

## Die Prozedur AUTOREG

Abhängige Variable	costs_num
--------------------	-----------

## Die Prozedur AUTOREG

Gewöhnliche Kleinste-Quadrate-Schätzwerte			
<b>SSE</b>	6.52679E10	<b>DFE</b>	168
<b>MSE</b>	388499230	<b>RMSE</b>	19710
<b>SBC</b>	3826.17665	<b>AIC</b>	3823.04675
<b>MAE</b>	8457.35072	<b>AICC</b>	3823.0707
<b>MAPE</b>	158.667059	<b>HQC</b>	3824.31692
<b>Durbin-Watson</b>	1.6288	<b>Summe R-Quadrat</b>	0.0000

Phillips-Perron-Unit-Root-Test					
Typ	Lags	Rho	Pr < Rho	Tau	Pr < Tau
<b>Nullmittelwe</b>	2	-124.6225	<.0001	-9.9272	<.0001
<b>Einfacher Mi</b>	2	-136.4000	0.0013	-10.6773	<.0001
<b>Trend</b>	2	-136.6541	0.0005	-10.6582	<.0001

Augmented Dickey-Fuller-Unit-Root-Tests							
Typ	Lags	Rho	Pr < Rho	Tau	Pr < Tau	F	Pr > F
<b>Nullmittelwert</b>	0	-124.7199	<.0001	-9.9288	<.0001		
<b>Einfacher Mittelwert</b>	0	-136.8980	<.0001	-10.6835	<.0001	57.0689	<.0010
<b>Trend</b>	0	-137.1464	<.0001	-10.6645	<.0001	56.8696	<.0010

ERS-Einheitswurzeltest						
Typ	Lags	Varianz	PT	Pr < PT	DF-GLS	Pr < DFGLS
<b>Einfacher Mi</b>	8	175312082	0.6867	<.0001	-4.0873	0.0002
<b>Trend</b>	8	175312082	2.4287	0.0002	-4.7749	0.0001

