

SOMMAIRE

	<i>Page</i>
1 - INTRODUCTION GENERALE	5
11 - Qu'est-ce qu'une série chronologique ?	5
12 - Quels types de séries peut-on analyser ?	5
13 - Comment débiter l'analyse d'une série ?	7
14 - Les différentes composantes d'une série	11
15 - Objectifs de l'étude d'une série	15
2 - LES METHODES DE DECOMPOSITION	17
21 - Introduction	17
22 - Un exemple de désaisonnalisation d'une série	17
23 - Les modèles de décomposition	21
24 - Choix d'un modèle de décomposition	23
25 - Estimation des composantes de la série	25
3 - LES PREVISIONS PAR LISSAGE	33
31 - Introduction	33
32 - Séries sans tendance et sans composante saisonnière	33
33 - Séries avec tendance et sans composante saisonnière	39
34 - Séries avec tendance et composante saisonnière	47
4 - LES PREVISIONS PAR LA METHODOLOGIE DE BOX ET JENKINS	53
41 - Introduction	53
42 - Transformation préliminaire des séries	55
43 - Autocorrélogramme et autocorrélogramme partiel	61
44 - Un exemple : le processus autorégressif d'ordre 1	63
5 - QUELQUES COMPLEMENTS	75
51 - Introduction	75
52 - Données manquantes	75
53 - Données anormales	79
54 - Choix d'une méthode d'analyse	79
6 - REFERENCES BIBLIOGRAPHIQUES	80