



## SYLLABUS

Niveau d'études : Master 1  
Semestre : 1

ECTS : 4

Cours : **Méthodes de Prévision**

CM : 30 heures

TD : 15 heures

Enseignant : Michel TERRAZA

E-mail : [michel.terraz@umontpellier.fr](mailto:michel.terraz@umontpellier.fr)

Modalité de contrôle des connaissances : examen terminal écrit d'1h30

### Objectif

Organiser les différentes méthodes de prévision à court terme des séries temporelles économiques, selon la nature de leurs différentes composantes. Pour cela, le cours rassemble des techniques éprouvées et traditionnelles (régression, désaisonnalisation, lissage exponentiel) dans un organigramme conclusif qui montre la logique, mais aussi les limites de leurs utilisations (Application en TD avec tableur Excel et logiciel Eviews)

### Pré-requis

Cours de Statistique Descriptive (1<sup>ère</sup> Année)

Cours de Statistique mathématique (2<sup>ème</sup> Année)

Cours de Méthodes Statistiques de l'économétrie (Licence)

### Contenu

Chap 1 : Analyse de la saisonnalité (Détection, Sélection Schéma, Méthode de désaisonnalisation)

Chap2 : Prévision de la chronique (Saisonnaire et non saisonnière)

Conclusion : Organigramme de prévision

### Bibliographie

R. Bourbonnais et M. TERRAZA (2010) : Analyse des séries temporelles : Application à l'économie et à la gestion, Dunod, Ed. 3 (Chap. 1 et 2)

R. Bourbonnais: Econométrie Dunod, 2013 Ed 8 ; V. Mignon : Econométrie, Economica, 2008 ; J. Johnston, J. Dinardo : Méthodes économétriques, Economica, 1999; W. Greene : Econométrie, Pearson Education, 2005