



ID de Contribution: 1

Type: Non spécifié

échantillonnage aléatoire, processus gaussiens, mémoire de processus stationnaire.

jeudi 14 mars 2019 15:15 (50 minutes)

Dans cet exposé, nous nous intéressons à un processus stationnaire du second ordre $X=(a(t))_{t \in \mathbb{R}^+}$ défini en temps continu. Dans les faits, les processus à temps continu ne sont pas observés sur l'intégralité de leur trajectoire mais seulement à des instants discrets. On pose $Y=(Y(n))_{n \in \mathbb{N}}$ le processus échantillonné tel que $Y(n) = a(T_n)$ où T_n correspond à l'instant de la n -ième observation. On suppose que les inter-arrivées sont iid de densité sur \mathbb{R}^+ . Quelles sont les propriétés du processus initial qui sont préservées par échantillonnage ? En particulier, on donnera des résultats sur la mémoire du processus échantillonné Y par rapport au processus initial X , ainsi que sur la non-préservation du caractère gaussien.

Auteur principal: ROBET, Caroline (Université de Nantes ; Laboratoire Jean Leray)

Orateur: ROBET, Caroline (Université de Nantes ; Laboratoire Jean Leray)