

**DÉPARTEMENT DE MATHÉMATIQUES ET DE STATISTIQUE
UNIVERSITÉ DE MONTRÉAL
PLAN DE COURS: HIVER 2025**

Sigle du cours:	STT-3220
Titre du cours:	Méthodes de prévision
Professeur:	Pierre Duchesne
Bureau:	4251, Pavillon André-Aisenstadt
e-mail:	pierre.duchesne@UMontreal.CA
	page web: http://www.dms.umontreal.ca/~duchesne
Horaire du cours:	lundi, 8h30 - 10h30, 1177, Pav. André-Aisenstadt mardi, 8h30 - 9h30, Z-245, Pav. Claire-McNicoll
Horaire des travaux pratiques:	mercredi, 9h30-11h30
Disponibilité:	mardi, 9h30-10h20 (ou sur rendez-vous).

Plan du cours

1. Rôle de la prévision dans les analyses statistiques.

Classification des prévisions. Introduction aux modèles de régression et de séries chronologiques. Meilleure prévision en moyenne quadratique. Espérance conditionnelle. Calcul des prévisions dans les modèles de régression linéaire multiple.

2. Hétéroscédasticité

Nature de l'hétéroscédasticité. Corrections pour l'hétéroscédasticité. Tests statistiques pour détecter l'hétéroscédasticité: test de Goldfeld-Quandt, test de Breusch-Pagan-Godfrey et test de White.

3. Corrélation sérielle

Nature de la corrélation sérielle. Tests pour la corrélation sérielle. Test de Durbin-Watson. Modèles de régression avec erreurs autocorrélées. Procédure de Yule-Walker (Cochrane-Orcutt), des moindres carrés inconditionnels (Hildreth-Lu) et à vraisemblance maximale.

4. Lissage exponentiel.

Modèles de lissage exponentiel simple et double. Motivation. Liens avec le modèle de régression pondéré. Lissage double et méthode de Holt. Mise en oeuvre du lissage simple et double. Bandes de prévision.

5. Concepts fondamentaux de séries chronologiques.

Processus stationnaires et non-stationnaires. Stationnarité au second ordre. Stationnarité au sens strict. Autocorrélations et autocorrélations partielles. Estimation de la moyenne d'un processus stationnaire. Estimation des autocovariances et autocorrélations.

6. Modèles de séries chronologiques linéaires.

Modèles moyennes-mobiles (MA). Modèles autorégressifs (AR). Identification des ordres autorégressifs et moyennes-mobiles. Modèles autorégressifs moyennes-mobiles (ARMA). Modèles ARIMA. Modèles ARIMA saisonniers (SARIMA). Estimation du modèle. Validation. Préviation avec erreur quadratique moyenne minimale. Calculs des prévisions. Erreurs de prévision. Intervalles de confiance des prévisions. Tests basés sur les autocorrélations.

7. Introduction aux modèles autorégressifs conditionnellement hétéroskédastiques (si le temps le permet).

Formulation d'un modèle autorégressif conditionnellement hétéroskédastique (ARCH). Modèles ARCH généralisés (GARCH). Volatilité. Liens avec les Modèles ARMA.

Barème

Le barème proposé est le suivant:

Examen intra: 30%; Lundi, 17 février 2024, 08:30 - 10:29, 1177, Pav. André-Aisenstadt

Examen final: 40%; Lundi, 28 avril 2024, 08:30 - 11:29, Z-350, Pav. Claire-McNicoll

Projet: 10%

Travaux : 20%

Vous disposez d'une séance de travaux pratiques de deux heures les mercredis de 9h30-11h30. Durant les travaux pratiques, des exercices seront résolus, qui nécessiteront parfois l'utilisation du progiciel SAS et/ou R.

Il y aura deux devoirs et un projet final. Vous pouvez remettre les travaux par équipes de deux, à moins d'un avis contraire. Vous devez remettre vos devoirs sur StudiUM.

