznaczając przez  $u_{\perp}$  użyteczność stanu „najgorszej katastrofy”  $u_{\perp} = U(S_{\perp})$  dla pierwotnej funkcji użyteczności  $U(S)$ , a przez  $u_{\top}$  użyteczność stanu „największej nagrody”  $u_{\top} = U(S_{\top})$ , dla znormalizowanej funkcji użyteczności  $U'$  przyjmujemy  $U'(S_{\perp}) = 0$  i  $U'(S_{\top}) = 1$ , natomiast użyteczności stanów pośrednich  $U'(S)$  określamy prosząc agenta o podanie prawdopodobieństwa  $p$ , dla którego agent nie ma preferencji pomiędzy stanem  $S$  a **loterią standardową**  $[p, S_{\top}; (1-p), S_{\perp}]$

$$U'(S) = p, \text{ gdy } S \sim [p, S_{\top}; (1-p), S_{\perp}]$$

Podjęcie decyzji na podstawie użyteczności — normalizacja

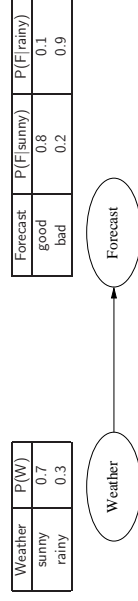
16

## Podęjmowanie decyzji

Bayesowskie sieci przekonane pozwalają na uzyskiwanie rozkładów prawdopodobieństw dowolnych zmiennych, przy posiadaniu informacji o dowolnej kombinacji innych zmiennych. Znając dodatkowo rozkład użyteczności, możemy tę wiedzę zastosować, z wykorzystaniem zasady MEU.

Rozważmy przykład: czy zabrać ze sobą parasol gdy wychodzimy z domu?

Parasol jest użyteczny tylko wtedy, gdy pada deszcz, poza tym jest uciążliwy, i można go zgubić. Skąd jednak możemy wiedzieć, czy będzie padać? Pewną wskazówką jest prognoza pogody.



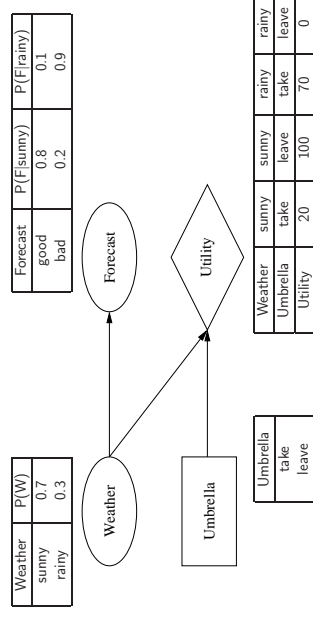
Przy okazji zauważmy, że powyższa sieć jest ciekawym przypadkiem zależności probabilistycznej, która zachodzi w kierunku odwrotnym do chronologii. Pogoda wpływa na prognozę, pomimo iż prognoza określała jest wcześniej. Jak to możliwe? O to trzeba by zapytać meteorologów.

Podęjmowanie decyzji na podstawie użyteczności — obliczanie decyzji

17

## Obliczanie decyzji

Najpierw rozważmy przypadek braku dodatkowych informacji o pogodzie.



$$\begin{aligned}
 EU(\text{leave}) &= P(\text{sunny}) * U(\text{leave, sunny}) + P(\text{rainy}) * U(\text{leave, rainy}) \\
 &= 0.7 * 100 + 0.3 * 0 \\
 &= 70
 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned}
 EU(\text{take}) &= P(\text{sunny}) * U(\text{take, sunny}) + P(\text{rainy}) * U(\text{take, rainy}) \\
 &= 0.7 * 20 + 0.3 * 70 \\
 &= 35
 \end{aligned}$$

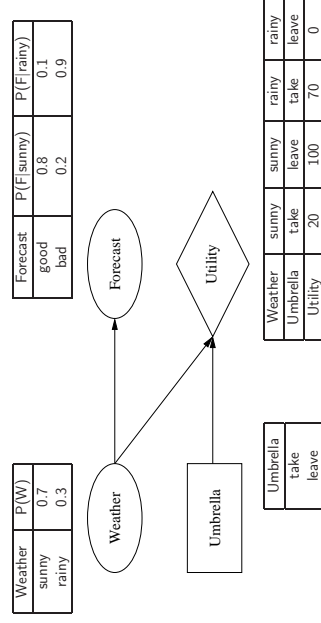
W tym przypadku wyższą użyteczność ma pozostawienie parasola w domu.

