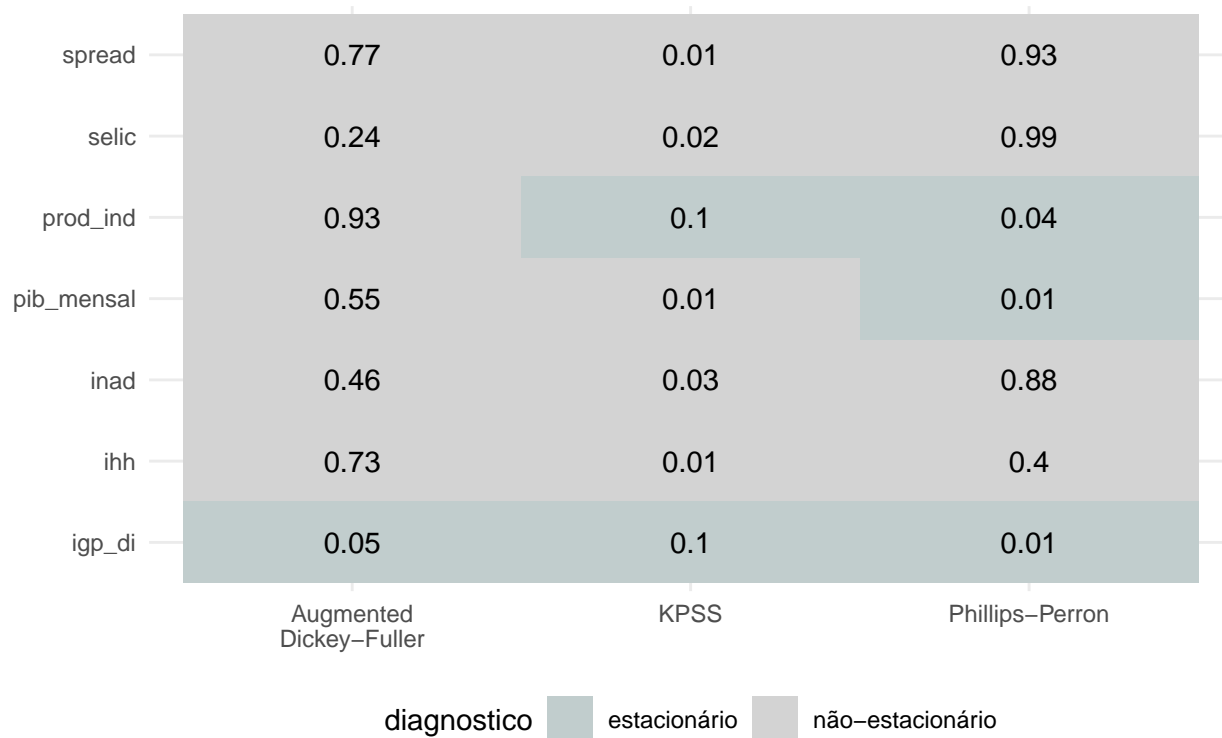


Processo de testes econométricos

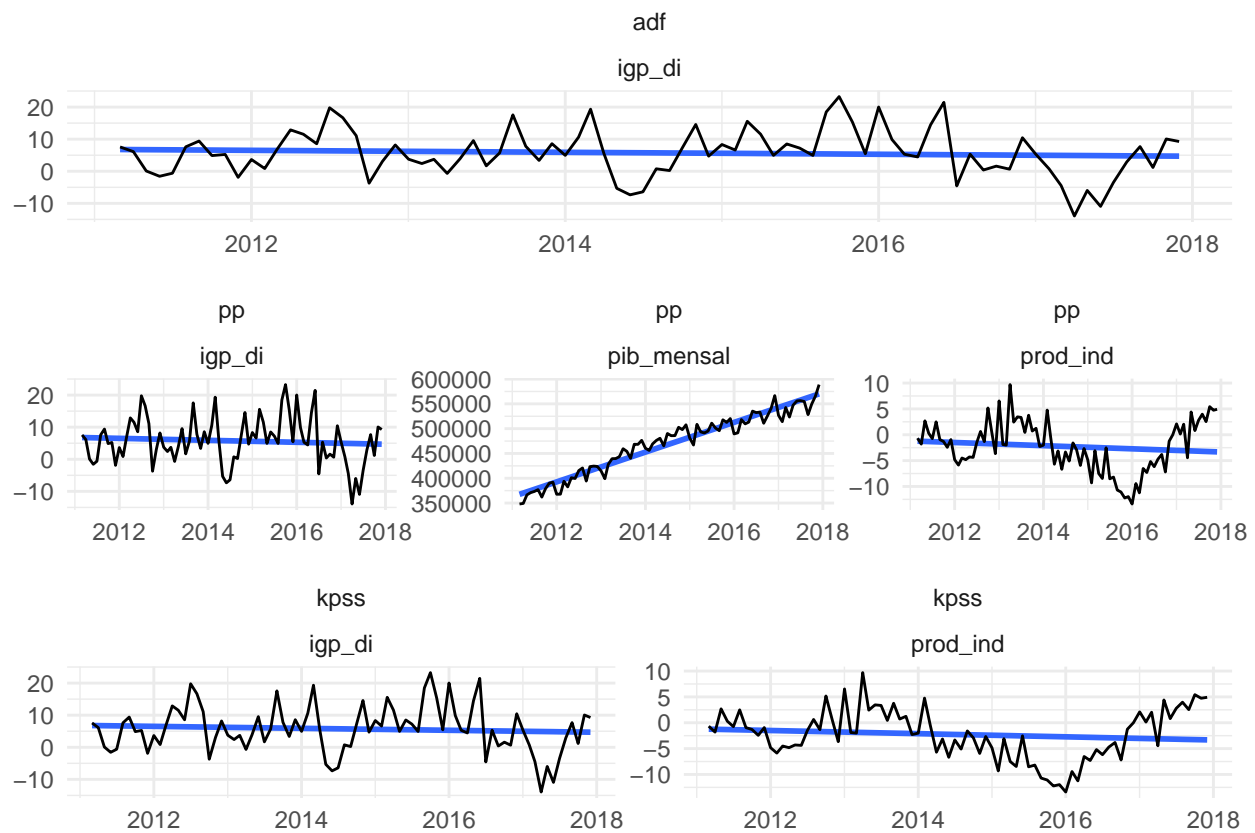
Testes de raiz unitária

Resultados dos testes de raiz unitária para cada variável



Hipótese nula de raiz unitária, exceto para KPSS

Séries diagnosticadas como estacionárias em cada teste



Testes de co-integração para várias combinações das variáveis

Philips-Ouliaris

$$spread = \beta_0 + \beta_1 selic + \beta_2 inad + \beta_3 pib_mensal + \beta_4 prod_ind + \beta_5 igp_di$$

A tibble: 2 x 3

	V1	V2	resultado
	<chr>	<chr>	<chr>
1	ihh	pib_mensal	0.01
2	prod_ind	igp_di	0.01

A tibble: 5 x 4

	V1	V2	V3	resultado
	<chr>	<chr>	<chr>	<chr>
1	ihh	spread	pib_mensal	0.01
2	ihh	selic	pib_mensal	0.01
3	ihh	inad	pib_mensal	0.01
4	ihh	pib_mensal	prod_ind	0.01
5	ihh	pib_mensal	igp_di	0.01

A tibble: 10 x 5

	V1	V2	V3	V4	resultado
	<chr>	<chr>	<chr>	<chr>	<chr>
1	ihh	spread	selic	pib_mensal	0.01
2	ihh	spread	inad	pib_mensal	0.01
3	ihh	spread	pib_mensal	prod_ind	0.01
4	ihh	spread	pib_mensal	igp_di	0.01
5	ihh	selic	inad	pib_mensal	0.01
6	ihh	selic	pib_mensal	prod_ind	0.01
