

# Choix d'une méthode de désaisonnalisation : application aux créations d'entreprise

*Virginie FABRE<sup>1</sup>*

Les séries de démographie d'entreprises, créations et défaillances, sont des indicateurs importants dans l'appréciation de la situation économique conjoncturelle. Pour interpréter ces indicateurs mensuellement, une correction des variations saisonnières est indispensable. Elle permet de comparer les évolutions entre deux mois consécutifs, ainsi que les chiffres au niveau international, sans que les effets de calendrier impactent ces valeurs.

Une bonne désaisonnalisation permet d'obtenir des indicateurs lisibles et interprétables. Elle est d'autant plus essentielle que la série des créations d'entreprises suscite un vif intérêt depuis le début des années 2000, suite aux nouvelles politiques engagées sur ce domaine. Le gouvernement ayant fait de la création d'entreprises une de ses actions prioritaires, les aides et dispositifs particuliers favorisant la création d'entreprises se sont multipliés et les créations ont ainsi crû de près de 26 % entre 2003 et 2005, ce qui impacte la saisonnalité de la série, fortement modifiée, donc nécessairement la désaisonnalisation. Il semble que la méthode de désaisonnalisation utilisée jusqu'alors ne tenait pas suffisamment compte des particularités de la série et de son évolution au cours des dernières années. Il s'avérait donc nécessaire de chercher si une méthode pouvait s'adapter à ces séries et de faire en sorte que l'évolution de la saisonnalité ne perturbe pas la série désaisonnalisée.

L'objectif a été dans un premier temps de construire une méthode de désaisonnalisation adaptée aux particularités que présentaient les séries de créations d'entreprises. Cette désaisonnalisation nécessitait à la fois de mettre en place une correction de jours ouvrables et une correction de variations saisonnières.

Une série de tests a ensuite été réalisée pour juger de la qualité des différentes méthodes retenues et chercher celle qui restituait le mieux l'information contenue dans la série brute des créations. Un large usage des méthodes d'analyse des données (Analyse en Composantes Principales et Classification Ascendante Hiérarchique) a aidé à cette comparaison et au choix final.

Enfin, après avoir évalué plusieurs modèles et méthodes de corrections simultanés de la saisonnalité et des effets de jours ouvrables, il s'agissait de revenir sur la pertinence de certaines hypothèses, notamment celle de la constance des effets de calendrier sur toute la période d'étude.

A l'issue de ce travail et en prenant en compte les contraintes qui étaient imposées, une méthode s'est avérée répondre aux critères nécessaires. La méthode de correction de variations saisonnières choisie est celle actuellement utilisée dans la publication des indicateurs de créations d'entreprises.

---

<sup>1</sup> Drees, Tél. : 01 40 56 88 19 - virginie.fabre@sante.gouv.fr