Podęjmowanie decyzji na podstawie użyteczności — obliczanie decyzji

19

## Diagramy wpływów

Zarówno rozważana akcja jak i użyteczności sytuacji mogą być wyrażone na grafie sieci przekonane jako specjalne węzły akcji i użyteczności. Sieć powinna zawierać połączenia z węzłów losowych i węzłów akcji do węzłów użyteczności.

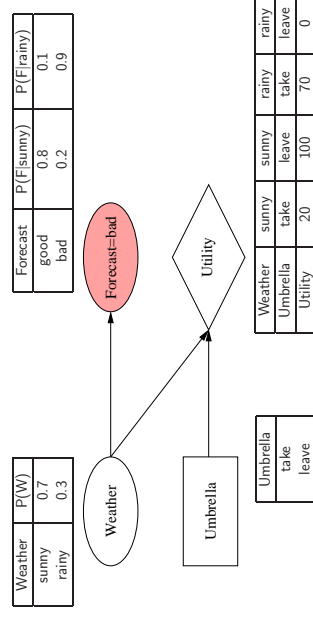


Takie rozszerzone sieci przekonane nazywane są **diagramami wpływów** (*influence diagrams*) albo też **sieciami decyzyjnymi** (*decision networks*). Niektóre narzędzia do budowy i przetwarzania sieci przekonane obsługują również takie diagramy wpływów.

Podęjmowanie decyzji na podstawie użyteczności — obliczanie decyzji

18

Założmy, że znana jest prognoza złej pogody. Prawdopodobieństwo pogody obliczone przez sieć wynosi teraz:  $P(\text{sunny, rainy|bad}) = (0.341, 0.659)$ .



$$\begin{aligned}
 EU(\text{leave|bad}) &= P(\text{sunny|bad}) * U(\text{leave, sunny}) + P(\text{rainy|bad}) * U(\text{leave, rainy}) \\
 &= 0.34 * 100 + 0.66 * 0 \\
 &= 34
 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned}
 EU(\text{take|bad}) &= P(\text{sunny|bad}) * U(\text{take, sunny}) + P(\text{rainy|bad}) * U(\text{take, rainy}) \\
 &= 0.34 * 20 + 0.66 * 70 \\
 &= 53
 \end{aligned}$$

W tym przypadku właściwą decyzją jest zabranie parasola ze sobą.

Podęjmowanie decyzji na podstawie użyteczności — obliczanie decyzji

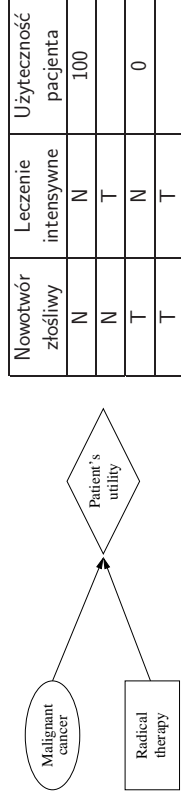
20

## Krótkie podsumowanie — pytania sprawdzające

1. Rozważ problem pacjenta, który z pewnym prawdopodobieństwem ma nowotwór złośliwy i rozważane jest podjęcie terapii intensywnej. Sytuację opisuje pokazany poniżej diagram wpływów z częściowo wypełnioną tabelką użyteczności pacjenta.

(a) Wyznacz i uzasadnij w racjonalny sposób brakujące użyteczności.

(b) Oblicz wartość prawdopodobieństwa nowotworu, przy którym decyzja o terapii ulega zmianie.

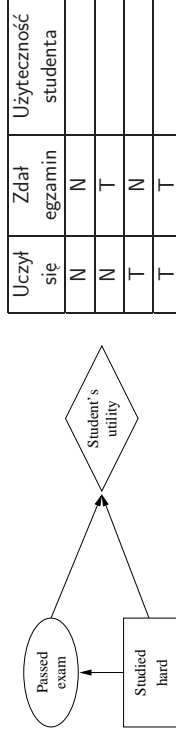


Podjęcie decyzji na podstawie użyteczności — obliczanie decyzji

21

2. Rozważ problem studenta, który przystępuje do sesji egzaminacyjnej i może uczyć się do egzaminu, bądź podejść bezstresowo, próbując zaliczyć „z biegu”, i nie tracić czasu na uczenie się.

