

Méthodologie - Raccordement de séries temporelles

Plusieurs méthodologies sont utilisées dans les PIE pour raccorder des séries temporelles. Le raccordement sur **12 mois ou 4 trimestres** est la méthode la plus fréquemment utilisée. Cette méthode peut être utilisée lorsque l'ancienne série et la nouvelle (qui est liée à l'ancienne) contiennent des données sur une période commune d'au moins une année.

La méthode de raccordement sur 12 mois (ou 4 trimestres) calcule le facteur de raccordement comme le rapport entre la moyenne des observations de la nouvelle série sur la première année commune par la moyenne des observations équivalentes de l'ancienne série. Cette méthode est robuste, en particulier lorsque des révisions ont été faites après l'introduction de la nouvelle série. Elle permet également de maintenir du mieux possible la cohérence entre les version brutes et désaisonnalisées de la même série. Une exception faite à cette procédure concerne les indices de prix, pour lesquels la préférence va à la méthode de raccordement basée sur la première période commune. Cette méthode calcule le facteur de raccordement comme le rapport entre la première observation de la nouvelle série et l'observation équivalente de l'ancienne série sur la période commune. Elle permet d'assurer l'égalité du taux de croissance mensuel pour le nouvel indice de prix et l'ancien, au point de raccord, et elle minimise l'impact sur la série temporelle longue si des changements majeurs sont survenus au niveau de la couverture du nouvel indice de prix.

L'utilisation de la méthode de raccordement basée sur la **première période commune** peut donner des relations étranges entre les versions brutes et désaisonnalisées de la nouvelle série, avant le point de raccordement (i.e. après que le raccordement a été effectué). C'est la raison principale pour laquelle la préférence va à l'utilisation de la méthode de raccordement sur 12 mois pour la plupart des séries temporelles. Cependant, cela n'est pas un problème pour les indices de prix car ceux-ci ne sont généralement pas désaisonnalisés. Au cas où il n'existerait pas d'année commune complète entre les séries anciennes et nouvelles fournies par un pays, la méthode de raccordement basée sur la première période commune continuera à être utilisée. Par ailleurs, si la nouvelle série n'a pas été révisée pendant la première année commune, ces deux méthodes de raccordement donnent les mêmes résultats. Le choix d'une méthode de raccordement privilégiée a résulté d'une étude méthodologique et empirique détaillée, réalisée par le Secrétariat de l'OCDE.

La **méthode du raccordement implicite** est utilisée pour raccorder des séries qui n'ont pas de périodes communes mais pour lesquelles une période de référence commune peut être établie par inférence ou par déduction. Par exemple, cette méthode pourrait utiliser l'information selon laquelle, pour les deux séries, la valeur pour l'année de base commune est 100. Ces deux séries sont recalculées dans cette année de base commune puis elles sont ensuite concaténées (i.e. jointes). Il est à noter qu'en pratique, il est rare de trouver l'ensemble de l'information nécessaire à l'utilisation de cette méthode de raccordement, si bien que l'utilisation de cette méthode est peu fréquente.

Certaines séries exprimées en niveau (masses monétaires en monnaie nationale, et certaines séries couvrant d'abord l'Allemagne de l'Ouest puis l'Allemagne unifiée) sont raccordées par **concaténation**. Ceci signifie qu'à partir des premières observations de la nouvelle série, les valeurs de la nouvelle série remplacent ou prolongent celles de l'ancienne série. En conséquence, cette méthode peut produire des ruptures significatives dans la série longue au(x) point(s) de raccordement. Ces ruptures sont toutefois documentées en détail dans la publication et dans les bases de données.

La division des PIE examine chaque série au cas par cas avant de faire des raccordements. Si les séries peuvent être raccordées, la méthode la plus appropriée est choisie après une analyse plus approfondie. Les séries qui ont des différences méthodologiques importantes ou qui ont des évolutions significativement différentes ne sont pas raccordées. D'autre part, il est à noter que différentes méthodes peuvent être utilisées pour les différents raccordements de la même série longue, en fonction de la nature des séries anciennes et nouvelles raccordées au point particulier dans le temps. De façon générale, la politique des PIE est d'essayer de maintenir des séries longues et par conséquent, notre préférence est de raccorder des séries là où cela est possible et de fournir des métadonnées appropriées aux utilisateurs.

Egalement disponible(s)

[Methodology - Linking Time Series, OECD](#)



Abonnez-vous aux newsletters de l'OCDE en français !

Vous souhaitez recevoir les dernières nouvelles de l'OCDE ? Abonnez-vous pour recevoir notre lettre d'information directement dans votre boîte de réception.

Abonnez-vous