

TABLE DES MATIÈRES

CHAPITRE I. — Construction d'un test, par la méthode de Neyman et Pearson, entre deux hypothèses simples		1
1	Décision par test de Neyman et Pearson	4
2	Risques de première et seconde espèce	9
3	Risques de première et seconde espèce	11
4	Détermination de la taille d'un échantillon, à partir de la connaissance des risques	14
5	Risques de première et seconde espèce	18
6	Un exemple économique	22
CHAPITRE II. — Construction d'un test, par la méthode de Bayes, entre deux hypothèses simples		26
7	Décision par test de Bayes	28
8	Détermination des probabilités a priori	32
CHAPITRE III. — Test paramétrique		35
9	Test uniformément le plus puissant	36
10	Test uniformly most powerful	40
11	Détermination d'une région d'acceptation pour un test non U. M. P.	43
12	Test d'une moyenne d'une loi normale	47
13	Test d'une fréquence	49
14	Test d'une variance d'une loi de Gauss	53
CHAPITRE IV. — Test de comparaison de deux moyennes		36
15	Cas général	60
16	Cas où les écarts-types sont estimés	61
17	Cas où les écarts-types sont égaux	63
18	Cas des petits échantillons	66
19	Cas des petits échantillons	68
20	Cas des très petits échantillons	70
CHAPITRE V. — Test de comparaison de deux fréquences		72
21	Comparaison de deux proportions	74
CHAPITRE VI. — Test de comparaison de deux variances		76
22	Test <i>F</i> de Behrens-Fisher-Snedecor	78
23	Comparaison des variances de deux populations	79

CHAPITRE VII. — Test du χ^2. Ajustement d'une distribution empirique par une loi de probabilité théorique	82
24 Ajustement par une loi uniforme.....	86
25 Ajustement par une loi uniforme.....	87
26 Ajustement par une loi de Poisson.....	89
27 Ajustement par une loi normale.....	92
CHAPITRE VIII. — Comparaison de distributions empiriques	96
28 Test d'homogénéité.....	98
CHAPITRE IX. — Comparaison de deux pourcentages	101
29 Comparaison d'un pourcentage observé à un pourcentage théorique.....	104
30 Comparaison de deux pourcentages observés.....	105
CHAPITRE X. — Corrélation et régression	108
31 Corrélation, Variance, Covariance.....	111
32 Approximation linéaire de Y en X : régression.....	116
CHAPITRE XI. — Application de la méthode des moindres carrés au modèle linéaire à une équation	122
33 Calcul des paramètres	125
34 Modèle à trois variables explicatives.....	130
CHAPITRE XII. — Précision d'un ajustement	135
35 Précision d'un ajustement.....	136
36 Recherche empirique des colinéarités.....	140
CHAPITRE XIII. — Interprétation probabiliste de la méthode des moindres carrés	143
37 L'estimation \hat{a} est sans biais.....	146
38 La septième hypothèse.....	147
39 Les conséquences probabilistes de la méthode des moindres carrés.....	149
CHAPITRE XIV. — Utilisation de la théorie des tests dans un modèle linéaire	154
40 Test d'un coefficient de régression.....	156
41 Test d'un coefficient de corrélation linéaire.....	160
42 Test de comparaison de coefficients de régression.....	161
CHAPITRE XV. — La prévision dans le cas d'un modèle linéaire	164
43 Prévision dans un modèle linéaire.....	167
44 Représentation d'une série chronologique par une fonction linéaire du temps.....	172
CHAPITRE XVI. — Identification dans les modèles linéaires à plusieurs équations	177
45 Le modèle keynésien à investissement autonome.....	181
46 Modèle non identifiable.....	185
CHAPITRE XVII. — Méthode des doubles moindres carrés. Suridentification	190
47 Méthode des doubles moindres carrés.....	192
48 Le modèle keynésien à investissement autonome.....	195

CHAPITRE XVIII. — Problèmes d'examens	198
49 École Supérieure des Sciences Économiques et Commerciales, juin 1968 .	198
50 Licence ès Sciences Économiques 3 ^e année, Paris-Assas, octobre 1969 . .	201
51 Concours de la Banque de France, 1971	206
52 Concours de la Banque de France, 1972	207
53 Licence ès Sciences Économiques, 3 ^e année, Paris 2, juin 1973	208
54 Licence ès Sciences Économiques, 3 ^e année, Lille, septembre 1973	209
55 Licence ès Sciences Économiques, 3 ^e année, Paris 2, juin 1974	210
56 Licence ès Sciences Économiques, 3 ^e année, Lille, juin 1974	213
57 Licence ès Sciences Économiques, 3 ^e année, Paris X, juin 1974	214
58 Licence ès Sciences Économiques, 3 ^e année, Lille, septembre 1974	216
59 Licence ès Sciences Économiques, 3 ^e année, Paris 2, septembre 1974	217

ANNEXES

I Extraits de la table de la loi normale, centrée, réduite	220
II Extraits de la table de la loi normale, centrée, réduite	221
III Extraits de la table de la fonction intégrale de la loi $\mathcal{N}(0,1)$	222
IV Extraits de la table dite de « l'écart réduit »	223
V Extraits de la table de la loi de Poisson	224
VI Extraits de la table cumulée de la loi de Poisson	225
VII Extraits de la table dite du t de Student-Fisher	226
VIII Extraits de la table dite du χ^2 de Pearson	227
IX Extraits de la table dite du F de Behrens-Fisher-Snedecor	228
X Extraits de la table dite du F de Behrens-Fisher-Snedecor (suite)	229
XI Extraits de la table e^λ et de $e^{-\lambda}$	230
BIBLIOGRAPHIE	231