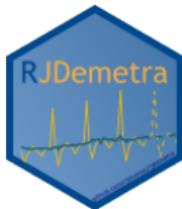


## DÉSAISONNALISER UNE SÉRIE TEMPORELLE



### 7 - Problèmes d'estimation du modèle Reg-ARIMA

ALAIN QUARTIER-LA-TENTE

## Questions de positionnement

Quelles sont les hypothèses sur les résidus du modèle regARIMA et sont-elles importantes ?

Avoir plus de données permet-il d'améliorer l'estimation du modèle regARIMA ?

Quelle est la longueur optimale pour l'estimation d'un modèle ?

# Sommaire

---

## 1. Problèmes liés à la qualité des résidus

### 1.1 Les hypothèses sur les résidus du modèle regARIMA

### 1.2 Exemple sur une série de l'IPI

## 2. Modèle regARIMA et séries longues

## 3. Conclusion

## Les hypothèses sur les résidus

---

Les estimations du modèle regARIMA sont **consistantes** (convergent et sans biais) et **efficaces** (de variance minimale), si les résidus  $\varepsilon_t$  sont :

- *décorrélés* :  $\forall t \neq t' : \text{Cov}(\varepsilon_t, \varepsilon_{t'}, \dots) = 0$  (*autocorrélés* sinon)
- *homoscédastiques* :  $\forall t, t' : \mathbb{V}[\varepsilon_t] = \mathbb{V}[\varepsilon_{t'}]$  (*hétéroscédistiques* sinon)
- distribuées selon une *loi normale*

# Conséquences des problèmes sur les résidus

Problème sur les résidus	Estimation des coefficients	Estimation de la variance des coefficients (pour tests de significativité)	Tests invalidés
Autocorrélation	biaisée (généralement)	biaisée	<ul style="list-style-type: none"> <li>– Student</li> <li>– Hétéroscédasticité</li> <li>– Normalité</li> <li>– Qualité des prévisions</li> </ul>
Heteroscédasticité	non biaisée	biaisée	<ul style="list-style-type: none"> <li>– Student</li> <li>– Normalité</li> <li>– Qualité des prévisions</li> </ul>
Normalité	non biaisée	non biaisée	<ul style="list-style-type: none"> <li>– Student</li> <li>– Qualité des prévisions</li> </ul>

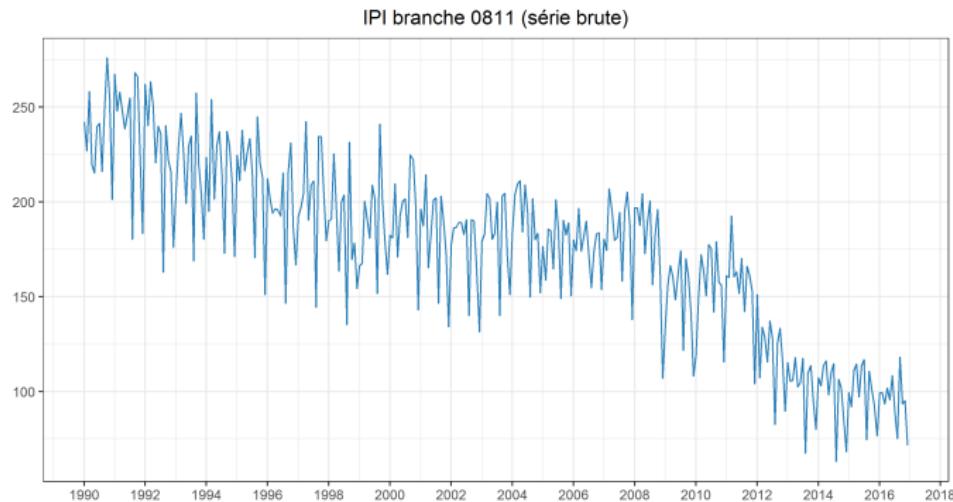
# Sources des problèmes de spécification des résidus

L'autocorrélation des résidus peut provenir :

- d'erreurs de mesure : si les données sont interpolées toujours à la même date, un biais systématique peut être observé
  - problème de variable omise : il manque une variable explicative importante
  - mauvaise spécification : par exemple dans le cas d'une équation non linéaire mais polynomiale
  - effet de l'habitude : biais systématique du fait de l'optimisme
  - d'un lissage artificiel des données trimestrielles sur données annuelles
- i** L'autocorrélation peut souvent être corrigé en augmentant l'ordre AR mais elle peut aussi provenir de la présence de certains points atypiques (LS, SO)
- i** Les points atypiques affectent l'hétéroscédasticité (AO, TC) et la non-normalité

## Exemple (1/4)

Un modèle ARIMA(0,1,1)(0,0,0) est-il plausible ?



