

SYLLABUS DE COURS

Année d'étude - parcours	Licence 3 Mention Economie et Gestion
Intitulé du cours	Modélisation économique 3: Modélisation microéconomique
Numéro de l'UE	UE : 6.11
Volume horaire (en heures maquettes)	17,5 heures
Objectifs et compétences développées	<p>Ce cours fait partie de ce que l'on appelle "La théorie de la décision". L'objectif de ce cours est de permettre aux étudiants d'aller plus loin dans de nombreux domaines de l'économie, en intégrant dans leurs analyses le risque et le comportement face au risque. Tous les domaines de l'économie sont concernés par le risque, mais plus particulièrement, l'assurance, le financement ou les choix d'investissement.</p> <p>Dans une première partie, le cours présentera la théorie classique de la décision dans l'incertain (le modèle de l'espérance d'utilité) et ses concepts principaux (aversion au risque, prime de risque). Une application simple en assurance par exemple sera présentée. Dans une seconde partie, les étudiants découvriront comment la théorie peut être utilisée pour, sur le plan expérimental, mesurer l'aversion au risque des individus. Enfin, nous irons au-delà du modèle de l'espérance d'utilité, en introduisant des modèles plus riches proposés par la théorie de la décision pour expliquer différents biais comportementaux constatés en économie expérimentale.</p>
Contenu et moyens pédagogiques	<p>I. L'espérance d'utilité</p> <p>Axiomatique de von Neumann-Morgenstern et théorème de l'espérance d'utilité Aversion au risque, prime de risque et équivalent certain</p> <p>II. Mesurer l'aversion au risque</p> <p>Principales approches</p> <p>III. Les réponses de la théorie microéconomique aux biais comportementaux</p> <p>Principaux biais et éléments de réponses théoriques : introduction à la Prospect theory, théorie du regret, rank dependent utility...</p>
Pré-requis	La fonction d'utilité
Modalités d'évaluation	Examen terminal
Références bibliographiques	<ul style="list-style-type: none"> ○ Analyse microéconomique, Hal R. Varian, de boeck (Chapitre sur l'incertitude). ○ Introduction à l'économie de l'incertitude, JL Cayatte, de boeck.