



ELSEVIER

Available online at www.sciencedirect.com

SCIENCE @ DIRECT®

C. R. Acad. Sci. Paris, Ser. I 341 (2005) 369–374



<http://france.elsevier.com/direct/CRASS1/>

Statistique/Probabilités

Vitesse de convergence en norme p -intégrale et normalité asymptotique de l'estimateur crible de l'opérateur d'un ARB(1)

Fatiha Rachedi ^{a,b}

^a *Université Aboubekr Belkaid, département de mathématiques, Tlemcen 13000, Algérie*

^b *LSTA, université Paris 6, 175, rue du Chevaleret, 75013 Paris, France*

Reçu le 3 décembre 2004 ; accepté après révision le 3 mai 2005

Disponible sur Internet le 2 septembre 2005

Présenté par Paul Deheuvels

Résumé

Le modèle autorégressif dans un espace de Banach (ARB) permet de représenter des processus à temps continu (voir, par exemple, D. Bosq, *Linear Processes in Function Spaces: Theory and Applications*, 2000, Springer, p. 150). Dans cette Note, nous considérons l'estimation, par la méthode des moindres carrés, de l'opérateur d'un ARB(1) dans le cas où cet opérateur est strictement p -intégral, $p \in]1, \infty[$, en utilisant la méthode des cribles de Grenander. Nous montrons la convergence de l'estimateur crible et sa normalité asymptotique. *Pour citer cet article : F. Rachedi, C. R. Acad. Sci. Paris, Ser. I 341 (2005).*

© 2005 Académie des sciences. Publié par Elsevier SAS. Tous droits réservés.

Abstract

Rate of convergence for Sieve estimator of the operator in ARB(1) process. The autoregressive model in a Banach space (ARB) allows to represent many continuous time processes used in practice (see, for example, D. Bosq, *Linear Processes in Function Spaces: Theory and Applications*, 2000, Springer, p. 150). In this Note we study an estimator of the operator in ARB(1) by the least squares method, when the operator is strictly p -integral, $p \in]1, \infty[$, and we use Grenander's method of sieves (From U. Grenander, *Abstract Inference*, Wiley, 1981). We show consistency of the sieve estimator and we derive a central limit theorem for this estimator. *To cite this article: F. Rachedi, C. R. Acad. Sci. Paris, Ser. I 341 (2005).*

© 2005 Académie des sciences. Publié par Elsevier SAS. Tous droits réservés.

Abridged English version

Let (B, \mathcal{B}) be a separable Banach space equipped with its Borel σ -algebra and $(\varepsilon_n, n \in \mathbb{Z})$ a B -strong white noise. Let ρ an operator of $\mathcal{L}(B)$, the space of bounded linear operators from B to B , such that $\exists j_0 \in \mathbb{N}^*$ for

Adresse e-mail : rachedi@ccr.jussieu.fr (F. Rachedi).

which $\|\rho^{j_0}\|_{\mathcal{L}} < 1$. A random process $(X_n, n \in \mathbb{Z})$ defined on the probability space $(\Omega, \mathcal{A}, \mu)$ is said to be an autoregressive process of order one with values in B , if it satisfies the following relation:

$$X_n = \rho X_{n-1} + \varepsilon_n, \quad n \in \mathbb{Z}. \tag{1}$$

In this Note we derive almost sure convergence of the sieve estimator of ρ by using properties of spaces L^p . These properties allow us to extend the techniques used in [9] for the case of strictly 2-integral operator to strictly p -integral operator, $p > 1$. ρ is strictly p -integral if and only if there exists a measurable space $(\Gamma, \mathcal{F}, \nu)$, two bounded linear operators a and b from $L^p(\nu)$ to B and from B to $L^\infty(\nu)$ respectively, and an operator of multiplication M_ϕ from $L^\infty(\nu)$ to $L^p(\nu)$ (defined by $\phi \in L^p(\nu)$) such that $\rho = bM_\phi a$ (see ([3] p. 111)).

