

# Literatur zur Vorlesung mit Übung ‚Entscheidungstheorie‘

Th. Augustin

[augustin@stat.uni-muenchen.de](mailto:augustin@stat.uni-muenchen.de)

<http://www.stat.uni-muenchen.de/~thomas>  
[http://www.stat.uni-muenchen.de/institut/ag/statsoz\\_neu/team/team.html](http://www.stat.uni-muenchen.de/institut/ag/statsoz_neu/team/team.html)

## Allgemeine Literatur (unterschiedlichen Schwierigkeitsgrads)

- **Bamberg, G.:** *Statistische Entscheidungstheorie*, Physika, Würzburg, 1972.
- **Berger, J.O.:** *Statistical Decision Theory and Bayesian Analysis*. 2<sup>nd</sup> ed., New York, 1985.
- **Bernardo, J.M., Smith, A.F.M.:** *Bayesian Theory*. Wiley, 1994.
- **Chernoff, H. und Moses, L.E.:** *Elementary Decision Theory*. Dover, 1987 (Nachdruck, Original 1959).
- **Dörsham, P.:** *Grundlagen der Entscheidungstheorie anschaulich dargestellt*. 4. Auflage. PD-Verlag, 2003.
- **Ferschl, F.:** *Nutzen- und Entscheidungstheorie. Einführung in die Logik der Entscheidungen*. Westdeutscher Verlag, Opladen, 1975.
- **Gilboa, I. :** *Rational Choice*. MIT Press, 2010.
- **Pratt, J.W., Raiffa, H. und Schlaifer, R.:** *Introduction to the Statistical Decision Theory*. MIT Press, 2008.
- **Rommelfanger, H. J., Eickmeier, S.H.:** *Entscheidungstheorie. Klassische Konzepte und Fuzzy Erweiterungen*. Springer, 2001.
- **Rüger, Bernhard.** *Test- und Schätztheorie. Band I: Grundlagen*. Oldenbourg, München, 1999.
- **Sorger, G.:** *Entscheidungstheorie bei Unsicherheit*, UTB. Stuttgart, 2004.
- **Witting, H.:** *Mathematische Statistik I. Parametrische Verfahren bei festem Stichprobenumfang*. Teubner. Stuttgart, 1985.

## Spezielle Literatur zu einzelnen Kapiteln

### zu Kap 1.4

- **Arthanari, T.S. und Dodge, Y.:** *Mathematical Programming in Statistics*. Wiley, New York, 1981.
- **Büning, H., Naeve, P., Trenkler, G., Waldmann, K.H.:** *Mathematik für Ökonomen im Hauptstudium*. Oldenbourg, München, 2000
- **Everitt, B.S. und Hand, D. J.:** *Finite Mixture Distributions*. Chapman and Hall, London, 1981.
- **Kosmol, P.:** *Optimierung und Approximation*. de Gruyter, Berlin, 1991.
- **Koop, A; Moock, H.:** *Lineare Optimierung: Eine anwendungsorientierte Einführung in Operations Research*. Spektrum, Berlin, 2008

- **Titterington, D. M.:** *Mixture distributions (update)*. In: S. Kotz, C.B. Read, and D. Banks (eds.): *Encyclopedia of Statistical Sciences, Update Volume 1*, Wiley, New York, 399-407', 1997.

**zu Kap 2.4.f und Kap 3.5.**

- **Coolen-Schrijner, P., Coolen, F., Troffaes, M., Augustin, T., Sat Gupta:** *Imprecision in Statistical Theory and Practice*. Grace, Greensboro, 2010.
- **Ellsberg, D.:** *Risk, ambiguity, and the Savage axioms*. *Quarterly Journal of Economics*, 643-669, 1961.
- **Hamouda, O.; Rowley, J.C.R. (Hg.):** *Paradoxes, Ambiguity and Rationality (Foundations of Probability, Econometrics and Economic Games 2)*. Edward Elgar, Cheltenham, 1997.
- **Kahneman, D., Tversky, A.:** *Prospect theory: An analysis of decisions under risk*. *Econometrica* 47, 313-327, 1979.
- **Kahneman, D.** Maps of Bounded Rationality (Nobel Prize in Economics documents) ([http://nobelprize.org/nobel\\_prizes/economics/laureates/2002/kahnemann-lecture.pdf](http://nobelprize.org/nobel_prizes/economics/laureates/2002/kahnemann-lecture.pdf)), 2002
- **Kofler, E.:** *Prognosen und Stabilität bei unvollständiger Information*. Campus. Frankfurt/Main, 1989.
- **Kofler, E. und Menges, G.:** *Entscheidungen bei unvollständiger Information*. Springer-Verlag, Berlin, 1976.
- **Hsu, M., Bhatt, M., Adolphs, R., Tranel, D., Camerer C. F.:** *Neural systems responding to degrees of uncertainty in human decision-making*, *Science* 310, 1680 – 1683, 2005.
- **Quaeghebeur, E.:** *Learning from samples using coherent lower previsions*. Dissertation: Universiteit Gent, Gent, 2009 (<http://users.ugent.be/~equaeghe/publications.php>)
- **Rios Insua, D. und Ruggeri, F. (Hg.):** *Robust Bayesian Analysis (Lecture Notes in Statistics)*, Springer, New York, 2000.
- **SIPTA (Society for Imprecise Probabilities: Theories and Applications):** [www.sipta.org](http://www.sipta.org) (insbesondere den Unterpunkt Proceedings bei 'Conferences and Schools'), 2013.
- **Troffaes M.:** *Decision making under uncertainty using imprecise probabilities*. *International Journal of Approximate Reasoning*, 45, 17–29, 2007.
- **Wakker, P.P.:** *Prospect Theory for Risk and Ambiguity*. Cambridge UP, 2010.
- **Walley, P.:** *Statistical Reasoning with Imprecise Probabilities*. Chapman and Hall, London, 1991.
- **Walley, P.:** *Inferences from multinomial data: learning about a bag of marbles (with discussion)*, *Journal of the Royal Statistical Society, Series B*, 58, 3-57, 1996.
- **Walter, G., Augustin, T.** *Imprecision and prior-data conflict in generalized Bayesian inference*. *Journal of Statistical Theory and Practice* 3, 255-271, 2009.
- **Weichselberger, K.:** *Elementare Grundbegriffe einer allgemeineren Wahrscheinlichkeitsrechnung I – Intervallwahrscheinlichkeit als umfassendes Konzept*. Physika, Heidelberg, 2001.