

Décision dans l'incertain appliquée à l'énergie

Microéconomie niveau M1.

Infos pratiques

- > ECTS : 2.0
- > Nombre d'heures : 24.0
- > Période de l'année : Enseignement neuvième semestre
- > Méthodes d'enseignement : En présence
- > Forme d'enseignement : Cours magistral et Travaux dirigés
- > Ouvert aux étudiants en échange : Oui
- > Composante : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique

Bibliographie

Benth F., 2004, Option Theory with Stochastic Analysis, Springer

Conejo A., Carrion M., Morales J., 2010, Decision Making Under Uncertainty in Electricity Markets, Springer.

Présentation

Dans la première partie du cours, on présente la prise en compte des incertitudes au travers d'une suite de décisions avec la théorie des options (études de cas). Dans une deuxième partie, seront présentés les avancées récentes en théorie de la décision en environnement incertain. Il s'agit de prendre en compte le risque dans les décisions inter-temporelles et également la façon dont les décideurs appréhendent ce risque au cours du temps et comment les choix peuvent en être affectés.

Objectifs

L'enseignement porte sur la prise de décision en avenir incertain ou incertain et en présence éventuelle d'irréversibilité. Les applications concernent le secteur de l'énergie.

La prise de décision dans l'incertain conduit à envisager un large ensemble de situations auxquelles l'entreprise peut être confrontée, ce qui conduit à mettre en œuvre des méthodes spécifiques pour y répondre. Différents modèles de décision en incertain seront présentés et discutés au regard de l'économie comportementale. Le cours est complété par des interventions de professionnels.

Pré-requis nécessaires
