



UNIVERSITÉ DE
MONTPELLIER

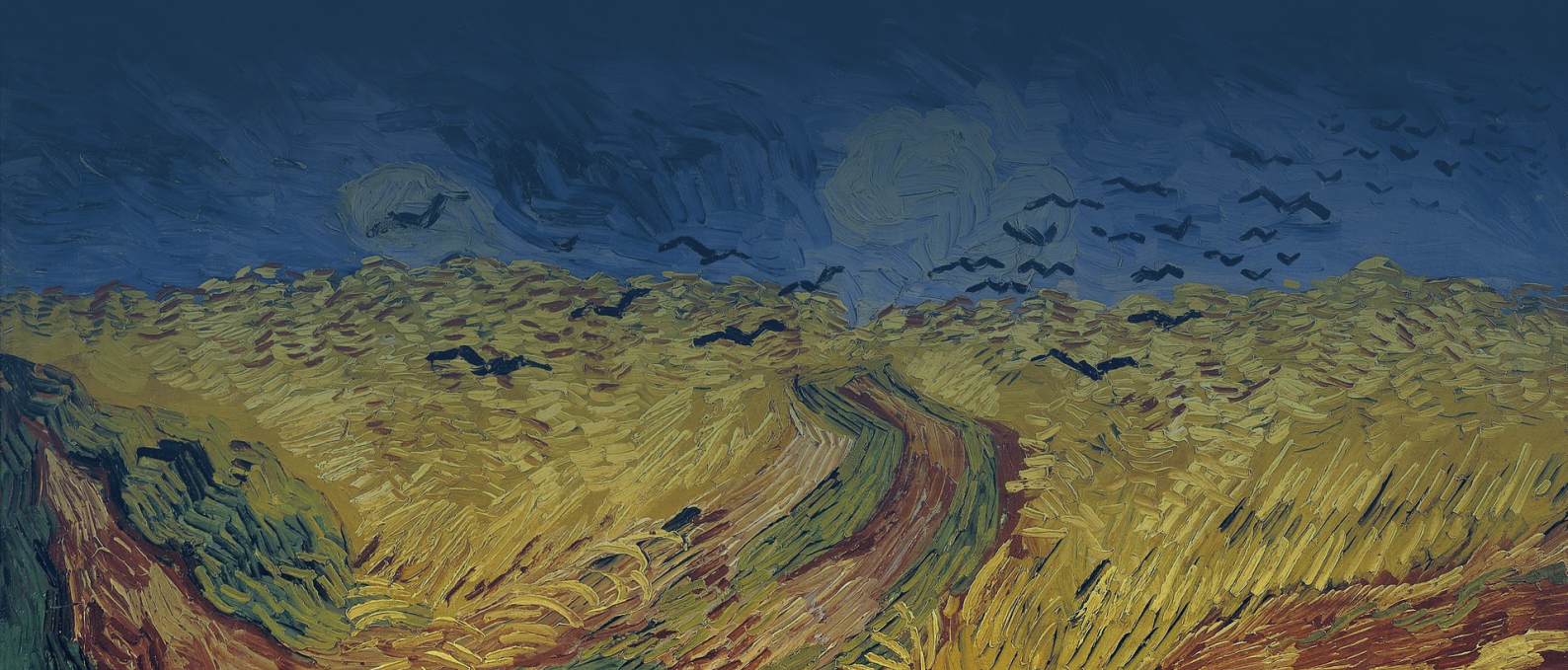


Projet d'économétrie appliquée

Prévision des cours du blé et du nickel

Mosse Joseph - Rubira Pierre
M1 - MBFA - ARB

Sous la direction de :
Seyte Françoise



Résumé

Sommaire

1	Analyse macroéconomique du blé et du nickel	3
1.1	Le blé	3
1.2	Le nickel	3
2	Analyse des séries chronologiques	3
2.1	Transformation logarithmique	3
2.2	Analyse graphique	3
2.3	Analyse de la variance	4
2.3.1	Test de Fisher sur la tendance	4
2.3.2	Test de Fisher sur la saisonnalité	4
3	Prévision par les méthodes traditionnelles	4
3.1	Lissage exponentiel double (LED)	4
3.1.1	Période 2016-2019	4
3.1.2	Période 2016-2021	4
3.2	Lissage exponentiel triple (Holt Winter)	4
3.2.1	Période 2016-2019	4
3.2.2	Période 2016-2021	4
3.3	Extrapolation d'une droite de tendance	4
3.3.1	Période 2016-2019	4
3.3.2	Période 2016-2021	4
3.4	Classification des méthodes	4
3.5	Prévision pour 2023	4
4	Prévision selon la méthodologie de Box & Jenkins	4
4.1	Présentation de la méthode	4
4.2	Test de racine unitaire	4
4.3	Identification des processus	4
4.4	Tests de validité	4
4.4.1	Significativité des paramètres	4
4.4.2	Tests sur les résidus	4
4.5	Prévision pour 2023	4

Introduction

1 Analyse macroéconomique du blé et du nickel

1.1 Le blé

1.2 Le nickel

2 Analyse des séries chronologiques

Les méthodes traditionnelles de prévision, reposent sur la décomposition des différentes composantes d'une série temporelle. Ici il s'agira donc ici d'analyser ces différentes composantes (c'est à dire la tendance et la saisonnalité).

2.1 Transformation logarithmique

Avant tout, il est nécessaire de s'affranchir des fluctuations importantes de la série. Pour cela un test d'homoscédasticité est fait sur la série initiale.

2.2 Analyse graphique

Correlo ?

2.3 Analyse de la variance

2.3.1 Test de Fisher sur la tendance

2.3.2 Test de Fisher sur la saisonnalité

3 Prévision par les méthodes traditionnelles

3.1 Lissage exponentiel double (LED)

3.1.1 Période 2016-2019

3.1.2 Période 2016-2021

3.2 Lissage exponentiel triple (Holt Winter)

3.2.1 Période 2016-2019

3.2.2 Période 2016-2021

3.3 Extrapolation d'une droite de tendance

3.3.1 Période 2016-2019

3.3.2 Période 2016-2021

3.4 Classification des méthodes

3.5 Prévision pour 2023

4 Prévision selon la méthodologie de Box & Jenkins

4.1 Présentation de la méthode

4.2 Test de racine unitaire

4.3 Identification des processus

4.4 Tests de validité

4.4.1 Significativité des paramètres

4.4.2 Tests sur les résidus

4.5 Prévision pour 2023

Conclusion