

THÉORÈMES DE CONVERGENCE DE CERTAINES FONCTIONNELLES MARKOVIENNES VERS DES PROCESSUS STABLES.

Les théorèmes de convergence font l'objet d'études intenses en théorie des probabilités, pour des applications en statistiques et aussi pour des fins théoriques. Nous considérons des fonctionnelles d'une chaîne de Markov ergodique à temps discret et décrivons des conditions pour la convergence vers un processus stable d'indice $\alpha \in (0, 2]$. Dans le cas où $\alpha = 2$, cela correspond à une convergence vers un mouvement brownien et requiert des conditions de trou spectral ou l'inégalité de Poincaré vérifiée par la mesure invariante de la chaîne. Dans le cas où $\alpha \in (0, 2)$, les choses deviennent différentes et nous avons besoin en plus de l'hyperbornitude (ou hypercontractivité) de l'opérateur de transition P associé à la chaîne de Markov. Notre approche pour une telle étude, est basée sur l'utilisation des mesures de dépendance, qu'on appelle la technique du mélange.