

RAPPORT DE GOUTEREAU (D2, N9)

(10 / 06 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

(i) Soit $x = (x_t)_{t=1,\dots,T}$ une **série temporelle** réelle scalaire en **temps** discret (eg une **trajectoire** d'un **processus** du même type).

On appelle parfois **rapport de Ch. GOUTEREAU** la **statistique** (à valeurs non négatives) suivante :

$$(1) \quad G_T = \sum_{t=1}^{T-1} |x_{t+1} - x_t| / \sum_{t=1}^T |x_t - \bar{x}_T|,$$

dans laquelle $\bar{x}_T = T^{-1} \sum_{t=1}^T x_t$ désigne la **moyenne empirique**.

G_T représente donc le **rapport** entre la **moyenne** des **écarts** successifs absolus (ou « variations » successives absolues) et le **moment absolu** d'ordre 1 de la série.

(ii) Cette statistique est bornée supérieurement par 2. Elle permet de tester si x est une série autocorrélée (à l'ordre 1) (cf **autocorrélation**, **coefficient de corrélation sérielle**, **médiane mobile**, **rapport de NEUMANN**, **test de DURBIN-WATSON**).