## Exemple (2/4)

Que peut-on dire sur les régresseurs JO ?

### Arima model

$[(0,1,1)(0,0,0)]$ .

	<b>Coefficients</b>	<b>T-Stat</b>	<b>P[ T  &gt; t]</b>
Theta(1)	-0,8417	-27,90	0,0000

### Regression model

User-defined calendar variables

	<b>Coefficients</b>	<b>T-Stat</b>	<b>P[ T  &gt; t]</b>
REG1_AC1	0,0052	0,34	0,7331
REG1_AC2	0,0224	1,48	0,1387
REG1_AC3	0,0237	1,58	0,1159
REG1_AC4	0,0200	1,25	0,2113
REG1_AC5	0,0122	0,80	0,4249
REG1_AC6	-0,0225	-1,37	0,1704
REG1_LPY	0,0473	0,76	0,4465

*Joint F-Test = 2,70 (0,0098)*

### Prespecified outliers

	<b>Coefficients</b>	<b>T-Stat</b>	<b>P[ T  &gt; t]</b>
AO (2-2012)	-0,2728	-1,91	0,0573
TC (12-2008)	-0,3779	-3,33	0,0010

# Exemple (3/4)

Avec un modèle bien spécifié :

## Arima model

[(2,2,1)(1,1,1)].

	Coefficients	T-Stat	P[ T  > t]
Phi(1)	0,5620	9,98	0,0000
Phi(2)	0,2396	4,29	0,0000
Theta(1)	-1,0000	-51,88	0,0000
BPhi(1)	-0,2398	-3,85	0,0001
BTheta(1)	-0,9457	-28,71	0,0000

## Correlation of the estimates

	Phi(1)	Phi(2)	Theta(1)	BPhi(1)	BTheta(1)
Phi(1)	1,0000	0,4630	-0,0181	0,1076	0,1149
Phi(2)	0,4630	1,0000	0,0365	0,1196	0,0481
Theta(1)	-0,0181	0,0365	1,0000	0,0275	0,3949
BPhi(1)	0,1076	0,1196	0,0275	1,0000	-0,0921
BTheta(1)	0,1149	0,0481	0,3949	-0,0921	1,0000

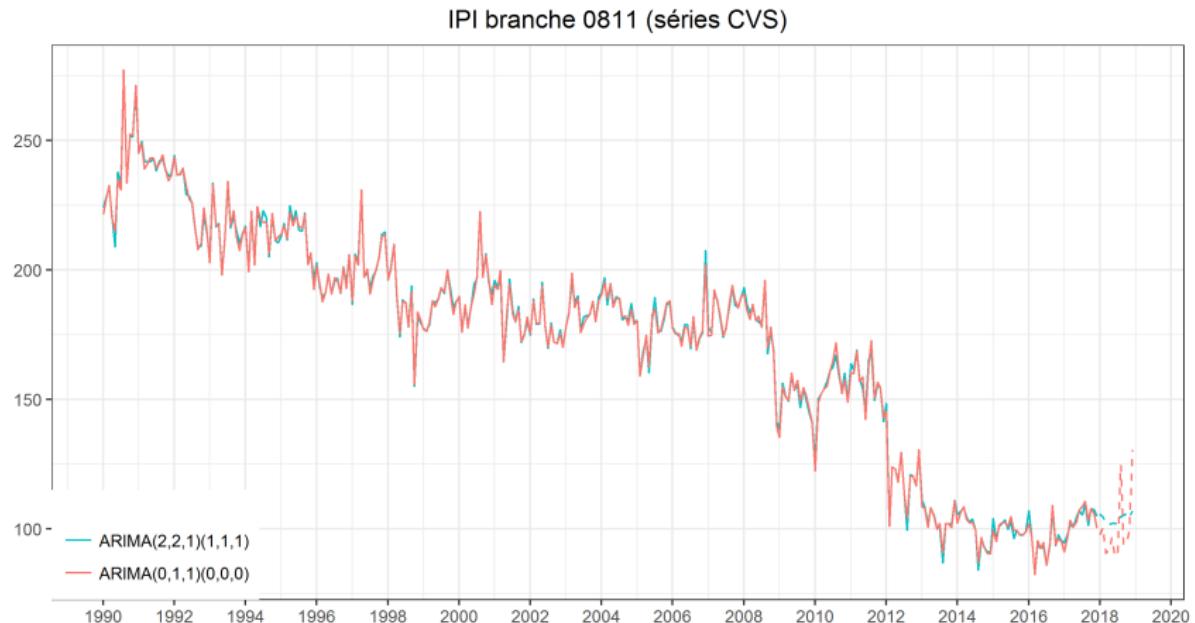
## Regression model

User-defined calendar variables.

