
EFFET DE L'HORIZON DES PRÉVISIONS SUR LA QUALITÉ DE L'AJUSTEMENT SAISONNIER

Salim CHERKAOUI

HCP, institut national de l'analyse de la conjoncture, Maroc

Sa.cherkaoui@hcp.ma

Mots-clés : prévision, désaisonnalisation, révision, séries temporelles

Résumé

L'ajustement saisonnier est une étape inévitable dans le processus d'analyse de la conjoncture, permettant de faciliter les exercices de comparaison dans le temps et dans l'espace et d'identification des retournements conjoncturels. La qualité de l'ajustement pourrait toutefois affecter ces deux exercices, notamment si les données corrigées des variations saisonnières s'avèrent instables. Cet article s'attèle à étudier l'horizon optimal des prévisions qui permet d'obtenir une meilleure stabilité des ajustements saisonniers. En retenant la méthode X13, nous avons opté pour une approche comparative des résultats obtenus pour 3 différents horizons de prévisions sur une année expérimentale. L'étude a été menée sur 32 séries mensuelles du secteur de la pêche au Maroc, s'étalant de janvier 1998 jusqu'à décembre 2016. Trois critères relatifs à l'examen de l'ampleur des révisions et deux tests d'hypothèses ont été utilisés à cet effet : le test des rangs signés de Wilcoxon et le test de Student pour deux échantillons appariés. Globalement, l'étude a révélé une légère amélioration des révisions non significative si on passe à 3 ans ou à 5 ans de prévisions. L'horizon optimal alors est celui d'un an, ce qui est généralement retenu l'exercice standard de désaisonnalisation.

[1] Bobbitt, L. and Otto, M. C. (1990), "Effects of Forecasts on the Revisions of Seasonally Adjusted Values Using the X-11 Seasonal Adjustment Procedure," Proceedings of the American Statistical Association, Business and Economic Statistics Section, 449-453

[2] Wilcoxon signed-rank test. (2015, August 11). In Wikipedia, The Free Encyclopedia. en.wikipedia.org/w/index.php?title=Wilcoxon_signed-rank_test&oldid=675600016

[3] Nicole Czaplicki (2015), U.S. Census Bureau, "The Effect of Forecast Quality on Seasonal Adjustment Revisions"