Let $(e_k^*, e_k)_{k \in \mathbb{N}}$ a Markushevich basis of $L^p(\nu)$ ([8]). To obtain a decomposition of ρ we suppose that $(ae_k)_{k \in \mathbb{N}}$ is a shrinking basis in B . In this case the operator ρ admits the following decomposition:

$$\rho(\cdot) = \sum_{k \geq 0} \alpha_k (e_k^*, e_k b(\cdot)) a e_k \tag{2}$$

where $\alpha_k = (e_k^*, \phi)$, $\forall k \geq 0$. We only consider here the case of known operators a and b , a case which is not too restrictive (see examples in [10]). Thus estimation of ρ passes through estimation of the coefficients $(\alpha_k)_k$ of ϕ . Let us set $\rho_k(\cdot) = (e_k^*, e_k b(\cdot)) a e_k$ $k \geq 0$ and $\Theta = \{\rho = \sum_{k \geq 0} \alpha_k \rho_k \mid (\alpha_k)_k \in \ell^p\}$. We consider the sieve

$$\Theta_m = \left\{ \rho = \sum_{k \geq 0} \alpha_k \rho_k \mid \alpha_k = 0, k > m \right\}, \quad m \geq 0, m = m(n) \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} +\infty.$$

Let (X_0, X_1, \dots, X_n) be a sample of the process defined in (1). Denoting by $(f_k^*)_{k \in \mathbb{N}}$ the sequence of functional coefficients of $(ae_k)_{k \in \mathbb{N}}$. The sieve estimator of ρ by least squares method is solution of the following equation:

$$\min_{\rho \in \Theta_m} \sum_{k=0}^m \left(\sum_{i=0}^n (f_k^*, X_i - \rho X_{i-1})^2 \right)^{p/2}.$$

In this Note we show the a.s. consistency of the sieve estimator for an empirical norm equivalent to the strictly p -integral norm and we derive a central limit theorem for this estimator.

1. Définitions et notations

Toutes les variables aléatoires considérées dans cette Note sont définies sur le même espace de probabilité $(\Omega, \mathcal{A}, \mu)$. (B, \mathcal{B}) est un espace de Banach séparable réel muni de sa tribu borélienne et de sa norme $\|\cdot\|$. Dans toute la suite $p \in]1, \infty[$ et q est tel que $\frac{1}{p} + \frac{1}{q} = 1$.

- (i) *Opérateur strictement p-intégral* : On note $\mathcal{L}(B)$ l'espace des opérateurs linéaires bornés de B dans B . Soit $\rho \in \mathcal{L}(B)$, d'après ([3] p. 111) ρ est strictement p -intégral si et seulement s'il existe un espace mesurable $(\Gamma, \mathcal{F}, \nu)$, deux opérateurs linéaires bornés a et b de $L^p(\nu)$ dans B et de B dans $L^\infty(\nu)$ respectivement, et un opérateur de multiplication M_ϕ de $L^\infty(\nu)$ dans $L^p(\nu)$ (défini par $\phi \in L^p(\nu)$) tel que $\rho = bM_\phi a$. On note $\mathcal{J}_p(B)$ l'ensemble des opérateurs strictement p -intégraux, muni de sa norme p -intégrale définie par $\|\rho\|_p = \inf_{a,b,\phi} \|b\|_{\mathcal{L}} \cdot \|M_\phi\|_{L^p} \cdot \|a\|_{\mathcal{L}}$, $\rho \in \mathcal{J}_p(B)$. On a $\|\rho\|_{\mathcal{L}} \leq \|\rho\|_p$.
- (ii) *Base dans un espace de Banach* Soient $(x_k)_k$ une base dans B et $(y_k^*)_k$ la suite des fonctionnelles de coefficients associée à cette base. Si la suite $(y_k^*)_k$ des fonctionnelles de coefficients forme une base dans B^* , $(x_k)_k$ est dite base de shrinking. En général si B est un espace de Banach tel que B^* admet une base $(y_k^*)_k$, alors B admet une base de shrinking ([7] p. 10, [5]). On note (\cdot, \cdot) le crochet de dualité entre B et B^* . Une suite $(y_k^*)_k$ dans B^* est dite suite basique faible s'il existe une suite $(x_k)_k$ dans B telle que $(y_k^*, x_j) = \delta_{kj}$. Le couple $(y_k^*, x_k)_k$ est dit système biorthogonal, il est dit base de Markushevich dans B si l'espace engendré par $(x_k)_k$,

noté $[x_k]_k$, est dense dans B et $[y_k^*]_k$ est faiblement dense dans B^* . En outre tout espace de Banach séparable B admet une base de Markushevich $(y_k^*, x_k)_k$ vérifiant : $\exists \varepsilon > 0$ tel que $\|x\|_k \cdot \|y^*\|_k \leq 1 + \varepsilon \forall k$, [8].

