

Propriétés des moments des coefficients de régression dans un modèle de régression linéaire avec erreurs autocorrelées

Thuan V. Truong

Volume 57, numéro 3, juillet–septembre 1981

21^e Congrès annuel de la Société Canadienne de Science économique

URI : <https://id.erudit.org/iderudit/600997ar>

DOI : <https://doi.org/10.7202/600997ar>

[Aller au sommaire du numéro](#)

Éditeur(s)

HEC Montréal

ISSN

0001-771X (imprimé)

1710-3991 (numérique)

[Découvrir la revue](#)

Citer ce compte rendu

Truong, T. V. (1981). Compte rendu de [Propriétés des moments des coefficients de régression dans un modèle de régression linéaire avec erreurs autocorrelées]. *L'Actualité économique*, 57(3), 426–427.
<https://doi.org/10.7202/600997ar>

Propriétés des moments des coefficients de régression dans un modèle de régression linéaire avec erreurs autocorrélées

Thuan V. TRUONG, Université Laval

Un des problèmes les plus fréquents en économétrie appliquée est celui où les erreurs sont autocorrélées. Dans la présente étude, il s'agit du cas le plus simple communément appelé le cas autorégressif du 1^{er} ordre. Quatre techniques d'estimation sont considérées, à savoir la méthode des moindres-carrés, la méthode de Cochrane et Orcutt, la méthode de Prais et Winsten et la méthode de Durbin. Pour chacune de ces méthodes, les moments du premier et du second ordres des estimateurs des coefficients de régression sont dérivés. La dérivation est immédiate avec la méthode des moindres carrés. Pour les autres méthodes, conditionnés par l'estimateur du coefficient d'autorégression, les estimateurs des coefficients de régression dépendent linéairement des observations. Leur variance est la somme des deux termes

dont l'un est fini et dont l'autre est simplement la valeur moyenne des variances conditionnelles, la valeur moyenne étant prise par rapport à la fonction de distribution de l'estimateur du coefficient d'autorégression. La présente étude fournit la démonstration de la continuité ou de la discontinuité des variances conditionnelles des estimateurs des coefficients de régression pour chaque méthode d'estimation considérée.