

SPECTRE CROISÉ (C5, N7)

(15 / 05 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

(i) En **analyse cospectrale**, soit X et Y deux **processus stochastiques** réels scalaires.

On appelle **spectre croisé** la **transformée de FOURIER** de la fonction de **covariance croisée retardée** de X par rapport à Y (cf **cospectre**, **périodogramme croisé**).

(ii) Le spectre croisé n'est autre que le produit du spectre d'**amplitude** et du spectre de **phase** du **processus vectoriel** (X, Y) .

(iii) La notion s'étend à un nombre fini de processus, ou processus vectoriel à plus de deux dimensions.