

HORIZON (D'UNE PRÉVISION) (N6)

(17 / 12 / 2019, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2019)

(i) Soit $X = (X_t)_{t \in T}$ un **processus stochastique** dans lequel T est un **groupe** additif ordonné et $x = (x_t)_{t \in T}$ une **série temporelle** générée par X .

Pour « *prévoir* » la valeur x_{J+H} de la série après un instant donné $J \in T$ (avec $H > 0$), on utilise généralement une **estimation** (eg **estimateur des mco**), notée eg \hat{x}_{J+H} ou $\hat{x}_J(H)$ de x_{J+H} .

On appelle alors **horizon** de la prévision $\hat{x}_J(H)$ l'élément H (ou parfois aussi l'élément $J + H$) de l'ensemble du temps T (cf **espace du temps**).

On appelle aussi **période de prévision** la durée $H - J$.

(ii) Si x est observée en **temps** discret (eg si $T \subset \mathbf{Z}$), H (resp $J+H$) est un nombre entier ; si x est observée en temps continu, on utilise la même terminologie (avec $H \in \mathbf{R}_+$ ou $J + H \in \mathbf{R}_+$) (cf graphe ci-après).

