

Lexique des termes en économétrie et analyse des séries temporelles

A

- **ADF (Test de Dickey-Fuller augmenté)** : Test statistique permettant de déterminer si une série temporelle est stationnaire.
- **Analyse de tendance** : Étude de l'évolution d'une variable dans le temps pour identifier des motifs de croissance ou de déclin.
- **Autocorrélation** : Corrélation d'une variable avec elle-même à des différents décalages temporels.

C

- **Coefficient de régression (β)** : Mesure de l'effet d'une variable indépendante sur une variable dépendante dans un modèle de régression.
- **Corrélation** : Mesure statistique qui exprime le degré de relation entre deux variables.
- **Cycle économique** : Fluctuations récurrentes de l'activité économique comprenant des phases d'expansion et de récession.

D

- **Décomposition d'une série temporelle** : Processus de séparation d'une série en ses composantes : tendance, saisonnalité et résiduels.
- **Désaisonnalisation** : Suppression des effets saisonniers d'une série temporelle pour analyser la tendance sous-jacente.
- **Durbin-Watson** : Statistique testant la présence d'autocorrélation dans les résidus d'un modèle de régression.

E

- **Estimation par les moindres carrés ordinaires (OLS)** : Méthode d'estimation des paramètres d'un modèle de régression en minimisant la somme des carrés des erreurs.
- **Étude de stationnarité** : Analyse visant à déterminer si une série temporelle présente des propriétés constantes dans le temps.

F

- **Facteurs explicatifs** : Variables indépendantes ayant une influence sur la variable dépendante dans un modèle économétrique.
- **Fréquence d'une série temporelle** : Intervalle de temps entre deux observations consécutives (journalier, mensuel, annuel, etc.).

H

- **Hétéroscédasticité** : Situation où la variance des erreurs d'un modèle de régression n'est pas constante.

M

- **Modèle additif** : Modèle de décomposition où les différentes composantes (tendance, saisonnalité et résidu) s'ajoutent.
- **Modèle multiplicatif** : Modèle de décomposition où les composantes sont multipliées (adapté lorsque l'amplitude des variations saisonnières change avec le temps).
- **Modèle économétrique** : Modèle mathématique permettant d'étudier les relations entre différentes variables économiques.

P

- **P-value** : Indicateur statistique permettant d'évaluer la significativité d'un test ou d'un coefficient de régression.
- **Prédiction** : Estimation des valeurs futures d'une variable à l'aide d'un modèle.
- **Prix boursier** : Valeur d'une action cotée en bourse à un instant donné.

R

- **Régression linéaire** : Modélisation d'une relation linéaire entre une variable dépendante et une ou plusieurs variables indépendantes.
- **Résidus** : Différence entre les valeurs observées et les valeurs prédites par un modèle.
- **R-squared (R^2 ou coefficient de détermination)** : Indicateur mesurant la proportion de la variance expliquée par le modèle.

S

- **Saisonnalité** : Composante d'une série temporelle représentant des variations récurrentes sur une base périodique.
- **Série temporelle** : Ensemble de données ordonnées chronologiquement.
- **Significativité statistique** : Degré de fiabilité d'un test statistique ou d'un coefficient.
- **Stationnarité** : Propriété d'une série temporelle dont les caractéristiques statistiques restent constantes dans le temps.

T

- **Tendance** : Composante d'une série temporelle qui représente l'évolution générale sur le long terme.
- **Test de normalité** : Test statistique vérifiant si les résidus d'un modèle suivent une distribution normale.

- **Test statistique** : Méthode permettant de vérifier une hypothèse statistique sur un ensemble de données.

V

- **Volatilité** : Mesure de la variabilité des prix boursiers dans le temps.
- **Valeur ajustée** : Valeur modifiée pour prendre en compte certains ajustements (inflation, split d'actions, etc.).

Ce lexique couvre les concepts clés présents dans le rapport d'économétrie, en particulier ceux liés à l'analyse des séries temporelles et des modèles de régression. Il peut servir de référence pour expliquer les différ

Signé avec Maxidoc



yRnyutrAT59JiT07GOT6