


Robert Merton

Robert C. Merton



Robert C. Merton

Données clés

Naissance	31 juillet 1944 New York ( États-Unis)
Nationalité	américaine
Champs	finance internationale
Institutions	MIT, Harvard
Diplômé de	université Columbia, Caltech, MIT
Renommé pour	application des mathématiques aléatoires en temps continu (Calcul d'Itô) à l'économie, et surtout à l'étude des marchés financiers, modèle Black-Scholes
Distinctions	Prix Nobel d'économie en 1997, Médaille Kolmogorov 2010

Robert C. Merton (né le 31 juillet 1944 à New York) est un économiste américain, connu pour avoir appliqué les mathématiques aléatoires en temps continu (Calcul d'Itô) à l'économie, et surtout à l'étude des marchés financiers. Il a reçu avec Myron Scholes le Prix de la Banque de Suède en sciences économiques en mémoire d'Alfred Nobel en 1997 pour sa participation à la découverte du modèle de Black et Scholes de valorisation des options. Il est le fils du sociologue Robert King Merton.

Biographie

Après des études de mathématiques à l'université Columbia puis au Caltech, il fait une thèse d'économie au MIT sous la direction de Paul Samuelson^[1]. il est ensuite professeur au même MIT et plus tard à Harvard.

Comme Myron Scholes, il a été dirigeant associé du hedge fund Long Term Capital Management, depuis sa fondation en 1994 à sa spectaculaire quasi-faillite en septembre 1998.

Distinction reçues

- En 2010, Robert Merton reçoit la Médaille Kolmogorov pour son travail sur la finance^[2].

Références

[1] Analytical optimal control theory as applied to stochastic and non-stochastic economics

[2] <http://www.kolmogorov.clrc.rhul.ac.uk/pastwinners.html>

Sources et contributeurs de l'article

Robert Merton *Source*: <http://fr.wikipedia.org/w/index.php?oldid=92670025> *Contributeurs*: Alexboom, Archeos, Arkanosis, Badmood, Bbullot, Bertol, Bombastus, Cantons-de-l'Est, Chris93, EDUCA33E, Ffx, Hercule, Htournyol, Huster, Hégésippe Cormier, Jules78120, Kelson, Lehalle, MaCroEco, Maurilbert, Oasisk, Recyclage, Thierrym, Tintamarre, ~Pyb, 8 modifications anonymes

Source des images, licences et contributeurs

Fichier:Robert C. Merton.jpg *Source*: http://fr.wikipedia.org/w/index.php?title=Fichier:Robert_C._Merton.jpg *Licence*: Public Domain *Contributeurs*: Digarnick at en.wikipedia

Fichier:Flag of the United States.svg *Source*: http://fr.wikipedia.org/w/index.php?title=Fichier:Flag_of_the_United_States.svg *Licence*: Public Domain *Contributeurs*: Dbenbenn, Zscout370, Jacobolus, Indolences, Technion.

Licence

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