HAL open science

Modèle autogressif à valeurs entières avec arrondi

Maher Kachour

To cite this version:

Maher Kachour. Modèle autogressif à valeurs entières avec arrondi. Journées MAS et Journée en l'honneur de Jacques Neveu, Aug 2010, Talence, France. inria-00510350

HAL Id: inria-00510350

https://inria.hal.science/inria-00510350

Submitted on 18 Aug 2010

HAL is a multi-disciplinary open access archive for the deposit and dissemination of scientific research documents, whether they are published or not. The documents may come from teaching and research institutions in France or abroad, or from public or private research centers.

L'archive ouverte pluridisciplinaire **HAL**, est destinée au dépôt et à la diffusion de documents scientifiques de niveau recherche, publiés ou non, émanant des établissements d'enseignement et de recherche français ou étrangers, des laboratoires publics ou privés.

Journées MAS 2010, Bordeaux

Session : Séries chronologiques à valeurs entières

Modèle autogressif à valeurs entières avec arrondi

par **Maher Kachour**

Dans cet exposé, nous présentons une nouvelle classe de modèles autorégressifs à valeurs entières basés sur l'opérateur d'arrondi. Par rapport aux modèles INAR(p), ces modèles possèdent plusieurs avantages : une structure d'innovation plus simple ; signes arbitraires pour les valeurs de la série, pour les coefficients autoregréssifs. Nous étudions d'abord les conditions de stationarité pour ces modèles. Ensuite, nous étudions l'estimation des paramètres par la méthode des moindres carrés conditionnels. Des applications aux séries réelles seront examinées.

Adresse :
Maher Kachour
IRMAR, Université de Rennes 1
Campus de Beaulieu
35042 Rennes Cedex
E-mail : `maher.kachour@univ-rennes1.fr`