

Inhaltsverzeichnis

Vorwort	V
1. Deterministische Entscheidungsmodelle	1
1.1 Alternativenmengen	1
1.2 Ziele und Zielfunktionen	15
1.2.1 Ziele	15
1.2.2 Zielfunktionen	19
1.3 Entscheidungsmodelle	20
1.4 Varianten und Erweiterungen	24
1.4.1 Zielvariablen, Fixierungs-, Satisfizierungs- und Ap- proximierungsziele	24
1.4.2 Nutzenfunktionen	29
2. Vektorielle Entscheidungsmodelle	33
2.1 Problemstellung	33
2.2 Effizienzbetrachtungen	38
2.3 Kompromißmodelle	44
2.3.1 Zielgewichtungsmo- dell	48
2.3.2 Kompromißmodelle auf Grundlage von Abstands- funktionen	52
2.3.3 Goal Programming	56
3. Stochastische Entscheidungsmodelle	62
3.1 Entscheidungen bei unvollkommener Information	62

3.2	Entscheidungsmodelle mit stochastischen Zielfunktionen	67
3.2.1	Problemstellung	67
3.2.2	Stochastische Dominanzen	72
3.2.3	Entscheidungsprinzipien	77
3.2.4	Ersatzmodelle	82
3.2.5	Informationswert	96
3.3	Entscheidungsmodelle mit stochastischen Alternativenmen- gen	102
3.3.1	Problemstellung	102
3.3.2	Stochastische Dominanzen	109
3.3.3	Ersatzmodelle	115
3.4	Entscheidungen bei Ungewißheit	123
4.	Erweiterungen und Anwendungen	130
4.1	Vektorielle stochastische Entscheidungsmodelle im Über- blick	130
4.2	Portfolio Selection: Ein Beratungsgespräch	143
4.2.1	Einführung	143
4.2.2	Das Grundmodell nach MARKOWITZ	145
4.2.3	Asymmetrische Risikomaße	151
4.2.3.1	Verlustwahrscheinlichkeit	151
4.2.3.2	Mißerfolgserwartung	155
4.2.4	Goal-orientierte Portfolios	158
4.3	Zweipersonen-Entscheidungsmodell bei asymmetrischer Information: Eine Vertragsverhandlung	162
4.3.1	Einführung	162
4.3.2	Spieltheoretische Aspekte einer Investitionsentschei- dung	163
4.3.3	Modellformulierung	166
4.3.4	Zielkonflikt	171
4.3.5	Kompromißlösungen	177
4.3.5.1	Kompromiß nach TSCHEBYCHEFF	178

4.3.5.2	Klassisches Prinzipal-Agent-Modell . .	183
4.3.6	Informationssymmetrie	185
Modellverzeichnis		189
Beispielverzeichnis		190
Verzeichnis ausgewählter Symbole		192
Literaturverzeichnis		194
Index		202