

Machine Learning

Seasonal Autoregressive Integrated Moving Average Model :
SARIMA

Peut être vu comme une cascade de deux modèles :

- processus de suppression des tendance et saisonnalité :

$$Y_t = (I - L)^d (I - L^s)^D X_t$$

- Y_t traité comme un processus ARMA(p,q)

Les processus SARIMA intègrent naturellement la tendance et la saisonnalité dans le modèle.