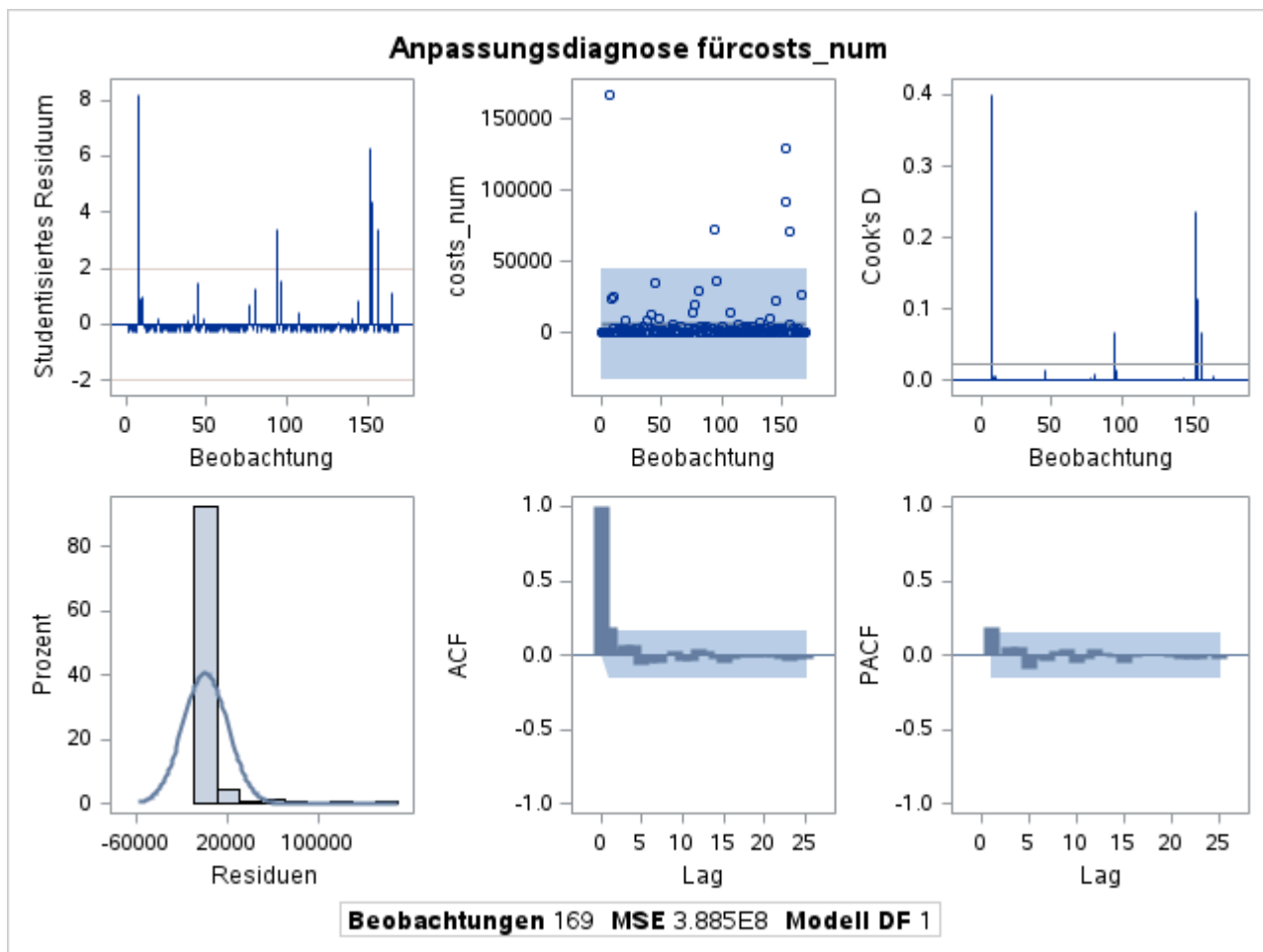
Ng und Perron Einheitswurzeltest					
Typ	Optimales Lag	Langfristige Varianz	Methode	Statistik	P-Wert
<b>Einfacher Mi</b>	8	75117781.3	<b>MZalpha</b>	-15.3457	0.0090
	8	75117781.3	<b>MSB</b>	0.1805	0.0109
	8	75117781.3	<b>MZ</b>	-2.7698	0.0050
	8	75117781.3	<b>PT</b>	1.6027	0.0070
	8	75117781.3	<b>MPT</b>	1.5973	0.0069
	8	75117781.3	<b>DFGLS</b>	-4.0873	<.0001
<b>Trend</b>	3	236003811	<b>MZalpha</b>	-50.6091	<.0001
	3	236003811	<b>MSB</b>	0.0993	<.0001
	3	236003811	<b>MZ</b>	-5.0267	0.0001
	3	236003811	<b>PT</b>	1.8041	<.0001
	3	236003811	<b>MPT</b>	1.8190	<.0001
	3	236003811	<b>DFGLS</b>	-5.3488	<.0001

KPSS-Test auf Stationarität			
Typ	Lags	Eta	Pr > Eta
<b>Einfacher Mi</b>	4	0.1139	0.5214
<b>Trend</b>	4	0.0874	0.2221

KERNEL=NW, AUTO

Parameterschätzer					
Variable	DF	Schätzung	Standard Fehler	t-Wert	Approx Pr >  t
Intercept	1	6121	1516	4.04	<.0001

## Die Prozedur AUTOREG



## Die Prozedur AUTOREG

Abhängige Variable	pri_num
--------------------	---------

## Die Prozedur AUTOREG

Gewöhnliche Kleinste-Quadrate-Schätzwerte			
SSE	0.01083633	DFE	168
MSE	0.0000645	RMSE	0.00803
SBC	-1146.9215	AIC	-1150.0514
MAE	0.00648146	AICC	-1150.0275
MAPE	104.88898	HQC	-1148.7813
Durbin-Watson	0.7593	Summe R-Quadrat	0.0000

