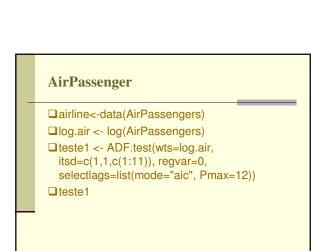
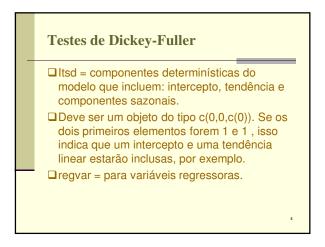




Testes de Dickey-Fuller Verificar se a tua versão do R é a 2.6 ou superior; caso contrário, atualizá-la; Baixar a biblioteca uroot.zip do sítio da CRAN; Instalá-la e carregá-la; Função: ADF.test (wts, itsd, regvar=0, selectlags=list(mode="signf", Pmax=NULL)) wts = dados





S – plus

- □É necessário que tua versão do software possua o ambiente FinMetrics; assim o teste de Dickey-Fuller para testar a existência de tendência com p_{max} = 10 e uma constante é:
- □teste = unitroot(dados, trend="c", statistic="t", method="adf", lags=10)

S – plus

- ☐O S-plus mostra os valores de todos os coeficientes e, para eliminar (saber) os que não são significantes é necessário rodar um summary(adf.out) que mostrará as significâncias de cada um deles.
- □ Para testar a existência de tendência com p_{max} = 10, uma constante e tendência determinística, temos:
- ☐ teste = unitroot(dados, trend="ct", lags=10)

8