

*CORRIGE DE L'EXERCICE CHAPITRE 7- EXERCICE 5

*Dalila Chenaf-Nicet Université de Bordeaux.

* Tout d'abord s'assurer d'avoir ouvert le fichier de données stata C7EX5 avant d'ouvrir le do.fileC7EX5 qui est le fichier programme.

* Attention l'exercice 5 utilise comme pour l'exercice 2 le même fichier de données excel (noté dans l'ouvrage C7EX2)

* Une fois le fichier de données ouvert ainsi que le do-file appuyer sur Run

*(Exécute en haut à droite de la barre de menu du dofile) pour démarrer le programme. Il sera exécuté dans son intégralité.

* Toutefois il est possible en sélectionnant les parties du programme de l'exécuter pas à pas afin de voir apparaître pas à pas les différents résultats.

*

CHAPITRE 7 EXERCICE 5

*Estimation d'un modèle d'ajustement partiel et d'anticipations adaptatives

* On commence par préciser la variable du temps
tsset date

* Nous estimons un modèle autorégressif d'ordre 1 avec autocorrélation des erreurs (Hildrethb-Lu)

* Nous créons une variable retard au préalable

gen Ly=L.y

* L'estimation est donnée par :
hlu y Ly x

* Nous récupérons les coefficients nécessaires aux calculs:

scalar alpha=(1-_b[Ly])
display alpha

scalar ahat0=_b[_inter]/alpha
display ahat0

scalar ahat1=_b[x]/alpha
display ahat1

* Le modèle d'ajustement partiel est donc :

* $y_t = ahat0 + \alpha * x_t$ et

* Le modèle d'anticipations adaptative

* $y_t = ahat0 + \alpha * x_t(\text{puissance } p) + et$

* avec $x_t(\text{puissance } p) = x_t - x_{t-1}(\text{puissance } p) = \alpha * (x_t - x_{t-1}(\text{puissance } p-1))$