	Coefficients	T-Stat	P[ T  > t]
REG1_AC1	0,0182	3,22	0,0014
REG1_AC2	0,0211	3,76	0,0002
REG1_AC3	0,0246	4,28	0,0000
REG1_AC4	0,0316	5,12	0,0000
REG1_AC5	0,0108	1,89	0,0594
REG1_AC6	-0,0177	-2,94	0,0035
REG1_LPY	0,0450	1,95	0,0523

## Exemple (4/4)

Quel impact sur ma série désaisonnalisée ?



# Sommaire

---

## 1. Problèmes liés à la qualité des résidus

## 2. Modèle regARIMA et séries longues

### 2.1 Hypothèse de stabilité des coefficients

### 2.2 Exemples

## 3. Conclusion

# Hypothèse de stabilité du modèle regARIMA

Le modèle regARIMA est un modèle de régression linéaire. Il suppose :

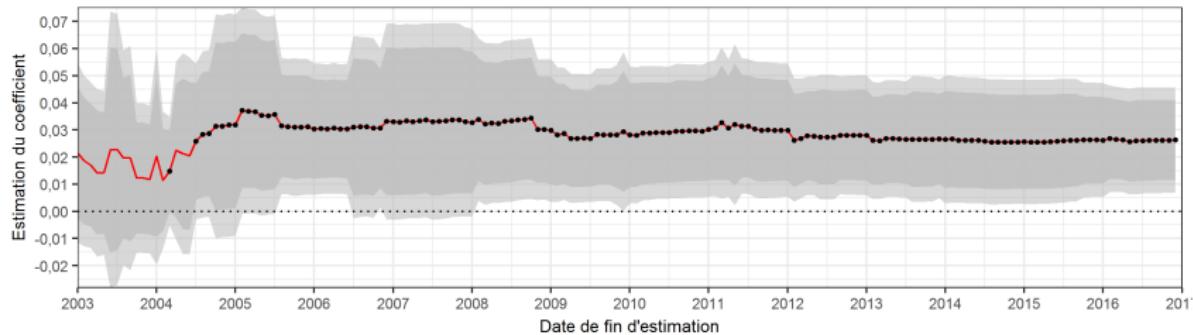
- que les coefficients sont stables dans le temps
- que la structure des résidus (modèle ARIMA) est constante dans le temps

**⚠** Est-ce plausible ? Quelle est la durée nécessaire pour avoir une estimation *stable* ?

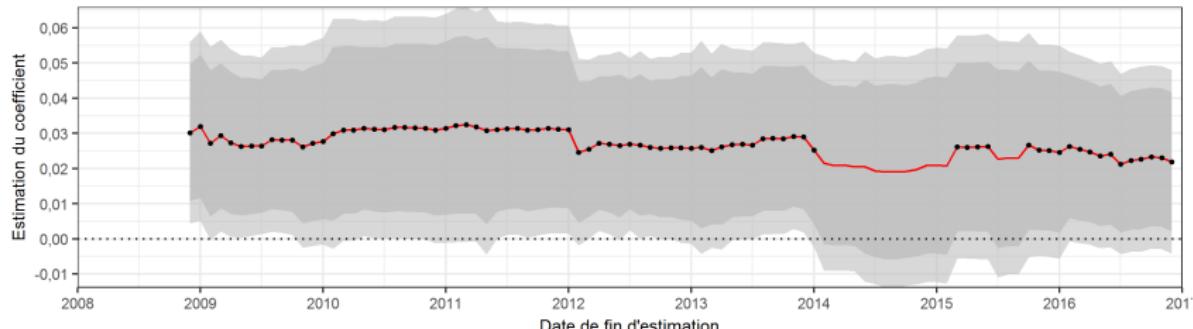
**➔** Étudions les estimations des régresseurs JO et la stabilité de la décision de CJO

Ici estimation du leap year relativement stable...

