

Teste de Raiz Unitária baseado em Pfaff (2008)

Vítor Wilher

6 de Agosto de 2016

Resumo

Código para gerar teste de raiz unitária conforme Pfaff (2008).

Matriz de Estatísticas de Teste e Valores Críticos

Tabela 1: Estatísticas do Teste ADF

	tau3	phi2	phi3	tau2	phi1	tau1
industria	-0.889	1.245	1.823	-1.755	1.585	0.146
confianca	-3.380	3.841	5.754	-3.122	4.881	-0.473

Tabela 2: Valores Críticos do Teste ADF

	1pct	5pct	10pct
tau3	-3.990	-3.430	-3.130
phi2	6.220	4.750	4.070
phi3	8.430	6.490	5.470
tau2	-3.460	-2.880	-2.570
phi1	6.520	4.630	3.810
tau1	-2.580	-1.950	-1.620

Matriz de Resultados

Tabela 3: Resultados do Protocolo de Pfaff (2008)

Processo Gerador	
industria	Passeio Aleatório sem Drift
confianca	Estacionário ao Redor de uma Tendência Linear

Referências

Pfaff, B. *Analysis of integrated and cointegrated time series with R*. Springer, New York, second edition, 2008.