Tests de linéarité, Spécification et Estimation de modèles à seuil :
Une analyse comparée des méthodes de Tsay et de Hansen

Annexes graphiques

Mélika Ben Salem et Corinne Perraudin*

*EUREQua, Université de Paris I. 106-112 Bld de l'hôpital. 75647 Paris Cedex 13. Emails: *bensalem@univ-paris1.fr*, *Corinne.Perraudin@univ-paris1.fr*

Annexe A : graphiques de de taille et de puissance

FIG. 2 – *Distribution empirique des probabilités des tests ($p = 1, d = 1, n = 100$)*
Taille empirique versus taille nominale

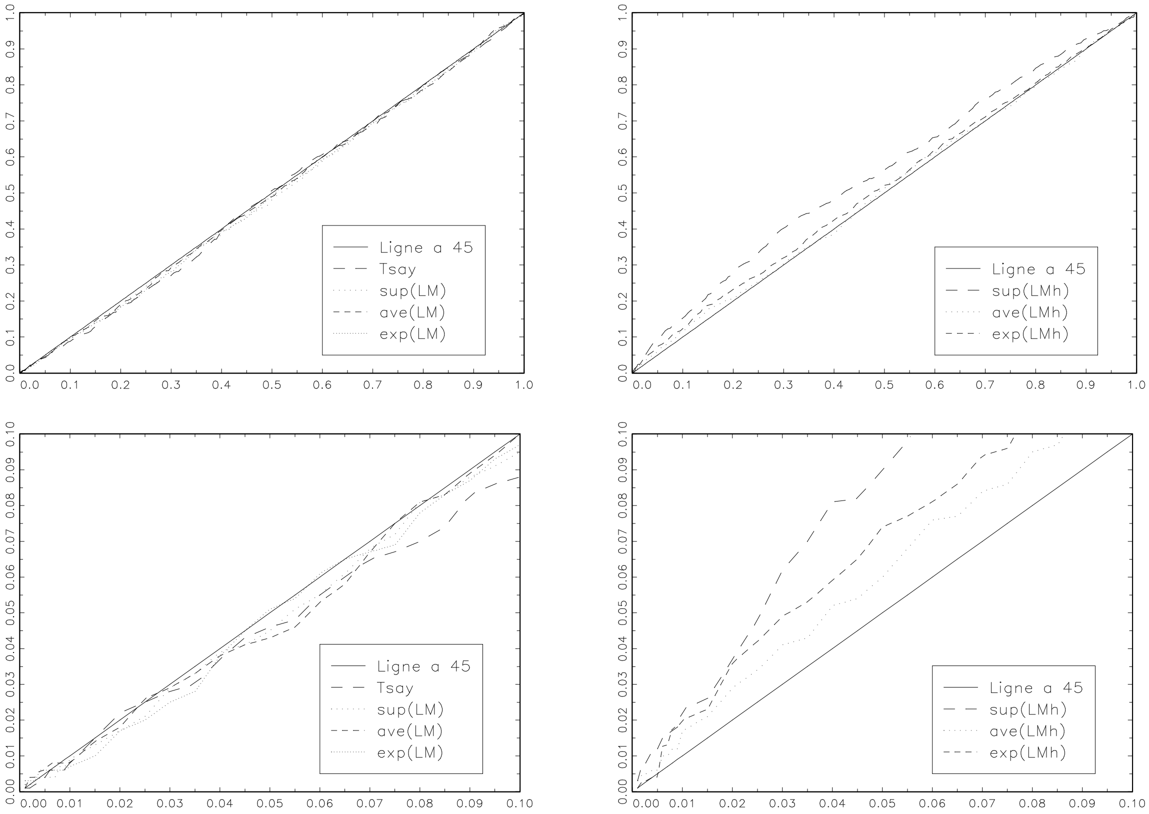


Fig. 3 – *Distribution empirique des probabilités* $(p = 1, d = 1)$
Taille empirique versus taille nominale

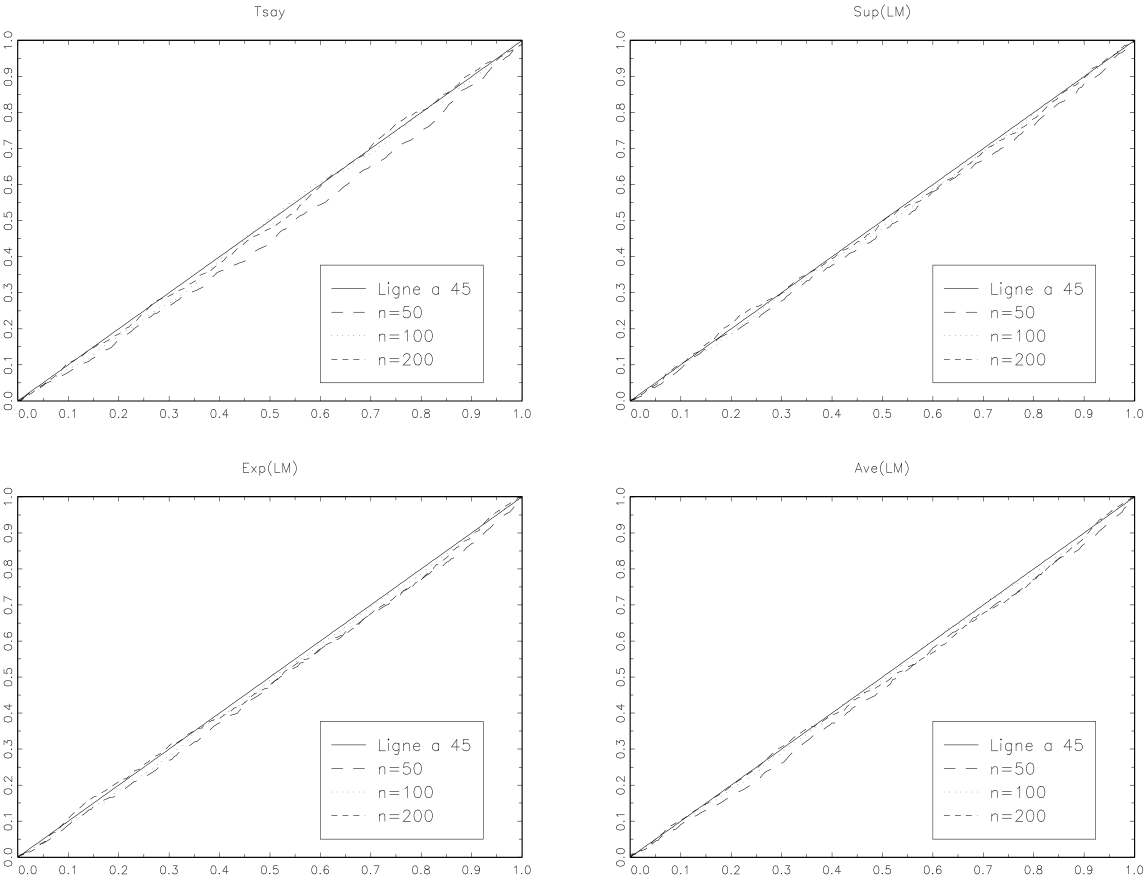


Fig. 4 – *Distribution empirique des probabilités ($n = 100$)*
Taille empirique versus taille nominale