Estimation du régresseur leap year (FR-G452), date de début fixée

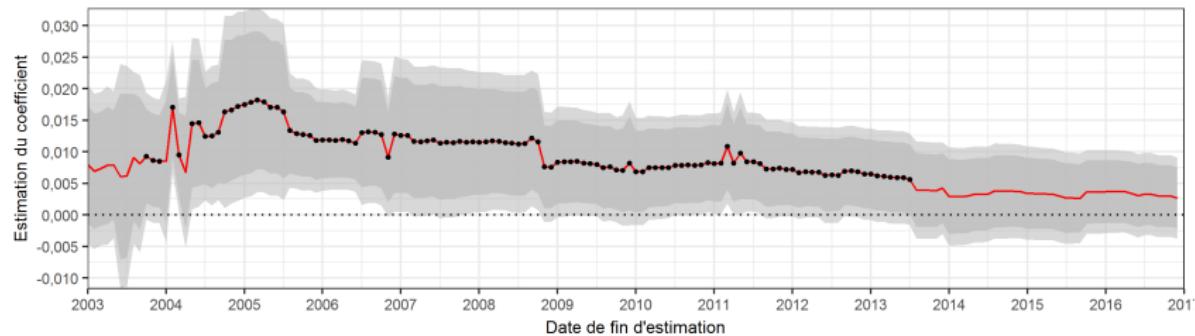


Estimation roulante sur 10 ans du régresseur leap year (FR-G452)

