

Document 1

Je vous propose, afin de préparer notre première séance, un exercice qui relève de la modélisation macro-économétrique. Nous allons estimer une fonction d'emploi, pour la FRANCE, en nous limitant à l'industrie.

Votre feuille de route est ainsi la suivante.

1. Récupérer sur Internet les données (cf. le tableau 1) en allant sur le site de l'INSÉÉ – il s'agit de données annuelles de comptabilité nationale.
2. Prendre connaissance des données : par exemple, que veut dire « *emploi intérieur total* » ? ou encore « *prix chaînés, base 2000* » ?
3. Regrouper les deux séries dans une même feuille de calcul Excel et refaire le graphique de la figure 1.
4. En utilisant SAS, retrouver les résultats portés dans le tableau 2.
5. Commenter ces premiers résultats.

TAB. 1 – Les données à récupérer sur Internet

Années	<i>L</i>	<i>Q</i>
1978	5 547,6	166,7
1979	5 458,5	168,2
⋮	⋮	⋮
2005	3 565,6	245,0
2006	3 496,1	249,1

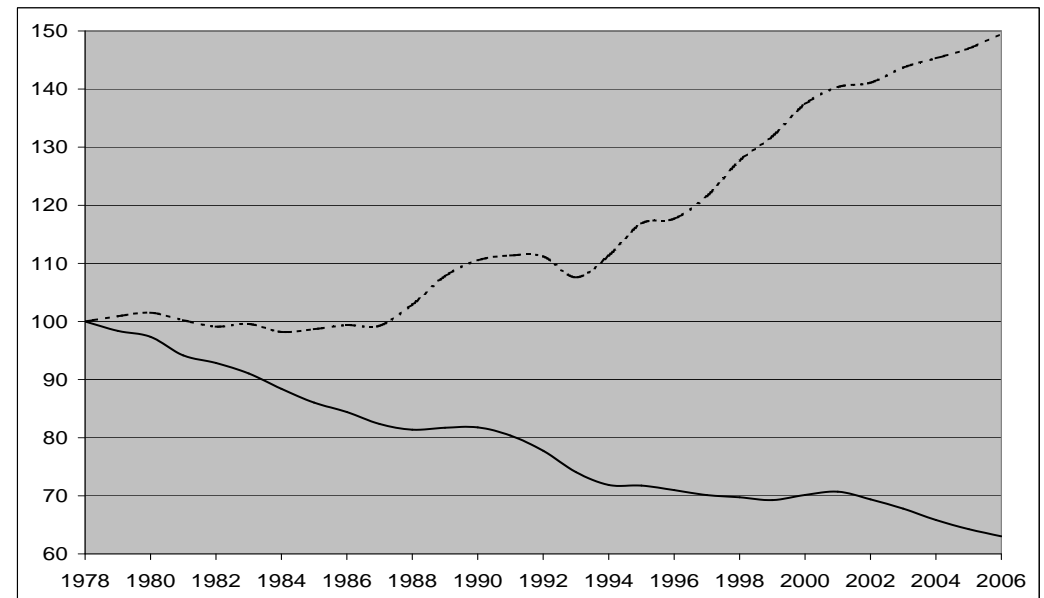
L est l'emploi intérieur.

Q est la valeur ajoutée brute.

TAB. 2 – Mes premières estimations, variable expliquée : $\log L_t$

	Modèle	(1)	(2)
Variables	Constante	12,7 (28,7)	6,3 (22,8)
	$\log Q_t$	-0,8 (-9,7)	0,5 (8,3)
	<i>t</i>		-0,023 (-24,4)
	SCR	0,1164	0,0049
	DW	0,19	0,50
	R ²	0,778	0,991

FIG. 1 – Emploi (trait plein) et valeur ajoutée (trait pointillé) en FRANCE dans l'industrie depuis 1978



Source : INSÉÉ, comptes nationaux.
 Unités : Indice base 100 en 1978.