- Rozważ dwie różne alternatywne filozofie życiowe studenta, i opisz je wartościami użyteczności w skali od 0 do 100.
- Dla przykładowo wybranego przedmiotu, określ prawdopodobieństwo pierwotne zdania egzaminu, i dla wybranych filozofii życiowych studenta oblicz jego decyzje zgodne z zasadą MEU. (Traktujemy tu węzeł decyzyjny uczenia się jako reprezentujący niezależną decyzję, a zatem zdanie egzaminu jest w tym wypadku zmienną losową niezależną od uczenia się.)
- Następnie, traktując uczenie się jako zmienną losową niezależną, określ warunkowy rozkład prawdopodobieństwa zdania egzaminu z wybranego poprzednio przedmiotu. Wybierz prawdopodobieństwo bezwarunkowe uczenia się i oblicz wartości oczekiwane użyteczności dla dwóch filozofii.



Podjęcie decyzji na podstawie użyteczności — obliczanie decyzji

22

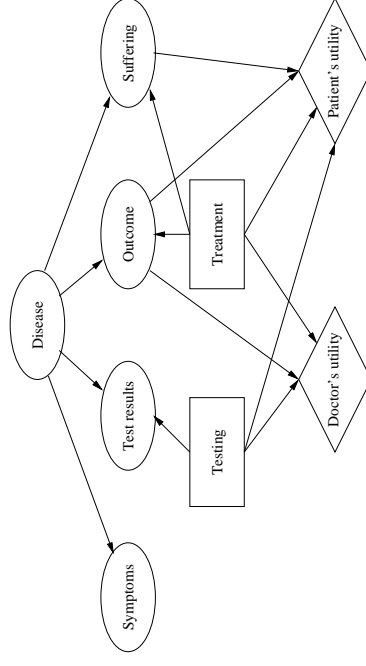
## Wielokrotne akcje i wielokrotne użyteczności

W sieci przekonań jest zwykle wiele węzłów losowych, ponieważ głównym przeznaczeniem takich sieci jest uproszczenie obliczeń prawdopodobieństw warunkowych dla złożonych przypadków.

Jest za to zupełnie normalnym przypadkiem gdy w diagramie wpływów istnieje dokładnie jeden węzeł decyzyjny i jeden węzeł użyteczności. Wynika to z faktu, że diagramy wpływów przedstawiają wiedzę niezbędną do podjęcia pojedynczej decyzji. Aby określić tę decyzję jednoznacznie, najlepiej mieć jedno kryterium.

Jednak wiele węzłów akcji może znaleźć się w diagramie wpływów. Wyrażają one wtedy sytuację, gdy agent musi podjąć tylko jedną z tych decyzji, lub w jednym kroku decyzję łączną, na podstawie informacji z sieci. Diagramy wpływów nie pozwalają na poprawny wybór zestawu decyzji, gdy konsekwencje jednej z nich wpływają na kolejne.

Z drugiej strony, wielokrotne użyteczności, gdy są takie, muszą być zagregowane za pomocą jednego z modeli obliczania użyteczności wieloatributowej, opisanych poniżej.



Podjęcie decyzji na podstawie użyteczności — wielokrotne akcje i wielokrotne użyteczności

23

Na podstawie powyższej sieci można zapisać pacjentowi badania, lub podjąć decyzję o leczeniu, niezależnie od tego, czy wyniki badań są dostępne czy nie. Nie ma natomiast możliwości podjęcia decyzji o badaniach, i uwzględniających skutki tych badań decyzji o leczeniu, w jednym kroku.

Zwróćmy również uwagę na odrębne obliczanie użyteczności z punktu widzenia pacjenta i lekarza. Pomimo iż dla obu stron ważny jest końcowy wynik, to biorąc one pod uwagę jeszcze inne czynniki, w odmienny sposób (np. prestiż lekarza i cierpienie pacjenta). Podejmowane na ich podstawie decyzje mogą być inne.

