

---

**ELIF FIDAN ACAR**, McGill University

*Tests statistiques pour copules conditionnelles*

Dans les modèles de copules conditionnelles, le paramètre des copules est lié de manière déterministe à une covariable au moyen de la fonction d'étalonnage. Cette dernière est d'un intérêt central pour l'inférence et est habituellement estimée de façon non paramétrique. Cependant, lorsqu'un modèle paramétrique pour la fonction d'étalonnage est approprié, l'estimateur qui en découle présente une efficacité statistique significativement plus élevée. Nous élaborons une méthodologie pour tester une formulation paramétrique de la fonction d'étalonnage par rapport à une alternative générale et nous proposons un test du rapport de vraisemblance généralisé qui permet le diagnostic de modèles de copules conditionnelles. Nous obtenons la distribution asymptotique du test proposé sous l'hypothèse nulle et nous étudions la performance du test sur des échantillons de taille finie au moyen de simulations.