Phillips-Perron-Unit-Root-Test					
Typ	Lags	Rho	Pr < Rho	Tau	Pr < Tau
Nullmittelwe	2	-57.1547	<.0001	-6.0466	<.0001
Einfacher Mi	2	-57.3908	0.0013	-6.0428	<.0001
Trend	2	-73.3572	0.0005	-7.0513	<.0001

Augmented Dickey-Fuller-Unit-Root-Tests							
Typ	Lags	Rho	Pr < Rho	Tau	Pr < Tau	F	Pr > F
Nullmittelwert	0	-64.2352	<.0001	-6.3131	<.0001		
Einfacher Mittelwert	0	-64.4435	0.0013	-6.3088	<.0001	19.9025	<.0010
Trend	0	-78.0897	0.0005	-7.1966	<.0001	25.9430	<.0010

ERS-Einheitswurzeltest						
Typ	Lags	Varianz	PT	Pr < PT	DF-GLS	Pr < DFGLS
Einfacher Mi	3	0.0000	2.8681	0.0384	-2.0427	0.0521
Trend	3	0.0000	7.8787	0.1492	-2.4534	0.1565

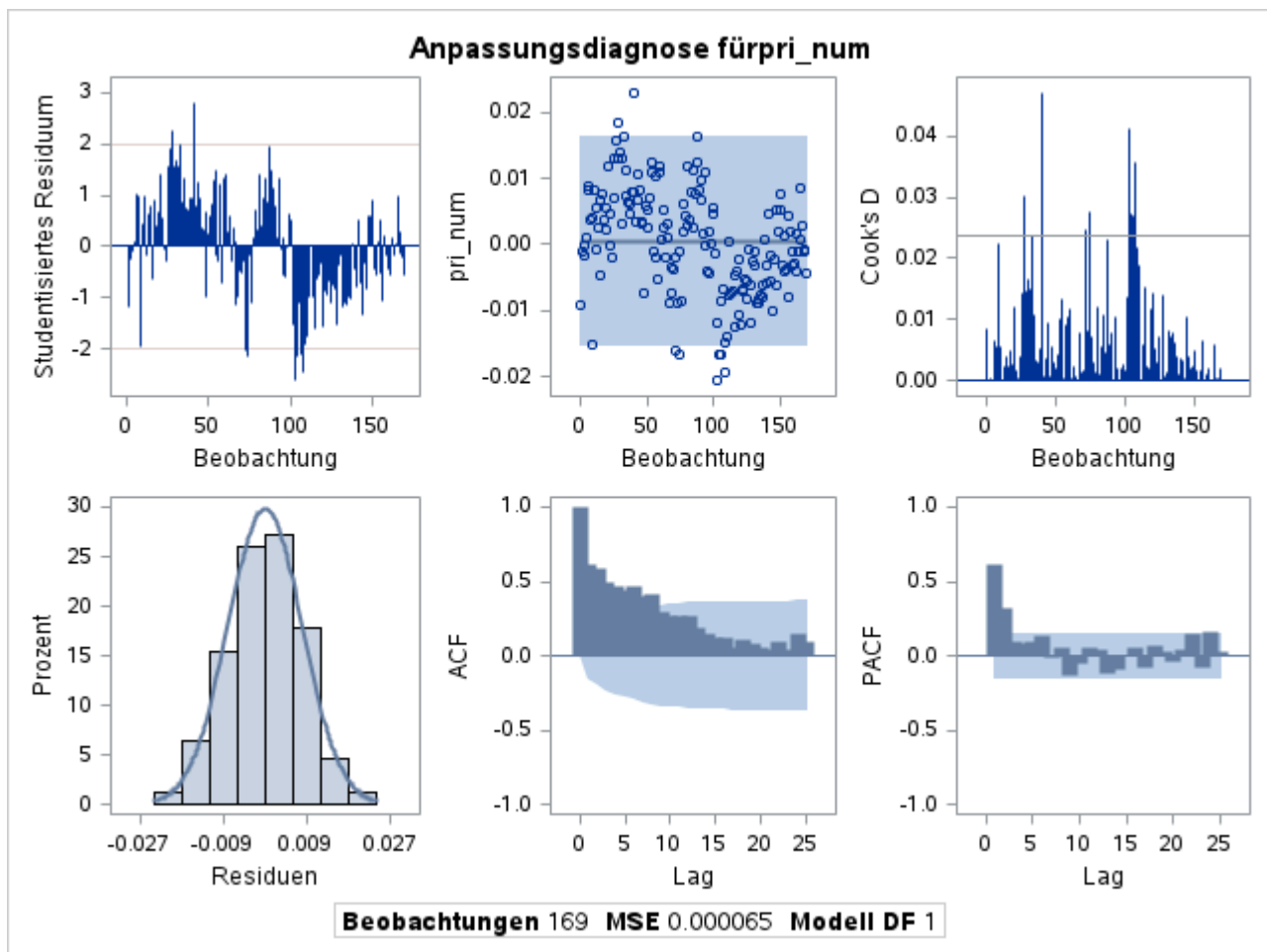
Ng und Perron Einheitswurzeltest					
Typ	Optimales Lag	Langfristige Varianz	Methode	Statistik	P-Wert
Einfacher Mi	5	0.0000	MZalpha	-4.1500	0.2020
	5	0.0000	MSB	0.3459	0.2630
	5	0.0000	MZ	-1.4356	0.1770
	5	0.0000	PT	6.7026	0.2100
	5	0.0000	MPT	5.9110	0.1932
	5	0.0000	DFGLS	-1.5611	0.1461
Trend	5	0.0000	MZalpha	-5.8202	0.5430
	5	0.0000	MSB	0.2909	0.5968
	5	0.0000	MZ	-1.6929	0.5059
	5	0.0000	PT	17.3200	0.5821
	5	0.0000	MPT	15.6390	0.5461
	5	0.0000	DFGLS	-1.9057	0.4027

