

Note de synthèse sur les Series Chronologiques

Hissein Tidei*

2023-05-06

Concepts de Base

Qu'est ce qu'une série chronologique ou Time Series (TS)?

C'est une suite finie des observations effectuées à un intervalle régulier au cours du temps. Dite aussi série temporelles, elle se matérialise économiquement par l'observation des grandeurs telles que: IPC, PNB, PIB, etc.

La notion de processus stationnaire au sens large (SSL):

un processus X_t est SSL si, et seulement si: 1. $\mathbb{E}(X_t)$

*Twitter