

Microéconomie financière

Jean-Baptiste DESQUILBET
Professeur des universités, Université de Lille 1

jean-baptiste.desquilbet@univ-lille1.fr
<http://jean-baptiste.desquilbet.org/>

bureau SH2 – 115

<http://jean-baptiste.desquilbet.org/> (notes de cours, liens utiles)

Volume horaire – présentiel : 21 h (cours)

Volume horaire – travail personnel : ???

OBJECTIFS DU COURS :

- Réviser les concepts fondamentaux de l'analyse microéconomique utiles pour la banque et la finance
- savoir modéliser/critiquer les choix intertemporels
- savoir modéliser/critiquer les choix dans l'incertain

PRÉREQUIS

- Connaissances de base en économie,
- Connaissances de base en mathématiques
- Savoir utiliser un tableur
- Curiosité intellectuelle
- Envie de comprendre

Plan du cours :

1. Choix intertemporels
2. Le choix rationnel face au risque

Manuel(s) de référence

- Varian (2015), *Introduction à la microéconomie*, De Boeck (chapitres 10 « les choix intertemporels », 11 « les marchés des actifs », 12 « l'incertitude », 13 « les actifs à risque », 31 « l'économie comportementale »)
- Eeckhoudt, Gollier & Schlessinger (2005) *Economic and Financial Decisions under Risk.*, Princeton University Press

Lectures recommandées :

Pradier (2006), *La notion de risque en économie*, collection Repères, La découverte

Moureau & Rivaud-Danset (2004), *L'incertitude dans les théories économiques*, collection Repères, La découverte

Eber & Willinger (2012), *L'économie expérimentale*, collection Repères, La découverte

Erta & al. (2013), *Applying Behavioural Economics at the Financial Conduct Authority*, FCA occasional-paper n°1

Arrondel & Masson (2014), « Mesurer les préférences des épargnants », *Économie et Statistiques*

Modalités de contrôle des connaissances :

- contrôle continu
- devoirs à la maison
- devoir sur table en fin de cours