



אוניברסיטת בן-גוריון בנגב
הפקולטה למדעי הרוח והחברה

המחלקה לכלכלה תשע"ז 2017

שם הקורס בעברית: כלכלת אי ודאות

שם הקורס באנגלית: Economic Under Uncertainty

מס' קורס: 142-1-1171

שם המרצה: פרופ' עזרא עיני

יעדי ההוראה:

הקורס עוסק בקבלת החלטות אופטימליות במצבים כלכליים שיש בהם אי ודאות.

פרשיות לימודים:

הגישה האכסיומטית לתוחלת התועלת. משפט ההצגה של פון נוימן ומורגנשטרן. הפרדוקס של Allais. שונות סיכון. איפיונים של שונות סיכון. שימושים לביטוח ולהשקעות. מדדי שונות סיכון ושימושיהם. שליטה סטוכסטית מסדר ראשון ומסדר שני והאיפיון שלהן באמצעות פונקצית ההתפלגות המצטברת. המודל של תוחלת- שונות בבחירת תיקי השקעות. האיפיון של מרקוביץ לתיקי ההשקעות היעילים לפי הקריטריון של תוחלת- שונות.

דרישות והרכב ציון הקורס

משקל בציון הסופי
מבחנים - 100%

רשימה ביבליוגרפית:

1. Huang and Litzenberger: Foundations for Financial Economics. MIT Press.
2. Laffont J.: The Economic of Uncertainty and Information. MIT Press.
3. Mas-Colell, Whinston and Green: Microeconomic Theory. Oxford University Press.