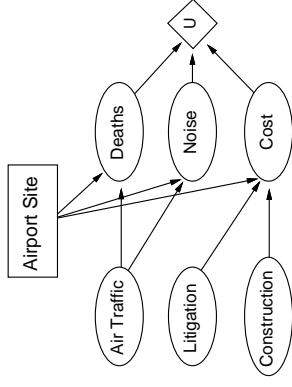
Podjęcie decyzji na podstawie użyteczności — wielokrotne akcje i wielokrotne użyteczności

24

## Użyteczności wieloatributowe

W wielu problemach praktycznych trzeba uwzględnić różne kryteria poprawności podejmowanych decyzji, albo, inaczej mówiąc, różne funkcje użyteczności, biorąc pod uwagę różne atrybuty rozważanych stanów. Preferencje wynikające z uwzględnienia różnych atrybutów mogą być ze sobą sprzeczne.

Rozważmy przykład z lokalizacją lotniska. Czynnikiem do uwzględnienia są: koszty gruntu, komplikacje przy jego zakupie, odległość od centrum miasta, zwiększony ruch na drogach, lokalne warunki pogodowe, i inne zagrożenia. Dla każdej możliwej lokalizacji można określić wartość krytycznych atrybutów takich jak: koszt całkowity, zagrożenie wypadkami (śmiertelnymi), uciążliwość ruchu lotniczego (hałas), itp.



Podjęmanie decyzji na podstawie użyteczności — użyteczności wieloatributowe

25

## Wieloatributowe funkcje użyteczności

Chcemy zbudować model podejmowania decyzji dla przypadków wieloatributowe. Będziemy oznaczać podlegające ocenie atrybuty stanu przez  $X_1, X_2, \dots$  a ich wartości  $x_1, x_2, \dots$ . Przyjmujemy dla uproszczenia, że większe wartości atrybutów oznaczają wyższą jakość rozwiązania, z punktu widzenia danego atrybutu.

Zakładając, że poszczególne atrybuty mają funkcje użyteczności oznaczone jako:  $f_1(x_1), f_2(x_2), \dots$  możemy próbować wyrazić globalną funkcję użyteczności agenta wzorem:

$$U(x_1, x_2, \dots, x_n) = f(f_1(x_1), f_2(x_2), \dots, f_n(x_n))$$

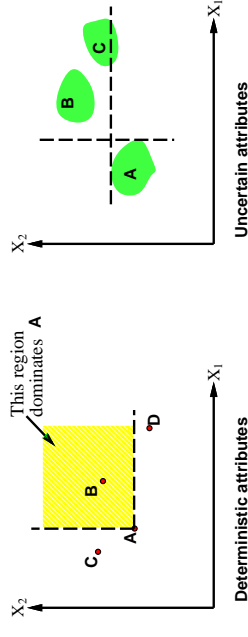
Niestety, na ogół funkcja  $f(\cdot)$  jest trudna do opisanie w jawny sposób. Najpierw rozważymy więc szereg łatwiejszych przypadków szczególnych.

Podjęmanie decyzji na podstawie użyteczności — użyteczności wieloatributowe

26

## Ścisła dominacja

Zjawiskiem **ściślej dominacji** nazwiemy sytuację, kiedy jeden wybór  $B$  posiada każdy z atrybutów lepszy od innego wyboru  $A$ . Na przykład, jedna lokalizacja lotniska jest tańsza, powoduje mniejsze obciążenie dla środowiska (naturalnego i ludzkiego), i jest bezpieczniejsza dla lotów. Wtedy możemy bez wahania odrzucić możliwość  $A$  z dalszych rozważań. Jednak nie można łatwo dokonać wyboru między możliwościami  $A$  a  $C$  lub  $A$  a  $D$  (diagram po lewej).



