21/04/2023

TP2 : Économétrie des séries temporelles

Thomas Vaudescal (11237578) – Benjamin Viau

Table des matières

[Question 1 2](#_Toc132966497)

[Sous question 1 2](#_Toc132966498)

[Sous question 2 2](#_Toc132966499)

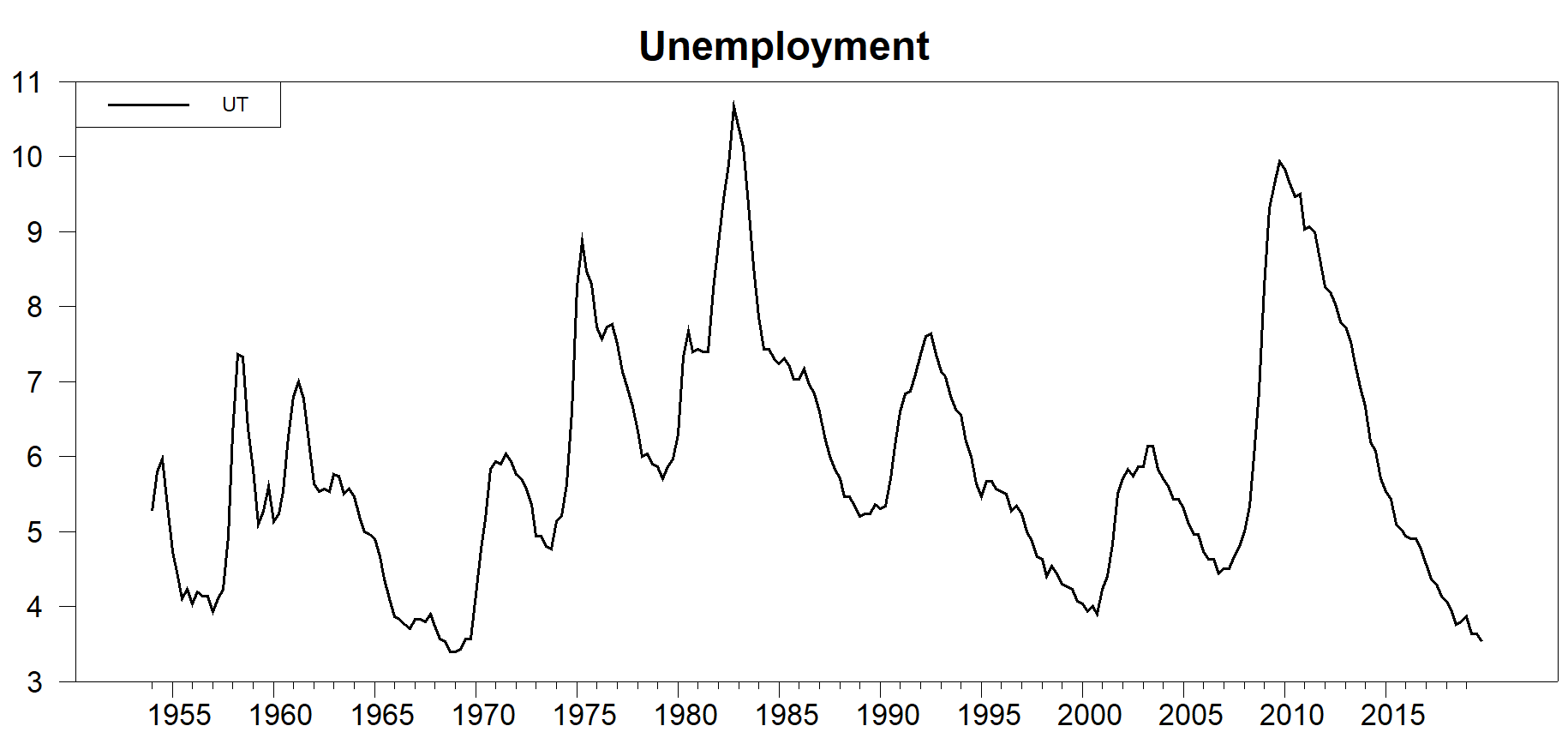
[(a) 2](#_Toc132966500)

