

Reprise du TP 3 ARMA

Question 1 : Saisir le principe de l'ARMA, programmer une fonction

Nous posons deux opérateurs pour $(\phi_1, \dots, \phi_p) \in \mathbb{R}^p$ et $(\theta_1, \dots, \theta_q) \in \mathbb{R}^q$. B est l'opérateur retard du cours.
 $\Phi(B) = I - \phi_1 B - \dots - \phi_p B^p$ et $\Theta(B) = I + \theta_1 B + \dots + \theta_q B^q$

(X_t) est un processus de type ARMA(p,q) si pour $m \in \mathbb{R}$ on a

$$\forall x \in$$

AR : Auto regressive associé à la partie en Φ

MA : Mouving average associé à la partie en Θ

```
simulerARMA <- function(n,m,Phi,Theta,s2) {  
  
}  
  
simulerARMA(4)
```

```
## NULL
```