KPSS-Test auf Stationarität			
Typ	Lags	Eta	Pr > Eta
Einfacher Mi	8	0.7233	0.0110
Trend	7	0.1295	0.0776

KERNEL=NW, AUTO

Parameterschätzer					
Variable	DF	Schätzung	Standard Fehler	t-Wert	Approx Pr >  t
Intercept	1	0.000393	0.000618	0.64	0.5254

Die Prozedur AUTOREG



#### Die Prozedur AUTOREG

Abhängige Variable

#### Die Prozedur AUTOREG

Gewöhnliche Kleinste-Quadrate-Schätzwerte			
<b>SSE</b>	27160.185	<b>DFE</b>	168
<b>MSE</b>	161.66777	<b>RMSE</b>	12.71486
<b>SBC</b>	1343.18499	<b>AIC</b>	1340.05509
<b>MAE</b>	11.4514114	<b>AICC</b>	1340.07904
<b>MAPE</b>	8.69460748	<b>HQC</b>	1341.32526
<b>Durbin-Watson</b>	0.0020	<b>Summe R-Quadrat</b>	0.0000

Phillips-Perron-Unit-Root-Test					
Typ	Lags	Rho	Pr < Rho	Tau	Pr < Tau
<b>Nullmittelwe</b>	2	0.2534	0.7425	4.8914	1.0000
<b>Einfacher Mi</b>	2	0.4916	0.9764	0.9042	0.9954
<b>Trend</b>	2	-7.2731	0.6346	-2.9707	0.1437

Augmented Dickey-Fuller-Unit-Root-Tests							
Typ	Lags	Rho	Pr < Rho	Tau	Pr < Tau	F	Pr > F
<b>Nullmittelwert</b>	0	0.2534	0.7425	4.9101	0.9999		
<b>Einfacher Mittelwert</b>	0	0.4919	0.9764	0.9057	0.9954	12.0936	<.0010
<b>Trend</b>	0	-7.3855	0.6253	-2.9610	0.1465	5.6548	0.0861

ERS-Einheitswurzeltest						
Typ	Lags	Varianz	PT	Pr < PT	DF-GLS	Pr < DFGLS
Einfacher Mi	3	0.3499	348.4859	0.9999	2.1956	0.9971
Trend	3	0.3499	58.9386	0.9804	-0.9292	0.9052

