



Modélisation autorégressive à coefficients aléatoires

Lionel Truquet

► **To cite this version:**

Lionel Truquet. Modélisation autorégressive à coefficients aléatoires. Journées MAS et Journée en l'honneur de Jacques Neveu, Aug 2010, Talence, France. <inria-00510344>

HAL Id: inria-00510344

<https://hal.inria.fr/inria-00510344>

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

Modélisation autorégressive à coefficients aléatoires

par **Lionel Truquet**

Nous présenterons les différents modèles autorégressifs à valeurs entières positives introduits dans la littérature, leur structure de covariance, leur propriété de prévision ainsi les méthodes principales d'inférence. Dans une deuxième partie de cet exposé, nous envisagerons la construction de séries à valeurs dans \mathbb{Z} ainsi que la prédiction à l'aide de la variance conditionnelle en comparant l'hétéroscedasticité obtenue avec l'opérateur d'amincissement avec celle des modèles ARCH classiques.

Adresse :

Lionel TRUQUET
IRMAR, Université de Rennes 1
Campus de Beaulieu
35042 Rennes Cedex
E-mail : lionel.truquet@univ-rennes1.fr

Session : Séries chronologiques à valeurs entières