

Économétrie des Séries Temporelles

Fiche TD R #1

Analyse de Séries Temporelles et Propriétés Stochastiques

Packages

```
library(readr)
library(zoo)
library(astsa)
```

Données

Nice : <https://drive.google.com/file/d/1QYI5dGRSb8jY2kxWyIOWhudSLalQt9Q5/view?usp=sharing>

Paris : https://drive.google.com/file/d/1Ptq3-aA2yFsw1nL3V0fPZ2-l8l_J7VkX/view?usp=sharing

Exercices

1. Donnez une représentation graphique des données d'insolation de Nice et Paris. Incluez graphiquement les moyennes respectives à l'aide de la fonction `abline()`.
2. Simulez un processus complètement aléatoire de 51 observations avec des valeurs indépendantes pour ces "distributions" :
 - (a) WN
 - (b) $\mathcal{N}(0, 1)$
 - (c) χ^2_2
 - (d) t_5

Tracez le graphique de la série temporelle. Cela semble-t-il « aléatoire » ? Répétez cet exercice plusieurs fois avec une nouvelle simulation à chaque fois.