

Licence Économie et gestion

Introduction à l'économétrie

Informations

Composante : Faculté d'Économie et de Gestion (FEG)
Nombre de crédits :

Responsable

Stephen BAZEN

Langue(s) d'enseignement

Français

Contenu

L'objectif de ce cours est de proposer une introduction à l'économie du risque et de l'incertain.

Plan du cours :

Le plan du cours comporte trois parties :

- La première plus fondamentale met l'accent sur (i) les processus de décisions en incertitude (ii) le concept d'utilité espérée, et (iii) ses fondements axiomatiques.
- La deuxième partie s'attaque à la notion de risque en introduisant (i) la notion de prime de risque et d'attitude face au risque et (ii) la notion de dominance stochastique.
- La troisième partie propose 3 types d'applications : (i) les propriétés de fonctions d'utilités usuelles (ii) le choix de portefeuille et (iii) la théorie de l'assurance.

Compétences à acquérir

- Comprendre la notion de décision en incertitude et appréhender la notion de risque.
- Appliquer au choix de portefeuille et à la notion d'assurance.

Modalités d'organisation

Examens : se référer aux Modalités de Contrôle des Connaissances et des Compétences.

Bibliographie, lectures recommandées

- Microéconomie de l'incertitude, Jean-Louis Cayatte, De Boeck (2009)
- The economics of risk and time, Christian Gollier, MIT Press (2001)
- Microéconomie de l'incertain : risque et décision, Octave Jockung, Dunod (2001)
- Économie de l'incertain et de l'information, Jean-Jacques Laffont, Economica (1991)

Pré-requis obligatoires

Bonne connaissance en microéconomie. Notion de théorie des probabilités et d'analyse mathématique.

VOLUME HORAIRE

- Volume total: 36 heures
- Cours magistraux: 24 heures
- Travaux dirigés: 12 heures

Codes Apogée

- BEG510A [ELP]
- BEG510AM [ELP]

Pour plus d'informations

[Aller sur le site de l'offre de formation...](#)



Dernière modification le 08/11/2024