

---

**BRUNO RÉMILLARD**, HEC Montréal

*Tests d'hypothèses pour la copule de modèles dynamiques*

On étudie le comportement asymptotique de la copula empirique construite à partir des résidus de modèles à volatilité stochastique. On montre que si la matrice de volatilité est diagonale, alors le processus de copule empirique a le même comportement que si les paramètres étaient connus, ce qui est remarquable. Cependant, ce n'est pas vrai dans le cas général. On présente des applications pour la détection de changements structuraux et pour des tests d'adéquations pour la copule des innovations.