Document generated on 04/25/2024 3:48 p.m.

L'Actualité économique

Studies in Econometric Method, par un groupe de préposés à la recherche de la Cowles Commission, sous la direction de WM.-C. HOOD and TJALLING-C. KOOPMANS. Un vol., 6 po. x 9¼, relié, XVII et 323 pages —JOHN WILEY & SONS, INC., New-York, 1953 ($5.50)

Roger Dehem

Volume 31, Number 2, July–September 1955

URI: https://id.erudit.org/iderudit/1002624ar
DOI: https://doi.org/10.7202/1002624ar

See table of contents

Publisher(s)

HEC Montréal

ISSN

0001-771X (print)
1710-3991 (digital)

Explore this journal

Cite this review

Dehem, R. (1955). Review of [*Studies in Econometric Method*, par un groupe de préposés à la recherche de la Cowles Commission, sous la direction de WM.-C. HOOD and TJALLING-C. KOOPMANS. Un vol., 6 po. x 9¼, relié, XVII et 323 pages —JOHN WILEY & SONS, INC., New-York, 1953 ($5.50)]. *L'Actualité économique*, *31*(2), 306–307. https://doi.org/10.7202/1002624ar

Tous droits réservés © HEC Montréal, 1955

This document is protected by copyright law. Use of the services of Érudit (including reproduction) is subject to its terms and conditions, which can be viewed online.

https://apropos.erudit.org/en/users/policy-on-use/

This article is disseminated and preserved by Érudit.

Érudit is a non-profit inter-university consortium of the Université de Montréal, Université Laval, and the Université du Québec à Montréal. Its mission is to promote and disseminate research.

https://www.erudit.org/en/

Les Livres

Studies in Econometric Method, par un groupe de préposés à la recherche de la Cowles Commission, sous la direction de WM.-C. HOOD and TJALLING-C. KOOPMANS. Un vol., 6 po. × 9¼, relié, XVII et 323 pages. — JOHN WILEY & SONS, INC., New-York, 1953. ($5.50).

L'économétrie est une discipline à cheval sur la théorie économique et la statistique. Elle vise à quantifier, avec autant de précision que possible, les paramètres des lois économiques, que la théorie ne fait que signaler. Ces lois, qui forment une *structure* à identifier, sont aléatoires, et les prévisions auxquelles elles donnent lieu sont donc soumises à des distributions de probabilité, dont il y a lieu de définir les caractéristiques. À cette première complication, s'ajoute la difficulté d'identifier la structure sous-jacente à la réalité observée, en raison de l'impossibilité d'expérimenter, et du nombre limité d'observations possibles ou disponibles. Au surplus, ces observations ne sont pas toujours exemptes d'erreurs. Et, après tout, la structure sous-jacente, même parfaitement identifiée, est-elle vraiment constante dans le temps? C'est là, pour plusieurs économètres un article de foi, dont il reste à démontrer le bien-fondé.

Dans l'après-guerre, des progrès énormes ont été accomplis par les chercheurs d'élite de la Cowles Commission dans la clarification et l'approfondissement des problèmes posés par la prévision économique sur la base d'estimations statistiques des paramètres des structures passées. Le présent ouvrage fait suite au *Statistical Inference in Dynamic Economic Models*, édité par T. Koopmans en 1950, dont il reprend les thèmes dans un langage moins technique, quoique encore impénétrable pour le non-mathématicien.

Dans le chapitre introductif, J. Marschak montre la nécessité de la connaissance de la structure des relations économiques pour la prévision et la politique économique. Même si l'on s'attend à un changement de structure dans l'avenir, la prévision des variables futures requiert quelque connaissance de la structure passée.

T. Koopmans examine, dans le chapitre II, les conditions nécessaires à l'identification des paramètres structurels. Cette identification n'est pas toujours possible, même si l'on dispose d'un nombre infini d'observations.

Dans le chapitre III, Herbert-A. Simon discute de la relation de causalité, et de son rapport avec le problème d'identification. Dans les débats méthodologiques, la relation fonctionnelle ou d'interdépendance s'est généralement substituée à la relation causale, résidu de philosophie médiévale, dont l'emploi a cependant persisté dans les discussions scientifiques. H. Simon réhabilite la relation causale en lui donnant le sens spécifique de relation asymétrique, pour la distinguer de l'interdépendance qui elle est symétrique.

Les chapitres IV et V exposent deux applications des méthodes d'estimation des structures, l'une par T. Haavelmo: méthodes d'estimation de la propension marginale à consommer, et l'autre par M.-A. Girschick et T. Haavelmo: analyse statistique de la demande alimentaire.

Le chapitre VI, par T. Koopmans et W.-C. Hood, est un exposé complet d'une méthode d'estimation des relations économiques linéaires et simultanées. Notons les restrictions posées a priori au problème: l'on présuppose que les relations sont linéaires, que les éléments aléatoires sont normalement répartis, que les paramètres sont identifiables, et que les observations ne sont pas entachées d'erreurs.

La suite du volume comporte des contributions d'intérêt plus spécial par H. Chernoff, H. Rubin, S.-G. Allen, J. Bronfenbrenner et N. Divinsky.

Souhaitons qu'un jour le succès dans l'application de ces méthodes vienne justifier la dépense énorme d'énergie intellectuelle que comportent ces détours méthodologiques.

Roger Dehem

Demand Analysis (A Study in Econometrics), par HERMAN WOLD et LARS JUREEN. Un vol., 6 po. × 9¼, relié, XVI et 358 pages. — JOHN WILEY & SONS, INC., New York et ALMQVIST & WIKSELL, Stockholm, 1953. ($8.40).

L'auteur principal, H. Wold, est l'économètre suédois actuellement le plus en vue. Élève du célèbre mathématicien-statisticien Crâmer, il soumet ses recherches économétriques à la discipline la plus rigoureuse. Il est actuellement professeur de statistique à l'université d'Uppsala.

Les origines de l'ouvrage ici résumé remontent à une étude de la demande de consommation faite pour le gouvernement suédois en 1938-40. Il s'agissait de combiner l'analyse des budgets familiaux et de statistiques de marché pour déterminer la structure de la demande de 1920 à 1938.

Continuant l'œuvre de H.-L. Moore, A. Bowley, R.-G.-D. Allen, et de H. Schultz, H. Wold a repensé les fondements méthodologiques de l'estimation des lois de demande. Quatre des cinq parties qui divisent le livre sont consacrées à la théorie économique et statistique. La première partie constitue à la fois une introduction et un résumé. La lecture en est facile et extrêmement intéressante. En particulier la discussion de l'emploi controversé de la méthode des moindres carrés est lumineuse. En une trentaine de pages, l'auteur résume le débat et fait