

TD 7 — Correction & explications (JB, stabilité)

1) Jarque–Bera

- **Statistique** : $JB = N \cdot (S^2/6 + (K-3)^2/24)$, où S = skewness, K = kurtosis.
- **Décision** : comparer à $\chi^2(2) = 5.9915$ (5%).
- Exemples usuels :
 - Sous-échantillon **PNBH < 1290** : $JB = 11.99 > 5.99$ **non normal**.
 - **PNBH = 1290** : $JB = 0.02 < 5.99$ **normal**.
 - **Total** : $JB = 2.23 < 5.99$ **normal**.

2) Stabilité (interactions)

- Créer `pnbh_dummy`.
- Tester `TEP × pnbh_dummy` (et/ou `TXPNBH × pnbh_dummy`).
- **H0** : coefficient du terme interactif = 0 (effet identique entre groupes).
- Rejet **H0 instabilité** (effet différent selon le niveau de PNBH).

3) Remarques

- Vérifier **homoscédasticité** et **spécification** en complément (tests White / RESET).
- Interpréter l'**importance économique** des effets selon les sous-échantillons.