

Économétrie — TD 7

Exogénéité, instrumentation et sur-identification

Pierre Beaucoral

```
library(knitr)
knit_hooks$set(optipng = hook_optipng)
```

Test de sur-identification

Questions TDs

1- Appliquez le test d'exogénéité de *Nakamura et Nakamura* en utilisant trois ensembles d'instruments :

- i)- *motheduc* (éducation de la mère)
- ii)- *motheduc* et *fatheduc* (éducation du père)
- iii)- *motheduc*, *fatheduc* et *huseduc* (éducation du mari)

Afficher la réponse

2- Si cela vous semble pertinent, appliquez les *doubles moindres carrés (DMC)* en utilisant les trois ensembles d'instruments.

3- Appliquez, lorsque cela est possible, le test de *sur-identification de Sargan*.

4- Réalisez un test de **White** sur les estimations **DMC** et appliquez, si besoin est, la procédure de correction de **White**. Qu'en concluez- vous ?