[(b) 3](#_Toc132966501)

[Sous question 3 3](#_Toc132966502)

# Question 1

## Sous question 1



Graphique - Taux de chômage américain de 1954 à 2019 dernier trimestre

## Sous question 2

### (a)

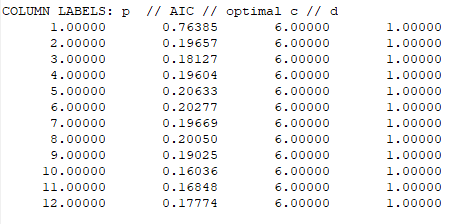


Tableau - Résultats avec critère AIC pour le modèle SETAR avec treshold et lag connu

À partir du Tableau 1, on remarque que **le lag optimal p est 10** car c’est celui qui minimise le critère d’information d’AIC, avec c = 6% et d = 1.

### (b)

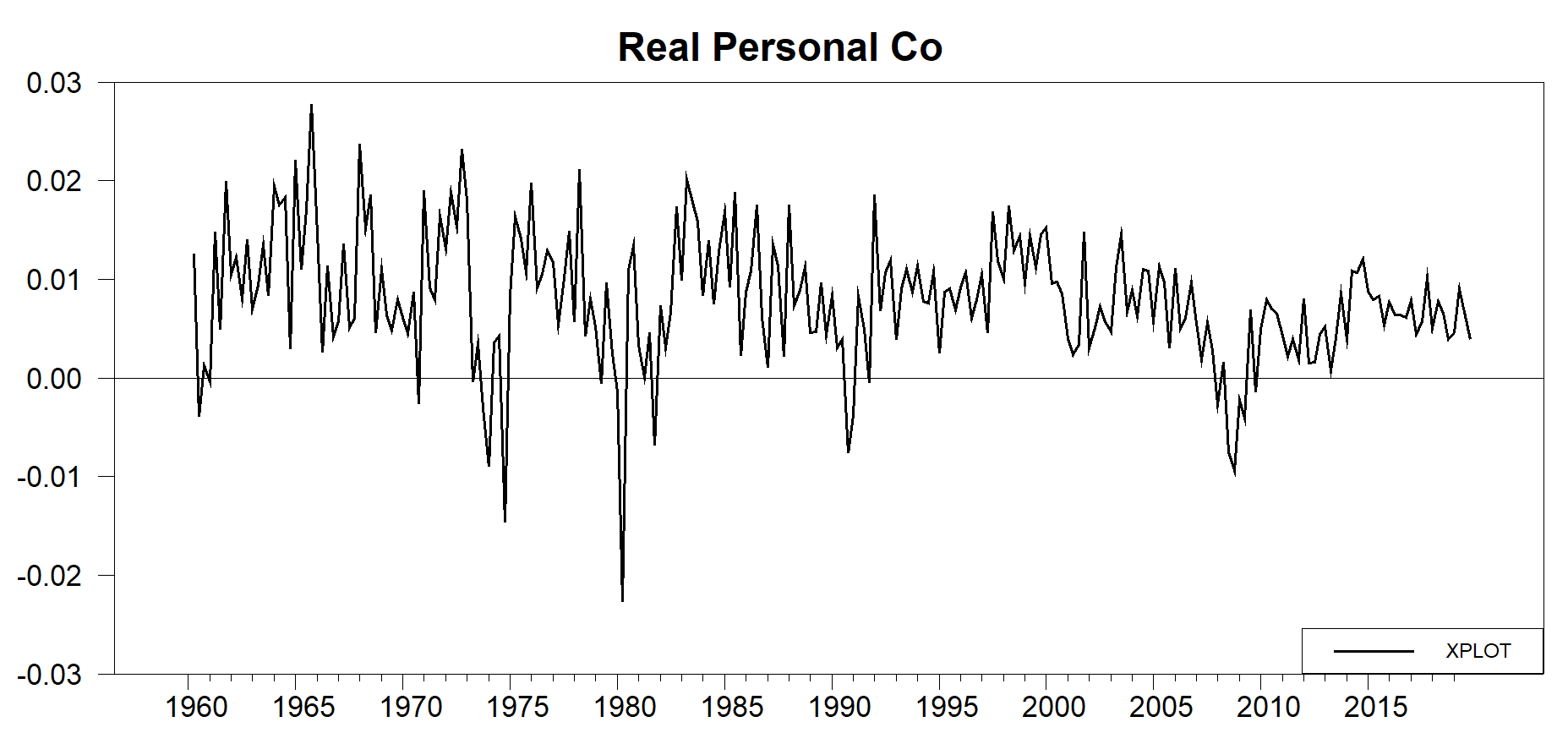
À compléter

## Sous question 3

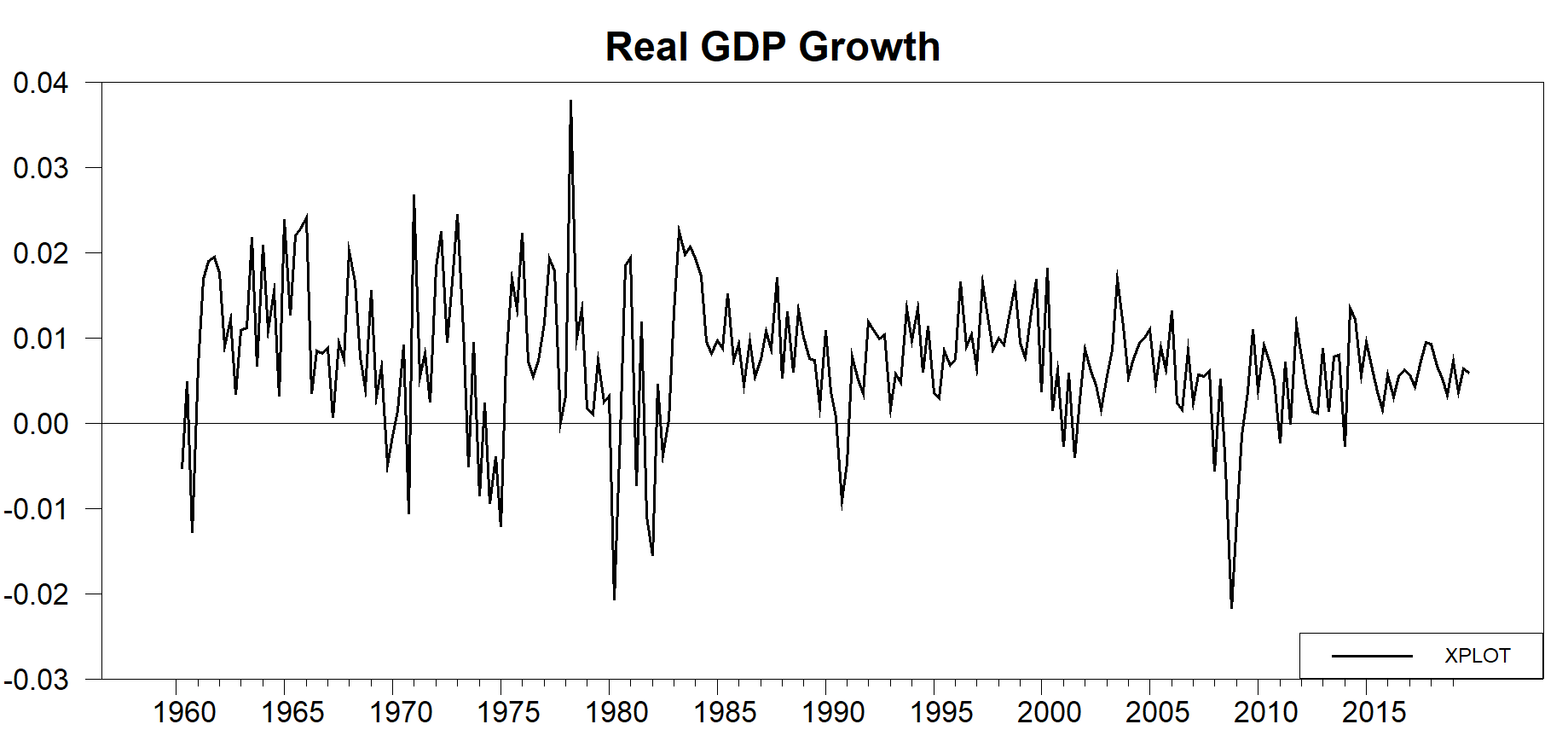
La 3 dépend du (b)

