
Comportement asymptotique du processus de Rosenblatt Ornstein-Uhlenbeck par rapport au paramètre de Hurst

Meryem Slaoui*¹ and Ciprian Tudor¹

¹Laboratoire Paul Painlevé - UMR 8524 – Université de Lille, Sciences et Technologies, Centre National de la Recherche Scientifique : UMR8524 – France

Résumé

Nous étudions la convergence en loi, lorsque $H \rightarrow \frac{1}{2}$ et lorsque $H \rightarrow 1$, de l'intégrale $\int_{-R}^R f(u) dZ_H(u)$,

*Intervenant