

Le but de ce présent travail est de faire une étude sur l'introduction des tests de ML dans l'analyse des séries chronologiques scalaires à partir des études faites par Silvey(1959), Godfrey(1978), Poskitt & tremayne(1981), Pötscher(1983) et Pötscher(1985) d'une part, et établir une étude dans le cas multivarié d'autre part.

Le premier chapitre est consacré à l'étude des tests de ML extraite des travaux de Silvey (1959). Le deuxième chapitre comporte un résumé important sur les connaissances de base des modèles *ARMA* stationnaires univariés et une brève introduction pour le cas multivarié. Dans le troisième chapitre on montre l'introduction de ces tests dans l'analyse des séries chronologiques scalaires par une étude extraite des travaux de Pötscher(1983 et 1985). Enfin nous terminons ce travail par le quatrième chapitre dans lequel on essaie de faire une étude similaire que celle donnée dans le chapitre 3 en considérant les séries chronologiques multivariées.