

Table des matières

Introduction	Erreur ! Signet non défini.
Chapitre 1 : Introduction à l'analyse classique de séries chronologiques.....	2
1.1 Présentation d'une série temporelle	2
1.2 Analyse des composantes d'une série temporelle.....	3
1.2.1 La méthode de la bande	3
1.2.2 La méthode du profil.....	4
1.2.3 La méthode de Buys et Ballot.....	4
1.2.4 Analyse de la tendance.....	6
1.2.5 Analyse de la composante aléatoire	6
1.2.6 Analyse de la composante cyclique	7
1.2.7 Analyse de la composante saisonnière	7
1.3 Test de Ficher d'analyse de la variance (tests de détection de la tendance et de la saisonnalité).....	9
1.4 La désaisonnalisation	12
1.7 Les techniques de prévision dans les séries chronologiques.....	Erreur ! Signet non défini.
1.7.1 Le lissage exponentiel	Erreur ! Signet non défini.
1.7.2 Lissage exponentiel simple	Erreur ! Signet non défini.
1.7.3 Le lissage exponentiel double	Erreur ! Signet non défini.
1.7.4 La méthode de Holt-Winters	Erreur ! Signet non défini.
Séries d'exercices.....	20
Chapitre 2 : Stationnarité et autocorrélation simple et partiel.....	32
2.1 Processus stationnaire	32
2.1.1 Fonction d'autocorrélation simple et partielle	32
2.2 Test de Bruit Blanc et de stationnarité	Erreur ! Signet non défini.
2.2.1 Test de Box-Pierce et de Ljung- Box.....	35
2.3 Analyse de la fonction d'autocorrélation	Erreur ! Signet non défini.
Série d'exercice n°2	Erreur ! Signet non défini.
Chapitre 3 : Prévision et modélisation univariée.	Erreur ! Signet non défini.
3.1 Etude de la stationnarité des séries.....	Erreur ! Signet non défini.
3.1.1 Les Processus TS	43
3.1.2 Les Processus DS.....	43
3.2 Test de racine unitaire Dickey-Fuller.....	44

3.3 Test de racine unitaire Dickey-Fuller augmenté	44
3.3.1 Stratégie du test ADF.....	45
3.4 Les modèles autorégressifs moyenne mobile (ARMA).....	47
3.4.1 Typologie des modèles ARMA	47
3.5 La méthode de Box-Jenkins	Erreur ! Signet non défini.
3.5.1 L'étape d'identification de p et de q.....	51
3.5.2 L'estimation des paramètres.....	51
3.5.3 La validation du processus ARMA	52
3.5.4 La prévision.....	53
Séries d'exercices n°3	Erreur ! Signet non défini.
Conclusion.....	69
Bibliographie.....	70
Table des matières.....	71