

LA MACRO - EXPRESSION DE LA REGRESSION LINEAIRE

La macro-expression « regser » applique la procédure PROC REG sur des observations supposées être des séries chronologiques. « regser » imprime, pour chaque observation, la valeur estimée et l'erreur constatée (écart entre la vraie valeur et la valeur estimée) en utilisant les paramètres définis dans le tableau ci-dessous.

Argument	Signification
filin	Nom symbolique du tableau Sas qui contiendra la variable à expliquer et les variables explicatives
filout	Nom que l'on veut donner au tableau SAS qui contiendra les résultats
vaest	Nom de la variable à expliquer (Y) dans le tableau filin
vest	Liste des variables explicatives (X) dans le tableau filin.
ident	Identifiant des observations présent dans filin.

Une fois ces calculs terminés, la macro-expression « regser » ci-dessous applique la procédure PROC CORR pour calculer les corrélations entre l'erreur et l'erreur décalée d'un temps, de deux temps et de trois temps.

```
%MACRO regser (filin,filout,vaest,vest,ident);

/* Regression linéaire sur séries chronologiques*/

PROC REG DATA=&filin;
MODEL &vaest=&vest;
OUTPUT OUT = &filout P=estime;

DATA &filout;
SET &filout;
erreur = 100*(&vaest-estime)/estime;
PROC SORT ;
BY erreur;

PROC PRINT DATA=&filout;
VAR &ident &vaest estime erreur;

DATA &filout; SET &filout;
erlag1=LAG1(erreur);
erlag2=LAG2(erreur);
erlag3=LAG3(erreur);
PROC CORR ;
VAR erreur ;
WITH erlag1-erlag3;
TITLE "autocorrélation de l''erreur" ;

%MEND regser ;
```