

Exposé SIA-Arbeit

ENTROPIE EINES WIRTSCHAFTSSYSTEMS

Daniel Meiborg

You should call it entropy [...] no one really knows what entropy really is, so in a debate you will always have the advantage.

John von Neumann zu Claude Shannon, *Scientific American* Vol. 225 No. 3, (1971)

Thema

Lassen sich einfache ökonomische Prozesse durch einem Markov-Prozess mit einer uniformen stationären Wahrscheinlichkeitsverteilung modellieren und aus der durch äußere Einflüsse entstehenden Entropiereduktion Rückschlüsse auf verschiedene Wirtschaftssysteme treffen?

Grundbaustein dieser Herangehensweise ist der zweite Hauptsatz der Thermodynamik. Dieser gilt unter anderem für Markov-Prozesse (auch *Markov Chains* genannt) unter bestimmten Voraussetzungen [1]. Durch manuelles Eingreifen lässt sich die Entropie des Systems allerdings reduzieren. Diese Entropiereduktion ist äquivalent zu der Menge an Information, die man durch das Eingreifen erhält. Wenn man dieses System in mehrere Subumgebungen unterteilt, kann man dadurch mehrere Wirtschaftstypen und ihre Eigenschaften vergleichen.

Motivation

Ziel dieses Modells ist es tiefere Erkenntnisse über das Grenzwertverhalten von Wirtschaften zu gewinnen, sowie diese nach Typen basierend auf ihrer Entropie zu klassifizieren.

Forschungsstand

Bisher wurden zwar schon Markov-Prozesse für die Modellierung von Wirtschaften verwendet, allerdings wurde dabei nicht auf die Entropie im oben beschriebenen Sinne geachtet [2], [3]. Genauso wurde auch das Entropieverhalten von Markov-Prozessen analysiert, aber nicht auf die Wirtschaft bezogen [4].

Zeitplan

- **Recherche 1 Monat** - Einlesen in das Themengebiet
- **Planung 1 Monat** - Konzeptionierung des Modells und der Versuche
- **Framework 2 Monate** - Programmierung eines Simulation Frameworks für die Markov-Prozess-Analyse
- **Modellierung 2 Wochen** - Genaue Konfiguration/Eingabe der Parameter des Modells
- **Analyse 1 Woche** - Untersuchung des Modells i.e. Spectral Analysis, Finden der stabilen Konfiguration
- **Manipulation 2 Wochen** - Eingreifen in die Simulation und Analyse der Entropie
- **Interpretation 2 Wochen** - Zurückführen der Ergebnisse auf die Wirtschaft
- **Schriftliche Arbeit 2 Monate** - Ausformulieren der schriftlichen Arbeit

Mögliche Probleme

- **Modellierung** Volkswirtschaften erfüllen die Markov-Eigenschaft nicht i.e. nicht auf diese Weise modellieren.
- **Komplexität** Die benötigte Komplexitätsreduktion macht die Resultate unbrauchbar.
- **Speichereskalation** Durch zu viele Parameter wächst der Speicherbedarf unkontrolliert.

Quellen

- [1] T. M. Cover and J. Halliwell, "Which processes satisfy the second law," *Cambridge University Press New York, NY*, pp. 98–107, 1994.
- [2] S. Barde, "Macroeconomic simulation comparison with a multivariate extension of the markov information criterion," *Journal of Economic Dynamics and Control*, vol. 111, 2020.
- [3] O. Kostoska, V. Stojkoski, and L. Kocarev, "On the structure of the world economy: An absorbing markov chain approach," *Entropy*, vol. 22, no. 4, 2020 [Online]. Available: <https://www.mdpi.com/1099-4300/22/4/482>
- [4] A. Rahman and P. Kemper, "Simulation study to identify the characteristics of markov chain properties," *Association for Computing Machinery*, vol. 30, no. 2, 2020 [Online]. Available: <https://doi.org/10.1145/3361744>