

Journées MAS 2010, Bordeaux

Session : Méthodes adaptatives pour les séries chronologiques

Sélection de variables explicatives pour une modélisation non-paramétrique de la consommation d'électricité française

par **Vincent Lefieux** et Laurence Teyssier-Maillard

Une prévision correcte de la consommation d'électricité est fondamentale pour le bon fonctionnement du réseau électrique français, dont RTE (Réseau de Transport d'Electricité) a la charge. Les prévisions utilisées quotidiennement sont issues d'un modèle alliant une régression paramétrique non linéaire et un modèle SARIMA. Dans l'idée d'obtenir un modèle de prévision adaptatif, nous testons des méthodes de prévision non-paramétriques, notamment la méthode IBR (Iterative Bias Reduction) qui pallie le fléau de la dimension dont souffrent communément les modèles non-paramétriques. Nous présentons dans cette communication la procédure de sélection de variables explicatives et son application à la consommation d'électricité française pour laquelle cette méthode se révèle performante.

Adresses :

Vincent LEFIEUX
RTE DMA
Immeuble Le Colbert
9, rue de la Porte de Buc
BP 561
78005 VERSAILLES CEDEX
E-mail : vincent.lefieux@rte-france.com

Laurence TEYSSIER-MAILLARD
RTE DMA
Immeuble Le Colbert
9, rue de la Porte de Buc
BP 561
78005 VERSAILLES CEDEX
E-mail : laurence.teyssier-maillard@rte-france.com

Session : Méthodes adaptatives pour les séries chronologiques