- (iii) *Crible* : Nous notons Θ l'espace des paramètres muni d'une métrique d . Un crible pour l'espace paramétrique Θ est une suite de sous ensembles $\{\Theta_m\}$ de Θ telles que Θ_m est compact, $\Theta_m \subset \Theta_{m+1}$, et $\Theta = \bigcup \Theta_m$ est dense dans Θ [4].

1.1. Le modèle

Un processus autorégressif d'ordre 1 dans un espace de Banach (ARB(1)) est une suite $(X_t, t \in \mathbb{Z})$ de variables aléatoires à valeurs dans B telle que :

$$X_t = \rho(X_{t-1}) + \varepsilon_t, \quad t \in \mathbb{Z} \tag{3}$$

où $\rho \in \mathcal{J}_p(B)$ et vérifie $\|\rho\|^{j_0} < 1$ pour un $j_0 \geq 1$, et $\varepsilon = (\varepsilon_t, t \in \mathbb{Z})$ est un bruit blanc fort dans B . Par la suite nous notons $\rho(X_{t-1})$ par ρX_{t-1} , $t \in \mathbb{Z}$. Le problème est l'estimation de l'opérateur ρ .

Dans cette Note nous montrons la convergence de l'estimateur crible de ρ en utilisant les propriétés des espaces L^p . Ces propriétés nous ont permis de généraliser les techniques utilisées dans [9] dans le cas d'un opérateur strictement 2-intégral.

Soit P la loi de probabilité de X_0 dans (B, \mathcal{B}) , d'après ([1] p. 149) $X_0 \in L^2_B(P)$. Soit (X_0, X_1, \dots, X_n) les observations du processus vérifiant (3), on définit les opérateurs de covariance et de covariance croisée de X_0 par $C(x^*) = E((x^*, X_0)X_0)$ et $D(x^*) = E((x^*, X_0)X_1)$ respectivement, $x^* \in B^*$. Les opérateurs de covariance empirique et covariance croisée empirique de X_0 sont :

$$C_n(x^*) = \frac{1}{n} \sum_{i=0}^{n-1} (x^*, X_i)X_i \quad \text{et} \quad D_n(x^*) = \frac{1}{n} \sum_{i=0}^{n-1} (x^*, X_i)X_{i+1} \quad \text{respectivement, } x^* \in B^*.$$

1.2. Hypothèses

- (i) Soit $(e_k^*, e_k)_{k \in \mathbb{N}}$ une base de Markushevich dans $L^p(\nu)$. Pour obtenir une décomposition de ρ nous supposons que $(ae_k)_{k \in \mathbb{N}}$ est une base de shrinking dans B . Notons $(f_k^*)_{k \in \mathbb{N}}$ la suite des fonctionnelles de coefficients associée à $(ae_k)_{k \in \mathbb{N}}$. Dans ce cas l'opérateur ρ s'écrit :

$$\rho(\cdot) = \sum_{k \geq 0} \alpha_k (e_k^*, e_k b(\cdot)) ae_k \tag{4}$$

où $\alpha_k = (e_k^*, \phi)$, $\forall k \geq 0$. Dans certains cas les opérateurs a et b sont connus. Le fait de considérer que a et b sont connus, n'est pas très restrictif (voir exemples dans [10]). Ainsi l'estimation de ρ revient à l'estimation des coefficients $(\alpha_k)_k$ de ϕ .

