

Economie du risque

Infos pratiques

- > ECTS : 3.0
- > Nombre d'heures : 40.0
- > Langue(s) d'enseignement : Français
- > Niveau d'étude : BAC +4
- > Période de l'année : Enseignement sixième semestre
- > Méthodes d'enseignement : En présence
- > Forme d'enseignement : Cours magistral et Travaux dirigés
- > Ouvert aux étudiants en échange : Oui
- > Campus : Campus de Nanterre
- > Composante : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique
- > Code ELP : 4E7IRECM

Présentation

Ce cours de microéconomie présente les concepts fondamentaux en économie du risque. L'objectif de ce cours est de proposer une représentation et une analyse des comportements des agents en présence de risque. Une large place sera accordée à la théorie de l'espérance d'utilité. Ce cours propose également des notions permettant de mesurer et comparer des risques. Les comportements étudiés sont variés et seront abordées les décisions d'investissement, de consommation et d'assurance.

Le cours présente le modèle d'espérance d'utilité et les notions d'aversion pour le risque. Puis, sont présentés trois types de décisions analysées à l'aide des outils précédemment présentés : la demande d'assurance, les choix de portefeuille et les choix de consommations et d'épargne. La dernière partie du cours est consacrée aux limites du modèle d'espérance d'utilité et à la présentation de modèles alternatifs comme les modèles d'espérance d'utilité dépendant du rang.

Évaluation

Session 1: épreuve écrite de contrôle continu (50% de la note finale) et examen terminal (50% de la note finale)

Session 2: épreuve écrite

Pré-requis nécessaires

Ce cours nécessite un niveau L3 en microéconomie ; des bases en mathématiques niveau L3 (optimisation, probabilités).

Compétences visées

Les compétences acquises au terme du module sont:

- la maîtrise des outils d'analyse et de modélisation des comportements dans le risque
- la maîtrise des outils permettant d'analyser des choix simples de portefeuille, d'assurance et de consommations intertemporelles

Bibliographie

Mas-Colell Whinston Green. Microeconomic theory

Gayant J.-P., *Risque et Déc*

Contact(s)

> Johanna Etner

Responsable pédagogique
jetner@parisnanterre.fr