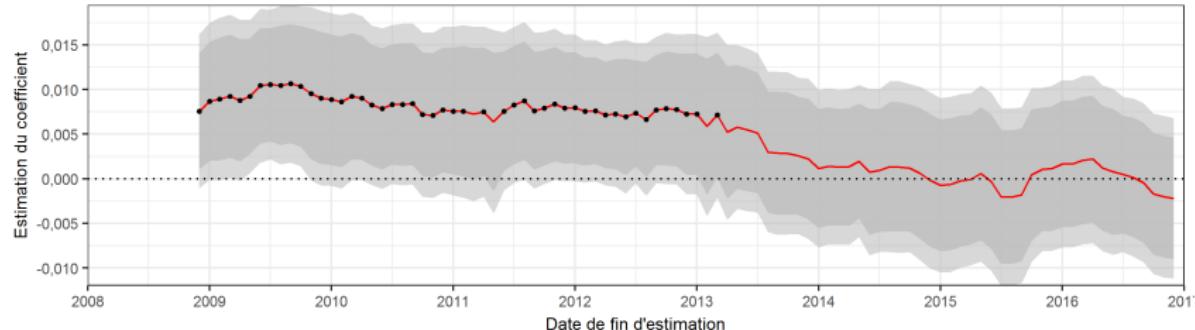


# ... Mais pas le régresseur mercredi

Estimation du régresseur mercredi (FR-G452), date de début fixée

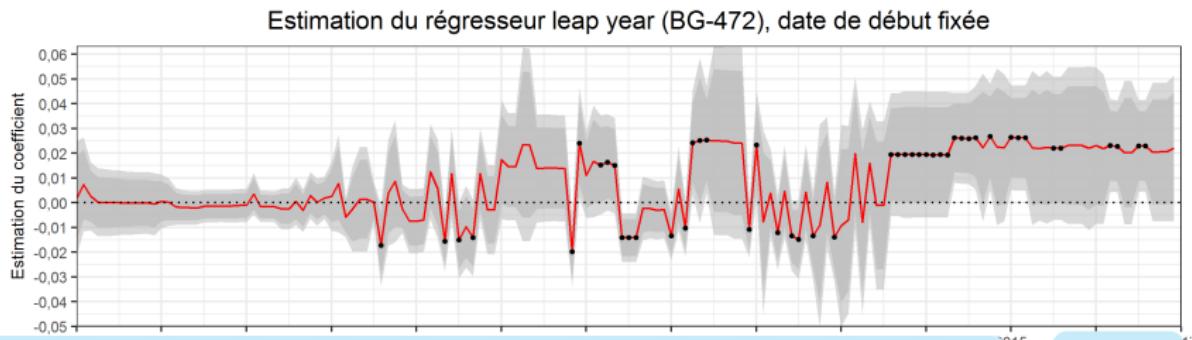
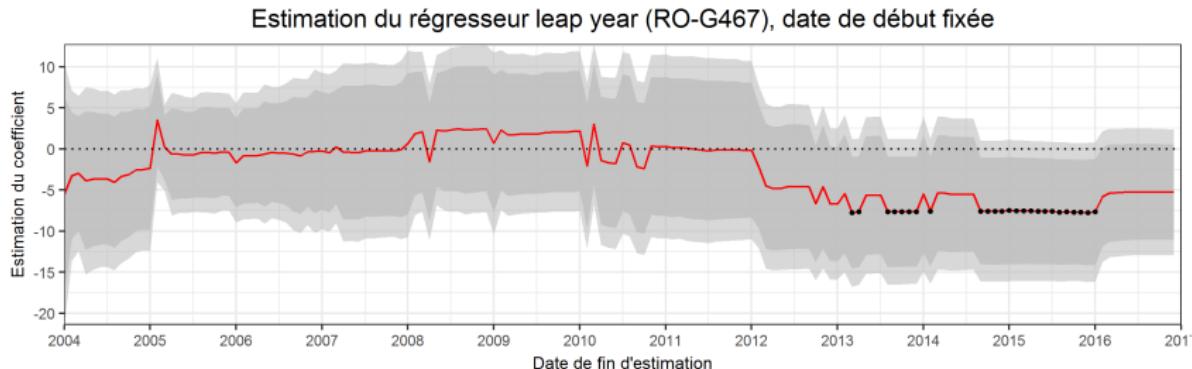


Estimation roulante sur 10 ans du régresseur mercredi (FR-G452)

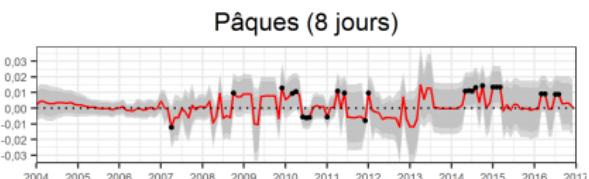
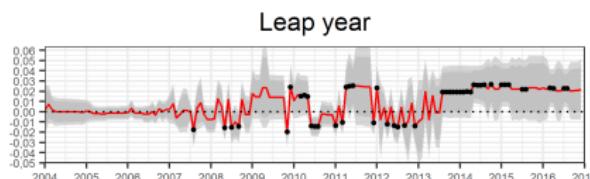
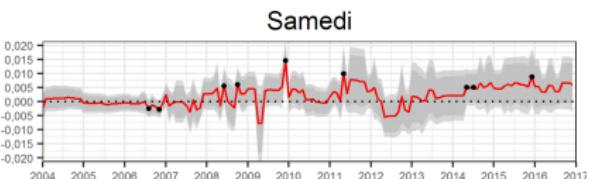
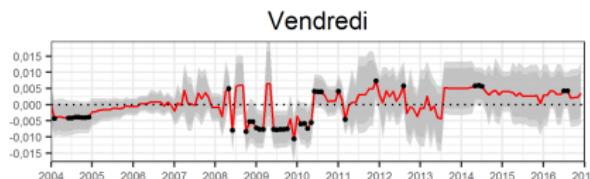
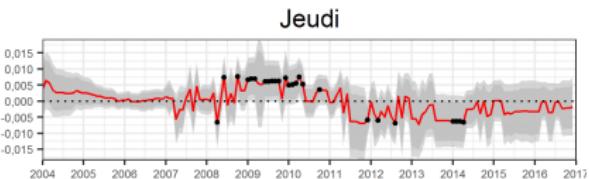
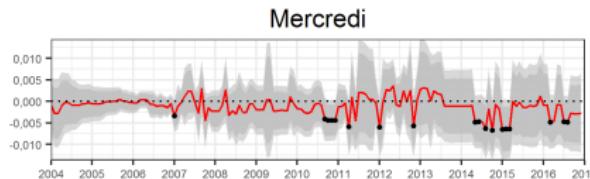
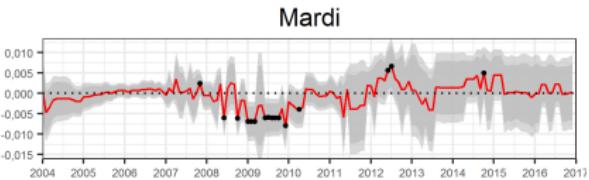
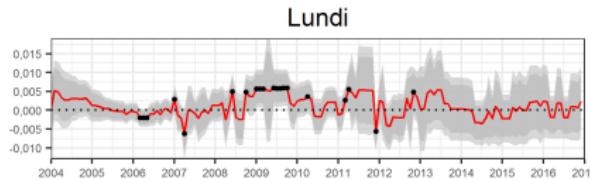