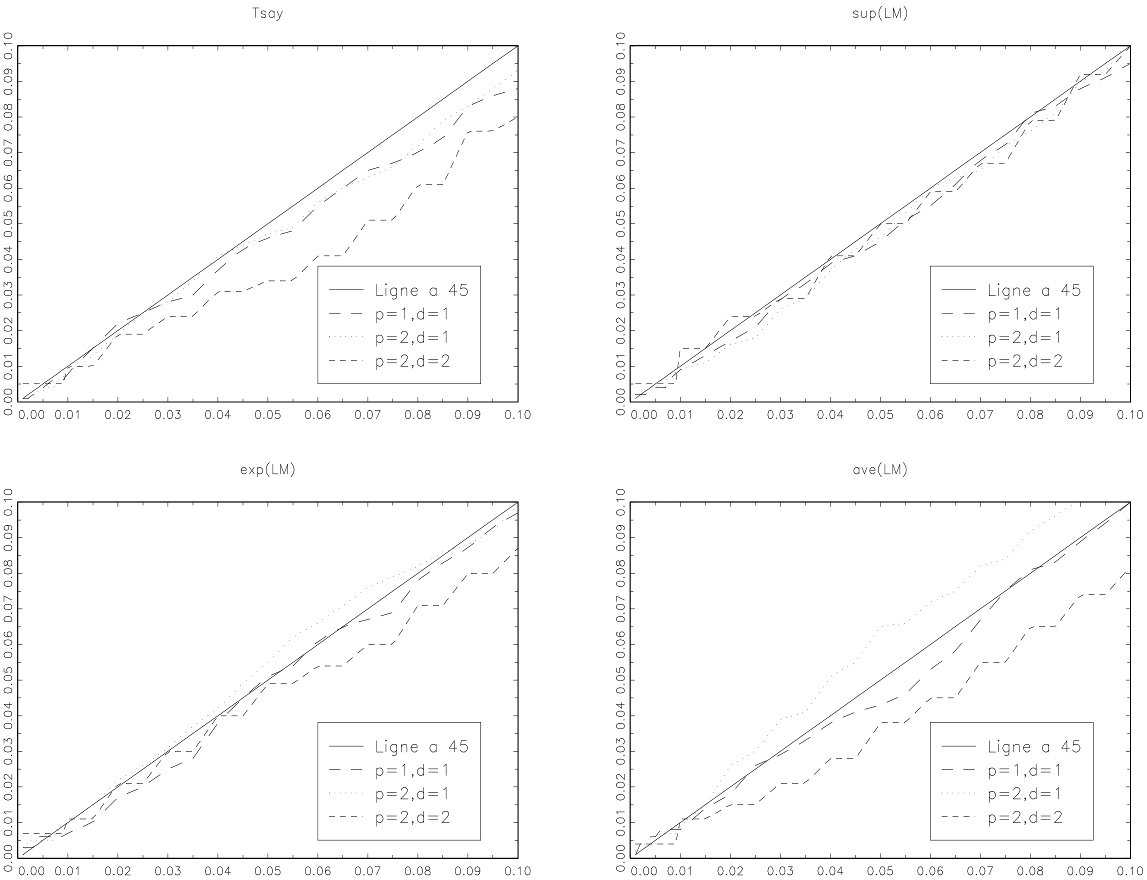


Fig. 5 – *Distribution empirique de la puissance versus la taille ($n = 100$) : changement dans la constante*

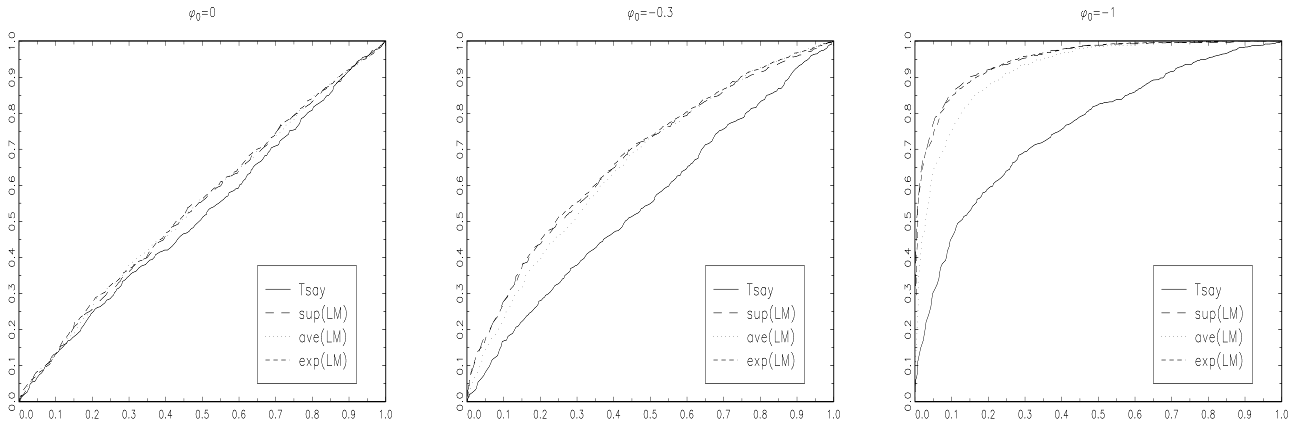


Fig. 6 – *Distribution empirique de la puissance versus la taille ($n = 100$) : changement dans l'autorégressif*

