



# Séminaire conjoint Département OSD et CIRRELT

**ZINSOU MAX DEBALY**  
Docteur en statistiques mathématiques



Faculté des sciences de l'administration  
Département d'opérations  
et systèmes de décision

## APPLICATION DES ÉQUATIONS RÉCURSIVES STOCHASTIQUES EN STATISTIQUE

**Résumé:** Nous présentons des résultats classiques de stabilité des suites de variables aléatoires dépendantes définies par des équations récursives stochastiques et une extension pour les modèles de séries temporelles avec des variables exogènes. Ces résultats sont appliqués à des modèles usuels comme les modèles GARCH et CHARN mais aussi à des modèles plus récents comme les modèles INGARCH et MINGARCH. Nous donnons des applications de ces résultats en estimation statistique.

**Biographie:** Zinsou Max Debaly est docteur en statistiques mathématiques et a obtenu son doctorat en 2022 en FRANCE à l'ENSAI (Ecole Nationale de la Statistique et de l'Analyse de l'Information). Ses travaux de recherche portent sur les modèles de séries temporelles multivariées à valeurs discrètes. Il a publié dans plusieurs revues de statistique et d'économétrie. Il effectue également des travaux de recherche en sciences appliquées comme l'écologie et la biostatistique.

VENDREDI 5 AVRIL 2024  
10h00-10h30

Université Laval  
Pavillon Palasis-Prince  
Salle 2307

Ouvert à tous  
Café et viennoiseries

Responsable :  
Jacques Renaud