

SOMMAIRE

| | <i>Page</i> |
|---|-------------|
| 1 - INTRODUCTION GENERALE | 5 |
| 11 - Qu'est-ce qu'une série chronologique ? | 5 |
| 12 - Quels types de séries peut-on analyser ? | 5 |
| 13 - Comment débiter l'analyse d'une série ? | 7 |
| 14 - Les différentes composantes d'une série | 11 |
| 15 - Objectifs de l'étude d'une série | 15 |
| | |
| 2 - LES METHODES DE DECOMPOSITION | 17 |
| 21 - Introduction | 17 |
| 22 - Un exemple de désaisonnalisation d'une série | 17 |
| 23 - Les modèles de décomposition | 21 |
| 24 - Choix d'un modèle de décomposition | 23 |
| 25 - Estimation des composantes de la série | 25 |
| | |
| 3 - LES PREVISIONS PAR LISSAGE | 33 |
| 31 - Introduction | 33 |
| 32 - Séries sans tendance et sans composante saisonnière | 33 |
| 33 - Séries avec tendance et sans composante saisonnière | 39 |
| 34 - Séries avec tendance et composante saisonnière | 47 |
| | |
| 4 - LES PREVISIONS PAR LA METHODOLOGIE DE BOX ET JENKINS | 53 |
| 41 - Introduction | 53 |
| 42 - Transformation préliminaire des séries | 55 |
| 43 - Autocorrélogramme et autocorrélogramme partiel | 61 |
| 44 - Un exemple : le processus autorégressif d'ordre 1 | 63 |
| | |
| 5 - QUELQUES COMPLEMENTS | 75 |
| 51 - Introduction | 75 |
| 52 - Données manquantes | 75 |
| 53 - Données anormales | 79 |
| 54 - Choix d'une méthode d'analyse | 79 |
| | |
| 6 - REFERENCES BIBLIOGRAPHIQUES | 80 |