

Projet de séries temporelles

Date de rendu : mardi 17 mai 2016 par mail à votre chargé de TD et assistant-econometrie@ensae.fr

Consigne générale : Ce projet doit être réalisé sous Stata, SAS ou R. La notation tiendra compte de la rigueur dans la mise en œuvre des outils économétriques, de la concision et de la clarté de la présentation des résultats. Le rapport (6 pages de contenu maximum hors annexe) fera figurer les programmes en annexe. Ce tutorat doit être effectué par binôme (au plus) d'un même groupe de TD.

Le barème (à titre indicatif) est le suivant : Partie 1 : 20%; Partie 2 : 40%; Partie 3 : 40%. Bon travail !

On s'intéresse à la modélisation et la prévision de l'indice de production industrielle observé en France. Il ne vous est pas demandé de connaître le processus de construction de l'indicateur. Vous ne travaillez que sur les données observées. A partir de <http://www.insee.fr/fr/bases-de-donnees/bsweb/theme.asp?id=07>, vous devez choisir une série agrégée brute, mensuelle, correspondant à n'importe quel secteur d'activité (à votre convenance) qui couvre la période jan1990-déc2015.

Partie 1 : Les données

- 1) Que représente la série choisie ? (secteur, périmètre, traitements éventuels, transformation logarithmique, ...)
- 2) Transformer si besoin la série pour la rendre stationnaire (désaisonnalisation, différenciation, suppression de la tendance déterministe, ..). Justifier soigneusement vos choix.
- 3) Représenter graphiquement la série choisie avant et après transformation.

Partie 2 : Modèles ARMA

- 4) Choisir, en le justifiant, un modèle ARMA(p,q) (avec éventuellement une composante saisonnière) pour votre série corrigée X_t . Estimer les paramètres du modèle et vérifier sa validité.

Partie 3 : Prévision

On note T la longueur de la série. Ici, $T=312$ (12 mois sur 26 ans). On suppose que les résidus de la série sont gaussiens.

- 5) Ecrire l'équation vérifiée par la région de confiance de niveau α sur les valeurs futures (X_{T+1}, X_{T+2}).
- 6) Préciser les hypothèses utilisées pour obtenir cette région.
- 7) Déterminer graphiquement cette région pour $\alpha=95\%$. Commenter.
- 8) Question ouverte : soit Y_t une série stationnaire disponible de $t=1$ à T . On suppose que Y_{T+1} est disponible plus rapidement que X_{T+1} . A quelles conditions cette information permet-elle d'améliorer la prévision de X_{T+1} ?