
JOSEPH FRANCOIS TAGNE TATSINKOU, Université de Montréal

Test lisse d'ajustement pour les erreurs d'un modèle ARMA avec moyenne inconnue

Neyman (1937) a proposé un test d'adéquation à la loi uniforme. Le test a été généralisé à une densité quelconque par Rayner et Best (1989). Ducharme et Lafaye de Micheaux (2004) ont utilisé l'approche de Neyman et la procédure de sélection de modèle de Ledwina (1994) pour construire un test de normalité pour les erreurs d'un modèle ARMA avec moyenne connue. Dans ce travail, nous généralisons les résultats de Ducharme et Lafaye de Micheaux dans le cas d'un modèle ARMA avec moyenne inconnue. Des simulations et une application aux données réelles sont fournies.