

A1- Valeurs critiques de la constante et tendance du test ADF

| | Modèle avec constante mais sans tendance | | | Modèle avec constante et tendance | | | | | |
|----------|---|------|------|-----------------------------------|------|------|-----------------|------|------|
| | $t_{constante} = 0$ | | | $t_{constante} = 0$ | | | $t_{trend} = 0$ | | |
| N obs | 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 | 2.72 | 3.48 | 2.78 | 2.38 |
| ∞ | 3.18 | 2.52 | 2.16 | 3.71 | 3.08 | 2.72 | 3.46 | 2.78 | 2.38 |

A2- Valeurs critiques du test de Schmidt-Phillips

| | $p=1$ (absence de trend) | | | $p=2$ (trend linéaire) | | | $p=3$ (trend quadratique) | | | $p=4$ (trend cubique) | | |
|------|-----------------------------|-------|-------|---------------------------|-------|-------|------------------------------|-------|-------|--------------------------|-------|-------|
| T | 1% | 5% | 10% | 1% | 5% | 10% | 1% | 5% | 10% | 1% | 5% | 10% |
| 50 | -3.73 | -3.11 | -2.80 | -4.28 | -3.65 | -3.34 | -4.73 | -4.08 | -3.77 | -5.13 | -4.47 | -4.15 |
| 100 | -3.63 | -3.06 | -2.77 | -4.16 | -3.60 | -3.31 | -4.59 | -4.03 | -3.72 | -4.99 | -4.39 | -4.10 |
| 200 | -3.61 | -3.04 | -2.76 | -4.12 | -3.55 | -3.28 | -4.53 | -3.99 | -3.69 | -4.90 | -4.33 | -4.06 |
| 500 | -3.59 | -3.04 | -2.76 | -4.08 | -3.55 | -3.26 | -4.50 | -3.96 | -3.68 | -4.85 | -4.31 | -4.03 |
| 1000 | -3.58 | -3.02 | -2.75 | -4.06 | -3.53 | -3.26 | -4.49 | -3.95 | -3.68 | -4.83 | -4.31 | -4.03 |

A3- Valeurs critiques du test de Perron

| λ | 0.1 | 0.2 | 0.3 | 0.4 | 0.5 | 0.6 | 0.7 | 0.8 | 0.9 |
|-----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| Modèle A | | | | | | | | | |
| 1% | -4.30 | -4.39 | -4.39 | -4.34 | -4.32 | -4.45 | -4.42 | -4.33 | -4.27 |
| 5% | -3.68 | -3.77 | -3.76 | -3.72 | -3.76 | -3.76 | -3.80 | -3.75 | -3.69 |
| 10% | -3.40 | -3.47 | -3.46 | -3.44 | -3.46 | -3.47 | -3.51 | -3.46 | -3.38 |
| Modèle B | | | | | | | | | |
| 1% | -4.27 | -4.41 | -4.51 | -4.55 | -4.56 | -4.57 | -4.51 | -4.38 | -4.26 |
| 5% | -3.65 | -3.80 | -3.87 | -3.94 | -3.96 | -3.95 | -3.85 | -3.82 | -3.68 |
| 10% | -3.36 | -3.49 | -3.58 | -3.66 | -3.68 | -3.66 | -3.57 | -3.50 | -3.35 |
| Modèle C | | | | | | | | | |
| 1% | -4.38 | -4.65 | -4.78 | -4.81 | -4.90 | -4.88 | -4.75 | -4.70 | -4.41 |
| 5% | -3.75 | -3.99 | -4.17 | -4.22 | -4.24 | -4.24 | -4.18 | -4.04 | -3.80 |
| 10% | -3.45 | -3.66 | -3.87 | -3.95 | -3.96 | -3.95 | -3.86 | -3.69 | -3.46 |