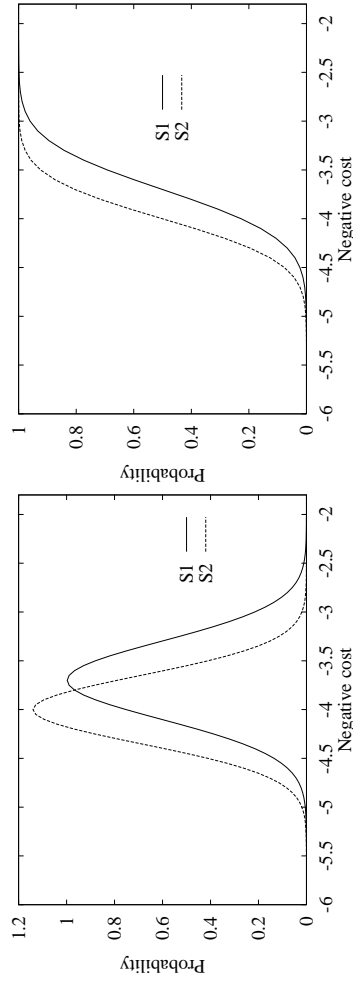
Ścisła dominacja lub jej brak może wystąpić również w warunkach niepewności, gdy dana akcja da wynik w postaci pewnej dystrybucji prawdopodobieństwa dla wartości atrybutów (diagram po prawej).

Podjęmanie decyzji na podstawie użyteczności — użyteczności wieloatributowe

27

## Dominacja stochastyczna

Ścisła dominacja nie zdarza się często w praktyce, i w ogólnym przypadku wartości atrybutów mogą nie być znane na pewno. Wtedy możemy posłużyć się rozkładami prawdopodobieństwa, i **dominacją stochastyczną**.



Na przykład, gdyby koszt lokalizacji lotniska w miejscu  $S_1$  był przewidziany z dystrybucją normalną z wartością oczekiwaną \$3,700M i odchyleniem standardowym \$400M, a w miejscu  $S_2$  z dystrybucją normalną z wartością oczekiwaną \$4,000M i odchyleniem standardowym \$350M, to  $S_1$  dominuje stochastycznie  $S_2$ , co widać z przebiegu dystrybucji kumulacyjnych.

Podjęmanie decyzji na podstawie użyteczności — użyteczności wieloatributowe

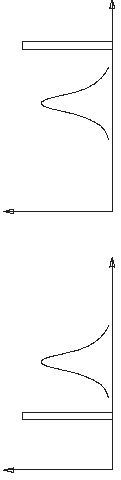
28

Jeśli agent rozpatruje dwie możliwe akcje  $A_1$  i  $A_2$ , które prowadzą do dystrybucji prawdopodobieństw  $p_1(x)$  i  $p_2(x)$  na atrybucie  $X$ , to możemy powiedzieć, że  $A_1$  dominuje stochastycznie  $A_2$  jeśli:

$$\forall x \int_{-\infty}^x p_1(x') dx' \leq \int_{-\infty}^x p_2(x') dx'$$

W skrajnym przypadku, możemy nawet mieć dla jednego z przypadków (wyniku akcji  $A_2$ ) wartość  $x_2$  atrybutu  $X$  pewną (tzn. ze 100% prawdopodobieństwem), co wcale nie oznacza, że akcja  $A_2$  powinna być preferowana (ani, że preferowana powinna być akcja  $A_1$  z wynikiem w postaci rozkładu prawdopodobieństwa dla atrybutu  $X$ ).

W zależności od konkretnego rozkładu akcja z niepewnym wynikiem może dominować stochastycznie akcję z wynikiem pewnym, albo na odwrót.



## Użyteczności wieloatrybutowe — przypadek deterministyczny

W ogólnym przypadku żadna dominacja może nie zachodzić. Jednak atrybuty stanu  $X_1$  i  $X_2$  mogą być **niezależne preferencyjnie** od  $X_3$  jeśli preferencje między  $\langle x_1, x_2, x_3 \rangle$  a  $\langle x_1', x_2', x_3 \rangle$  nie zależą od wartości  $x_3$ .

Jeśli każda para atrybutów  $X_i$  i  $X_j$  jest preferencyjnie niezależna od każdego z pozostałych atrybutów  $X_k$ , to ten zbiór atrybutów posiada własność **wzajemnej niezależności preferencyjnej** (MPI — *mutual preferential independence*).

Okazuje się, że w takim przypadku istnieje **addytywna funkcja wartości** opisująca preferencje agenta:

$$V(S) = \sum_i V_i(X_i(S))$$

W wielu przypadkach ta formuła pozwala prawidłowo modelować rzeczywiste preferencje i podejmowane decyzje.

