

Université de la Méditerranée
- Maîtrise D'Économétrie
Année académique 2003-2004

1) **Intitulé du cours:** Microéconomie II

2) **Enseignant responsable:** N. Gravel

3) **Objectifs:**

Ce deuxième cours de microéconomie inscrit dans le cursus de 2^{ème} cycle d'économétrie vise à permettre à l'étudiante¹ d'obtenir une plus grande familiarité avec le cadre d'analyse de la micro-économie. Une première partie du cours est consacrée à l'étude du seul modèle cohérent du fonctionnement intégré de l'économie dans son ensemble dont disposent les économistes : Celui de la théorie de l'équilibre général concurrentiel. Ce modèle, qui sert de point de référence à pratiquement toutes les théories économiques, étudie le comportement d'acteurs économiques individuels (entreprises et ménages) dont l'interaction est médiatisée par un système de prix qu'ils considèrent comme donné. Une seconde partie du cours sera consacrée à la prise en compte d'interactions plus complexes entre ces acteurs dans des contextes spécifiques. On y présentera quelques éléments de théorie des jeux non-coopératifs qui permettent d'appréhender de manière générale l'interaction stratégique. On y abordera également quelques problèmes soulevés par les situations d'asymétries d'information dans lesquelles peuvent être plongés les acteurs.

4) **Prérequis et exigences**

Ce cours suppose de l'étudiante une familiarité avec l'expression formalisée des principaux concepts économiques (fonctions d'utilité et de demandes, fonctions de production et de coûts) et une connaissance minimale des mathématiques de base (calcul différentiel, optimisation, rudiments d'analyse).

5) **Manuels de référence:** Les ouvrages suivants sont utilisés à différents endroits du plan de cours.

G. Debreu « *A theory of Value* », New Haven, Cowles Commission foundation monograph, 1959 (traduction française parue chez Dunod en 1963)

David M. Kreps « *A Course in Microeconomic Theory* », Princeton University Press, 1990 (traduit en français en 1995))

Hal R. Varian « *Microeconomic Analysis* », Third Edition, Norton, 1992 (traduction française chez De Boeck en 1995)

D. Fudenberg et J. Tirole « *Game Theory* », MIT press, 1991

B. Salanié, « *Théorie des Contrats* », Paris, Economica, 1994.

6) **Méthode d'évaluation et organisation de l'enseignement**

L'enseignement est donné de façon magistrale. Des problèmes pratiques sont remis périodiquement à l'étudiante et sont traités en T.D. L'étudiante doit arriver préparée au T.D. La chargée de T.D. vérifiera cette préparation en demandant au hasard à certaines étudiantes d'aller au tableau ou de lui remettre une préparation écrite d'exercices. La note finale de l'étudiante résultera, pour 2/3, de sa performance à un examen sans notes ni documentation qui se tiendra en fin de semestre et, pour le tiers restant, de sa préparation aux séances de T.D.

7) **Plan du cours (36 heures)**

Thème

¹ L'usage du féminin est générique et n'implique aucune discrimination à l'encontre du genre masculin.

Thème 1 : Le producteur en équilibre général
(5 heures)

- Description de la technologie : ensembles et fonctions de productions
- Dualité et comportements de demande et d'offre

Debreu, 3; Kreps, 7.1, Varian, 1.

Debreu, 3; Kreps, 7.2-6; Varian, 3.1-2, 5.4-6;

Thème 2 : Le consommateur en équilibre général
(5 heures)

- Le consommateur propriétaire
- Les préférences des consommateurs
- La contrainte budgétaire du consommateur
- Dualité et comportements de demande et d'offre

Debreu, 4; Kreps, 2.1; Varian, 7

Debreu, 4; Varian, 9;1, 17.1, 18,3

Kreps, 2.2-4, Varian, 7.3, 8.6-8.10

Thème 3 : L'interprétation du modèle en situation d'incertitude (4 heures)

- Notion de biens contingents
- Le modèle de l'utilité espérée
- Aversion pour le risque et demande d'assurance

Debreu, 7; Kreps, 3.4,

Kreps, 3.1; Varian 11.2

Kreps, 3.2-3; Varian, 11.5-7

Thème 4 : L'équilibre général concurrentiel
(5 heures)

- Existence d'un équilibre général concurrentiel
- Temps et équilibre général concurrentiel
- Théorème de non-substitution
- Propriétés normatives de l'équilibre général concurrentiel

Debreu, 5; Kreps, 6.1, 8.4; Varian, 17.2-5, 18.1-5

Kreps, 6.5, Varian, 19

Varian, 18.9

Debreu, 6; Kreps 6.3, 8.4; Varian 17.6-9; 18.6

Thème 5 : Jeux non-coopératifs en information complète (6 heures)

- Formes stratégiques et extensives d'un jeu
- Solutions d'un jeu : Stratégies dominantes, élimination itérative de stratégies dominées, équilibres de Nash, équilibres parfaits en sous-jeu

Fudenberg et Tirole, 1.1, 3.1-4, Kreps, 11

Fudenberg et Tirole, 1.1-2, 2.1, 3.5, Kreps, 12

Thème 6 : Jeux non-coopératifs en information incomplète (3 heures)

- Equilibres Bayésiens et séquentiels et jeux de signaux

Fudenberg et Tirole, 6.1-6.4, Kreps, 12.7.3, 13.1

Thème 7 : Risque moral et incitations (4 heures)

- Le problème du risque moral
- Le modèle principal-agent discret
- Applications au marché du travail

Kreps, 16; 1-2, Varian, 25.1

Kreps, 16.3, Salanié, 5.1, Varian, 25.2-6

Salanié, 5.3

Thème 8 Antisélection et signalisation (4 heures)

- Le problème d'antisélection
- Les contrats séparateurs et mélangeant
- La théorie des mécanismes
- Applications à l'assurance et à la théorie des choix collectifs

Kreps, 17.1-2, Salanié, 4.1

Kreps 17.2, Salanié, 4.2-3, Varian 25.6-10

Kreps, 18, Salanié, 1

Chapitres et sections des manuels