

INTRODUCTION AUX SÉRIES TEMPORELLES

Daniel Szpiro

Chapitre 1 Présentation des séries chronologiques

section 1 Généralités

1.1 Définition d'une série, rôle de la statistique descriptive standard

1.2 Deux définitions du temps

section 2 Les objectifs de l'analyse

2.1 Prévoir le futur à partir du passé

2.2 Interpréter les données récentes

section 3 Le cadre temporel

3.1 Répétition cyclique du temps

3.2 Stabilité des structures

3.3 Permanence de la définition de la grandeur

Chapitre 2 l'analyse des séries chronologiques

section 1 Les éléments constitutifs d'une série

1.1 Définitions

1.2 Hypothèses

section 2 La méthode analytique

2.1 Coefficients saisonniers

2.2 Estimation de la tendance

section 3 La méthode par élimination

section 4 Les moyennes mobiles

4.1 Définitions

4.2 Estimation de la tendance

4.3 Les coefficients saisonniers

4.4 L'effet Slutsky-Yule

4.5 Le traitement des fins de séries

section 5 La correction des jours ouvrables

5.1 Situation du problème

5.2 Aperçu du principe de correction

Chapitre 3 le lissage exponentiel

section 1 Définition

section 2 Lien avec les anticipations adaptatives

section 3 Cas d'une série constante au voisinage de la date de prévision

Références bibliographiques :

Calot G. : Statistique Descriptive, Dunod

Pour en savoir plus :

Gourieroux C & Monfort A : Séries temporelles et modèles dynamiques, ed Economica, 664 p

Maillard V. : « Théorie et pratique de la correction des effets de jours ouvrables », Document de travail INSEE, G9405, 35 p