

TEST D'HÉTÉROSCÉDASTICITÉ (I2, J)

(26 / 05 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

Alternativement appelé **test d'homoscédasticité** (cf **hétéroscédasticité**), ce test consiste à vérifier que la **perturbation aléatoire** d'un modèle de régression possède une **matrice de dispersion** Σ qui est une **matrice scalaire**, au sens où $\Sigma = \sigma^2 \cdot I_N$ (N étant le nombre d'**observations** du **modèle**).

Des exemples classiques de ce test sont les suivants :

- (a) **test de GLEJSER** ;
- (b) test de GOLDFELD - QUANDT ;
- (c) **test de WHITE**.