

PROJET SCIENTIFIQUE d'OLEG KLESOV

Oleg Klesov est un coauteur de longue date, il est aussi directeur du laboratoire d'analyse et de probabilités de l'université Polytechnique de Kiev.

Nous avons déjà publié de nombreux travaux conjoints et le travail proposé suit celui dont il avait proposé le germe lors de la conférence "non stationarité" des 4 au 6 juin partiellement organisée à l'IEA

il s'agit de développer une théorie des valeurs extrêmes pour des séries temporelles non stationnaires; plus précisément nous souhaitons donner des conditions pour l'existence d'une infinité de records pour des séries temporelles

Le cas de modèle à moyenne ou variance évoluant dans le temps faisait l'objet de la présentation de Klesov lors de cette conférence

Notre objectif est d'étendre ce type d'énoncé à des modèles pour lesquels la stationnarité est inhérente à la dynamique (comme les modèles autorégressifs). Très peu de choses sont actuellement connues dans le domaine des valeurs extrêmes pour ces cas non stationnaires.