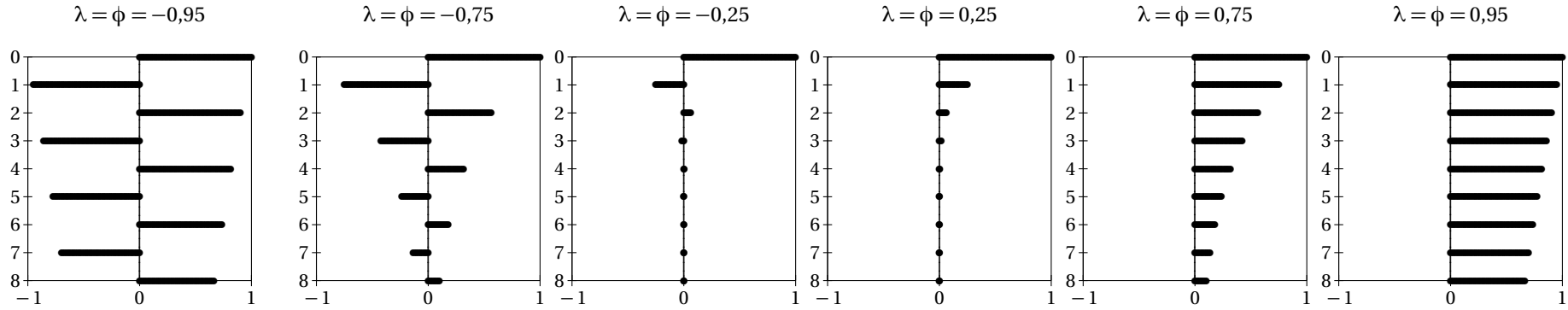


Document n°2 – Une collection de corrélogrammes

Processus AR(1) $(1 - \lambda L)x_t = x_t - \phi x_{t-1} = \varepsilon_t$ avec $\phi = \lambda$



Processus AR(2) $(1 - \lambda_1 L)(1 - \lambda_2 L)x_t = x_t - \phi_1 x_{t-1} - \phi_2 x_{t-2} = \varepsilon_t$ avec $\phi_1 = \lambda_1 + \lambda_2$ et $\phi_2 = -\lambda_1 \lambda_2$

