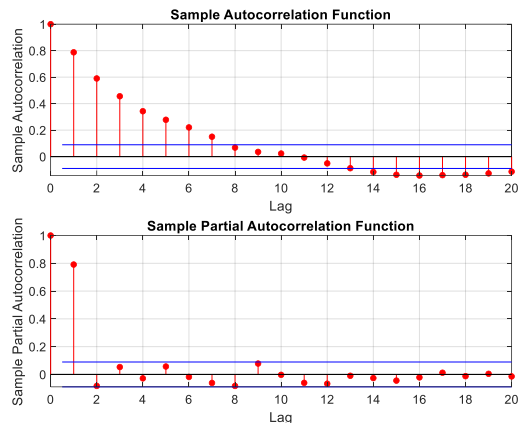
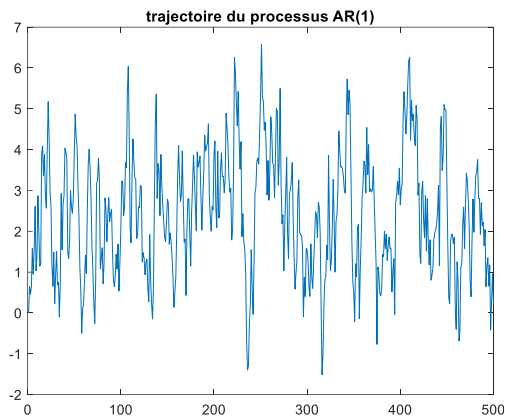


RESULTATS DU TP1

Résultats sur les données simulées avec rng(100)



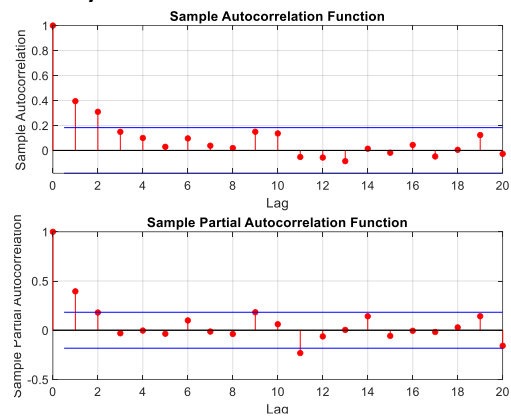
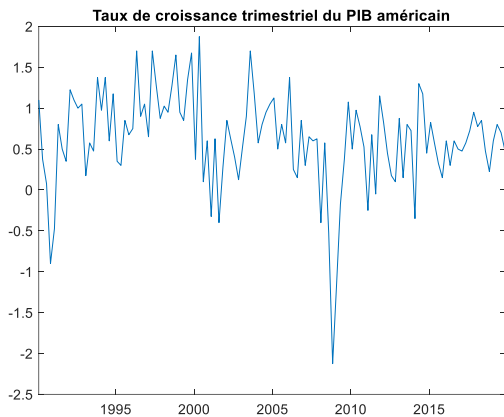
Estimation et tests de signicativité des coefficients

x_dgp	x	std	tstat	pval
0.5000	0.5074	0.0778	6.5258	0.0000
0.8000	0.7910	0.0274	28.9138	0

Tests sur les résidus

Test d'autocorrélation dans les résidus : 0.3023 0.0867 0.3475
 Test d'effets ARCH dans les résidus : 0.2858 0.1787 0.0571
 Test de normalité des résidus : 0.4641

Résultats sur la croissance trimestrielle du PIB US (1990-2019)



Résultats sans indicatrice de crise

x	std	tstat	pval
0.3038	0.0782	3.8849	0.0001
0.3286	0.0903	3.6378	0.0003
0.1798	0.0901	1.9964	0.0459

Test de Ljung Box sur les résidus
 0.9792 0.4516 0.3037
 Test de Ljung Box sur les résidus au carré
 0.6695 0.8878 0.9793
 test de Jarque Bera sur les résidus
 Stat VC pvalue
 41.3153 5.5048 **0.0010**

Résultats avec indicatrice de crise

x	std	tstat	pval
0.3570	0.0717	4.9816	0.0000
-2.4728	0.4885	-5.0622	0.0000
0.2467	0.0835	2.9565	0.0031
0.2094	0.0819	2.5579	0.0105

Test de Ljung Box sur les résidus
 0.7254 0.3466 0.3020
 Test de Ljung Box sur les résidus²
 0.7516 0.7597 0.6384
 test de Jarque Bera sur les résidus
 Stat VC pvalue
 0.4415 5.5048 0.5000