

QUESTION #1 : (40 points)

1. Définissez les termes suivants :

- a) modèle linéaire classique;
- b) collinéarité exacte;
- c) hétéroscédasticité;
- d) statistique de Durbin-Watson (précisez son utilisation);
- e) modèle à erreurs sur les variables;
- f) méthode des variables instrumentales;
- g) test de Fisher;
- h) test de Goldfeld et Quandt.

QUESTION #2 : (20 points)

2. Donnez un exemple (version simple) d'un

- a) modèle à ajustement partiel,
- b) modèle à anticipations adaptives,

et discutez les problèmes d'estimation associés.

QUESTION #3 : (20 points)

3. Démontrez l'identité suivante :

$$\bar{R}^2 = R^2 - \frac{K-1}{T-K} (1 - R^2).$$

QUESTION #4 : (20 points)

4. Utilisant un modèle à équation simultanées simple

- a) décrivez les problèmes qui se posent dans l'estimation de tels modèles;
- b) décrivez comment un tel modèle peut être estimé de façon

convergente.

SIGNATURE DU PROFESSEUR

*JM Dufour*