## Użyteczności wieloatrybutowe — przypadek probabilistyczny

Można uogólnić własność MPI na loterie: zbiór atrybutów  $X$  jest **niezależny użytecznościowo** od zbioru atrybutów  $Y$ , jeśli preferencje między loteriami na atrybutach  $X$  są niezależne od konkretnych wartości atrybutów z  $Y$ . Zbiór atrybutów jest **wzajemnie niezależny użytecznościowo** (MUJ — *mutually utility-independent*), jeśli każdy podzbiór jego atrybutów jest niezależny użytecznościowo od pozostałych atrybutów.

Dla atrybutów MUJ zachowanie agenta może być opisane **multiplikatywną funkcją użyteczności**, którą dla przypadku trzyatrybutowego można zapisać:

$$\begin{aligned} U(S) &= k_1 U_1(X_1(S)) + k_2 U_2(X_2(S)) + k_3 U_3(X_3(S)) \\ &+ k_1 k_2 U_1(X_1(S)) U_2(X_2(S)) + k_2 k_3 U_2(X_2(S)) U_3(X_3(S)) \\ &+ k_1 k_2 k_3 U_1(X_1(S)) U_2(X_2(S)) U_3(X_3(S)) \end{aligned}$$

W pewnych szczególnych przypadkach istnieje również całkowiec addytywna funkcja użyteczności.



## Wartość informacji

W dotychczasowych rozważaniach przyjmowaliśmy założenie, że cała dostępna informacja jest znana agentowi podejmującemu decyzje. To założenie jest mało realistyczne. W praktycznych przypadkach podejmowania decyzji jedną z najważniejszych i jednocześnie najtrudniejszych kwestii jest na jakie pytania dotyczące problemu należy zebrać odpowiedzi.

Np. lekarz nie ma wszystkich kluczowych informacji o pacjencie w chwili gdy zapoznaje się z jego przypadkiem. Może zatem zlecić wykonanie pewnych badań, jednak takie zbieranie informacji jest z jednej strony kosztowne, a z drugiej wpływa na opóźnienie leczenia.

Ważność informacji zależy od dwóch czynników: (1) czy różne możliwe wyniki badań mocno wpłyną na podejmowaną decyzję, i (2) prawdopodobieństwa różnych wyników.

Teoria wartości informacji pozwala podejmować decyzje, które informacje należy zebrać.

Podjęcie decyzji na podstawie użyteczności — wartość informacji

33

## Wartość informacji — przykład

Założmy, że firma wiertnicza rozważa możliwość wykupu praw wiercenia w jednym z  $n$  obszarów oceanu. Założmy dalej, że jest pewne, że dokładnie w jednym z obszarów położone jest złożo, którego eksploatacja przyniesie zysk  $C$ , natomiast koszt każdego obszaru wynosi  $C/n$ . Zauważmy, że wartość oczekiwaną zysku  $EP$  z tej transakcji wynosi 0:

$$EP = \frac{1}{n} \left( C - \frac{C}{n} \right) + \frac{n-1}{n} \left( -\frac{C}{n} \right) = 0$$

Założmy dalej, że pewien geolog wie na pewno, czy w jednym konkretnym obszarze jest ropa. Jaka może być wartość tej informacji dla firmy wiertniczej? Rozważmy przypadek. Z prawdopodobieństwem  $\frac{1}{n}$  wybrany obszar zawiera ropę, i w takim przypadku firma kupi ten obszar i zarobi  $C$  minus  $C/n$  koszt praw. W przeciwnym wypadku, z prawdopodobieństwem  $\frac{n-1}{n}$  obszar nie zawiera ropy, i firma wiedząc to, kupi inny obszar, zawierający ropę z prawdopodobieństwem  $\frac{1}{n-1}$ , i zarobi, być może,  $C$ , z oczekiwaną wartością zysku  $C/(n-1)$ , ponownie minus  $C/n$ :

$$EP' = \frac{1}{n} \left( C - \frac{C}{n} \right) + \frac{n-1}{n} \left( \frac{C}{n-1} - \frac{C}{n} \right) = \frac{C}{n}$$

Wniosek: informacja ma wartość, w tym przypadku równą cenie prawa do eksploatacji złoża.

