

# Robert F. Engle

---

 Pour les articles homonymes, voir Engle.

Robert F. Engle



Robert F. Engle <sup>3<sup>e</sup></sup> à gauche lors d'une cérémonie avec G. W. Bush

## Données clés

<b>Naissance</b>	10 novembre 1942 Syracuse, État de New York (États-Unis)
<b>Nationalité</b>	américaine
<b>Champs</b>	Économétrie
<b>Institutions</b>	Université de Californie à San Diego, New York University, Stern School of Business
<b>Diplômé de</b>	Williams College, Université Cornell
<b>Renommé pour</b>	méthodes ARCH
<b>Distinctions</b>	Prix de la Banque de Suède en sciences économiques en mémoire d'Alfred Nobel 2003

**Robert F. Engle** (né le 10 novembre 1942 à Syracuse, État de New York), a reçu le « Prix Nobel » d'économie en 2003 avec Clive Granger, « pour des méthodes d'analyse économique des séries temporelles économiques avec volatilité saisonnière (méthodes ARCH) ».

## Biographie

Après avoir passé son BS en physique au Williams College, Robert Engel est diplômé d'un Ph.D. à l'université Cornell en 1969. Il enseigne actuellement à la New York University, et à la Stern School of Business où il occupe le poste de "Michael Armellino Professor" en management des services financiers. Robert Engle avait auparavant travaillé à l'Université de Californie à San Diego (USCD), en 1975, qu'il quitta en 2003.

## Travaux principaux

Une des contributions les plus importantes de Robert Engle a été la découverte de méthodes pour analyser les mouvements imprévisibles des prix des marchés financiers et les niveaux des taux d'intérêts.

Une caractérisation précise et une bonne prédiction de ces mouvements volatils sont essentielles pour quantifier efficacement les risques de management. Par exemple, la mesure des risques joue un rôle-clé dans la recherche du prix des options et des produits financiers dérivés.

Mais alors que les précédentes recherches supposaient une volatilité constante et utilisaient des formules très simples d'approximation, Engle développa de nouveaux modèles statistiques de volatilité analysant la tendances des prix des

stocks et d'autres variables financières, à bouger entre des périodes de haute volatilité et de faible volatilité (Autoregressive Conditional Heteroskedasticity: ARCH). Ces modèles statistiques sont devenus des outils modernes essentiels aussi bien dans la pratique, que dans la théorie économique.




## Principaux articles

- "Autoregressive Conditional Heteroskedasticity With Estimates of the Variance of U.K. Inflation", *Econometrica* 50 (1982): 987-1008.
- "Estimation of Time Varying Risk Premia in the Term Structure: the ARCH-M Model" (avec David Lilien et Russell Robins), *Econometrica* 55 (1987): 391-407.
- "Co-integration and Error Correction: Representation, Estimation and Testing" (avec Clive Granger), *Econometrica* 55 (1987): 251-276.
- "Semi-parametric estimates of the relation between weather and electricity demand" (avec Clive Granger, J. Rice et A. Weiss), *Journal of American Statistical Association* 81 (1986): 310-320.
- "Exogeneity" (avec David F. Hendry et Jean-Francois Richard), *Econometrica* 51 (1983): 277-304.
- "Asset Pricing with a Factor ARCH Covariance Structure: Empirical Estimates for Treasury Bills" (avec V. Ng, et M. Rothschild), *Journal of Econometrics* 45 (1990): 213-237.
- "Dynamic Conditional Correlation - A Simple Class of Multivariate GARCH Models" *Journal of Business and Economic Statistics*, (Juillet 2002).

## Articles connexes

- Économétrie

## Lien externe

- (fr) Interview <sup>[1]</sup>
-  Portail de l'économie
-  Portail des États-Unis
-  Portail de l'éducation

## Références

[1] <http://www.ac-grenoble.fr/camille.vernet/spip.php?article88>

# Sources et contributeurs de l'article

**Robert F. Engle** *Source:* <http://fr.wikipedia.org/w/index.php?oldid=89980930> *Contributeurs:* Badmood, Bombastus, Cantons-de-l'Est, CommonsDelinker, Coyau, Drongou, Former user 1, Kilom691, MaCRoEco, Maurilbert, Mith, Oasisk, PAC2, Polmars, Recyclage, Ryo, Rémi, Stanlekub, Traleni, 3 modifications anonymes

## Source des images, licences et contributeurs

**Image:Disambig colour.svg** *Source:* [http://fr.wikipedia.org/w/index.php?title=Fichier:Disambig\\_colour.svg](http://fr.wikipedia.org/w/index.php?title=Fichier:Disambig_colour.svg) *Licence:* Public Domain *Contributeurs:* Bub's

**Fichier:Bush6NobelLaureates.jpg** *Source:* <http://fr.wikipedia.org/w/index.php?title=Fichier:Bush6NobelLaureates.jpg> *Licence:* Public Domain *Contributeurs:* Tina Hager

**Fichier:Emblem-money.svg** *Source:* <http://fr.wikipedia.org/w/index.php?title=Fichier:Emblem-money.svg> *Licence:* GNU General Public License *Contributeurs:* perfectska04

**Fichier:Flag of the United States.svg** *Source:* [http://fr.wikipedia.org/w/index.php?title=Fichier:Flag\\_of\\_the\\_United\\_States.svg](http://fr.wikipedia.org/w/index.php?title=Fichier:Flag_of_the_United_States.svg) *Licence:* Public Domain *Contributeurs:* Dbenbenn, Zscout370, Jacobolus, Indolences, Technion.

**Fichier:Books-aj.svg aj ashton 01.svg** *Source:* [http://fr.wikipedia.org/w/index.php?title=Fichier:Books-aj.svg\\_aj\\_ashton\\_01.svg](http://fr.wikipedia.org/w/index.php?title=Fichier:Books-aj.svg_aj_ashton_01.svg) *Licence:* Public Domain *Contributeurs:* Original author: AJ Ashton (on OpenClipArt). Code fixed by verdy\_p for XML conformance, and MediaWiki compatibility, using a stricter subset of SVG without the extensions of SVG editors, also cleaned up many unnecessary CSS attributes, or factorized them for faster performance and smaller size. All the variants linked below are based on this image.

## Licence

---

Creative Commons Attribution-Share Alike 3.0  
[//creativecommons.org/licenses/by-sa/3.0/](http://creativecommons.org/licenses/by-sa/3.0/)