Pour réussir le cours, l'étudiant doit obtenir plus de 35 points dans la somme pondérée de l'intra et du final (valant au total 70%).

Les étudiants inscrits au Bureau de Soutien aux étudiants en Situation de Handicap (BSESH) désirant bénéficier de mesures d'accommodement aux examens (intra et final) sont priés de consulter le lien suivant pour connaître la procédure à suivre:

<https://safire.umontreal.ca/reussite-et-ressources/mesures-daccommodement-aux-examens-pour-les-etudiants-en-situation-de-handicap/>

Objectifs du cours

L'objectif principal du cours vise à présenter la théorie, les méthodes et la pratique statistique entourant l'élaboration des prévisions dans des modèles de plus en plus complexes. Ainsi, nous compléterons dans un premier temps l'étude du modèle de régression linéaire multiple en considérant des situations où les hypothèses classiques de Gauss-Markov ne tiennent plus forcément. À titre d'exemple, nous aborderons les situations où le terme d'erreur d'un modèle de régression linéaire multiple n'est pas de variance constante. Nous aborderons également le problème de l'autocorrélation qui pourrait être présente dans le terme d'erreur. Un autre objectif est l'introduction des techniques de lissage exponentiel et du calcul des prévisions dans ce contexte. Finalement, nous introduirons des concepts généraux entourant les processus stochastiques, plus particulièrement les processus stationnaires. Nous introduirons des modèles généraux de séries chronologiques, permettant de formuler des modèles pouvant décrire des observations perçues comme réalisation d'un processus stochastique.

L'apprentissage de l'analyse de données avec des logiciels est un autre objectif du cours. Nous utiliserons principalement le logiciel SAS, plus particulièrement le module SAS-ETS (principalement la procédure PROC ARIMA). Le logiciel SAS domine le secteur privé; il va sans dire que sa maîtrise est un atout. Nous utiliserons également le logiciel R.

Dans le projet final, les étudiants seront invités à télécharger une série chronologique réelle, par exemple provenant de la base CANSIM II (Canadian socio-economic information management system) de Statistique Canada, et à l'analyser en utilisant les techniques vues au cours. Les étudiants seront amenés à proposer un modèle pour la série chronologique choisie, et à évaluer la performance prévisionnelle du modèle adopté.

Il n'y a pas de livre obligatoire mais le contenu pour la première partie du cours se trouve dans Gujarati et Porter (2009, quatrième édition). Les chapitres couverts seront les chapitres 9 et 10, qui traitent de l'hétéroscédasticité et de la régression avec erreurs autocorrélées. D'autres éditions des livres de Gujarati sont disponibles.

La seconde partie du cours débute avec le lissage exponentiel, une référence possible est Bowerman, O'Connell et Koehler (2005, quatrième édition).

Le contenu portant sur les séries chronologiques se trouvent dans Brockwell et Davis (2016, troisième édition) ainsi que dans Wei (1994), portant sur les modèles de séries chronologiques (modèles ARMA et ARIMA, modèles saisonniers et non-saisonniers).

Si le temps le permet, nous aborderons les modèles ARCH, tels que décrits dans Tsay (2002).

Références

- Bowerman, B. L., O'Connell, R. T. et Koehler, A. B. (2005), *Forecasting, Time Series, and Regression. An Applied Approach*, 4ième édition, Thomson Brooks/Cole: United States
- Brockwell, P. J. et Davis, R. A. (2016), *Introduction to Time Series and Forecasting*, troisième édition, Springer-Verlag: New York.
- Gujarati, D. N. et Porter, D. C. (2009) *Essentials of Econometrics*, quatrième édition, McGraw-Hill, Irwin: New York.
- Tsay, R. S. (2002), *Analysis of Financial Time Series*, Wiley: New York.
- Wei, W. W. S. (1994), *Time Series Analysis, Univariate and Multivariate Methods*, Addison-Wesley Publishing Company, Advanced Book Program, Redwood City, CA.

Dernière mise à jour: 19 décembre 2024.