Ng und Perron Einheitswurzeltest					
Typ	Optimales Lag	Langfristige Varianz	Methode	Statistik	P-Wert
Einfacher Mi	7	1.1678	MZalpha	1.3166	0.9527
	7	1.1678	MSB	1.1211	0.9670
	7	1.1678	MZ	1.4760	0.9838
	7	1.1678	PT	104.4037	0.9698
	7	1.1678	MPT	91.7498	0.9739
	7	1.1678	DFGLS	1.0718	0.9560
Trend	0	0.2765	MZalpha	-1.3881	0.9600
	0	0.2765	MSB	0.5929	0.9948
	0	0.2765	MZ	-0.8230	0.9250
	0	0.2765	PT	74.5629	0.9911
	0	0.2765	MPT	64.4188	0.9890
	0	0.2765	DFGLS	-0.8839	0.9184

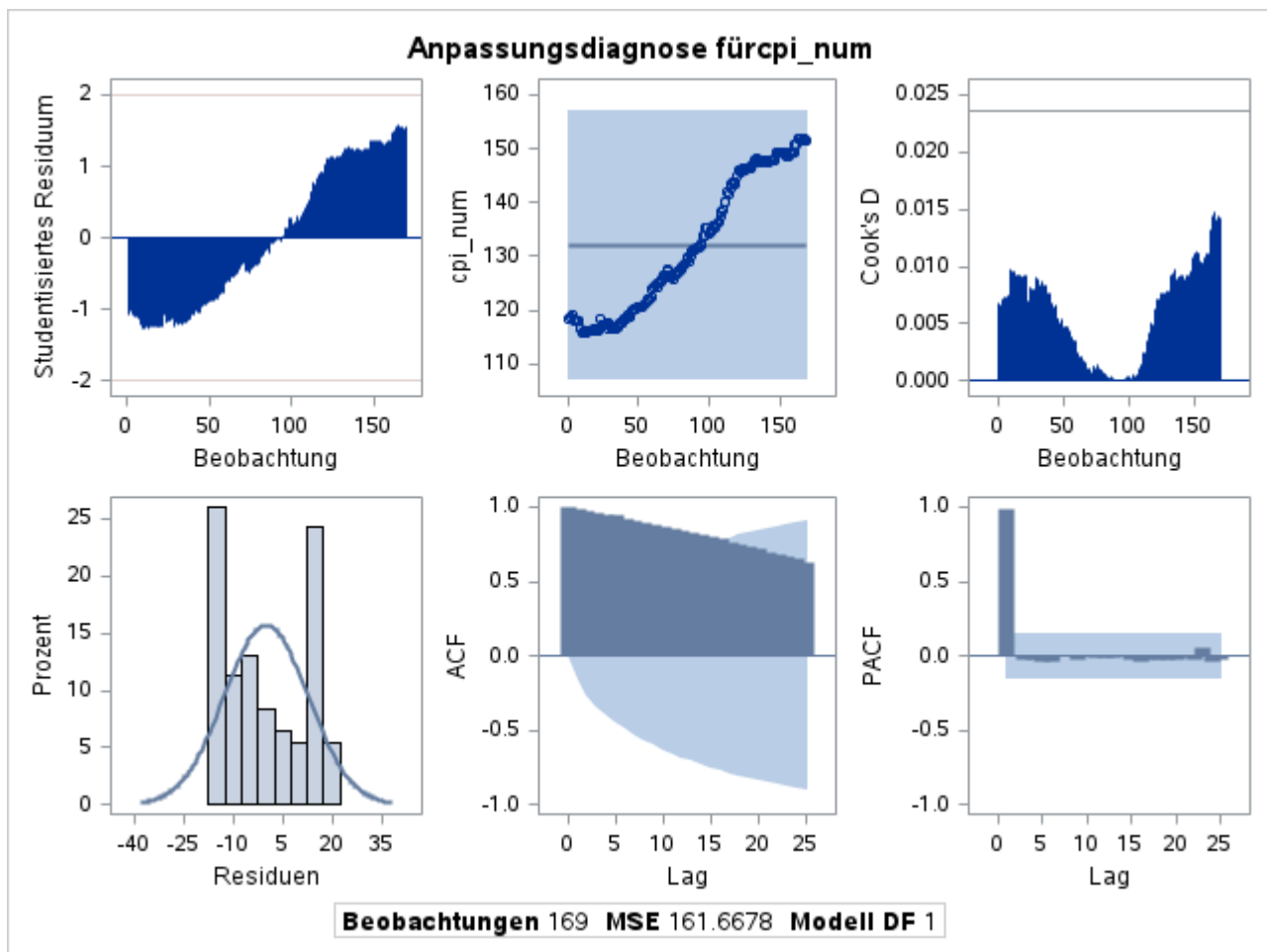
KPSS-Test auf Stationarität			
Typ	Lags	Eta	Pr > Eta
Einfacher Mi	9	1.7533	<.0001
Trend	8	0.2824	0.0021

