

Compléments de cours

Chapitre 7

Séries Chronologiques:

Prévisions et qualité du modèle

Prof. Mohamed El Merouani

1

Prévisions:

- D'abord, on sait que l'on peut déterminer la tendance par deux approches:
 - Globale \Rightarrow moindres carrées
 - Locale \Rightarrow Moyennes mobiles
- Dans le cas globale, la tendance est déterminée par la méthodes des moindres carrées: $T_t = a.t + b$
- Ainsi $Y_t = T_t C_t S_t R_t \Rightarrow \hat{Y}_t = T_t S_t$

2

Coefficient de détermination:

- Noté R^2 , c'est le carré du coefficient de corrélation **R** ou **r** ou **ρ**
- Le coefficient de détermination est un indicateur de la qualité de la représentation ou du modèle.
- R^2 est au plus égale à 1 ($-1 \leq R \leq 1$).
- Si R^2 est proche de 1, alors le modèle est de bonne qualité.
- Si R^2 est proche de zéro, alors le modèle est de mauvaise qualité.