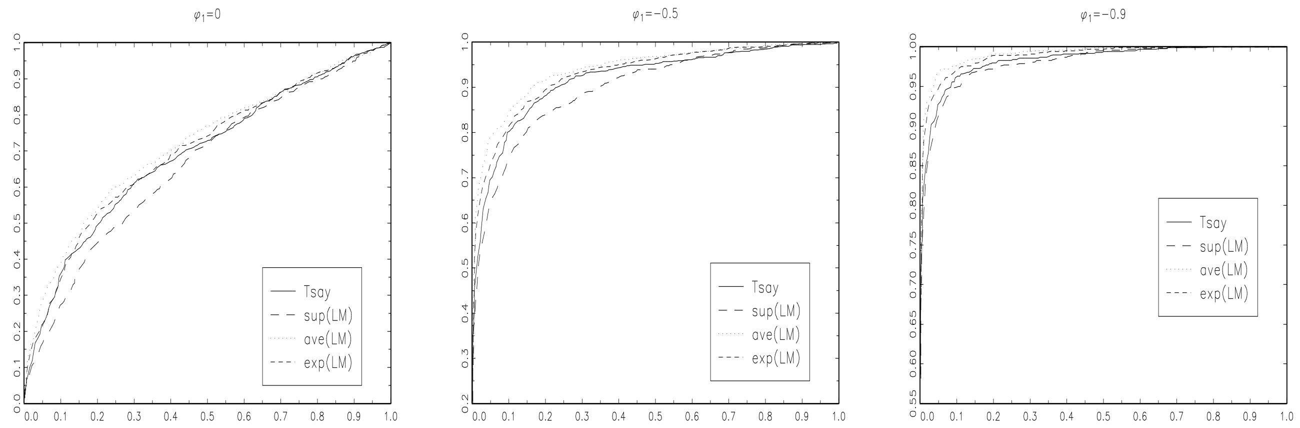


FIG. 7 – *Distribution empirique de la puissance versus la taille* ($n = 100, \varphi_1 = -0.5, \varphi_0 = 0.3$)

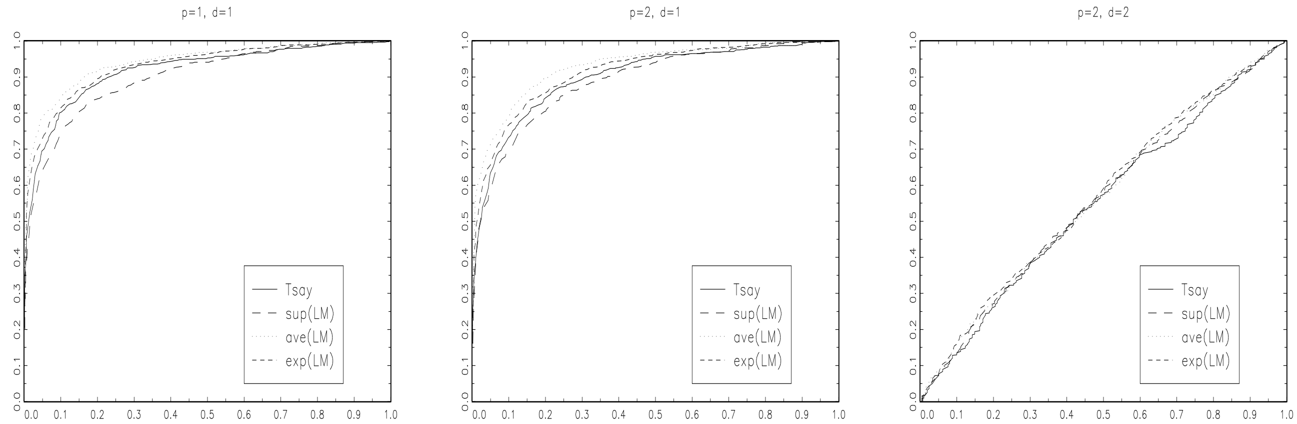


FIG. 8 – *Distribution empirique de la puissance versus la taille* ($n = 100$)

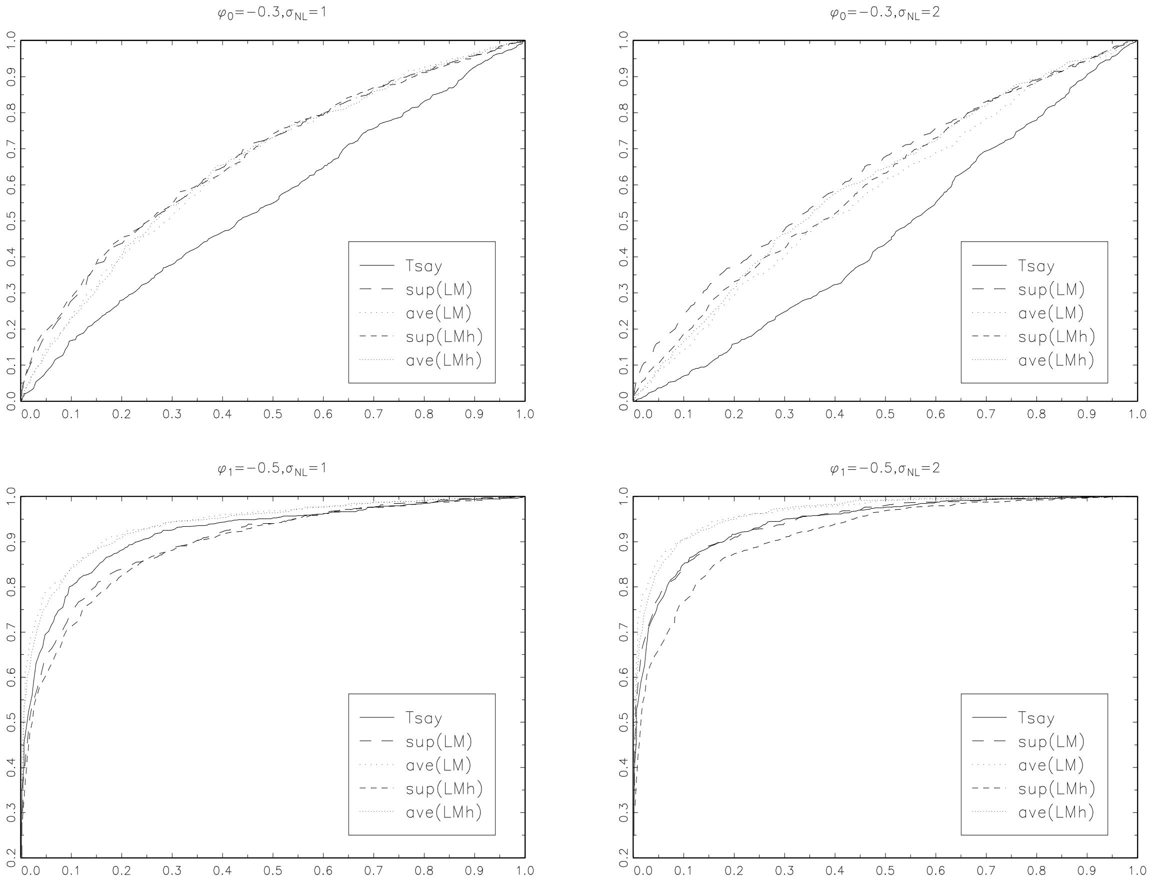


FIG. 9 – *Distribution empirique du seuil estimé ($n = 100$): changement dans la constante*

