

# Literatur zur Vorlesung mit Übung ‚Entscheidungstheorie‘

Th. Augustin, G. Walter

[thomas@stat.uni-muenchen.de](mailto:thomas@stat.uni-muenchen.de)  
[gero.walter@stat.uni-muenchen.de](mailto:gero.walter@stat.uni-muenchen.de)

<http://www.stat.uni-muenchen.de/~thomas>  
<http://www.stat.uni-muenchen.de/~walter>

## Allgemeine Literatur

- **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).
- **Dörsham**, P.: *Grundlagen der Entscheidungstheorie anschaulich dargestellt*. 4. Auflage. PD-Verlag, 2003.
- **Fersch**, F.: *Nutzen- und Entscheidungstheorie. Einführung in die Logik der Entscheidungen*. Westdeutscher Verlag, Opladen, 1975.
- **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
- **Titterton**, 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 4.

- **Bernard, J.M.:** *Special issue on the Imprecise Dirichlet Model*. International Journal of Approximate Reasoning, 2009
- **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*. Universiteit Gent, Gent, 2009 (auch online: <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 die Unterpunkte 'Documentation und Resources', Proceedings ), 2010.
- **Troffaes M.:** *Decision making under uncertainty using imprecise probabilities*. International Journal of Approximate Reasoning, 45(1), 17–29, 2007.
- **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 (1): 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.
- **Weichselberger, K.:** *Elementare Grundbegriffe einer allgemeineren Wahrscheinlichkeitsrechnung*. Physika, Heidelberg, 2001.

**zu Kap. 5.2**

- **Aumann**, R.J. (Hg.): *Handbook of Game Theory - with Economic Applications*. North-Holland, Amsterdam, 3 Bände, 1992, 1994, 2002.
- **Holler**, M.J. und **Illing**, G.: *Einführung in die Spieltheorie*. Springer, Berlin, 2000.
- **Rasmusen**, E.: *Games and Information – An Introduction to Game Theory*. Blackwell, Malden, Mass., 2001.