

Exercice1 Soit les séries suivantes:

1. $y_t = e_t$;
2. $y_t = S_t + e_t$;
3. $y_t = 0.3t + S_t + e_t$;
4. $y_t = t \times S_t \times e_t$;
5. $y_t = \cos(t/30) \times e_t$;
6. $y_t = \cos(t/30) + e_t$;

où e_t est un bruit aléatoire gaussien centré de variance 1, s_t est une série d'effets saisonniers de période 12 dont les 12 premiers termes sont tirés de façon indépendante dans la loi uniforme sur $[0, 5]$:

- Faire correspondre chaque figure à une équation adéquate.

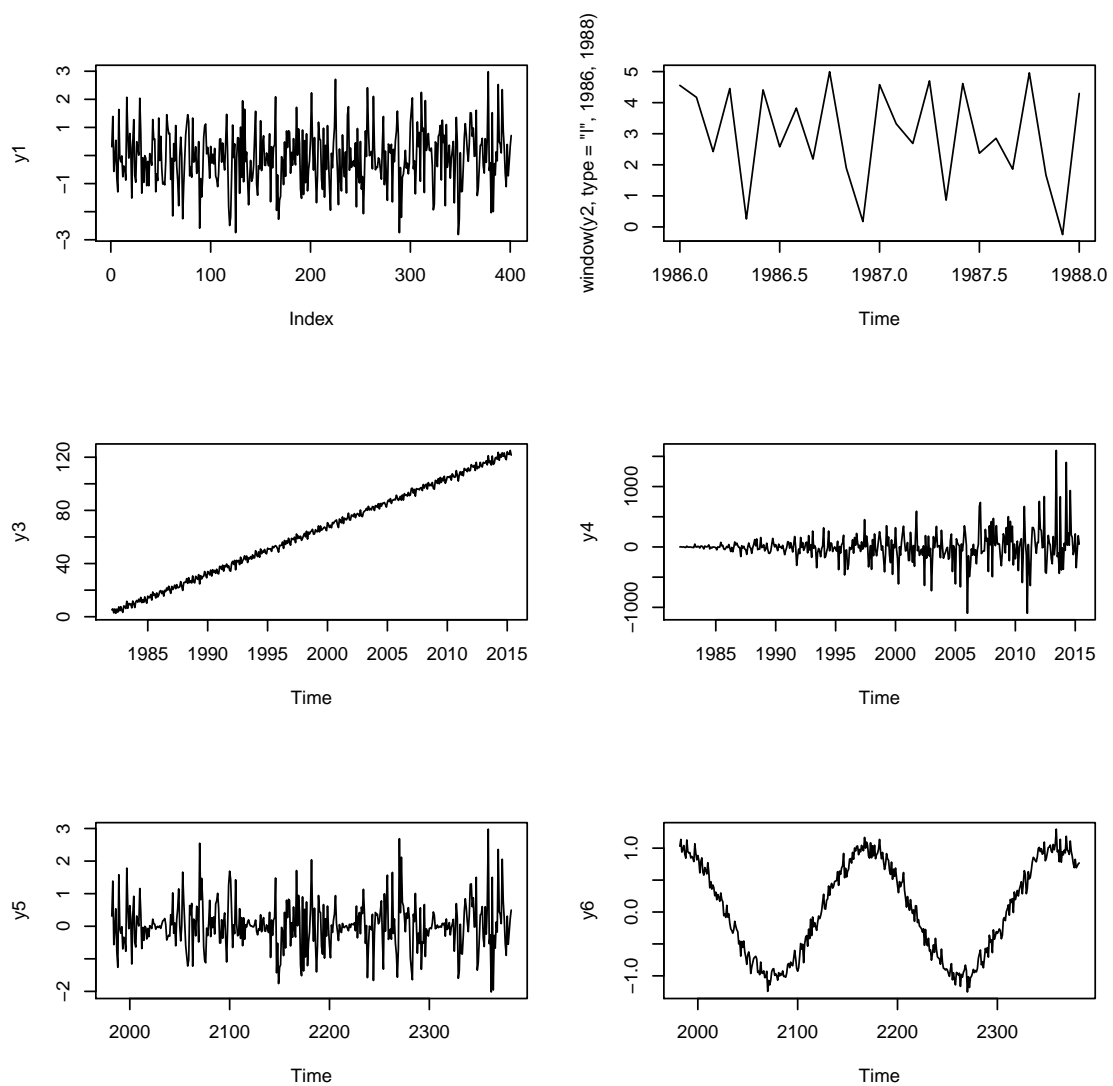


Figure 1.1