

Changement du logiciel de désaisonnalisation

A partir de la publication d'octobre 2015, portant sur le 2^{ème} trimestre 2015, l'unité MAC1: Comptes nationaux, utilisera le nouveau logiciel de désaisonnalisation JDemetra+ (v2.0.0) pour la désaisonnalisation des comptes trimestriels.

Depuis le début de 2015, JDemetra+ est l'outil officiellement recommandé par Eurostat pour faire la désaisonnalisation de séries statistiques.

<http://ec.europa.eu/eurostat/web/ess/-/jdemetra-officially-recommended-as-software-for-the-seasonal-adjustment-of-official-statistics>

Les pays de l'Union Européenne et leurs Banques Centrales respectives sont invités par Eurostat à utiliser le nouveau logiciel JDemetra+, afin de garantir la comparabilité des données désaisonnalisées.

JDemetra+ est en ligne avec les «ESS Guidelines on Seasonal Adjustment»; il implémente parfaitement les deux méthodes prépondérantes dans le domaine de la désaisonnalisation, à savoir TRAMO-SEATS et X-13ARIMA-SEATS; il existe une large documentation et il a été testé extensivement sur des banques de données depuis plus d'une année par le «Seasonal Adjustment Centre of Excellence» (SACE), dont le Statec fait également partie.

Par rapport à Demetra+, plusieurs bugs ont été fixés et les versions les plus actuelles de TRAMO-SEATS et X-13ARIMA-SEATS ont été intégrées. Contrairement à Demetra+, JDemetra+ est un logiciel open-source qui offre la possibilité d'intégrer des plug-ins faits maison en Java.

Pour les dernières campagnes des comptes trimestriels, un «dual run» a eu lieu, pour évaluer l'impact d'un changement de logiciel sur les séries.

Concernant le taux de croissance du PIB, le maximum des différences dues uniquement au changement de logiciel est de l'ordre de 0.2% en glissement annuel et de l'ordre de 0.5% en glissement trimestriel.

Notons que le changement vers JDemetra+ n'affecte aucunement la méthode de désaisonnalisation utilisée. Le Statec utilisera comme auparavant la méthode X-13ARIMA-SEATS.

La publication d'octobre a été choisie pour le changement vers JDemetra+, car à ce moment les nouveaux modèles seront définis et gardés fixes pendant une année («Current adjustment (partial)»), jusqu'à la disponibilité de nouveaux comptes annuels.

La désaisonnalisation de l'indicateur Emploi pour l'unité CMP1: Conjoncture se fait en JDemetra+ depuis mi-juin 2015. Pour cet indicateur, aucune différence entre l'ancien logiciel Demetra+ et le nouveau logiciel JDemetra+ n'a été détectée.

JDemetra+ peut être téléchargé sur GitHub via

<https://github.com/jdemetra/jdemetra-app/releases>

La désaisonnalisation des comptes trimestriels par le Statec peut être reproduite à l'aide du manuel suivant:

<http://www.statistiques.public.lu/fr/methodologie/methodes/economie-finances/comptes-nat/comptes-nationaux/jd-course.pdf>

Pour de plus amples informations et en cas de questions, n'hésitez pas à contacter Véronique Elter sous veronique.elter@statec.etat.lu ou au (+352) 247-84335.