

1 Méthodes de lissage et saisonnalité

1.1 Noël s'en vient !

On considère les taux d'inflation sur 12 mois disponibles dans le fichier cg130823a001-fra.csv. On représente cette série chronologique par la variable aléatoire Y_t . L'an passé, les Canadiens ont dépensé en moyenne 674\$ en cadeaux au mois de décembre 2012. Notre objectif est de prévoir quel sera le montant dépensé pour l'achat de cadeaux en décembre 2013.

1. Tracez un graphique de la série chronologique Y_t à l'aide d'un logiciel statistique. Êtes vous en mesure de déceler visuellement la présence d'une tendance et/ou d'une saisonnalité ?
2. Utilisez l'opérateur différentiel ∇_{12} afin d'éliminer la saisonnalité annuelle de la série chronologique Y_t . Tracez à nouveau un graphique avec les données obtenues. Remarquez-vous toujours la présence de saisonnalité ?
3. Maintenant, nous voulons déceler s'il y a présence d'une tendance dans les données. En utilisant la méthode de la moyenne mobile avec $q = 3$, du lissage exponentiel double avec $\alpha = 75\%$ et de la régression linéaire simple, estimer la tendance \hat{m}_t .
4. En utilisant le résultat de la régression linéaire précédente, prévoir la valeur non saisonnalisée en décembre 2013. En évaluant la moyenne des différences entre la série Y_t et la valeur de la régression pour les mois de décembre des années précédente, on peut estimer la valeur \hat{s}_{12} . Ajouter cette valeur au résultat obtenu pour obtenir une estimation du taux d'inflation en décembre 2013.
5. En appliquant ce taux d'inflation à la donnée du problème, prédire le montant dépensé pour l'achat de cadeaux en décembre 2013.