

EAE1223: Econometria III

Exercícios sobre Raízes Unitárias

Usando as duas séries que você analisou no exercício anterior.

1. Para cada uma das séries, realize o procedimento sequencial descrito nos *slides* para testar a presença de raiz unitária. Conduza os testes ao nível de significância de 10%. Qual a conclusão dos procedimentos?
2. Para cada uma das séries, realize o teste de tendência determinística descrito nos *slides*, já usando a série transformada obtida com base na conclusão dos testes no item anterior. Conduza os testes ao nível de significância de 10%. Qual a conclusão de cada teste?
3. Repita os dois itens anteriores a 5% de significância. As conclusões mudaram?