



# Détection en temps réels des points de retournement : Apport de l'utilisation des filtres asymétriques dans l'analyse conjoncturelle

ALAIN QUARTIER-LA-TENTE

# Travaux actuels

---

- Il est possible de mettre toutes les méthodes étudiées dans de la théorie générale de Grun-Rehorme et alii (2018)

# Travaux actuels

---

- Il est possible de mettre toutes les méthodes étudiées dans de la théorie générale de Grun-Rehorme et alii (2018) ➡ donne des diagrammes généraux plus ou moins lisibles

# Travaux actuels

---

- Il est possible de mettre toutes les méthodes étudiées dans de la théorie générale de Grun-Rehorme et alii (2018) ➡ donne des diagrammes généraux plus ou moins lisibles ➡ permet de clarifier certains liens (ex : Proietti et RKHS)

# Travaux actuels

---

- Il est possible de mettre toutes les méthodes étudiées dans de la théorie générale de Grun-Rehorme et alii (2018) ➡ donne des diagrammes généraux plus ou moins lisibles ➡ permet de clarifier certains liens (ex : Proietti et RKHS)
- package `R` `rjdfilters` ➡ réflexions autour d'une interface plus générale sur les filtres finis ou infinis pour faire facilement des opérations.

# Travaux actuels

---

- Il est possible de mettre toutes les méthodes étudiées dans de la théorie générale de Grun-Rehorme et alii (2018) ➡ donne des diagrammes généraux plus ou moins lisibles ➡ permet de clarifier certains liens (ex : Proietti et RKHS)
- package `R` `rjdfilters` ➡ réflexions autour d'une interface plus générale sur les filtres finis ou infinis pour faire facilement des opérations.
- comparaison empirique sur séries d'IPI de l'UE : méthode actuelle de X-13ARIMA semble la plus performante

# Discussion

---

- Faut-il...
  - simplifier les applications en appliquant uniquement les méthodes sur les séries désaisonnalisées ?
  - reestimer la série linéarisée à chaque date ? Quid de l'hypothèse d'orthogonalité entre les composantes ?

# Discussion

---

- Faut-il...
  - simplifier les applications en appliquant uniquement les méthodes sur les séries désaisonnalisées ?
  - reestimer la série linéarisée à chaque date ? Quid de l'hypothèse d'orthogonalité entre les composantes ?
- Quel définition retenir pour le déphasage ? Utiliser des indicateurs statistiques ( $\mathbb{P}$  détecter le point de retournement en  $i$  mois) ? Révisions entre deux dates consécutives ?



# Discussion

---

- Faut-il...
  - simplifier les applications en appliquant uniquement les méthodes sur les séries désaisonnalisées ?
  - reestimer la série linéarisée à chaque date ? Quid de l'hypothèse d'orthogonalité entre les composantes ?
- Quel définition retenir pour le déphasage ? Utiliser des indicateurs statistiques ( $\mathbb{P}$  détecter le point de retournement en  $i$  mois) ? Révisions entre deux dates consécutives ?
- Fonction de gain et déphasage filtre final de X-11 ; *time path* de la *timeliness* pour comparer les méthodes ?

# Discussion

---

- Faut-il...
  - simplifier les applications en appliquant uniquement les méthodes sur les séries désaisonnalisées ?
  - reestimer la série linéarisée à chaque date ? Quid de l'hypothèse d'orthogonalité entre les composantes ?
- Quel définition retenir pour le déphasage ? Utiliser des indicateurs statistiques ( $\mathbb{P}$  détecter le point de retournement en  $i$  mois) ? Révisions entre deux dates consécutives ?
- Fonction de gain et déphasage filtre final de X-11 ; *time path* de la *timeliness* pour comparer les méthodes ?
- Continuer la comparaison de différentes méthodes ? étudier d'autres séries ? Changer le filtre symétrique ?

# Discussion

---

- Faut-il...
  - simplifier les applications en appliquant uniquement les méthodes sur les séries désaisonnalisées ?
  - reestimer la série linéarisée à chaque date ? Quid de l'hypothèse d'orthogonalité entre les composantes ?
- Quel définition retenir pour le déphasage ? Utiliser des indicateurs statistiques ( $\mathbb{P}$  détecter le point de retournement en  $i$  mois) ? Révisions entre deux dates consécutives ?
- Fonction de gain et déphasage filtre final de X-11 ; *time path* de la *timeliness* pour comparer les méthodes ?
- Continuer la comparaison de différentes méthodes ? étudier d'autres séries ? Changer le filtre symétrique ?
- Tester des longueurs différentes pour les MM asymétriques ? I-C ratios locaux ?