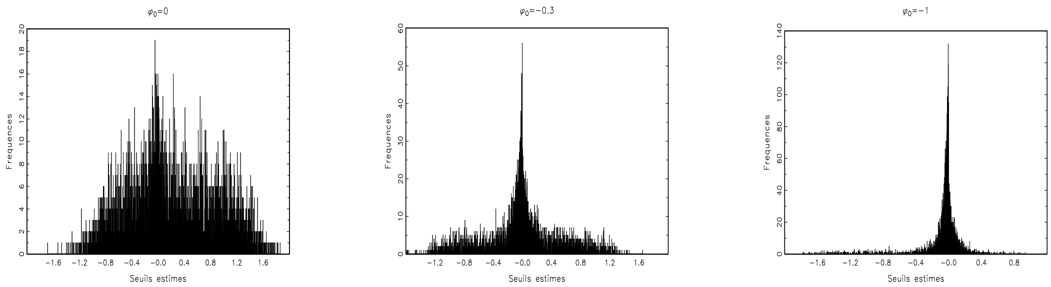
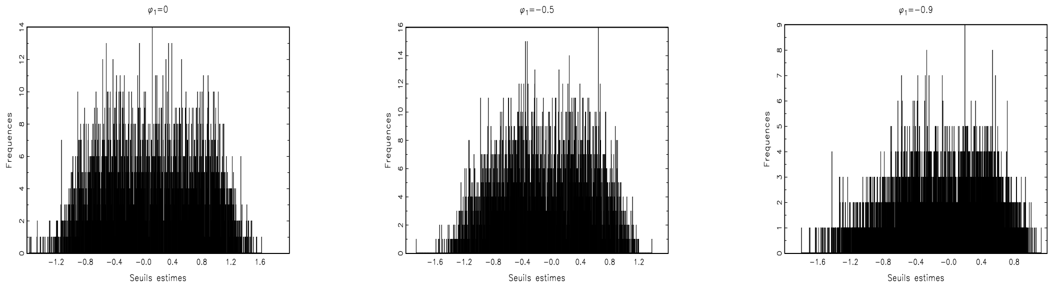


FIG. 10 – *Distribution empirique du seuil estimé ($n = 100$): changement dans le paramètre autorégressif*



Annexe B : graphiques de détection de seuils

FIG. 11 – *Allemagne: Statistiques récursives en fonction de la variable de transition* dly_{t-1}

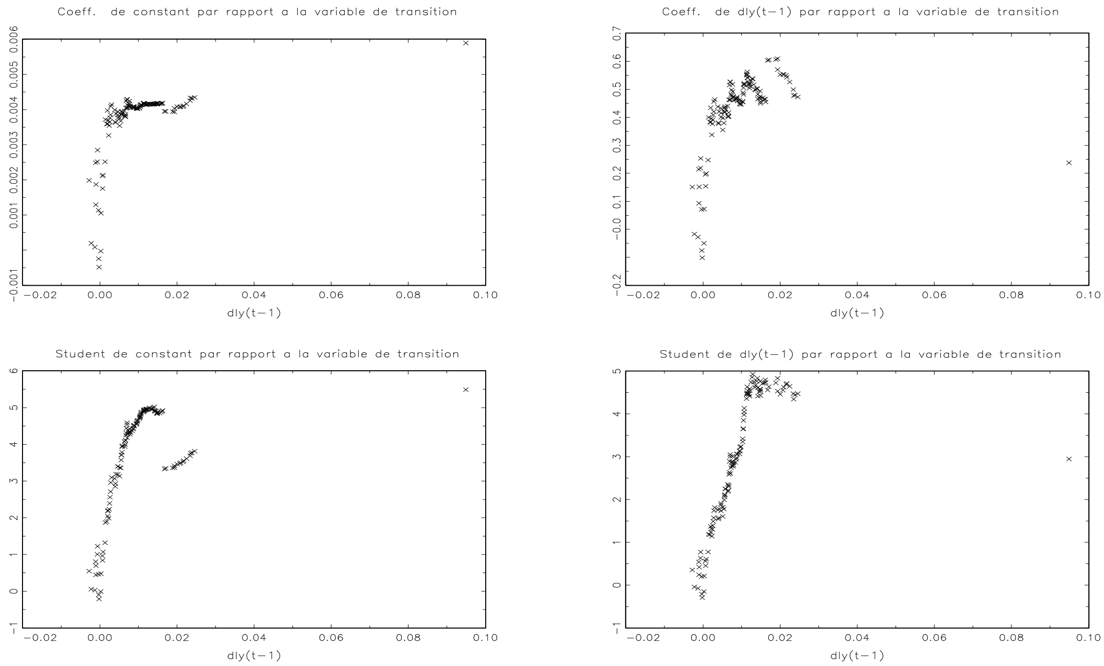


FIG. 12 – *Canada : Statistiques récursives en fonction de la variable de transition* dly_{t-1}

