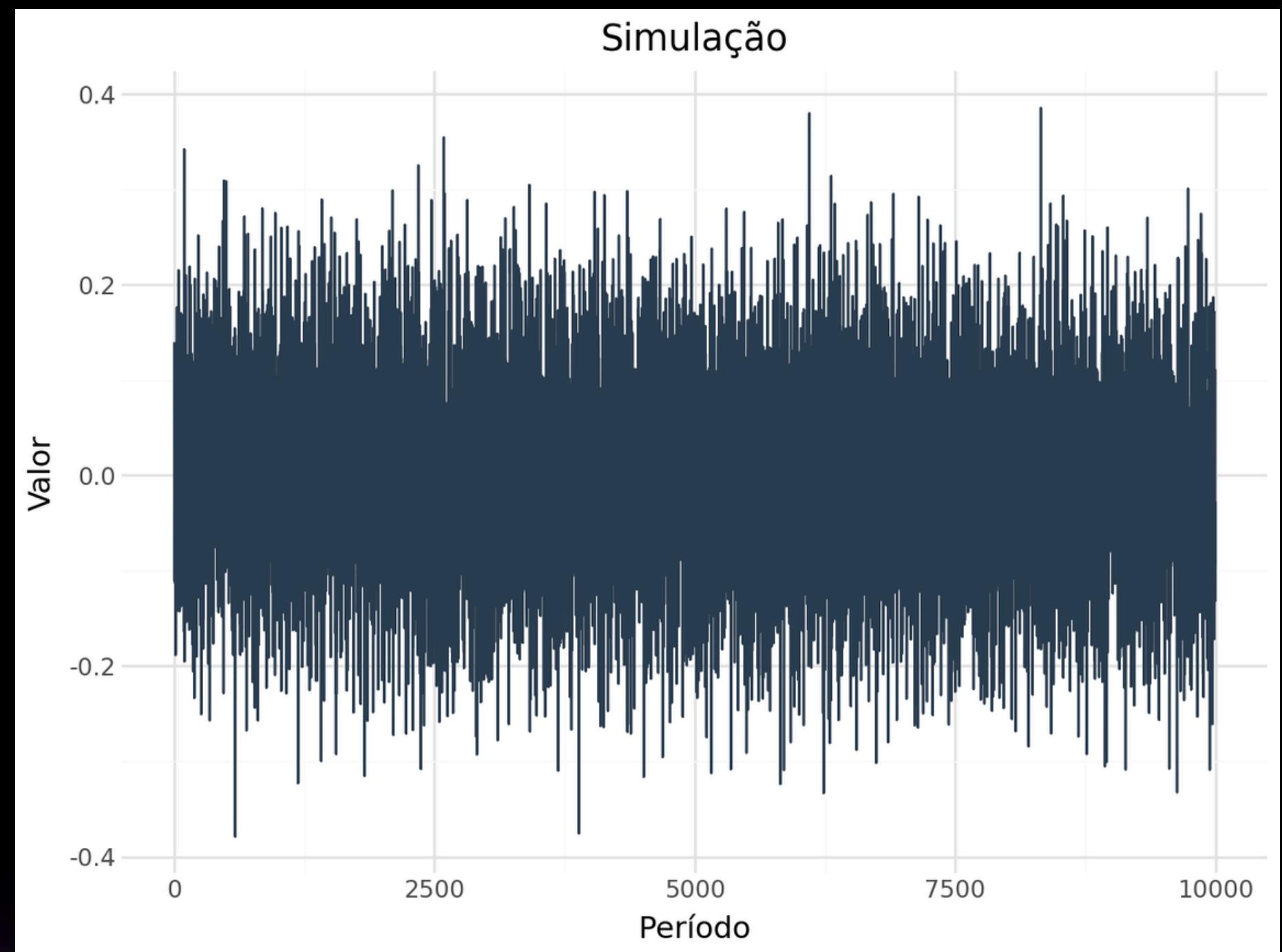


DICKY FULLER

2025



- Série estacionária com $\phi_1 = 0$ e 1000 observações
- Estatística DF simples (t-test para β):
-101.65080209540139
- p-valor associado: 0.0
- Rejeitamos a hipótese nula



KPSS:

