

# Économétrie des Séries Temporelles

## Devoir Maison #2

### Analyse macroéconomique VAR

*L'utilisation d'une IA est **strictement** proscrite*

*Le Devoir Maison #2 (DM#2) est optionnel, la note finale sera calculée ainsi :*

$$\begin{aligned} & \max\{0.4 \times \textit{Projet} + 0.6 \times \textit{Partiel}; \\ & \quad 0.4 \times \textit{Projet} + 0.5 \times \textit{Partiel} + 0.05 \times \textit{DM\#1} + 0.05 \times \textit{DM\#2}; \\ & \quad 0.4 \times \textit{Projet} + 0.55 \times \textit{Partiel} + 0.05 \times \textit{DM\#2}\} \end{aligned}$$

Analyser à l'aide d'un **modèle VAR**, les données macroéconomiques **PIB** et **Chômage** sur une période de **100 trimestres**. Les données sont celles simulées dans le chunk **data**. Commenter chaque étape et chaque résultat :

1. Grapher les données
2. Tester la stationnarité et transformer les données si besoin
3. Estimer un modèle VAR
4. Tester la causalité *a la* Granger
5. Analyse des IRF