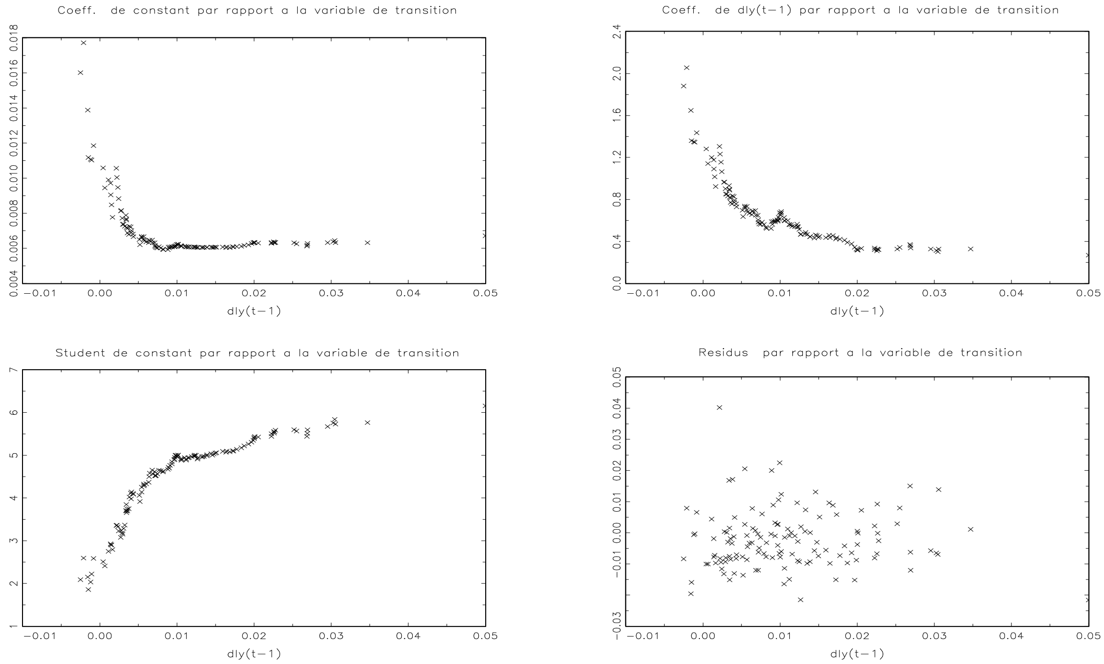
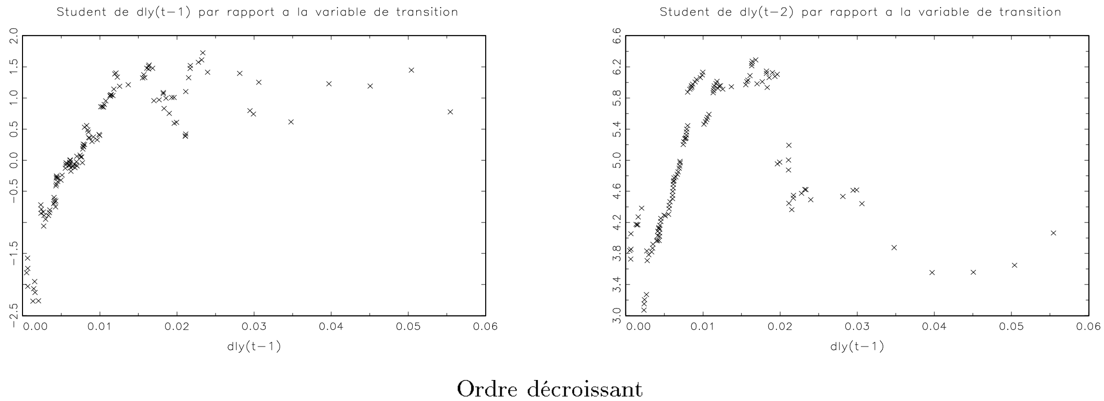


FIG. 13 – *Espagne : Statistiques récursives en fonction de la variable de transition* dly_{t-1}

Ordre croissant



Ordre décroissant

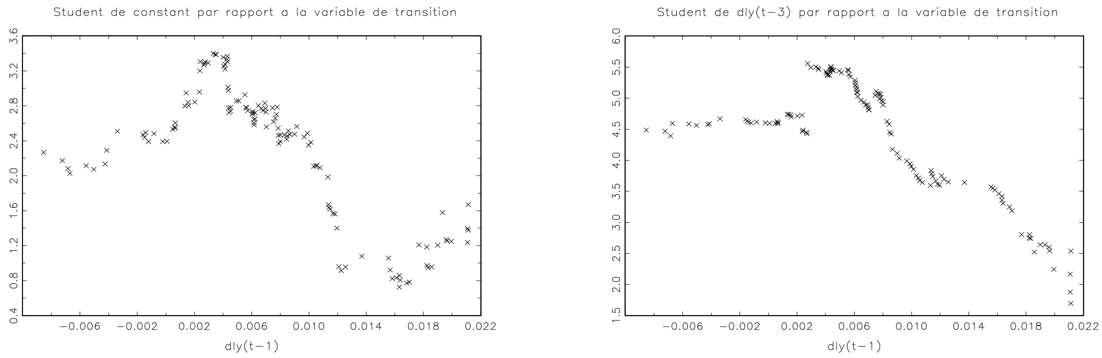


Fig. 14 – *France : Statistiques récursives en fonction de la variable de transition* dly_{t-2}

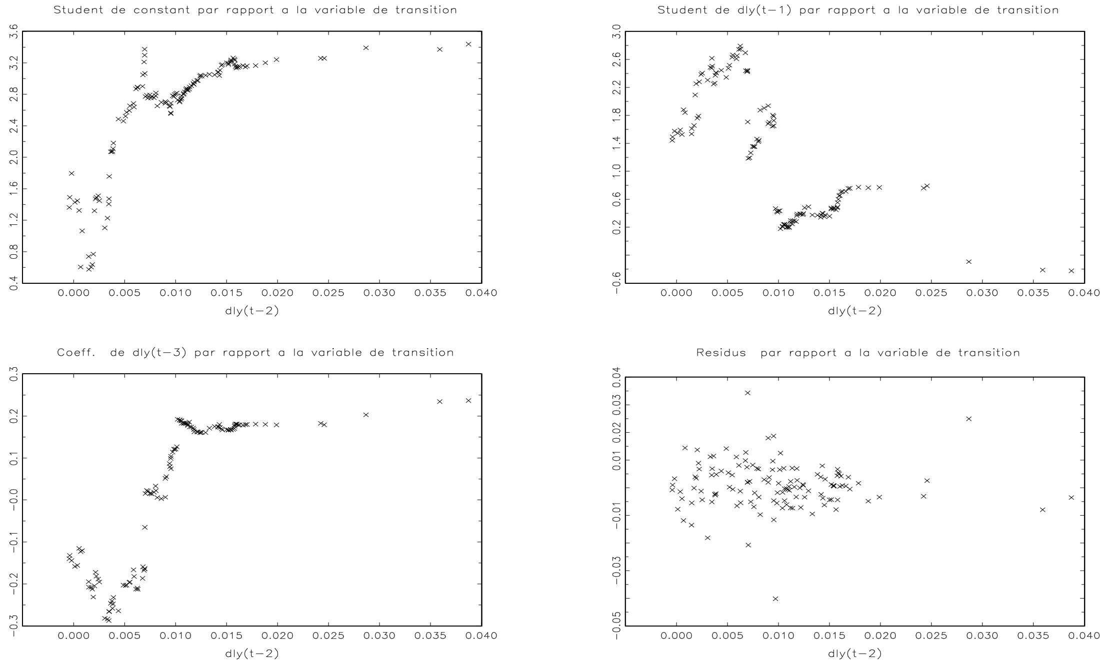


Fig. 15 – *Italie : Statistiques récursives en fonction de la variable de transition* dly_{t-1}

