

AUTOSPECTRE (C5, N)

(18 / 05 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

(i) Le terme de **spectre** se rapporte, par défaut, à un **processus stochastique** unique, ou à une **série temporelle** unique : il s'agit d'un processus (resp d'une série) « simple » (dans le cas général) ou « scalaire » (dans le cas numérique). On l'appelle parfois **autospectre**.

(ii) De ce terme se distingue la notion de **spectre croisé**, relative à une **famille** de processus ou de séries, étudié(e)s conjointement : il s'agit d'un processus (resp d'une série) « multiple » (dans le cas général) ou « vectoriel » dans le cas numérique (cf eg **processus vectoriel**).

Un processus pouvant être scalaire ou vectoriel, la distinction précédente n'est pas absolue : on peut appeler autospectre d'un processus multiple (resp vectoriel) l'ensemble des spectres croisés entre les processus simples (resp scalaires) définis par les « coordonnées » du processus considéré.