

Test de présélection des candidats en vue de l'inscription
En master d'économétrie appliquée à la modélisation des comportements macro et microéconomiques
Vendredi 12 Octobre 2012 – 9 h

Traiter en 2 heures, les questions suivantes

Question 1

(6 points)

- i. Les fonctions de la Monnaie : les citer et dire en quoi chacune consiste
- ii. Indiquer parmi ces fonctions, laquelle est la moins bien remplie et expliquer pourquoi.

Question 2

(10 points)

La spécification suivante retient deux variables : la FBCF (la Formation Brute de capital Fixe) et IprixM (l'Indice des prix des Importations), pour expliquer les importations (Imp).

Les paramètres ont été estimés sur la période 1970 à 2008, et les résultats obtenus sont :

$$\text{Imp}_t = 23,06 \text{ FBCF}_t - 0,43 \text{ IprixM}_t + 45,20$$

(10,14) (0,21) (40,38)

Entre parenthèses, figurent les écarts types estimés des estimateurs. $R^2 = 0,95$ et $DW = 2,103$
 Analysez ces résultats sur le plan économique et sur le plan statistique.

Question 3 : Soit la statistique de Student :
$$T = \frac{\frac{\hat{a}_k - a_k}{\delta_k \sqrt{V_k}}}{\frac{\sqrt{\hat{u}'\hat{u}}}{\delta \sqrt{n-p}}} = \frac{\hat{a}_k - a_k}{\sqrt{V_k \cdot \hat{u}'\hat{u}} \cdot \frac{\delta}{\delta \sqrt{n-p}}}$$

(4 points)

Donner le sens de chacune de ses composantes et dire l'intérêt de sa construction