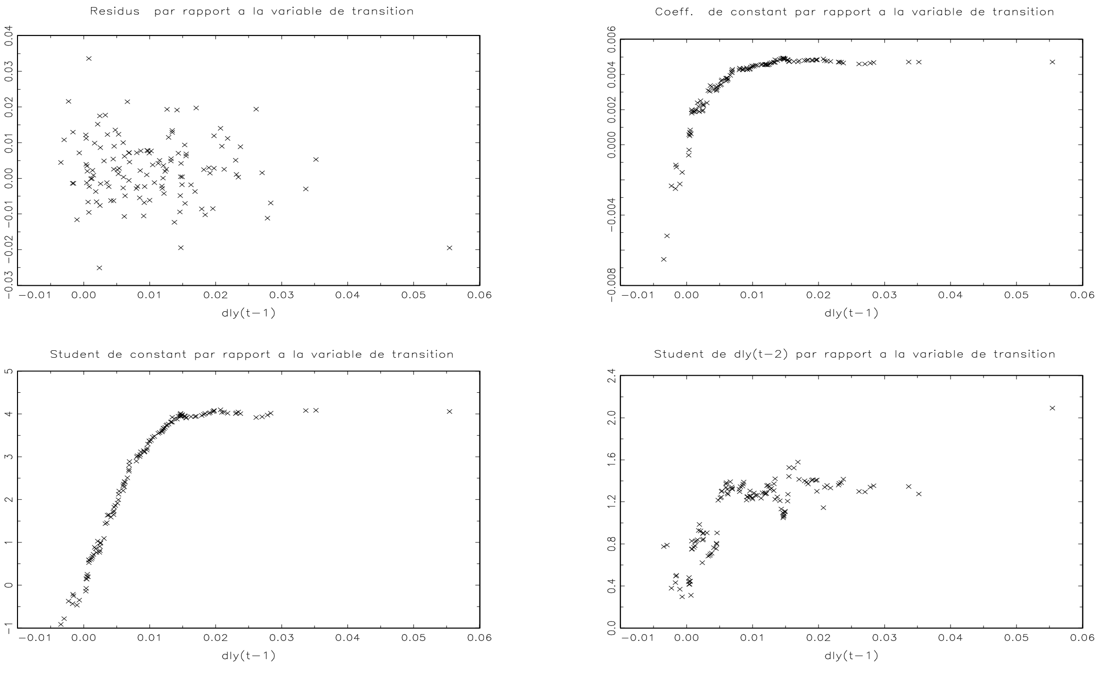
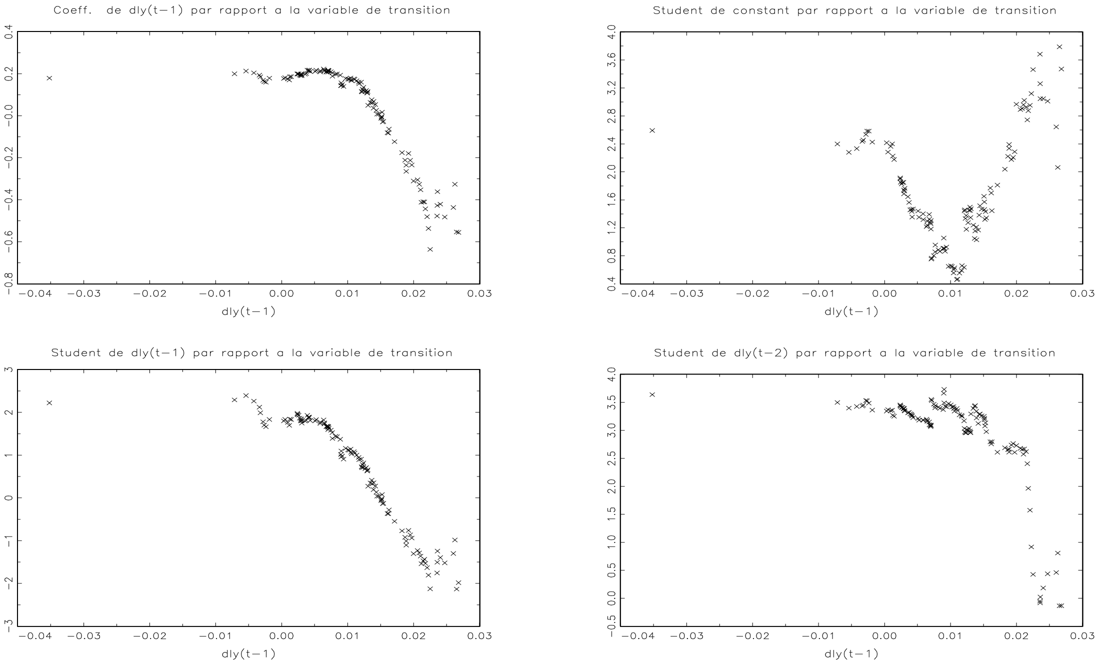


Fig. 16 – *Japon : Statistiques récursives en fonction de la variable de transition* dly_{t-2}