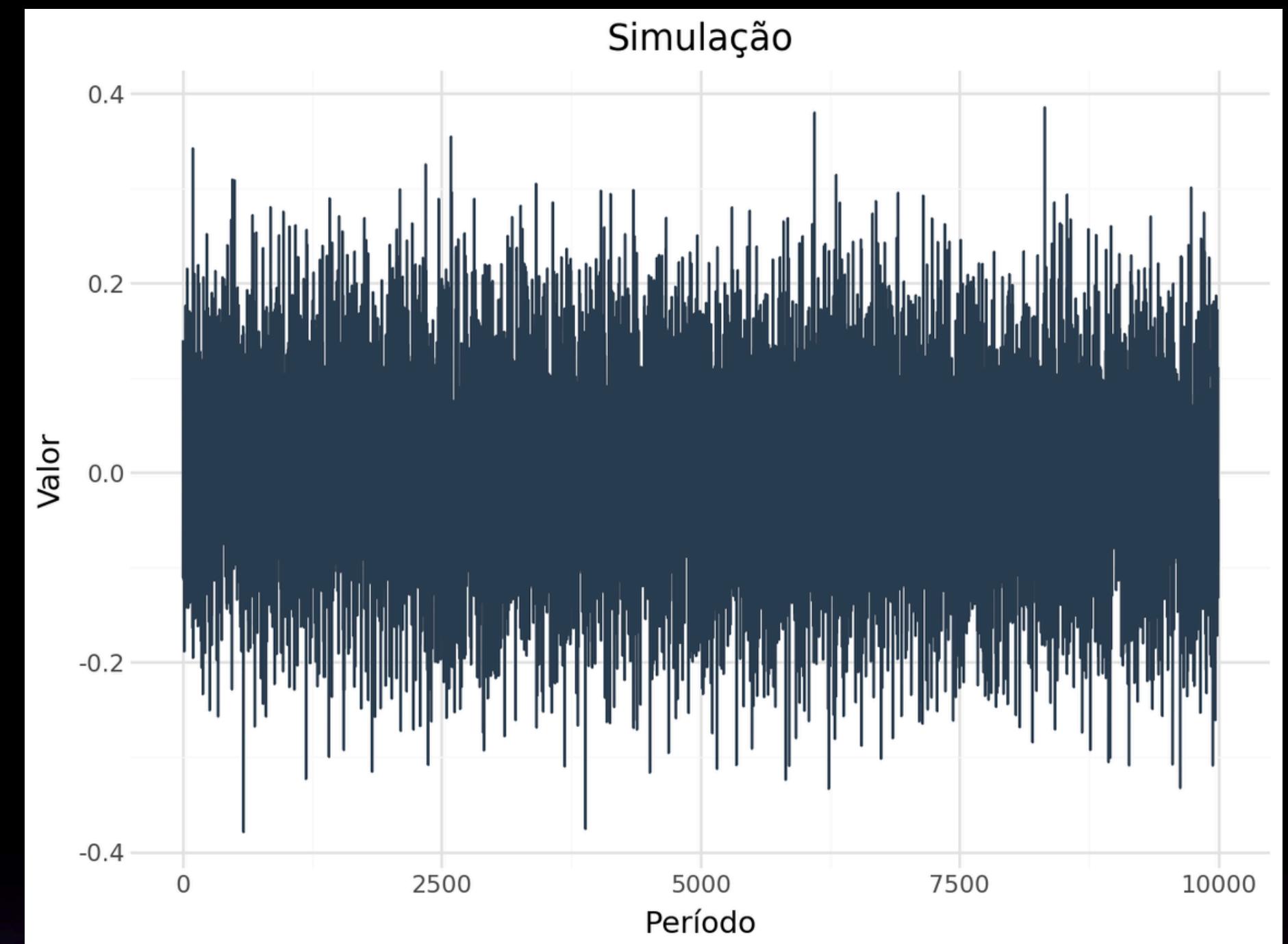
- Estatística: 1.1759215860970618
- p-valor: 0.01
- Lags usados: 18
- Critérios: {'10%': 0.347, '5%': 0.463, '2.5%': 0.574, '1%': 0.739}

Phillips Perron:

- Test Statistic: -101.743
- p-valor: 0.000
- Lags: 38

Dicky Fuller Aumentado:

