

exo11 h2012

Q1- Montrez comment vous estimeriez les paramètres  $\phi_1, \phi_2, \phi_4$  du modèle suivant :

$y_t = \phi_1 y_{t-1} + \phi_2 y_{t-2} + \phi_4 y_{t-4} + \varepsilon_t$  avec  $\varepsilon_t \sim i.i.d.N(0, \sigma_\varepsilon^2)$  de manière efficace. Soyez précis.

Q2- Montrez comment vous estimeriez  $\phi_4$  du modèle suivant :  $y_t = \phi_4 y_{t-4} + \varepsilon_t$  avec  $\varepsilon_t \sim i.i.d.N(0, \sigma_\varepsilon^2)$  de manière efficace. Soyez précis.