

[CVS101] Introduction à la correction des variations saisonnières

Ce stage est destiné aux personnes désireuses de découvrir les principes et l'intérêt de la désaisonnalisation (ou correction des variations saisonnières). Il couvre principalement les méthodes basées sur les moyennes mobiles et se termine sur un panorama des méthodes de désaisonnalisation.

Ce cours est prévu sous forme appliquée ; seules les formules indispensables seront présentées.

Durée : 1 jour

Logiciels possibles : SAS, SAS Enterprise Guide (code), R, WPS, SPSS, JDemetra+



Pré-requis : AEDT

1. Les objectifs et les principes de la désaisonnalisation

- Les composantes d'une série temporelle : tendance, cycle, saisonnalité, Effets de calendrier, points atypiques
- Pourquoi désaisonnaliser une série temporelle ?
- Une méthode de désaisonnalisation naïve : le glissement annuel.

2. Décomposition d'une série temporelle par moyenne mobile

- Les moyennes mobiles : construction et propriétés
- Un algorithme simple de désaisonnalisation
- La méthode X-12
- Prise en compte des points atypiques : la méthode X-12-ARIMA

3. Panorama des méthodes de désaisonnalisation

- Méthodes paramétriques et méthodes non-paramétriques
- Les méthodes basées sur des modèles explicites : Tramo-Seats (modèles ARIMA) et les modèles « espace-état »
- Un panorama complet des méthodes