KERNEL=NW, AUTO

Parameterschätzer					
Variable	DF	Schätzung	Standard Fehler	t-Wert	Approx Pr >  t
Intercept	1	132.0193	0.9781	134.98	<.0001

---

Die Prozedur AUTOREG



#### Die Prozedur AUTOREG

Abhängige Variable ppi\_num

#### Die Prozedur AUTOREG

Gewöhnliche Kleinste-Quadrate-Schätzwerte			
SSE	61415.7105	DFE	168
MSE	365.56971	RMSE	19.11988
SBC	1481.07438	AIC	1477.94448
MAE	17.0392143	AICC	1477.96843
MAPE	9.59858103	HQC	1479.21465
Durbin-Watson	0.0012	Summe R-Quadrat	0.0000

Phillips-Perron-Unit-Root-Test					
Typ	Lags	Rho	Pr < Rho	Tau	Pr < Tau
Nullmittelwe	2	0.3221	0.7599	7.7741	1.0000
Einfacher Mi	2	-0.3507	0.9365	-0.9074	0.7841
Trend	2	-3.4845	0.9131	-1.0351	0.9355

Augmented Dickey-Fuller-Unit-Root-Tests							
Typ	Lags	Rho	Pr < Rho	Tau	Pr < Tau	F	Pr > F
Nullmittelwert	0	0.3221	0.7599	8.0818	0.9999		
Einfacher Mittelwert	0	-0.3469	0.9368	-0.9214	0.7796	34.6833	<.0010
Trend	0	-3.0910	0.9318	-0.9515	0.9468	0.7854	0.9879

ERS-Einheitswurzeltest						
Typ	Lags	Varianz	PT	Pr < PT	DF-GLS	Pr < DFGLS
Einfacher Mi	3	0.3976	1073.7934	1.0000	2.4918	0.9988
Trend	3	0.3976	17.1854	0.5830	-1.4889	0.6529

Ng und Perron Einheitswurzeltest					
Typ	Optimales Lag	Langfristige Varianz	Methode	Statistik	P-Wert
Einfacher Mi	5	1.1988	MZalpha	1.3627	0.9565
	5	1.1988	MSB	2.0613	0.9995
	5	1.1988	MZ	2.8090	0.9999
	5	1.1988	PT	356.1101	0.9992
	5	1.1988	MPT	296.2655	0.9992
	5	1.1988	DFGLS	2.1086	0.9976
Trend	0	0.3003	MZalpha	-3.5959	0.7749
	0	0.3003	MSB	0.3284	0.7353
	0	0.3003	MZ	-1.1808	0.8037
	0	0.3003	PT	22.7548	0.7313
	0	0.3003	MPT	22.9069	0.7619
	0	0.3003	DFGLS	-1.1911	0.8097

KPSS-Test auf Stationarität			
Typ	Lags	Eta	Pr > Eta
Einfacher Mi	9	1.7932	<.0001
Trend	8	0.2252	0.0082

KERNEL=NW, AUTO

Parameterschätzer					
Variable	DF	Schätzung	Standard Fehler	t-Wert	Approx Pr >  t
Intercept	1	179.7757	1.4708	122.23	<.0001

---

Die Prozedur AUTOREG

