

RESULTATS DU TP2

Résultats sur données simulées avec $\text{rng}(100)$

Seuil optimal : 0

x_dgp	x	std	tstat	pval
-0.5000	-0.5734	0.1251	-4.5846	0.0000
0.5000	0.4978	0.0746	6.6744	0.0000
0.5000	0.4009	0.1078	3.7182	0.0002
0.7000	0.7026	0.0528	13.3177	0

Statistique de test de linéarité : 35.9668

p-value : 0

Table du test de linéarité : VC à 5% = 11.8408

Test de Ljung Box sur les résidus : 0.6920 0.7323 0.6853

Test de Ljung Box sur les résidus au carré : 0.8871 0.9281 0.8859

Test de Jarque Bera sur les résidus (Stat VC pvalue) : 0.5466 5.8578 0.5000

Warning: P is greater than the largest tabulated value, returning 0.5.

Application sur le PIB US : SETAR(2,2) avec comme variable de seuil le VIX retardé d'une période

Le seuil estimé est égal à : 26.1600

bet	std	tstat	pval
0.4758	0.1071	4.4442	0.0000
0.0858	0.1087	0.7891	0.4301
0.2117	0.1013	2.0900	0.0366
0.1903	0.1217	1.5639	0.1178
0.8010	0.1651	4.8520	0.0000
-0.1879	0.1790	-1.0499	0.2938

régime 1 (moy et sig) : 0.6772 0.4524

régime 2 (moy et sig) : 0.4917 0.7013

Test de Ljung Box sur les résidus : 0.9767 0.4943 0.4214

Test de Ljung Box sur les résidus au carré : 0.6553 0.5264 0.4320

Test de Jarque Bera sur les résidus avec Stat VC pvalue : 5.5812 5.5048 0.0488