

Série temporelles

ECTS : 4

Volume horaire : 39

Description du contenu de l'enseignement :

Volume horaire détaillé :

CM : 19h30

TD : 19h30

Processus stationnaires du second ordre.

Filtrage.

Processus ARMA.

Mesure spectrale d'un processus et théorème de Herglotz.

Prédiction linéaire.

Estimation statistique (si le temps le permet).

Compétence à acquérir :

Analyse des processus stationnaires du second ordre : filtrage, analyse spectrale, prédiction, estimation.

Document susceptible de mise à jour - 02/04/2026

Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16