

« Econométrie »

Régis Bourbonnais, Dunod, 10^{ème} éd., 2018

Errata

Page 9 : Dernière ligne

2) Calculer le coefficient de corrélation simple et testez sa significativité par rapport à 0 pour un seuil $\alpha = 0,05$.

Page 28 : numérateur de la formule

En effet $\frac{\hat{a}_1 - a_1}{\hat{\sigma}_{\hat{a}_1}} = \frac{\frac{\hat{a}_1 - a_1}{\sigma_{\hat{a}_1}}}{\sqrt{(n-2) \frac{\hat{\sigma}_{\hat{a}_1}^2}{\sigma_{\hat{a}_1}^2} \frac{1}{(n-2)}}}$ est le rapport d'une loi normale centrée réduite à la

racine carrée d'un chi-deux divisé par son degré de liberté.

Page 36 : Dernière ligne du tableau 5

Total	$SCT = \sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2$	$n - 1$	
-------	--	---------	--

Page 64 : Formule annule et remplace

En effet, $F = \frac{\frac{1}{k+1} (\hat{a} - a)' [\sigma_\varepsilon^2 (X'X)^{-1}]^{-1} (\hat{a} - a)}{(n-k-1) \frac{\hat{\sigma}_\varepsilon^2}{\sigma_\varepsilon^2} \frac{1}{(n-k-1)}}$