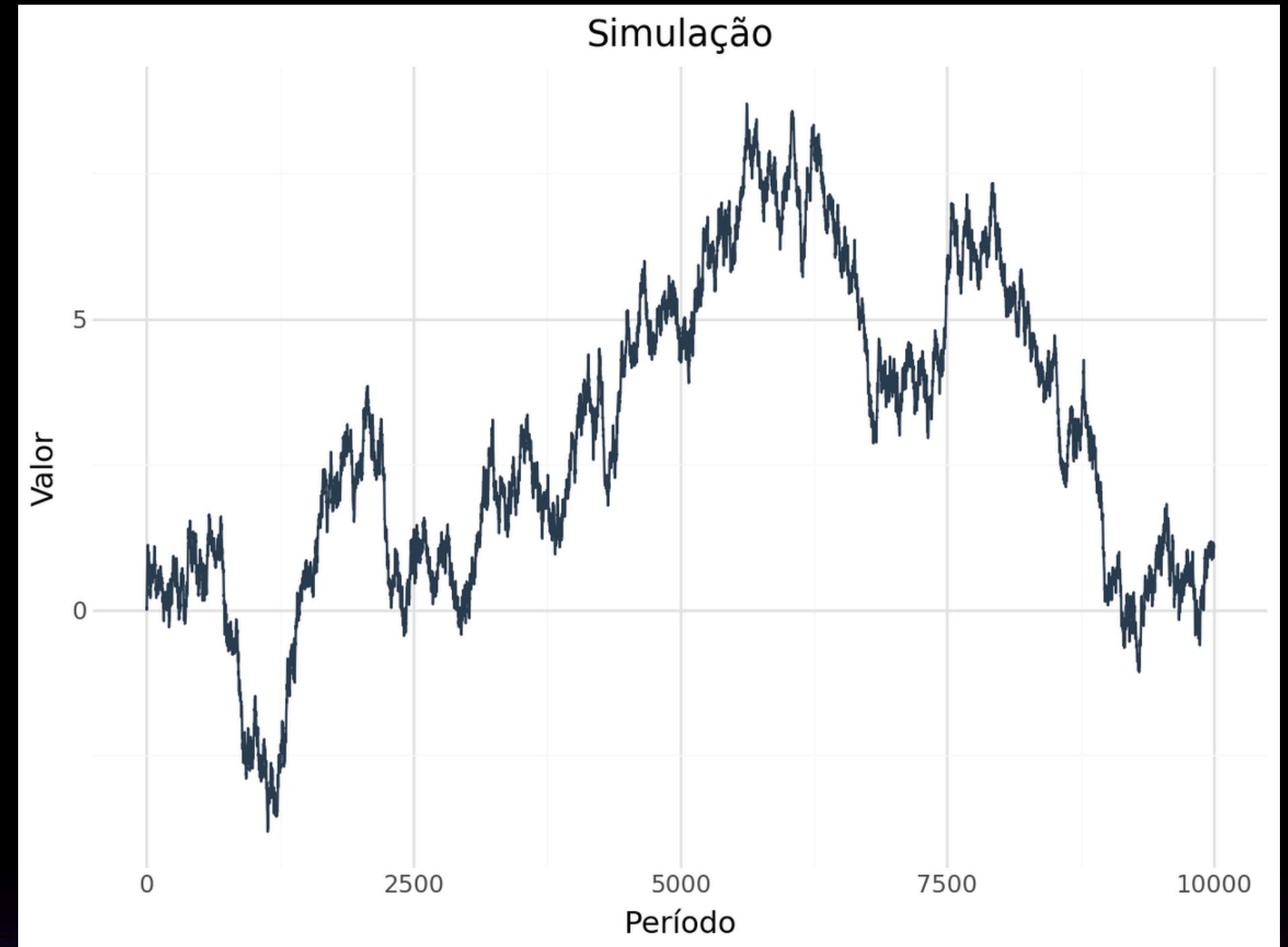
- Test Statistic: -101.651
- p-valor: 0.000
- Lags: 0



- Série não estacionária
- Defasagem
- $\text{PHI1} = 1$

Phillips Perron:

- Test Statistic: -1.861
- p-valor: 0.351
- Lags: 38



- Gerando série defasada em uma unidade (AR(1))
- Comprovando estacionariedade

KPSS (não rejeitamos):

- Estatística: 0.12255592200565171
- p-valor: 0.1
- Lags usados: 7

Dicky Fuller Aumentado (rejeitamos):

- Test Statistic -99.571
- p-valor 0.000
- Lags 0

Phillips Perron:

- Test Statistic: -99.800
- p-valor: 0.000
- Lags: 38

OBRIGADO!