

Schéma 1 : Stratégie simplifiée du test de stationnarité.

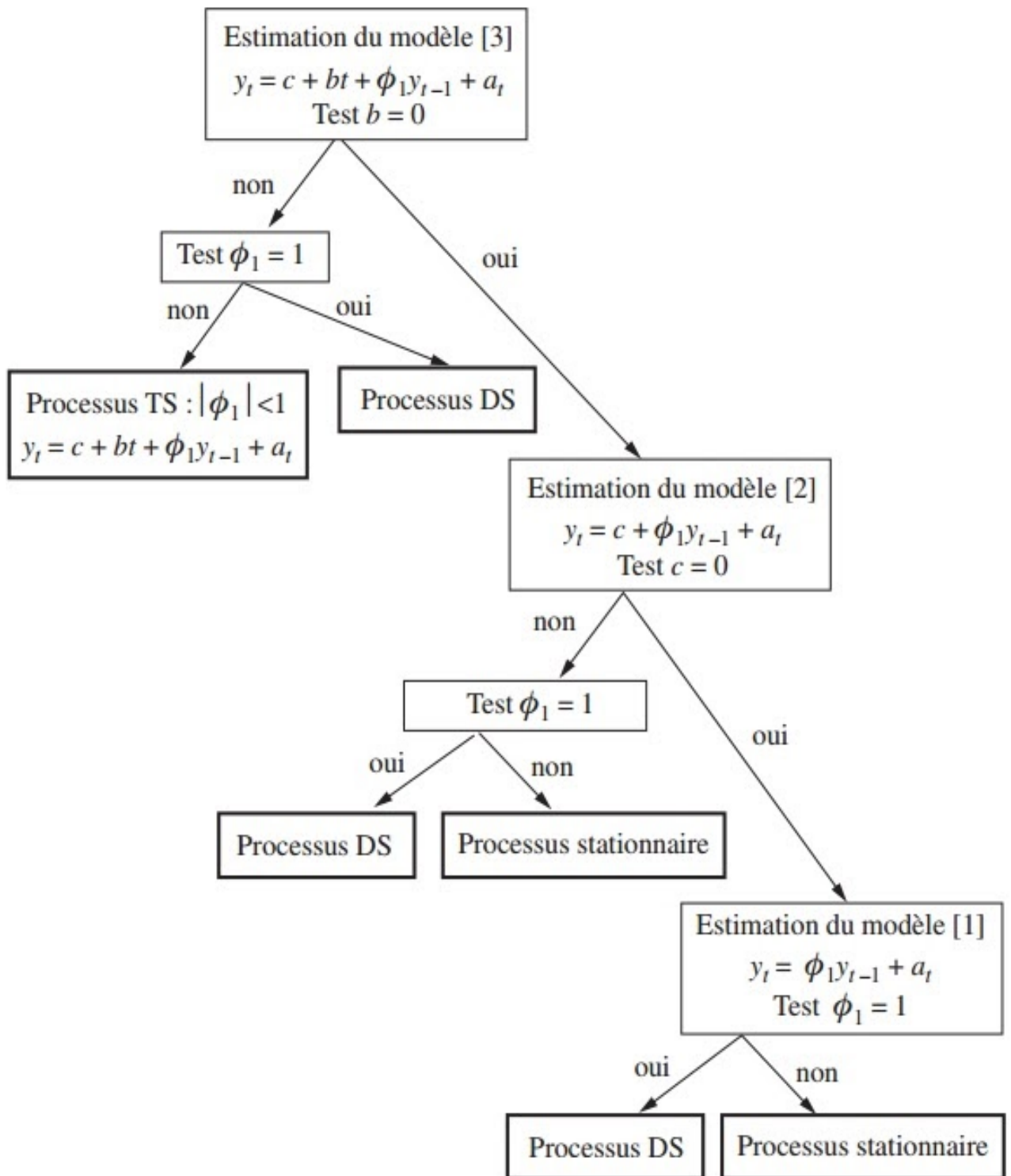


Tableau N°04 : Valeurs critiques du test de Dickey-Fuller :

Valeurs critiques du test de Dickey-Fuller

T	1%	5%	10%
Modèle[1]			
100	-2.60	-1.95	-1.61
250	-2.58	-1.95	-1.62
500	-2.58	-1.95	-1.62
∞	-2.58	-1.95	-1.62
Modèle[2]			
100	-3.51	-2.89	-2.58
250	-3.46	-2.88	-2.57
500	-3.44	-2.88	-2.57
∞	-3.43	-2.87	-2.57
Modèle[3]			
100	-4.04	-3.45	-3.15
250	-3.99	-3.43	-3.13
500	-3.98	-3.42	-3.13
∞	-3.96	-3.41	-3.12

Tableau N°05 : Valeurs critiques de la constante et de la tendance¹³ :

T	Modèle[2]			Modèle[3]					
	Constante			Constante			Tendance		
	1%	5%	10%	1%	5%	10%	1%	5%	10%
100	3.22	2.54	2.17	3.78	3.11	2.73	3.53	2.79	2.38
250	3.19	2.53	2.16	3.74	3.09	2.73	3.49	2.79	2.38
500	3.18	2.52	2.16	3.72	3.08	2.73	3.48	2.78	2.38
∞	3.18	2.52	2.16	3.71	3.08	2.72	3.46	2.78	2.38

Source : Lardic Sandrine, Mignon Valérie, op cité, p137.