# Question 2

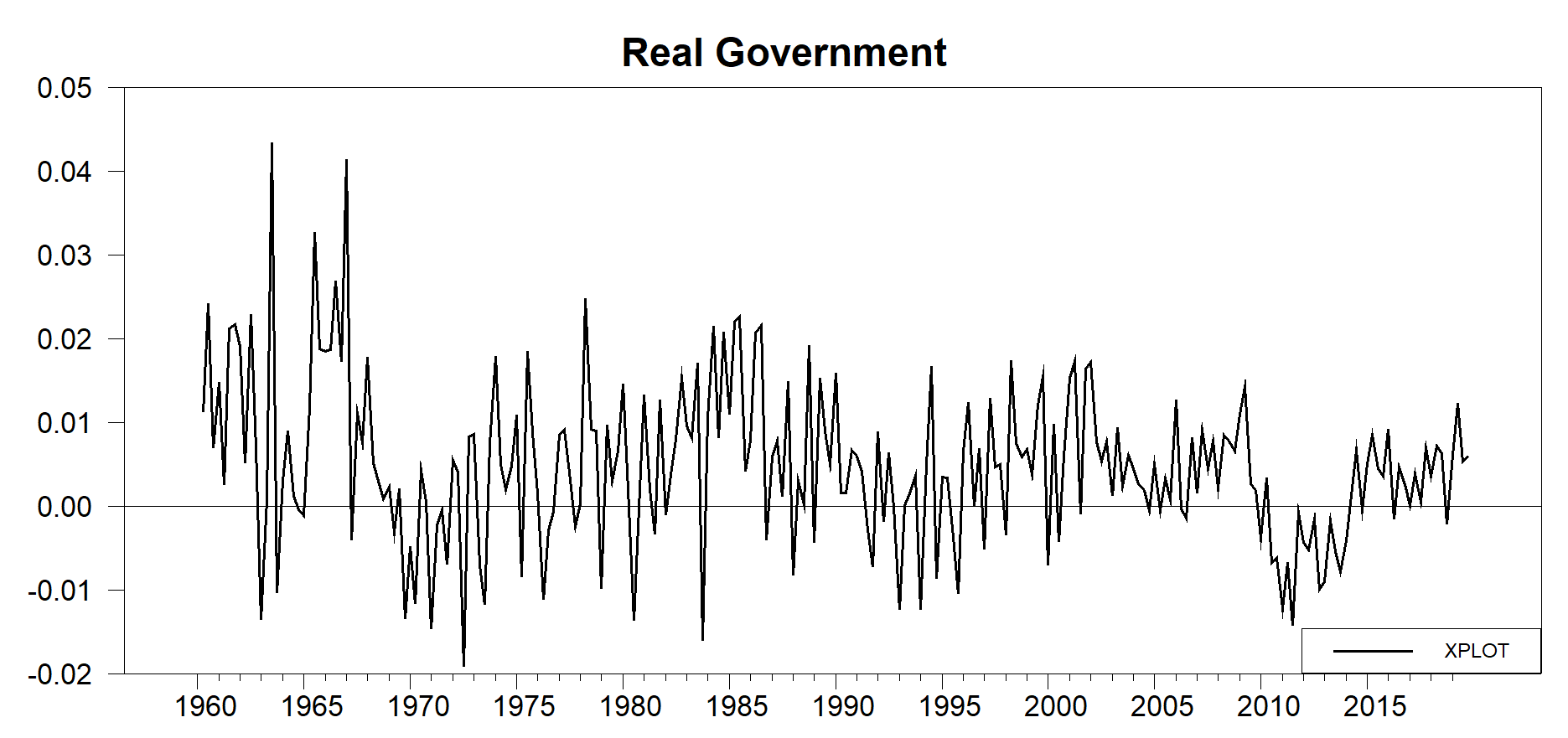
## Sous question 1



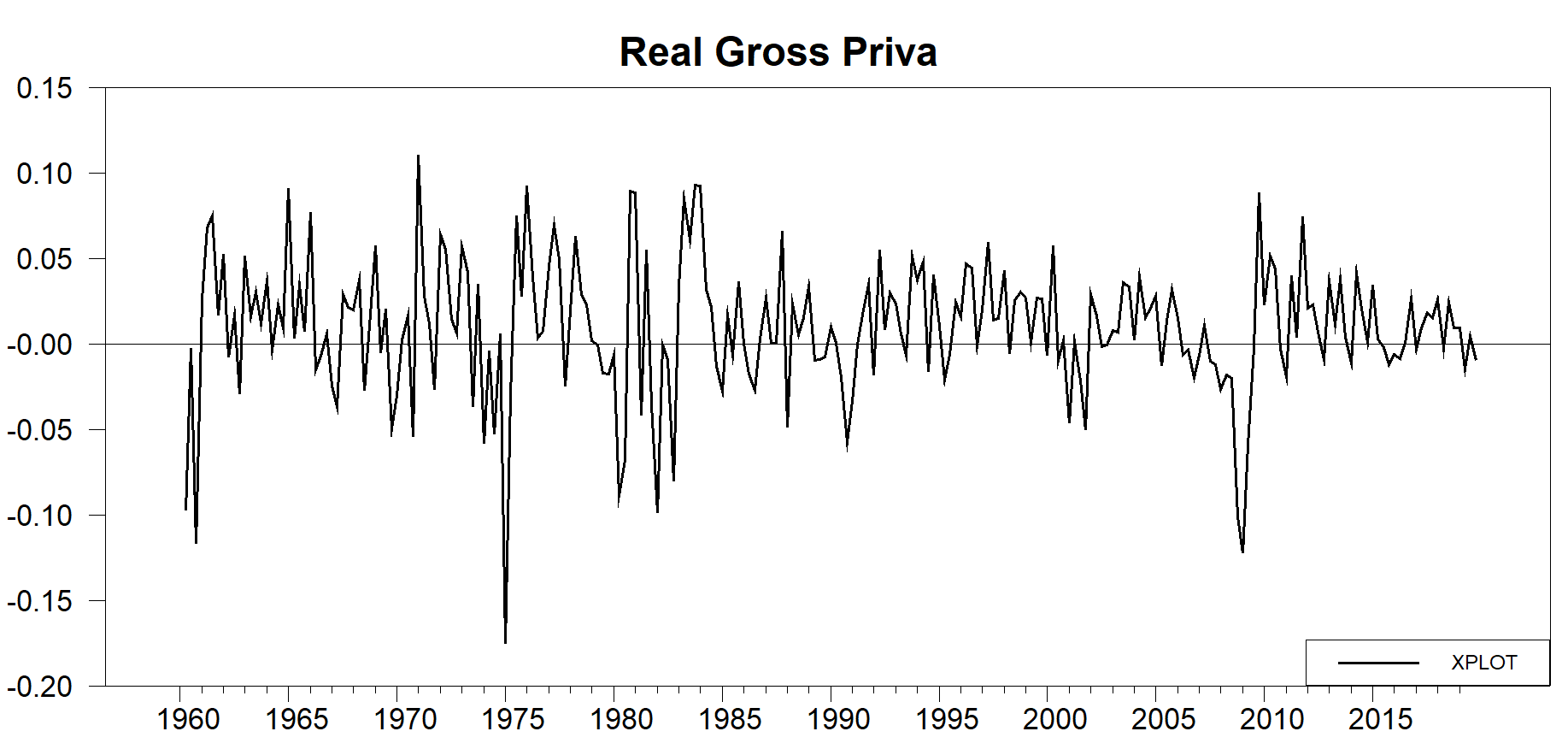
Graphique - Dépenses réelles de consommation personnelle (différence en log première de Ct)



Graphique - PIB réel (différence en log première de Yt)



Graphique - Dépenses réelles de consommation publique (différence en log première de Gt)



Graphique - Investissement privé brut réel (différence en log première de It)

## Sous question 2