

Indice

Introduzione	IX
1 Teoria delle decisioni	1
1.1 Assiomi e utilità attesa	1
1.2 Paradossi di Allais e di Zeckhauser	8
2 Incertezza e informazione	17
2.1 Struttura informativa senza rumore	17
2.2 Struttura informativa con rumore	28
2.3 Mercati e informazione	59
3 Rendimento e rischio	81
3.1 Dominanza stocastica del primo ordine	81
3.2 Attitudine nei confronti del rischio	91
3.3 Dominanza stocastica del secondo ordine	108
3.4 Dominanza stocastica monotona	136
3.5 Applicazioni economiche	144
4 Approccio media-varianza	169
4.1 Frontiera efficiente e portafoglio ottimo	169
5 Scelte finanziarie	187
5.1 Scelta di portafoglio	187
5.2 Scelta di assicurazione	259
5.3 Scelta intertemporale	273
6 Equilibrio concorrenziale e prezzi degli asset	297
6.1 Mercati dei beni e dei titoli	297
6.2 Mercati completi. Ripartizione del rischio	322
6.3 Mercati completi. Scelta intertemporale e prezzi dei titoli	381
6.4 Mercati incompleti	407