

THEORIE DER WIRTSCHAFTLICHEN ENTSCHEIDUNG

Untersuchungen zur Logik und Bedeutung
des rationalen Handelns

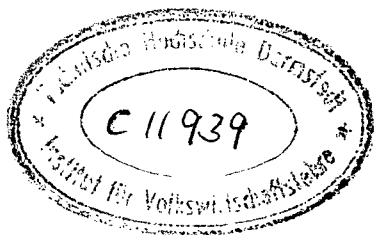
mit 84 Abbildungen

von

Dr. GÉRARD GÄFGEN

o. Professor an der Universität Konstanz

3., erweiterte und ergänzte Auflage



1974

J. C. B. MOHR (PAUL SIEBECK) TÜBINGEN

INHALTSVERZEICHNIS

Zur Einführung	1
--------------------------	---

I. Teil

METHODISCHE GRUNDLAGEN

1. Kapitel: Die rationale Entscheidung als Gegenstand der National- ökonomie	18
I. Begriff und Bereich des rationalen Handelns	18
1. Elemente der Mikrotheorie: Akteure und Attitüden 18 – 2. A-ratio- nale, teleologische und vollrationale Verhaltensprinzipien 22 – 3. Die formale Rationalität und ihre Reichweite 26 – 4. Subjektive Ratio- nalität, Voraussicht und Information 32	
II. Psychische Wirklichkeit und Entscheidungsmodell	36
1. Die Psychologie der Willensbildung 36 – 2. Psychische Introspektion und ökonomisches Modell 40	
III. Der Objektbereich der Nationalökonomie und der Entschei- dungstheorie	43
1. Die „ontologische“ Auffassung 43 – 2. Die „analytische“ Auffas- sung 45 – 3. Sozialökonomik, reine Ökonomik und Entscheidungs- theorie 48	
IV. Die logische, die explikative und die normative Verwendung der Entscheidungstheorie	50
2. Kapitel: Die Entscheidungstheorie als beschreibende Theorie des Wirtschaftsablaufs	53
I. Die Beschreibung des einzelwirtschaftlichen Verhaltens	53
1. Die Verstehbarkeit und Deduzierbarkeit rationalen Verhaltens 53 – 2. Die Nachprüfbarkeit und der empirische Gehalt der Rational- hypothese 56 – 3. Anhaltspunkte zur Verbreitung rationaler Haltun- gen im Wirtschaftsleben 59	
II. Einzelwirtschaftliche Entscheidung und volkswirtschaftliches Geschehen	63
1. Von der Entscheidungstheorie zur sozialökonomischen Theorie 63 – 2. Das Problem der Gruppenbildung 65 – 3. Das Summationspro-	

	blem 69 / a) Die Aggregation in der ökonomischen Theorie 69 / b) Die Ursachen der Nicht-Aggregierbarkeit 71 – 4. Die Entbehrlichkeit der Rationaltheorie für die Makroanalyse 76	
3. Kapitel: Die Entscheidungstheorie als Grundlage der Wirtschaftsberatung		79
I. Wirtschaftswissenschaft als Kunstlehre		79
1. Das utilitaristisch-normative Element in der Ökonomik 79 – 2. Die finale Ausrichtung der wirtschaftstheoretischen Modelle (Kalkülmodelle) 82		
II. Die Arten der Wirtschaftsberatung und ihr normativer Charakter		86
/		
II. Teil		
GRUNDZÜGE EINER THEORIE DER WIRTSCHAFTLICHEN ENTSCHEIDUNG		
4. Kapitel: Das Wirtschaftssubjekt in der Entscheidungssituation		95
I. Grundbegriffe		95
1. Umwelt und Wissen 95 – 2. Werte, Normen und Maximen 98 – 3. Entscheidung, Durchführung und richtige Planung 100		
II. Die Entscheidung nach dem ökonomischen Prinzip		102
III. Die Entscheidung nach dem Prinzip der Bewertung von Alternativen		105
5. Kapitel: Die Beschreibung von Handlungsalternativen		106
I. Die Bestimmung der Folgen einer Handlung (durch technologische Situationsmodelle)		106
II. Die Formen der Beschreibung von Konsequenzen		110
1. Die Suche nach geeigneten Beschreibungskriterien 110 – 2. Die Darstellungsarten 114 / a) Matrizen 114 / b) Vektoren 115 / c) Polarkoordinaten 117		
III. Die Formen der Begrenzung der Handlungsmöglichkeiten		119
6. Kapitel: Die Information über Handlungsfolgen		126
I. Die Notwendigkeit von Informationsentscheidungen		126
II. Die Beschreibung von Informationszuständen		129
1. Unvollkommene Information 129 – 2. Informationsgrade 131		
III. Die Entscheidungen unter Ungewißheit über die Handlungsfolgen		133

