

ОПРЕДЕЛЯНЕ НА РАНГА НА КОИНТЕГРИРАНОСТ И МОДЕЛА
ЗА ДЕТЕРМИНИРАНИТЕ КОМПОНЕНТИ СРЕД КОМБИНАЦИИТЕ
ОТ ПРОМЕНЛИВИ, ЧИЯТО ПРОВЕРКА ЗА СТАЦИОНАРНОСТ СЕ
ОСЪЩЕСТВЯВА БЕЗ ОТЧИТАНЕ НА ВЛИЯНИЕТО НА СЕЗОННИЯ ФАКТОР

H0:	r	n-r	<i>λ</i> max-критерий			Trace-критерий		
			модел 2	модел 3	модел 4	модел 2	модел 3	модел 4
y1, k1, II	0	3	37.866	37.764	61.140	52.604	45.604	72.970
	1	2	8.195	7.807	8.283	4.738	7.840	11.830
	2	1	6.543	0.033	3.546	6.543	0.033	3.546
y1, k2, II	0	3	56.947	56.759	62.223	71.645	64.379	73.785
	1	2	8.380	7.856	8.100	11.698	7.980	11.562
	2	1	6.318	0.124	3.462	6.318	0.124	3.462
y1, k3, II	0	3	60.548	60.310	61.284	75.338	68.464	72.812
	1	2	8.611	7.907	8.047	14.790	8.154	11.528
	2	1	6.179	0.246	3.482	6.179	0.246	3.482
y1, gcf, II	0	3	22.527	19.928	20.184	48.900	28.107	42.409
	1	2	18.203	8.177	14.954	26.372	8.178	22.225
	2	1	8.170	0.001	7.271	8.170	0.001	7.271
y1, gfcf, II	0	3	29.900	27.154	28.627	60.648	36.767	44.713
	1	2	21.405	9.381	10.391	30.749	9.613	16.085
	2	1	9.343	0.232	6.695	9.343	0.232	5.695
y1, cfc, II	0	3	22.530	13.020	28.340	42.085	0.884	47.506
	1	2	11.960	7.721	12.362	19.554	7.864	19.166
	2	1	7.594	0.142	6.804	7.594	0.142	6.804
y2, k1, II	0	3	45.884	45.861	66.369	61.967	53.347	78.668
	1	2	8.982	7.465	8.178	16.083	7.486	12.299
	2	1	7.101	0.021	4.121	7.101	0.021	4.121
y2, k2, II	0	3	33.318	33.263	65.686	49.434	41.046	77.755
	1	2	9.421	7.638	8.183	16.116	7.783	12.069
	2	1	6.695	0.145	3.886	6.695	0.145	3.886
y2, k3, II	0	3	25.762	25.667	64.323	42.102	33.860	76.479
	1	2	9.841	7.872	8.316	16.340	8.164	12.156
	2	1	6.499	0.322	3.840	6.499	0.322	3.840
y2, gcf, II	0	3	30.358	19.443	40.403	53.185	25.493	65.048
	1	2	17.313	5.863	18.801	22.827	6.051	24.645
	2	1	5.514	0.188	5.845	5.514	0.188	5.845
y2, gfcf, II	0	3	24.757	18.149	59.326	50.027	26.568	76.997
	1	2	16.942	8.330	11.665	25.270	8.419	17.671
	2	1	8.329	0.089	6.006	8.329	0.089	6.006
y2, cfc, II	0	3	28.050	20.025	65.218	50.777	27.929	91.087
	1	2	15.138	7.635	19.204	22.727	7.905	25.960
	2	1	7.589	0.270	6.755	7.589	0.270	6.755

Забележка: С r се означава броят на коинтеграционните вектори, а с n - броят на променливите. С подчертаване са отбелязани значенията, при които нулевата хипотеза се приема за първи път при равнище на значимост $\alpha = 0.01$, а с bold - тези, при които се приема нулевата хипотеза за първи път при равнище на значимост $\alpha = 0.05$.