Podjęcie decyzji na podstawie użyteczności — wartość informacji

34

## Wartość dokładnej informacji

Założmy, że aktualna wiedza agenta to  $E$  i jego celem jest określenie najlepszej akcji  $\alpha$  spośród wszystkich możliwych akcji  $A$ . Określiśmy wartość oczekiwaną (uśredniana po różnych wynikach  $Result_t(A)$  tej akcji) użyteczności tej akcji:

$$EU(\alpha|E) = \max_A \sum_k U(Result_t(A)) P(Result_t(A)|Do(A), E)$$

Gdyby jednak agent zdobył wiedzę o wartości pewnej zmiennej losowej  $E_j$  to wartość oczekiwaną użyteczności wtedy wybranej akcji  $\alpha_{E_j}$  byłaby:

$$EU(\alpha_{E_j}|E, E_j) = \max_A \sum_k U(Result_t(A)) P(Result_t(A)|Do(A), E, E_j)$$

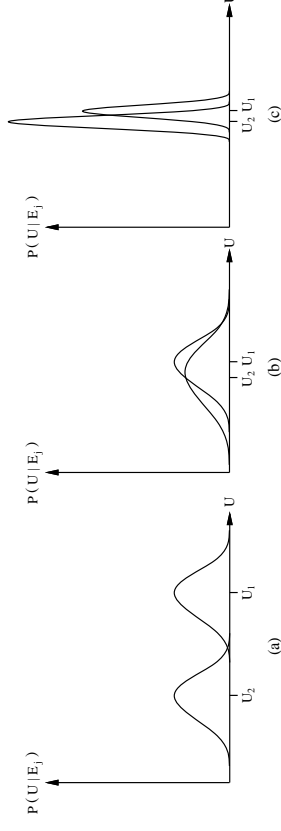
Ponieważ  $E_j$  jest zmienną losową o nieznannej wartości, to decyzję o tym, czy chcemy poznać jej wartość musimy podjąć biorąc pod uwagę wszystkie możliwe jej wartości, i to obecnie o nich wiemy. **Wartość dokładnej informacji** (VPI, *value of perfect information*) o zmiennej losowej  $E_j$  obliczamy jako:

$$VPI_E(E_j) = \left( \sum_k P(E_j = e_{jk}|E) EU(\alpha_{e_{jk}}|E, E_j = e_{jk}) \right) - EU(\alpha|E)$$

Podjęcie decyzji na podstawie użyteczności — wartość informacji

35

Wyobraźmy sobie, że mamy do wyboru tylko dwie akcje  $A_1$  i  $A_2$ , oraz ich użyteczności z wartościami oczekiwanymi  $U_1$  i  $U_2$ . Zdobywanie informacji  $E_j$  spowoduje, że oczekiwane użyteczności tych akcji zmienią się na  $U'_1$  i  $U'_2$ . Znając wartości  $U_1$ ,  $U_2$ , oraz  $U'_1$ ,  $U'_2$ , możemy podjąć decyzję, czy oplatę się zdobywać informację.



W przypadku (a) różnica oczekiwanego użyteczności jest duża, ale wybór jest jasny, i być może dodatkowa informacja i tak nań nie wpłynie, a wtedy wartość informacji jest żadna. W przypadku (b) różnica użyteczności (oczekiwanych) jest mała, ale faktyczne różnice mogą być duże, więc dodatkowa informacja może mieć istotną wartość. W przypadku (c) różnica wartości oczekiwanych jest mała, jak również wariancja obu zmiennych, więc ostateczna różnica prawdopodobieństwa będzie niewielka, i informacja również ma wartość znikomą.

Podjęcie decyzji na podstawie użyteczności — wartość informacji

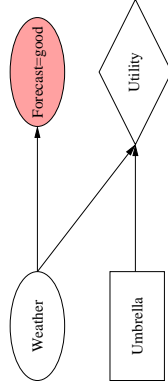
36

## Przykład: wartość informacji o pogodzie

Wróćmy do przykładu z deszczem i noszeniem parasola. Obliczyliśmy wcześniej:

$$\begin{aligned} MEU(\text{Umbrella}) &= \max_a EU(a) = 70 \\ MEU(\text{Umbrella}|\text{bad}) &= \max_a EU(a|\text{bad}) = 53 \end{aligned}$$