7	ihh	selic	pib_mensal	igp_di	0.01
8	ihh	inad	pib_mensal	prod_ind	0.01
9	ihh	inad	pib_mensal	igp_di	0.01
10	ihh	pib_mensal	prod_ind	igp_di	0.01

A tibble: 11 x 6

	V1	V2	V3	V4	V5	resultado
	<chr>	<chr>	<chr>	<chr>	<chr>	<chr>
1	ihh	spread	selic	inad	pib_mensal	0.0101548982701054
2	ihh	spread	selic	pib_mensal	prod_ind	0.01
3	ihh	spread	selic	pib_mensal	igp_di	0.01
4	ihh	spread	inad	pib_mensal	prod_ind	0.01
5	ihh	spread	inad	pib_mensal	igp_di	0.01
6	ihh	spread	pib_mensal	prod_ind	igp_di	0.01
7	ihh	selic	inad	pib_mensal	prod_ind	0.01
8	ihh	selic	inad	pib_mensal	igp_di	0.01
9	ihh	selic	pib_mensal	prod_ind	igp_di	0.01
10	ihh	inad	pib_mensal	prod_ind	igp_di	0.01
11	spread	selic	inad	pib_mensal	prod_ind	0.038977069480577

A tibble: 5 x 7

	V1	V2	V3	V4	V5	V6	resultado
	<chr>	<chr>	<chr>	<chr>	<chr>	<chr>	<chr>
1	ihh	spread	selic	inad	pib_mensal	prod_ind	0.0293105809705589
2	ihh	spread	selic	inad	pib_mensal	igp_di	0.01
3	ihh	spread	selic	pib_mensal	prod_ind	igp_di	0.01

4	ihh	spread	inad	pib_mensal	prod_ind	igp_di	0.01
5	ihh	selic	inad	pib_mensal	prod_ind	igp_di	0.01