

Sommaire du document

Introduction

Visualisation des séries

Rappel sur la stationnarité

MSE

[Visualisation graphique](#)

[Analyse des composantes](#)

[ACF, PACF](#)

[Tests de la stationnarité](#)

PIB

SMIC

TCHO

Corrélations

Modélisation individuelle des séries

Lissage exponentiel

[Définition](#)

[Résultats sur les séries](#)

Modèles ARMA

[Définition](#)

[Résultats sur les séries](#)

Comparaison des résultats pour les deux méthodes

Modélisation ARMA avec variables exogènes

Définition

Résultats obtenus

Modèles vectoriels

Définition des modèles

Ecriture

Hypothèses

Transformation des séries

Découpage des séries + méthode pour la stationnarisation

MSE

Visualisation de la série stationnarisée

ACF, PACF

Tests de la stationnarité

PIB

SMIC

TCHO

Corrélations

Application avec le package vars

Méthodologie utilisée (modèle complet)

Choix de l'ordre p

Estimation du modèle

Tests de la validité des hypothèses

Prévisions

Résultats obtenus pour tous les modèles

Application avec le package MTS

Méthodologie utilisée (modèle complet)

Choix de l'ordre p

Estimation du modèle

Tests de la validité des hypothèses

Prévisions

Résultats obtenus pour tous les modèles

Comparaison des résultats pour les deux packages

Conclusion