Annexe C : représentations des séries et de leurs éventuels régimes

FIG. 17 – *Etats-Unis : Taux de croissance du PIB et ses régimes*

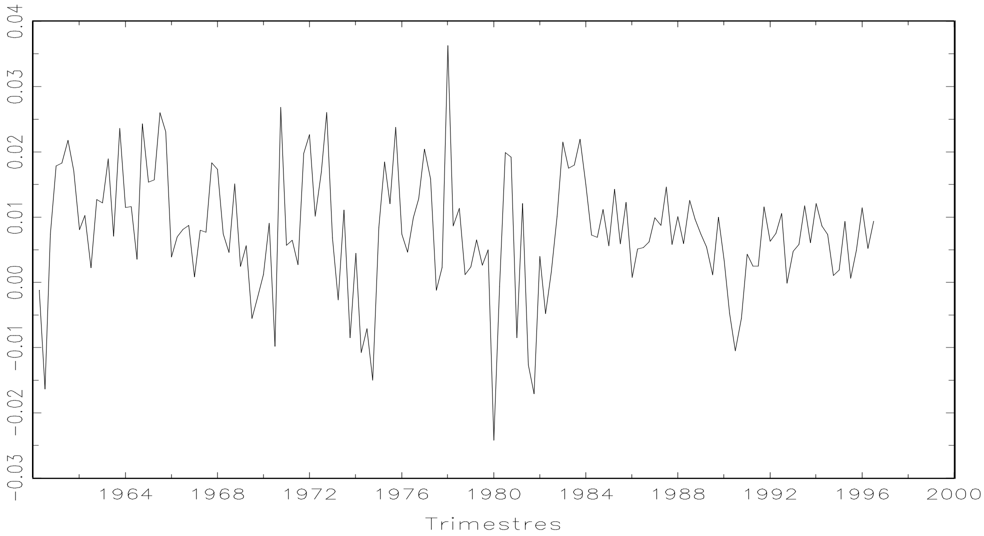


FIG. 18 – *Italie : Taux de croissance du PIB et ses régimes*

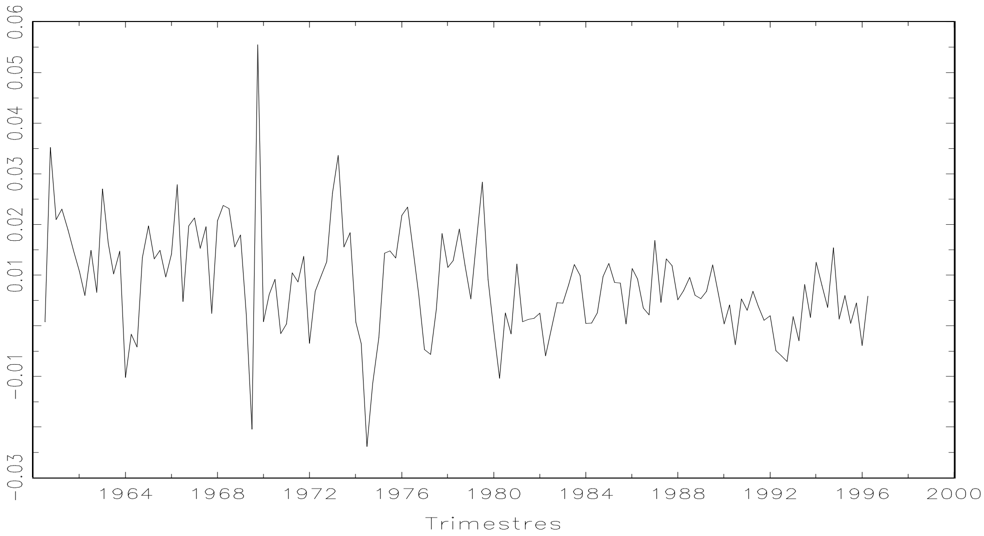


Fig. 19 – *Allemagne : Taux de croissance du PIB et ses régimes*

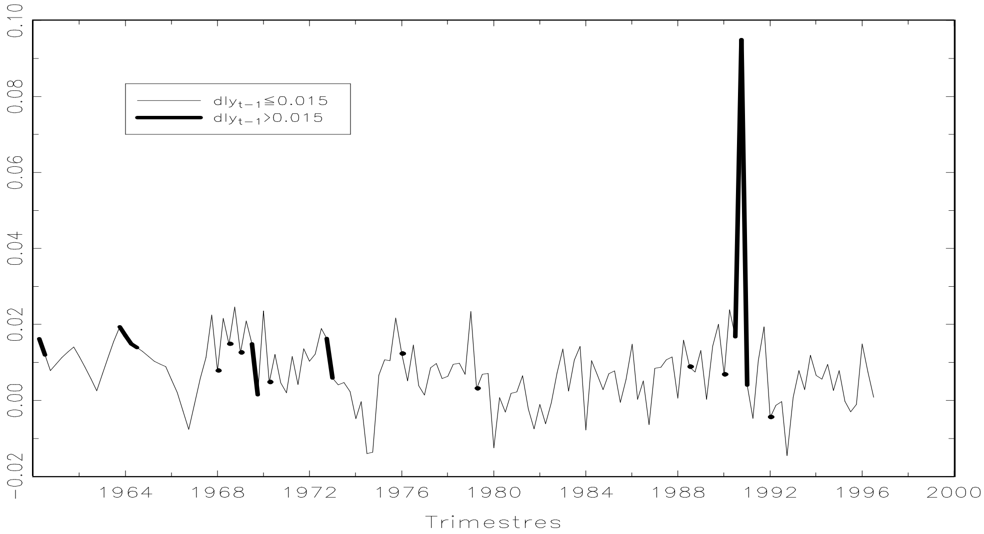


Fig. 20 – *Canada : Taux de croissance du PIB et ses régimes*