7. Kapitel: Die Bewertung der Handlungsfolgen	137
I. Notwendigkeit und logische Struktur der Bewertungsvorgänge	137
1. Bewertung als Kompromiß 137 – 2. Bewertung als Messung 140	
II. Wertordnungen und Nutzenfunktionen (Die verschiedenen Grade der messenden Bewertung)	144
1. Nominalskalen 144 – 2. Unvollständige Relationsskalen 145 / a) Allgemeines über Relationsskalen 145 / b) Partielle Wertord- nungen 147 – 3. Ordinalskalen 150 / a) Schwache und starke Wertord- nungen 150 / b) Die Abbildung durch ordinale Nutzenfunktionen 152 / c) Die lexikographische Ordnung 154 – 4. Kardinalskalen 156 / a) Die Intervallskala 156 / b) Die Verhältnisskala 158 / c) Die additive Ver- hältnisskala und die Unabhängigkeit der Einzelnutzen 159 / d) Die absolute Skala 164 – 5. Zusätzliche Bewertungsfaktoren 164	
III. Typische Formen der Wertordnung	165
1. Beziehungen zwischen Wertkriterien 165 / a) Typen von Indiffe- renzfunktionen 165 / b) Andere Feststellungen von Wertbeziehun- gen 170 – 2. Sättigungsphänomene bei Wertkriterien 171 / a) Relative und absolute Sättigung 171 / b) Relative und absolute Übersätti- gung 174	
8. Kapitel: Besonderheiten der kollektiven Entscheidung	176
I. Einführung	176
II. Entscheidungen bei rationaler Unbestimmtheit	178
1. Kompetitive Situationen 178 – 2. Kooperative und nicht-koopera- tive Lösungen 179	
III. Entscheidungen anhand von Sozialwahlfunktionen	184
1. Die soziale Wahl in Entscheidungsgemeinschaften 184 – 2. Zur Methode der Theorien sozialer Wahl 187	
IV. Entscheidungen über Organisation und von Organisationen	189
1. Funktionsteilung, Koordination und Kommunikation in einem handelnden Kollektiv 189 – 2. Ansätze einer Theorie der Organi- sation 196	
9. Kapitel: Die Vereinfachung von Entscheidungskomplexen	199
I. Die Reichweite und Komplexität von Entscheidungen	199
1. Die Verflechtung von Entscheidungsbereichen 199 – 2. Die Abgrenz- barkeit von Entscheidungsbereichen 201 – 3. Ein Beispiel: Die zeit- liche Ausdehnung eines Entscheidungsfeldes 203	
II. Vereinfachungen durch Kondensation des Betrachtungsfeldes	205
1. Vor-Auswahl von Entscheidungselementen 205 – 2. Künstliche Be- grenzung des Betrachtungsfeldes 206	
III. Vereinfachungen durch Zerlegung komplexer Entscheidungen	209
1. Voraussetzungen (partielle-Unabhängigkeit der Teilbereiche) 209 –	

