

Machine Learning

Autoregressive Integrated Moving Average Model : ARIMA

Peut être vu comme une cascade de deux modèles :

- processus de suppression de la tendance par différenciation temporelle : $Y_t = (I - L)^d X_t$
- Y_t traité comme un processus ARMA(p,q)

On note alors X_t comme étant un processus ARIMA(p,d,q)

Les processus ARIMA intègrent naturellement la tendance dans le modèle.