

Théorie de la décision : ambiguïté

Volume horaire		Unité d'Enseignement	Semestre	Niveau
Cours	TD			
18	7.5	Fondamentale	8	M1 IES FI
Enseignante		Evaluation	Coefficient	ECTS
Chantal Marlas		Ecrit + CC	1	1.5 FI

Objectifs de l'enseignement

Ce cours a pour objectif de comprendre les décisions économiques prises dans des situations où il n'existe pas de distribution de probabilité « objective » sur l'occurrence de différents événements. C'est le cas dans des situations où il existe peu de données, comme par exemple l'impact d'une toute nouvelle technologie, les risques environnementaux et les maladies rares. Nous commencerons par rappeler le modèle de Savage (SEU) dont on exposera les limites (paradoxe d'Ellsberg). Nous introduirons ensuite une série de modèles alternatifs à SEU permettant de prendre en compte une éventuelle aversion pour l'ambiguïté. Dans un troisième temps, nous analyserons la portée de ces modèles à travers différentes applications (environnement, santé). Finalement, nous présenterons les limites de ces modèles.

Descriptif de l'enseignement

- Le modèle de Savage et ses limites
- Les modèles d'ambiguïté
- Applications à l'environnement et la santé

- Les limites des modèles d'ambiguïté

Méthode d'enseignement

Cours et exercices.

Pré-requis

Micro-économie L3.

Bibliographie

I. Gilboa, *Decision under uncertainty*.