2. Bildung von Entscheidungshierarchien 212 – 3. Bildung von Entscheidungssequenzen 214 – 4. Rationalitätshierarchien 217	
10. Kapitel: Existenz und Eindeutigkeit von Lösungen bei Entscheidungsproblemen	218
I. Bedingungen für die Existenz von Lösungen	218
II. Bedingungen für die Eindeutigkeit von Lösungen	221
1. Allgemeine Bedingungen (einfache Konvexität) 221 – 2. Strengste Bedingungen (strikte Konvexität) 224 – 3. Das „Gesetz der abnehmenden Grenzrate der Substitution“ 227	
III. Theoretische Bedeutung und empirische Geltung der Konvexitätsbedingung	230
1. Die Bedeutung der Konvexität für die Wirtschaftstheorie 230 – 2. Anhaltspunkte für das Vorliegen konvexer Präferenzordnungen 232	
Exkurs: Zum Aufbau einer vollständigen Theorie der wirtschaftlichen Entscheidung	236

III. Teil

EINIGE WICHTIGE TYPEN VON ENTSCHEIDUNGEN

11. Kapitel: Statische Theorien der Entscheidung unter Gewißheit	240
I. Die Theorie des erwünschten Niveaus	240
II. Die Theorie des Optimums	243
1. Zur Relativität optimaler Lösungen 243 – 2. Die schwache Rangordnung und die Theorie der latenten Indifferenz 245 – 3. Die starke Ordnung und die Theorie der manifesten Präferenz 250	
III. Die Theorie der Präferenzschwellen	256
1. Fixierte Schwellen 256 – 2. Stochastische Schwellen 260	
IV. Die Theorie der probabilistischen Ordnungen	263
1. Vorzugswahrscheinlichkeit und Präferenzordnung 263 – 2. Die Ableitung von Nutzenskalen 266	
V. Besondere nachprüfbare Einzeltheoreme	271
1. Die Prüfung der Konsistenz und Transitivität von Wertordnungen 271 – 2. Konsistenz-Theoreme 274 – 3. Transitivitäts-Theoreme 276 / a) Allgemeine Transitivitätsprüfungen 276 / b) Prüfung einzelner Ursachen der Intransitivität 281 / c) Prüfung probabilistischer Theoreme 285	
12. Kapitel: Theorien der dynamischen und quasisicheren Entscheidung	288
I. Entscheidungen bei Quasigewißheit	288
1. Die Situation der stochastischen Sicherheit 288 – 2. Besondere Voraussetzungen 290 / a) Zur Existenz stochastischer Gesetze 290 /	

b) Die Voraussetzung der „großen Zahl“ 291 – 3. Der Versicherungseffekt 291 – 4. Die subjektive Beurteilung stochastischer Sicherheit und Unsicherheit 294

II.	„Dynamische“ Entscheidungen	297
	1. Die Einführung des Zeitmoments 297 – 2. Verschiedene Methoden der dynamischen Entscheidung 300 / a) Statisierte Dynamik 300 / b) Sequentielle Dynamik 303 / c) Hierarchisierte Dynamik 311 / d) Intraperiодische Optimalisierung 313 – 3. „Zeitpräferenz“, Dynamik und Rationalität 317	

13. Kapitel:	Maximen der Entscheidung unter Ungewißheit	325
--------------	--	-----

I.	Arten und Grade der Ungewißheit	325
	1. Ungewißheit als Wahrscheinlichkeit 325 / a) Ereigniswahrscheinlichkeit und kalkulierbares Risiko 325 / b) Hypothesenwahrscheinlichkeit als Anhaltspunkt 329 / c) Subjektive Wahrscheinlichkeiten 332 – 2. Die Meßbarkeit von Gewißheitsgraden 338	

II.	Die Darstellung der Ungewißheitslage	342
-----	--	-----

III.	Regeln zur Kondensation des Entscheidungsfeldes	351
	1. Die Vernachlässigung möglicher Ereignisse 352 – 2. Die Ausscheidung von Alternativen 355 / a) Die Vermeidung von Katastrophenmöglichkeiten 355 / b) Die Einhaltung von Sicherheitsmargen 356 / c) Die Ausscheidung wertloser Alternativen 360 / d) Die Ausscheidung nicht-admissibler Alternativen 361 / e) Die Regel der absoluten Wahrscheinlichkeitspräferenz 362	

