

SPECTRE (D'UN PROCESSUS STOCHASTIQUE) (N7)

Notion liée à la représentation d'un [processus stochastique](#) ou d'une [série temporelle](#) (cf [fonction de répartition spectrale](#)).

(i) La terminologie n'étant pas toujours fixée, le **spectre**, ou **autospectre**, peut désigner :

- (a) soit la [fonction de répartition spectrale](#), encore simplement appelée fonction spectrale ;
- (b) soit la [densité spectrale](#), notion qui dérive de la précédente ;
- (c) soit le [graphe](#) de l'une ou l'autre des notions précédentes.

Le graphe de la fr spectrale est aussi appelé **spectre intégré**. Par ailleurs, on appelle souvent **spectre** le graphe de la densité spectrale lorsqu'elle est exprimée en fonction de la [fréquence](#) (spectre de fréquence).

(ii) De même que l'on parle de **spectre théorique**, associé à un processus, on parle aussi de **spectre empirique**, associé à une série temporelle.