

Statische Optimierung und Entscheidungstheorie (3SWS)

Gliederung

- 1 Statische Optimierung
 - 1.1 Der Lagrange-Ansatz**
 - 1.2 Der Dualitätssatz der Linearen Optimierung**
 - 1.3 Das Envelopentheorem**
 - 1.4 Die Kuhn-Tucker-Bedingungen**
- 2 Entscheidungstheorie
 - 2.1 Entscheidungsmodelle**
 - 2.1.1 Rationalitätsbegriffe
 - 2.1.2 Grundstruktur von Entscheidungsmodellen
 - 2.1.3 Entscheidung unter Sicherheit, Risiko und Ungewißheit
 - 2.2 Einstufige Entscheidungen unter Sicherheit**
 - 2.2.1 Präferenzrelationen, Nutzenfunktionen
 - 2.2.2 Mehrfachzielsetzungen
 - 2.2.3 Entscheidungsregeln bei Mehrfachzielsetzungen
 - 2.3 Einstufige Entscheidungen unter Risiko**
 - 2.3.1 Optimierung des Erwartungswertes
 - 2.3.2 Risikonutzenfunktionen
 - 2.3.3 Optimale Wertpapiermischung
 - 2.4 Einstufige Entscheidungen unter Ungewißheit**
 - 2.4.1 Entscheidungsregeln unter Ungewißheit
 - 2.4.2 Problematik von Entscheidungsregeln
 - 2.5 Mehrstufige Einzelentscheidungen**
 - 2.5.1 Mehrstufige Einzelentscheidungen bei gegebenem Informationsstand
 - 2.5.2 Mehrstufige Einzelentscheidungen bei variablem Informationsstand