

Inférence statistique d'un modèle auto-régressif à seuil avec innovations dépendantes

Bruno SAUSSEREAU, Laboratoire de Mathématiques de Besançon, 16 route de Gray 25 030
Besançon cedex

Mots-clés : Série temporelle, modèles à seuil, mélange

Dans cet exposé, nous nous intéressons à un modèle auto-régressif d'ordre un avec un seuil. On ne supposera pas que le bruit est un processus indépendants mais juste non corrélé. Sous des hypothèses de mélange, on montrera la consistance de nos estimateurs et on étudiera leurs lois limites. Le point le plus intéressant étant la loi limite de l'estimateur du seuil qui fait intervenir un théorème limite de convergence vers un processus de Poisson composé sans utiliser les hypothèses classiques d'indépendance du bruit.

Références