IV.	Bewertungs- und Handlungsregeln: Entscheidungsmaximen für beliebige Gewißheitspräferenzen	363
	1. Zur Typologie der Ungewißheitsmaximen 363 – 2. Maximen zur Berücksichtigung verschiedener Gewißheitspräferenzen 366 / a) Die Ophelimität ungewisser Ergebnisse 366 / b) Die Ophelimität der Parameter von Ergebnisverteilungen 372 / c) Gewißheitsäquivalente als Ophelimitätsindizes 377	

V.	Weitere Bewertungs- und Handlungsregeln: Maximen mit fixierten Gewißheitspräferenzen	379
	1. Regeln ohne Wahrscheinlichkeitsgrade 379 / a) Erwünschtes Niveau bei voller Sicherheit 379 / b) Maximales Ergebnis bei höchstem Risiko oder voller Sicherheit 381 / c) Minimierung maximaler Risiken 385 / d) Maximierung von Mittelwerten aus Extremwerten 387 – 2. Regeln mit fingierten Wahrscheinlichkeiten 389 – 3. Regeln mit partiell meßbaren Wahrscheinlichkeiten 392 / a) Maximierung bei bester Schätzung 392 / b) Maximierung von Sicherheitsmargen 394 – 4. Regeln mit voller Anwendung des Wahrscheinlichkeitskalküls 396 / a) Maximierung der Wahrscheinlichkeit guter Ergebnisse 396 / b) Maximierung der mathematischen Erwartung des Nutzens 399	

VI.	Maximen über Maximen (zur Auswahl von Entscheidungsregeln)	408
-----	--	-----

14. Kapitel: Wahlregeln für Entscheidungen von Kollektiven	413
I. Die Aufstellung von Sozialwahlfunktionen	413
1. Die Formulierung des Wahlproblems 413 – 2. Soziale Normierung und Nutzenmessung 416	
II. Einstimmigkeitsregeln	421
1. Einstimmig befriedigende Lösungen 421 – 2. Einstimmige Verbesserungen 422 – 3. Einstimmigkeit durch Stimmenkauf 423 / a) Totale Nutzenumverteilung 423 / b) Kompensation und Bestechung 424	
III. Mehrheitsregeln	427
1. Das mehrheitlich Befriedigende und das mehrheitlich Beste 427 – 2. Die Schwächen des Ordinalismus bei kollektiven Entscheidungen 429	
IV. Stimmzählregeln /	
1. Annahmen am Beispiel von Mehrheitsurteilen 431 – 2. Die Annahme gleichmäßiger Stimmenverteilung 435 – 3. Die Annahme normalverteilter Stimmen 437	
V. Präferenzbeschränkende Regeln	439
1. Beschränkung auf eingipflige Präferenzen 439 – 2. Beschränkung auf faltbare Präferenzskalen 440	
VI. Präferenzstärkeregelungen	444
1. Festlegung individueller Differenzskalen 444 – 2. Festlegung individueller Verhältnisskalen 449 – 3. Absolute Festlegung individueller Skalen 452 – 4. Die allgemeine Form der Summation individueller Nutzen 455	
VII. Verfassungen als Prinzipien zur Aufstellung von Wahlregeln	456

IV. Teil

ERGÄNZUNGEN ZUR WIRTSCHAFTLICHEN ENTSCHEIDUNGSLEHRE

15. Kapitel: Jenseits der Entscheidungslogik	461
I. Grenzen und Verzerrungen der entscheidungstheoretischen Perspektive	461
II. Die Implementation entscheidungstheoretischer Vorschläge.	463
1. Utopische oder praktikable Entscheidungslogik? 463 – 2. Anpassungsrezepte für die Entscheidungspraxis 466	
III. Die Komplexität von Entscheidungen und ihre Reduktion	469
IV. Die Relevanz der Entscheidungstheorie und der jeweiligen Entscheidungsdimensionen	475
1. Totale Vernunft und formale Praxeologie 475 – 2. Überprüfungen der Relevanz 479	

V. Die Rechtfertigung und die Revision von Entscheidungen	482
1. Das Dilemma der Rechtfertigung von Entscheidungen 482 – 2. Die Verwertung von Erfahrungen 486	
VI. Vom Nutzen und den Kosten der Entscheidungslogik	489
Literaturverzeichnis	492
Personenregister	512
Sachregister	517