

TD 7 — Normalité (Jarque–Bera) & spécification

Objectifs

- Appliquer le **test de normalité de Jarque–Bera** (JB) sur différents sous-échantillons.
- Construire une **variable muette** pour un seuil de revenu et tester des **interactions** (stabilité).

Données

Workfile **BERA** : 99 pays (1989). Variables : TU089, PNBH, SUPER, TEP, TXPNBH, JEUNE.

Travail

1. Estimer : $TU089 = c + a \cdot PNBH + b \cdot \log(SUPER) + d \cdot TEP + e \cdot TXPNBH + f \cdot JEUNE$:
 - (i) **PNBH** < 1290, (ii) **PNBH** ≥ 1290, (iii) tous.
 - Pour chaque cas, appliquer **JB** (*Histogram – Normality test*).
 - Décider au seuil 5% : **H0** : normalité (df = 2).
2. Créer **pnbh_dummy** = (PNBH ≥ 1290) et tester la **stabilité** via interactions :
 - Ajouter **TEP × pnbh_dummy** (et/ou **TXPNBH × pnbh_dummy**) ;
 - Tester la significativité (t ou **Wald**).