



Institut national de la statistique
et des études économiques

Mesurer pour comprendre

Estimation en temps réel de la tendance-cycle : Apport de l'utilisation des filtres asymétriques dans la détection des points de retournement

ALAIN QUARTIER-LA-TENTE
16 Mai 2023

Définition du sujet

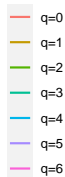
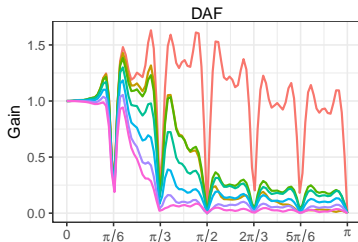
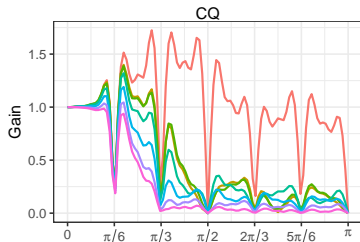
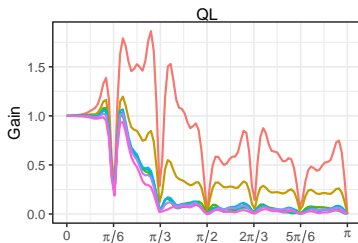
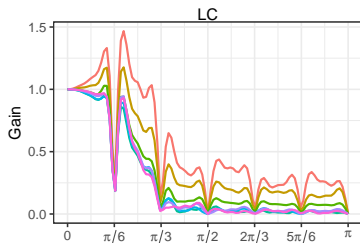
Point de retournement, lissage, X-13?

FST

- Poids trouvés en minimisant le déphasage observé sur les séries simulées
- Poids non normalisés peuvent avoir un avantage : on associe un poids décroissant à la *timeliness*

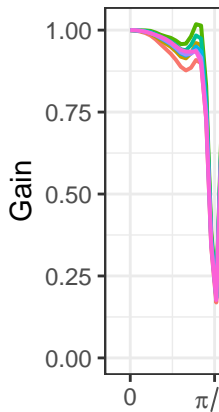
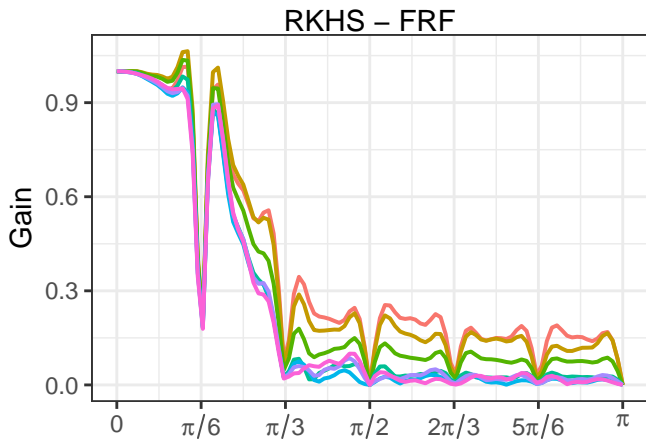
rjd3filters

```
knitr::include_graphics("img/gain_lp.pdf")
```



rjd3filters

```
knitr::include_graphics("img/gain_autres.pdf")
```



RKHS – phase