Soit la suite des opérateurs $\rho_k(\cdot) = (e_k^*, e_k b(\cdot)) ae_k$, $k \geq 0$, ρ_k est un opérateur de rang 1. Soit $(\alpha_k)_k \in \ell^p$, posons $\rho_N = \sum_{k=0}^N \alpha_k \rho_k$, alors ρ_N converge vers $\rho = \sum_{k \geq 0} \alpha_k \rho_k$ par rapport à la norme strictement p -intégrale donc linéaire. On pose $\xi_k = (C \rho_k^* f_k^*, \rho_k^* f_k^*)$, $k \geq 0$, $(\xi_k)_k \in \ell^\infty$.

- (ii) $\forall k \geq 0$ les v.a. réelles $(f_k^*, \varepsilon_n)_n$ sont indépendantes et de même variance σ_k^2 , nous supposons que $\sigma = (\sum_{k \geq 0} \sigma_k^p / (\xi_k^p \mathbb{I}_{\{\xi_k > 0\}}))^{1/p} < \infty$.
- (iii) Soit $F_i = (\cdot, X_{i-1})\varepsilon_i$ et $G_i = (\cdot, \varepsilon_i)\varepsilon_i$, $i \in \mathbb{Z}$. $E(G_i) = E^{B_{i-1}}(G_i) = C_\varepsilon$, $i \in \mathbb{Z}$. Posons $E_i = ((F_i \rho_k^* f_k^*, f_k^*) / (\xi_k \mathbb{I}_{\{\xi_k > 0\}}))_{k \geq 0}$, c'est une variable aléatoire à valeurs dans $(\ell^p, \|\cdot\|_p)$ où $\|\cdot\|_p$ désigne la norme usuelle de ℓ^p , $i \in \mathbb{Z}$. F_i est une différence de martingale dans B (voir [1] p. 166, [2]), alors E_i est une différence de martingale dans ℓ^p , $i \in \mathbb{Z}$. On pose $\bar{E}_n = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n E_i$ et $C_{E_1}(x^*) = E((x^*, E_1)E_1)$, $x^* \in B^*$.

1.3. Construction de l'estimateur crible

Soit $\Theta = \{\rho = \sum_{k \geq 0} \alpha_k \rho_k \mid (\alpha_k)_k \in \ell^p\} \subset \mathcal{J}_p(B)$.

On peut munir Θ de la norme $\|\rho\|_p = (\sum_{k \geq 0} |\alpha_k|^p)^{1/p}$, qui est équivalente à la norme p -intégrale.

Dans ce paragraphe nous définissons les cribles en utilisant la décomposition (4) de ρ . Nous considérons le crible :

$$\Theta_m = \left\{ \rho = \sum_{k \geq 0} \alpha_k \rho_k \mid \alpha_k = 0, k > m \right\}, \quad m \geq 0, m = m(n) \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} +\infty.$$

L'estimateur crible de ρ par la méthode des moindres carrés est solution de l'équation suivante :

$$\min_{\rho \in \Theta_m} \sum_{k=0}^m \left(\sum_{i=0}^{n-1} (f_k^*, X_{i+1} - \rho X_i)^2 \right)^{p/2}.$$

La solution est donnée dans le lemme suivant :

Lemme 1.1. Si $(C_n \rho_k^* f_k^*, \rho_k^* f_k^*) > 0$ pour $k = 0, \dots, m$; l'estimateur crible de ρ est l'opérateur

$$\hat{\rho}_m = \sum_{k=0}^m \hat{\alpha}_k \rho_k$$

où

$$\hat{\alpha}_k = \frac{(D_n \rho_k^* f_k^*, f_k^*)}{(C_n \rho_k^* f_k^*, \rho_k^* f_k^*)}, \quad k = 0, \dots, m.$$

2. Convergence de l'estimateur crible

Pour la convergence de l'estimateur crible nous utilisons les conditions suivantes :

C₁ : ε_t est une v.a. pré-gaussienne, $t \in \mathbb{Z}$, (cf. [6]).

C₂ : $E(\exp \gamma \|E_1\|_p) < \infty$ pour un $\gamma > 0$.

C₃ : $\|X_t\| \leq c_0$, où c_0 est une constante.

C₄ : $E\|X_t\|^4 < \infty$, $t \in \mathbb{Z}$.

