

Series chronologiques  
sept. 2011  
TD 1  
V. Monbet

# Modélisation des moyennes mensuelles de la température en France

On considère une série temporelle qui décrit les moyennes mensuelles de la température en France entre 1901 et 2000.

## 1 Importation des données

Télécharger les données (au format ascii) sur la page du cours (<http://perso.univ-rennes1.fr/val>). Importer ces données en utilisant par exemple l'instruction `read.table` sous R puis créer une variable `x` de type *time series* qui contient les données à l'aide de la fonction `ts`.

```
x=ts(as.numeric(temp),frequency = 12, start = 1901)
```

## 2 Visualisation

Représenter graphiquement la série temporelle. Peut-on identifier une tendance et/ou une composante saisonnière ?

## 3 Etude de la tendance

(a) **Moyennes mobiles.** On propose dans cette question d'estimer la tendance par la méthode des moyennes mobiles. On rappelle que si  $\{x_i\}_{i=1,\dots,n}$  est une série

temporelle, alors la moyenne mobile d'ordre  $p$  associée est la série temporelle définie pour  $t \in \{p + 1, \dots, n - p\}$  par

$$\hat{x}_t = \sum_{i=t-p}^p x_i$$

avec  $2p + 1$  la largeur de la fenêtre.

1. Calculer les séries temporelles obtenues par la méthode des moyennes mobiles avec des largeurs de fenêtre de 1 an, 2 ans, 5 ans puis 10 ans à l'aide de la fonction `filter`. Pourquoi choisit-on des largeurs de fenêtre qui sont des multiples de la période de la composante saisonnière (1 an ici) pour estimer la tendance?
2. Tracer sur une même figure la série temporelle initiale et ces moyennes mobiles. Discuter les résultats obtenus : quelle largeur de fenêtre vous semble être la mieux adaptée? Peut-on identifier une tendance dans la série temporelle résiduelle?
3. A t'on modélisé une tendance additive ou multiplicative? Ecrire le modèle en notant  $X_t$  le processus moyen mensuel de la température et  $T_t$  la tendance.

**(b) Ajustement d'un modèle paramétrique.** On propose dans cette question d'utiliser un modèle de tendance polynomiale.

1. Quel degré de polynôme la question précédente suggère t'elle d'utiliser?
2. Ajuster le modèle à l'aide de la fonction `lm`.
3. Tracer sur une même figure la série temporelle et la tendance estimée. Discuter la qualité de l'ajustement. Donner une expression analytique du modèle en définissant rigoureusement vos notations.
4. Quelle est le degré de signification (p-value) du test associé à l'hypothèse selon laquelle il n'y a pas de tendance dans la série temporelle? Sur quelles hypothèses reposent la validité de ce test? Ces hypothèses sont-elles vérifiées?
5. Calculer la série temporelle des moyennes annuelles de la température. Représenter graphiquement cette série et ajuster le modèle de tendance polynomiale. Que devient le degré de signification du test? Discuter les résultats.

## 4 Etude de la composante saisonnière

- (a) Calculer les coefficients saisonniers (i.e. moyennes mensuelles) de la série `xdet` (ie la série sans tendance). On notera `xstat` la série obtenue après avoir retiré les coefficients saisonniers.
- (b) Représenter graphiquement la série `xstat`. Cette série vous paraît-elle être stationnaire?

## 5 Utilisation de fonctions prédéfinies

Taper les commandes ci-dessous et interpréter les résultats obtenus

```
> dog=stl(x,'periodic')
> plot(dog)
```

## 6 Prédition

Peut-on prévoir la température moyenne en Janvier 2100 et Juillet 2100 ? Si oui, donner les valeurs numériques et éventuellement un intervalle de confiance.

## 7 Etude de la série stationnaire.

- (a) Rappeler la (ou les) définitions d'un processus stationnaire. Donner un exemple de processus stationnaire d'ordre 2 puis de processus non stationnaire. Simuler une trajectoire de chacun de ces processus et tracer ces trajectoires. Commenter les graphiques.
- (b) Rappeler les définitions de la fonction d'autocorrélation et de la fonction d'autocorrélation empirique. Que représentent ces fonctions? Tracer la fonction d'autocorrélation empirique de la série initiale `x` à l'aide de la fonction `acf`. Discuter les résultats.
- (c) Tracer la fonction d'autocorrélation empirique de la série `xstat`. Discuter. Peut-on supposer que les températures moyennes de deux mois successifs sont indépendantes? Peut-on affirmer que s'il fait plus chaud que la normale un mois donnée, alors le mois suivant sera plutôt froid? Pourquoi?
- (d) Rappeler la définition de la fonction d'autocorrélation partielle. Que représente cette fonction? Tracer la fonction d'autocorrélation partielle empirique de la série `xstat` à l'aide de la fonction `pacf`. Discuter.

(e) Peut-on supposer que la série `xstat` est un bruit blanc ? On répondra à l'aide fonction `Box.test`. Rappeler les hypothèses de test associées à ce test. Conclure.

## 8 Modélisation de la série stationnaire.

(a) Quel modèle peut-on proposer pour la série stationnaire d'après les résultats de la section précédente? Justifier la réponse. Donner une expression analytique pour le modèle. Quels en sont les paramètres?

(b) Inférence - Quels estimateurs peut-on utiliser pour estimer les paramètres du modèle? Quel estimateur préconisez vous de choisir? Pourquoi? Utiliser la fonction `ar` pour estimer les paramètres du modèle.

(c) Proposer une méthode de validation du modèle. Mettez la en oeuvre.