Możemy jeszcze dodatkowo obliczyć użyteczność najlepszej decyzji w przypadku dobrej pogody (w oczywisty sposób optymalną decyzją będzie wtedy „leave” ponieważ ta decyzja zwyciężyła już nawet przy braku wiedzy o pogodzie):



$$MEU(\text{Umbrella}|\text{good}) = \max_a EU(a|\text{good}) = 95$$

Podjęmowanie decyzji na podstawie użyteczności — wartość informacji

37

Aby obliczyć wartość prognozy pogody musimy znać rozkład prawdopodobieństwa dla zmiennej Forecast. Można go uzyskać odpytując się przekonana:  $P(\text{good}, \text{bad}) = (0.59, 0.41)$ . Dalej:

$$\begin{aligned} VPI_E(E_j) &= \left( \sum_k P(E_j = e_{jk}|E) EU(\alpha_{e_{jk}}|E, E_j = e_{jk}) \right) - MEU(\alpha|E) \\ VPI(\text{Forecast}) &= P(\text{good})EU(\alpha_{\text{good}}|\text{good}) + P(\text{bad})EU(\alpha_{\text{bad}}|\text{bad}) - MEU(\alpha) \\ &= P(\text{good})MEU(\text{good}) + P(\text{bad})MEU(\text{bad}) - MEU(\alpha) \\ &= 0.59 * 95 + 0.41 * 53 - 70 \\ &= 7.78 \end{aligned}$$

Dla rozkładu użyteczności zdefiniowanego w tym problemie, wartość prognozy pogody wynosi 7.78, wyrażona w jednostkach użyteczności. Gdybyśmy mogli kupić prognozę pogody o wiarygodności przyjętej w powyższym obliczeniu, i poniżej tej ceny, to opłaca się to zrobić aby podjąć lepszą decyzję w kwestii parasola.

Podjęmowanie decyzji na podstawie użyteczności — wartość informacji

38

## Własności wartości informacji

Twierdzenie: wartość informacji jest nieujemna.

Może jednak osiągnąć wartość zero, gdy np. znajomość innych faktów czyni daną informację bezużyteczną. Wartość informacji nie jest więc addytywna.

Z kolei wartość informacji o dwóch zmiennych losowych nie zależy od kolejności gromadzenia tych informacji. Jeśli znamy wartości zmiennych  $E_i$  i  $E_j$  to wnioski, które płyną z tej łącznej wiedzy nie zależą od tego kiedy i w jakiej kolejności agent te informacje pozyskał.

$$VPI_E(E_j, E_k) = VPI_E(E_j) + VPI_{E, E_j}(E_k) = VPI_E(E_k) + VPI_{E, E_k}(E_j)$$

Jednak wartość dwóch różnych informacji może być różna, i agent mógłby próbować obliczyć, które informacje przyniosłyby mu większy zysk (z uwzględnieniem ich kosztów).

Podjęmowanie decyzji na podstawie użyteczności — wartość informacji

39

## Krótkowzroczny agent gromadzący informacje

Inteligentny agent powinien zadawać użytkownikowi pytania w sensownej kolejności, unikać zadawania pytań nieistotnych, brać pod uwagę ważność informacji względem ich kosztu, i przestać zadawać pytania kiedy to nie ma już sensu. Takie działania można osiągnąć posługując się wartością informacji.

Możliwy algorytm agenta: wybierz informację, której zdobycie przyniesie największy oczekiwany zysk netto (zmniejszony o koszt zdobycia informacji), i jeśli ten zysk netto jest dodatni to zdecyduj się zdobywać tę informację. W przeciwnym wypadku przejdź do rzeczywistego działania.

Ten algorytm agenta jest **krótkowzroczny**, ponieważ kieruje się zyskiem z jednej tylko informacji, podczas gdy pozyskanie więcej niż jednej informacji mogłoby się okazać korzystne. Jest to w pewnym sensie analogiczne do zachłannej strategii przeszukiwania, i podobnie jak strategię zachłanne może przynieść sukces w niektórych przypadkach.

W ogólnym przypadku agent inteligentny mógłby rozważyć różne podzbiory zmiennych losowych i sekwencje pytań o nie.

Podjęmowanie decyzji na podstawie użyteczności — agent gromadzący informacje

40

## Krótkie podsumowanie — pytania sprawdzające

1. Dla problemu pacjenta z chorobą nowotworową przedstawionego w pytaniu na stronie 21, i wartości użyteczności tam wybranych, oblicz wartość dokładnej informacji o nowotworze.