C₅ : $\sup_{i \geq 1} E\|E_i\|_p^{2+\delta} < \infty$ pour un $\delta > 0$.

Nous supposons que $\xi_k > 0$, pour $k = 0, \dots, m$.

Soient $w_{k,n} = (C_n \rho_k^* f_k^*, \rho_k^* f_k^*) / \xi_k$ et $\lambda_m = \min_{k=0, \dots, m} \xi_k$, $k = 0, \dots, m$; et Π_m la projection de Θ sur Θ_m .

On peut munir Θ_m de la norme empirique : $\forall \rho \in \Theta_m$, $\|\Pi_m \rho\|_n = (\sum_{k=0}^m w_{k,n}^p |\alpha_k|^p)^{1/p}$.

Soit $\rho_0 = \sum_{k \geq 0} \alpha_{0,k} \rho_k$ la vraie valeur de ρ , on pose $\rho_m = \Pi_m \rho_0$.

Dans la proposition suivante nous montrons qu'il suffit d'utiliser la norme empirique pour montrer la convergence de l'estimateur crible :

Proposition 2.1. Si (C₄) est vérifiée et si $n^{1/2} \lambda_{m_n} (\log n)^{-\beta} \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} +\infty$ alors :

$$\left(\forall \beta > \frac{1}{2} \right), \quad n^{1/2} \lambda_{m_n} (\log n)^{-\beta} \left| \|\Pi_m \rho\|_n^p - \|\Pi_m \rho\|_p^p \right| \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{p.s.} 0, \quad \rho \in \Theta.$$

Donc la convergence de $\hat{\rho}_m$ par rapport à la norme empirique entraîne sa convergence par rapport à la norme strictement p -intégrale.

Dans la proposition suivante nous donnons les propriétés et la vitesse de convergence de la moyenne empirique du bruit blanc E_n , qui permet de déduire celles de $\hat{\rho}_m$. On note \mathcal{D} la convergence en loi :

Proposition 2.2. *Quelle que soit la vitesse considérée du crible $m = m(n) \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} +\infty$ on a :*

(i) Si (C_1) est vérifiée alors :

$$n^{1/\min(2,p)} (\log n)^{-\beta/\min(2,p)} \|\Pi_m \bar{E}_n\|_p \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{p.s.} 0 \quad p.s. \quad \forall \beta > 1.$$

(ii) Si (C_2) et (C_3) sont vérifiées alors $\forall \eta > 0$:

$$P(\|\Pi_m \bar{E}_n\|_p > \eta) \leq 2 \exp\left(-\frac{n\eta^2}{8nl^2 + 4L\eta}\right)$$

où $l > 0$ et $L > 0$ sont deux constantes.

De plus on a :

$$n^{-1/2} (\log \log n)^{-1/2} \|\Pi_m \bar{E}_n\|_p \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{p.s.} 0 \quad p.s.$$

(iii) Si (C_5) est vérifiée alors $\forall u^* \in \ell^q$:

$$\sqrt{n} (u^*, \Pi_m \bar{E}_n) \xrightarrow{\mathcal{D}} N \sim \mathcal{N}(0, E(u^*, E_1)^2).$$

Dans le cas particulier $p = 2$ on a :

$$\sqrt{n} \Pi_m \bar{E}_n \xrightarrow{\mathcal{D}} N \sim \mathcal{N}(0, C_{E_1})$$

où \mathcal{D} désigne la convergence en loi dans ℓ^2 .

Remarque 1. La condition (C_1) n'est pas nécessaire dans le cas $p = 2$.

Dans le théorème suivant nous donnons la vitesse de convergence de $\hat{\rho}_m$ pour tout choix de $m = m(n)$. Ainsi on peut choisir $m = m(n)$ tel que $\|\mathbb{I} - \Pi_m \rho_0\|_p = (\sum_{k>m(n)} \alpha_k^p)^{1/p}$ a la même vitesse de convergence que $\|\hat{\rho}_m - \rho_m\|_n$.