# Estimations du LY pas toujours stable

Estimations du LY toujours non significatives avec estimations roulantes

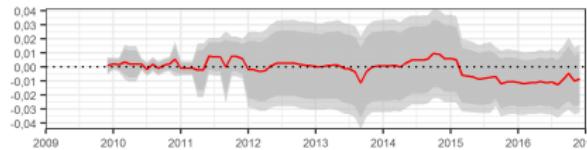


# Cas compliqué (1/2) : EL G473

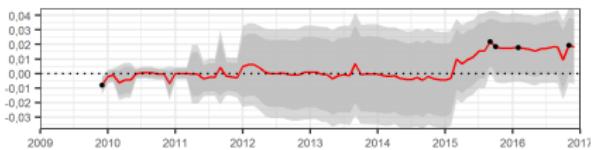


# Cas compliqué (2/2) : estimations roulantes

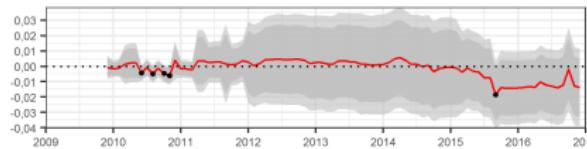
Lundi



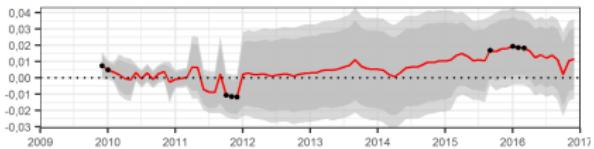
Mardi



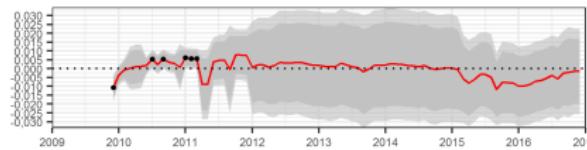
Mercredi



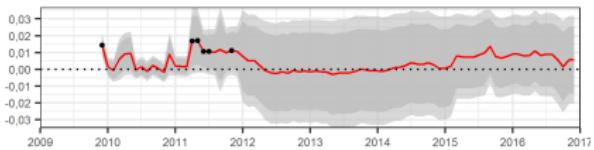
Jeudi



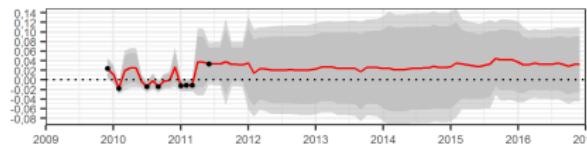
Vendredi



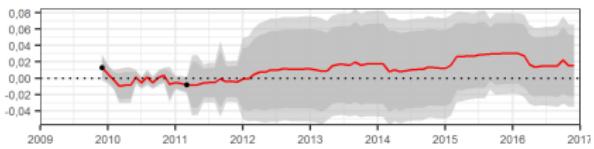
Samedi



Leap year



Pâques (8 jours)



# Sommaire

---

1. Problèmes liés à la qualité des résidus

2. Modèle regARIMA et séries longues

3. Conclusion

3.1 Bibliographie

# Les essentiels

---

- une bonne spécification des résidus est importante pour interpréter le modèle regARIMA
- résidus autocorrélés  $\implies$  hétéroscédasticité  $\implies$  non normalité
- attention aux séries longues : l'hypothèse de stabilité du modèle est généralement fausse pour les séries de plus de 20 ans
- attention aux séries courtes : les estimations sont généralement moins précisent (plus grande variance des estimateurs) et peuvent être fortement révisées

# Bibliographie

---

- 
- Ladiray D., Quartier-la-Tente A. (2018), Du bon usage des modèles Reg-ARIMA en désaisonnalisation, Actes des 13<sup>e</sup> Journées de Méthodologie Statistique, [http://www.jms-insee.fr/2018/S05\\_1\\_ACTEv3\\_QUARTIERLATENTE\\_JMS2018.pdf](http://www.jms-insee.fr/2018/S05_1_ACTEv3_QUARTIERLATENTE_JMS2018.pdf).