Théorie de la décision en incertain

ECTS : 2

Volume horaire : 18

Description du contenu de l'enseignement :

- Analyser, formaliser une décision risquée
- Caractériser un comportement optimal
- Calculer la composition d'un portefeuille
- Cadre d'analyse : Espérance d'utilité, Théorie duale.

Compétence à acquérir :

- Comprendre et interprêter les comportements risqués
- Analyser l'évolution des comportements risqués.

Mode de contrôle des connaissances :

- Devoir écrit.

Bibliographie, lectures recommandées :

- Bien F. et Lanzi T. (2015), Risques, Finances, Assurance, Pearson
- Eeckhoudt L. et Gollier C. (1992), Les Risques Financiers.

Document susceptible de mise à jour - 05/11/2026

Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16