Théorème 2.3. (i) Si (C_1) est vérifiée alors pour tout choix de $m = m(n)$:

$$n^{1/\min(2,p)} (\log n)^{-\beta/\min(2,p)} \|\hat{\rho}_m - \rho_m\|_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{p.s.} 0 \quad p.s. \quad \forall \beta > 1$$

(ii) Si (C_2) et (C_3) sont vérifiées alors pour tout $m = m(n)$ et $\forall \eta > 0$:

$$P(\|\hat{\rho}_m - \rho_m\|_n > \eta) \leq 2 \exp\left(-\frac{n\eta^2}{24nK^2 + 16L\eta}\right)$$

où $K > 0$ et $L > 0$ sont deux constantes.

De plus on a :

$$n^{1/2} (\log \log n)^{-1/2} \|\hat{\rho}_m - \rho_m\|_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{p.s.} 0 \quad p.s.$$

(iii) Si (C_5) est vérifiée et si $n^{1/2} \lambda_{m_n} (\log n)^{-\beta} \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} +\infty$ alors $\forall \theta^* \in \Theta^*$:

$$\sqrt{n} (\theta^*, \hat{\rho}_m - \rho_m) \xrightarrow{\mathcal{D}} N \sim \mathcal{N}(0, E(\zeta^*, E_1)^2)$$

où ζ^* est la suite dans ℓ^q associée à θ^* .

Dans le cas particulier $p = 2$ on a :

$$\sqrt{n}(\hat{\rho}_m - \rho_m) \xrightarrow{\mathcal{D}} N \sim \mathcal{N}(0, C_{E_1})$$

où \mathcal{D} désigne la convergence en loi dans \mathcal{J}_2 .

Exemple 1. Soit $\rho \in \mathcal{D}(\ell^\infty, \ell^\infty)$ défini par $\alpha = (\alpha_k)_{k \in \mathbb{N}} \in \ell^p$ alors ρ est p -nucléaire [3], d'image dans ℓ^p tel que $\|\rho\|_p = \|\alpha\|_{\ell^p}$. L'opérateur a est l'injection de ℓ^p dans ℓ^∞ et b est l'identité dans ℓ^∞ . Dans ce cas l'estimation de ρ revient à l'estimation de α dans ℓ^p car ρ s'écrit $\rho(\cdot) = \sum_{k \in \mathbb{N}} \alpha_k (e_k, \cdot) e_k$, où $(e_k)_{k \in \mathbb{N}}$ est la base canonique de ℓ^p .

Références

- [1] D. Bosq, Linear Processes in Function Spaces: Theory and Applications, Springer, 2000.
- [2] D. Bosq, Estimation of mean and covariance operator of autoregressive processes in Banach spaces, Statist. Inference Stochastic Process. 5 (2002) 287–306.
- [3] J. Diestel, H. Jarchow, A. Tonge, Absolutely Summing Operators, Cambridge University Press, Cambridge, 1995.
- [4] U. Grenander, Abstract Inference, Wiley, New York, 1981.
- [5] V.M. Kadets, M.I. Kadets, Rearrangements of Series in Banach Spaces, American Mathematical Society, 1991.
- [6] M. Ledoux, M. Talagrand, Probability in Banach Spaces, Springer-Verlag, Berlin, 1991.
- [7] J. Lindenstrauss, L. Tzaferi, Classical Banach Spaces I: Sequences Spaces, Ser. Modern Surveys Math., Springer-Verlag, 1977.
- [8] A. Pelczynski, All separable Banach spaces admit for every $\varepsilon > 0$ fundamental and total biorthogonal sequences bounded by $(1 + \varepsilon)$, Studia Math. 55 (1976) 295–304.
- [9] F. Rachedi, Vitesse de convergence de l'estimateur crible d'un processus ARB(1), Ann. ISUP 48 (3) (2004) 87–97.
- [10] F. Rachedi, T. Mourid, Estimateur crible de l'opérateur d'un processus ARB(1), C. R. Acad. Sci. Paris Sér. I 336 (2003) 605–610.

Further reading

- [11] J.S. Gal, Sur les moyennes arithmétiques des suites de fonctions orthogonales, Ann. Inst. Fourier 1 (1949) 53–56.