

Errata

Avant propos page IX (remplacer url) :

<http://regisbourbonnais.dauphine.fr>

Page 53 : (en bas)

La matrice M_1 est symétrique et idempotente ($M_1' M_1 = M_1$), de plus $M_1 X_1 = 0$.

Page 60 : (en haut)

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

Page 98 : (en haut)

$$\text{Soit } F^* = \frac{(1,853 - (0,795 + 0,629)) / 3}{(0,795 + 0,629) / 44} \approx 4,42 \dots$$

Page 101 : (deuxième tableau)

Premier élément : \hat{a}_3

Page 225 (note de bas de page)

Dunod, 2010.

Page 235 (note de bas de page)

Chapitre 5, 2010.

Page 237 (note de bas de page)

, 2010.

Page 271 (annule et remplace)

Prenons l'exemple d'un VAR à 4 variables Y1, Y2, Y3 et Y4.

Si nous choisissons l'ordre de décomposition de Cholesky suivant : Y3 Y2 Y1 Y4, cela entraîne :

- un choc en période 1 sur Y3 (la variable la plus exogène) a un impact sur l'ensemble des quatre variables ;
- un choc en période 1 sur Y2 a un impact sur Y2, Y3 et Y4, absence de corrélation contemporaine avec Y3 ;
- un choc en période 1 sur Y1 a un impact sur Y1 et Y4, absence de corrélation contemporaine avec Y3 et Y2 ;
- enfin, un choc en période 1 sur Y4 (la moins exogène) n'a un impact que sur elle-même, absence de corrélation contemporaine avec Y3, Y2 et Y1.

Bibliographie (Page 369, remplacer)

Bourbonnais R., Terraza M., Analyse des séries temporelles, Dunod, Paris 3^e éd., 2010.