**Université Paris Dauphine**

**Licence d’économie appliquée – Cours Informatique appliquée à la finance**

**Philippe Bernard & Frédéric Peltrault**

**Année universitaire 2015-2016**

**Travail à faire : créer une fonction fnMaxiMin**

Un agent a le choix entre 4 investissements. Les projets d’investissement donnent des résultats dans les 10 états de la nature (voir tableau ci-dessous). On suppose qu’un individu prend sa décision en appliquant le critère de Wald. Ce critère de décision conduit à sélectionner le projet qui maximise le résultat minimum. On parle de critère « Maxi Min ». Il s’agit d’un critère qu’adopterait un agent pessimiste ou prudent.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Le code reporte tout d’abord dans le vecteur de valorisation **Valo** qui donne le résultat minimum de chaque projet.  **Valo** =  La ligne qui correspond au maximum de **Valo** permet d’identifier le projet sélectionné par le critère de Wald. |

Dans cet exercice, il s’agit de créer une fonction qui renvoie le nom du projet que l’individu choisit s’il applique le critère de Wald. Dans l’exemple proposé, le projet retenu est le projet n°3. Il faudra donc que la fonction fnWald renvoie la valeur 3.