

Sommaire

Les auteurs	VII
Préface de Florence Legros	IX
Préface de Claude Fluet	X
Introduction	XI
Chapitre 1 Temps et consommation : équilibre général et optimum de Pareto	1
1. Définitions de base	3
2. Équilibre général intertemporel d'échanges purs	20
3. L'optimum de Pareto	25
Activités	37
Chapitre 2 Temps et production : équilibre général et optimum de Pareto	39
1. Équilibre général de production	41
2. Optimalité parétienne et production	48
3. Propriétés de l'équilibre général de production	53
4. Agent représentatif	67
Activités	83
Chapitre 3 L'évaluation des situations risquées : risque et comportement face au risque	87
1. Le cadre d'analyse	88
2. Différents modèles d'évaluation	93
3. Les comportements face au risque	102
4. Le modèle d'espérance d'utilité	103
5. Dominances stochastiques et comportement face au risque	120
6. Les modèles alternatifs	125
Activités	138
Chapitre 4 La valeur fondamentale d'actifs financiers	141
1. Principe d'arbitrage	144
2. Les principes généraux de valorisation	146
3. Les quatre méthodes de valorisation	148
4. Application à la valorisation d'actifs financiers élémentaires d'une économie sans risque	160
5. Application à la valorisation d'actifs financiers d'une économie risquée	165
Activités	175

Chapitre 5	La gestion des risques financiers (I) : une application à l'assurance de biens	177
	1. Présentation générale de l'assurance	179
	2. Modèle d'assurance à risque simple et critère d'espérance d'utilité	184
	3. Théorie duale de Yaari	210
	Activités	221
Chapitre 6	Temps et risque : équilibre général et optimum de Pareto	223
	1. Équilibre général risqué	226
	2. Optimum de Pareto et partage des risques	236
	3. Équilibre général et actifs financiers élémentaires à la Arrow	249
	4. Les déterminants des prix Arrow-Debreu	254
	5. Équilibre général risqué et assurance	257
	Activités	262
	Index	265