

Stratégie de tests de Dickey et Fuller

Les différents modèles retenus pour construire les statistiques de tests sont les suivants:

$$\Delta Y_t = \rho Y_{t-1} + \alpha + \beta t + \sum_{i=1}^p \phi_i \Delta Y_{t-i} + \varepsilon_t \quad (1)$$

$$\Delta Y_t = \rho Y_{t-1} + \alpha + \sum_{i=1}^p \phi_i \Delta Y_{t-i} + \varepsilon_t \quad (2)$$

$$\Delta Y_t = \rho Y_{t-1} + \sum_{i=1}^p \phi_i \Delta Y_{t-i} + \varepsilon_t \quad (3)$$

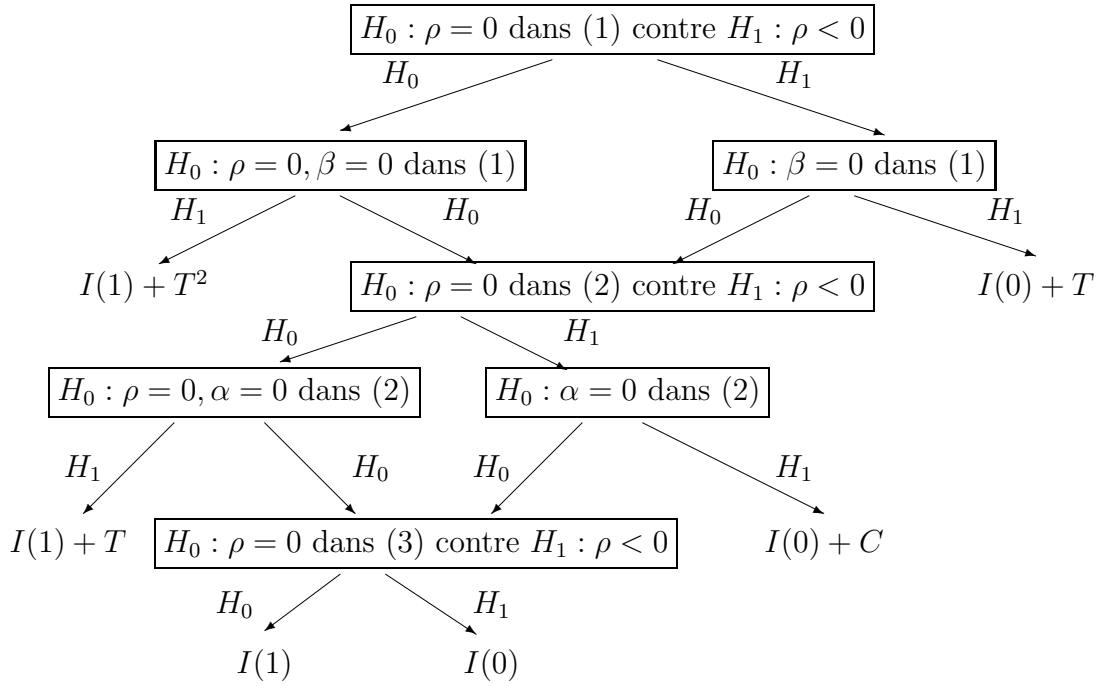


Table 1: Valeurs critiques des tests de racine unitaire de Dickey et Fuller

Modèles	10%			5%			1%		
	(1)	(2)	(3)	(1)	(2)	(3)	(1)	(2)	(3)
T=50	-3.18	-2.6	-1.61	-3.5	-2.93	-1.95	-4.15	-3.58	-2.62
T=100	-3.15	-2.58	-1.61	-3.45	-2.89	-1.95	-4.04	-3.51	-2.60
T=250	-3.13	-2.57	-1.62	-3.43	-2.88	-1.95	-3.99	-3.46	-2.58