

CORRÉLATION CROISÉE (D2, D3, N)

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

(i) Une « **corrélation croisée** » est une **corrélation** existant :

(a) soit entre deux **variables aléatoires** ;

(b) soit entre deux **séries temporelles** (variables temporelles) ;

(c) soit entre deux **séries spatiales** (variables géométriques).

(i) Dans le cas d'une série temporelle (ou du **processus** dont elle est une **trajectoire**), ce type de corrélation peut être instantané (cf **coefficient de corrélation linéaire**) ou retardé (cf **corrélation croisée retardée**).