

Master Économie

Risque et incitations

Responsables	Descriptions	Informations
Christophe MULLER Christophe.MULLER@univ-amu.fr	Code : BECAV4B	Composante : Faculté d'Économie et de Gestion
Nicolas GRAVEL nicolas.gravel@univ-amu.fr	Nature :	Nombre de crédits :
	Domaines : Droit, Économie, Gestion	

LANGUE(S) D'ENSEIGNEMENT

Anglais

CONTENU

Ce cours est une introduction à l'analyse des décisions incertaines dont les conséquences résultent de forces qui échappent au contrôle de l'agent les prend. Après avoir introduit les principaux concepts pertinents pour l'analyse de ces décisions (en particulier ceux d'actes et distributions de probabilités, de risque, d'incertain et d'ambiguïté), on discute en détail le modèle important et largement utilisé d'espérance d'utilité. On étudie ensuite comment on peut mesurer le risque et définir une attitude par rapport à celui-ci à l'intérieur de ce modèle. On utilise ensuite ce modèle pour étudier les décisions d'assurance et d'investissement dans le cadre stylisé où l'information sur les risques est également partagée par les agents et dans celui, plus réaliste, où le partage de cette information est inégal.

Plan du cours détaillé :

Chapitre 1 : Concepts de la décision en incertitude

- Exemples
- Probabilités, risque, incertitude, ambiguïté

Chapitre 2 : Décider en situation incertaine

- Le modèle d'espérance d'utilité subjective
- Le modèle d'espérance d'utilité objective
- Limites et alternatives au modèle d'espérance d'utilité

Chapitre 3 : Le risque et sa mesure

- Equivalent certain, prime de risque, attitude par rapport au risque
- Mesure quantitative locale de risque
- Dominance stochastique à l'ordre 1 et 2

Chapitre 4 : Applications en situation d'information symétrique

- Biens contingents et demande d'assurance
- Épargne risquée
- Choix statique de portefeuille

Chapitre 5 : La décision incertaine avec information asymétrique

- Le risque moral
- L'antisélection

COMPÉTENCES À ACQUÉRIR

- Notions de risque, d'incertitude et d'ambiguïté.
- Principaux modèles d'analyses de décisions incertaines.
- Rudiments d'analyse financière et assurantielle.
- Principales solutions aux problèmes que posent les asymétries d'information.

MODALITÉS D'ORGANISATION

Examens : 1 terminal et 1 de contrôle continu

BIBLIOGRAPHIE, LECTURES RECOMMANDÉES

- Eeckhoudt, L., C. Gollier and H. Schlesinger. Economic and Financial Decisions under Risk. Princeton University Press, 2005.
- Gayant, J.-P. Risque et décision, Paris, Vuibert, 2001.

- Gilboa, I. Theory of Decision under Uncertainty, Cambridge University Press, 2009.
- Laffont, J.-J., Cours de Théorie Microéconomique. Volume II : Économie de l'Incertain et de l'Information, Economica, 1991.
- D. Luce and H. Raiffa (1957), "Games and Decisions", New York, Wiley.

PRÉ-REQUIS OBLIGATOIRES

- Probabilités, rudiments de théorie du consommateur
- Optimisation

PRÉREQUIS RECOMMANDÉS

Mathématique de l'optimisation

VOLUME HORAIRE

- Volume total: 24 heures
- Cours magistraux: 24 heures

CODES APOGÉE

- BECA04B [ELP]

M3C

Aucune donnée M3C trouvée

POUR PLUS D'INFORMATIONS

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



Dernière modification le 30/06/2023