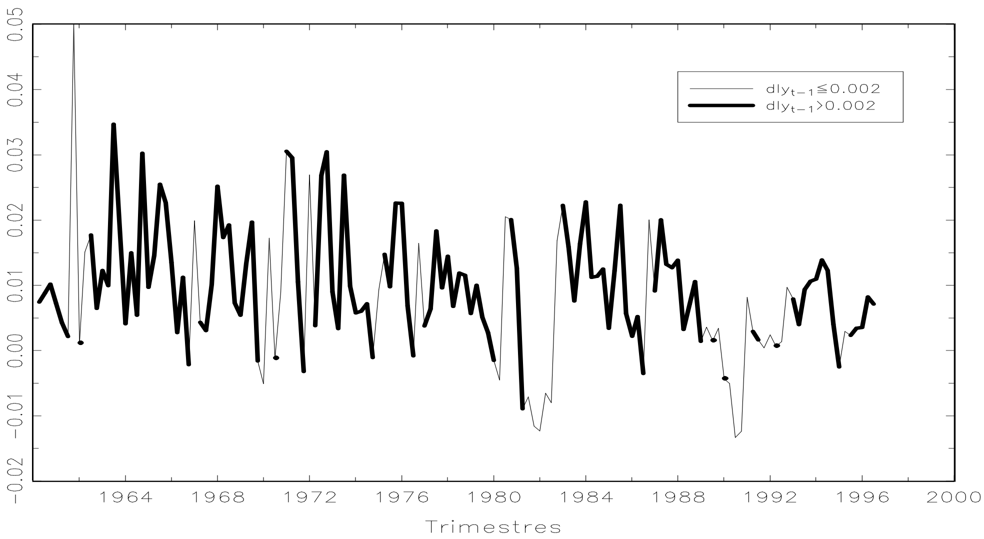


Fig. 21 – *Espagne : Taux de croissance du PIB et ses régimes*

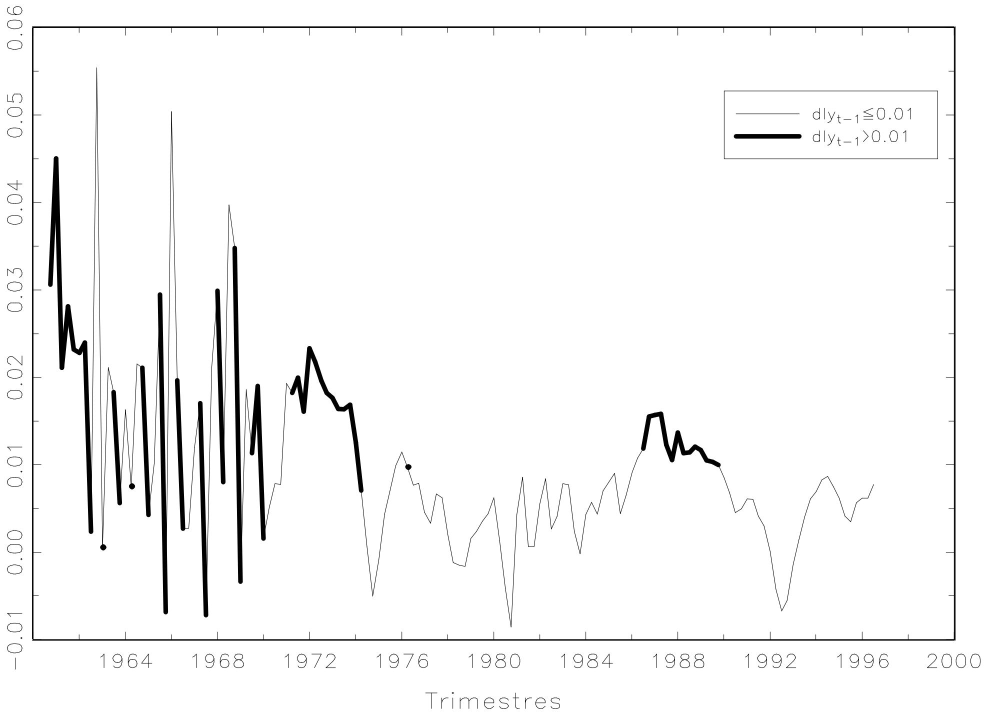


Fig. 22 – *France : Taux de croissance du PIB et ses régimes*

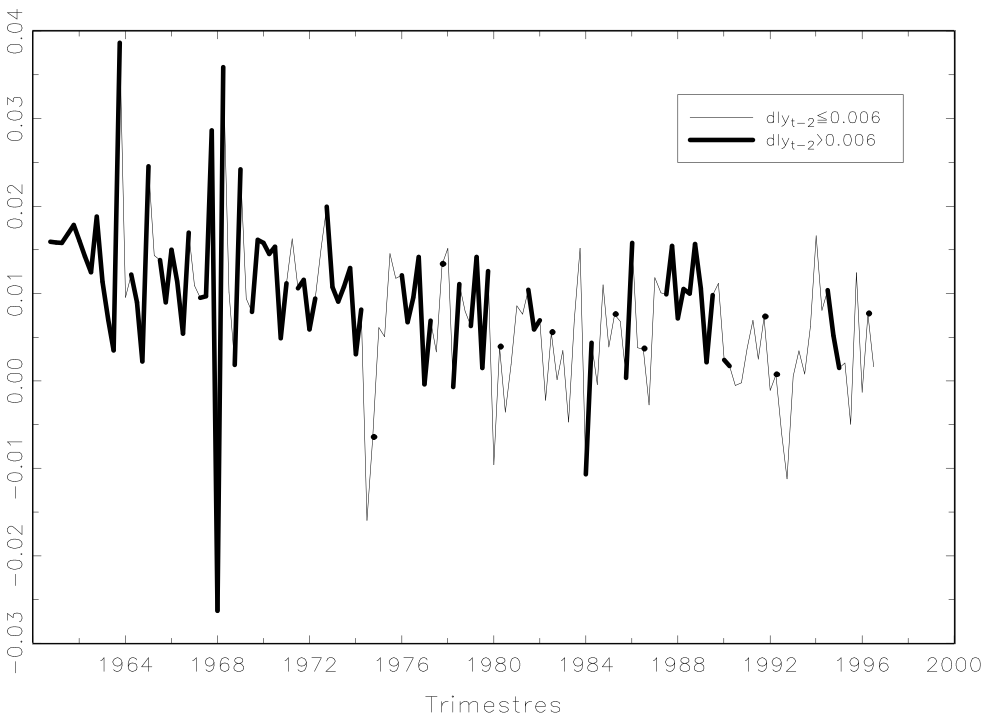


Fig. 23 – *Japon : Taux de croissance du PIB et ses régimes*

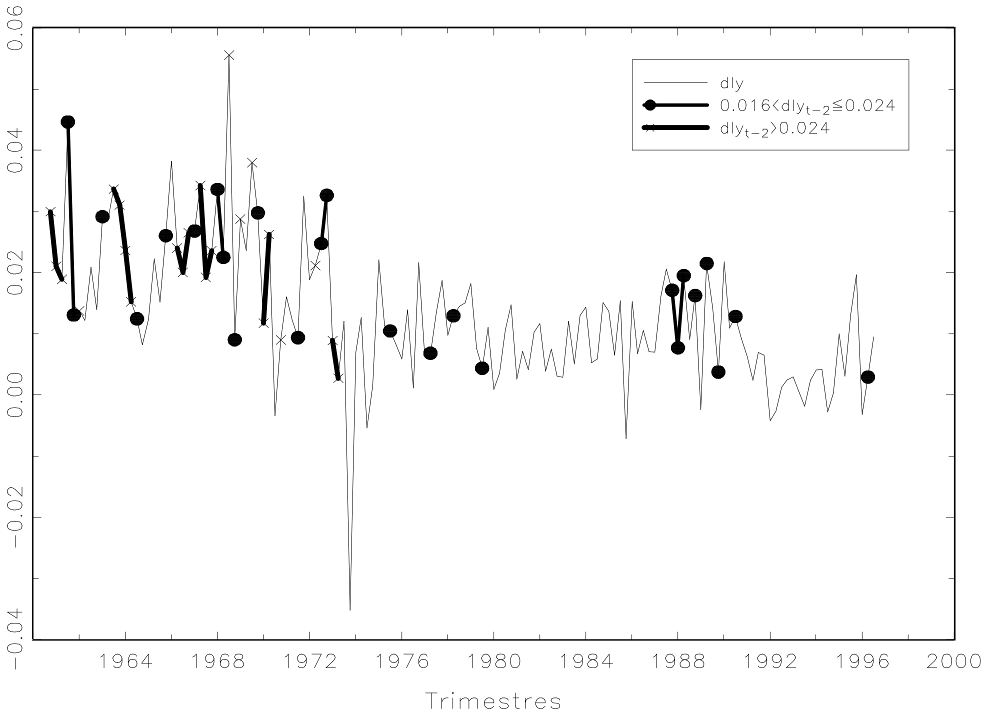


Fig. 24 – *Royaume-Uni : Taux de croissance du PIB et ses régimes*