

ОПРЕДЕЛЯНЕ НА РАНГА НА КОИНТЕГРИРАНОСТ И НА МОДЕЛА  
 ЗА ДЕТЕРМИНИРАНИ КОМПОНЕНТИ СРЕД КОМБИНАЦИИТЕ  
 ОТ ПРОМЕНЛИВИ, ЧИЯТО ПРОВЕРКА ЗА СТАЦИОНАРНОСТ СЕ  
 ОСЪЩЕСТВЯВА С ВКЛЮЧВАНЕ НА ФИКТИВНИ СЕЗОННИ ПРОМЕНЛИВИ

H0:	r	n-r	<i>λ</i> max-критерий			Trace-критерий		
			модел 2	модел 3	модел 4	модел 2	модел 3	модел 4
y1, gcf, I1	0	3	47.694	<u>24.637</u>	<b>24.641</b>	75.809	40.950	46.549
	1	2	20.674	11.916	16.399	28.115	<b>16.314</b>	21.908
	2	1	7.469	4.397	5.509	7.469	4.397	5.509
y1, gcf, II	0	3	37.847	<b>23.757</b>	23.956	69.073	41.883	43.222
	1	2	23.703	11.968	13.080	31.226	<u>18.126</u>	<b>19.266</b>
	2	1	7.523	6.158	6.187	7.523	6.158	6.187
y1, cfc, I1	0	3	35.979	<b>21.084</b>	26.675	56.869	<u>30.889</u>	43.649
	1	2	13.534	8.749	13.199	20.890	<b>9.806</b>	16.975
	2	1	7.356	1.057	3.776	7.356	1.057	3.776
y2, gcf, I1	0	3	33.757	<b>17.298</b>	20.899	58.140	<b>25.573</b>	43.700
	1	2	16.940	7.822	16.991	24.383	8.275	22.802
	2	1	7.442	0.453	5.810	7.442	0.453	5.810
y2, gcf, II	0	3	<u>25.143</u>	<b>16.411</b>	30.355	48.907	<b>25.538</b>	50.254
	1	2	15.315	7.549	12.454	22.765	9.127	19.898
	2	1	7.450	1.578	7.444	7.450	1.578	7.444
y2, cfc, I1	0	3	31.109	28.098	35.060	59.321	37.319	62.256
	1	2	<u>19.111</u>	<b>9.195</b>	18.206	28.212	<b>9.221</b>	27.196
	2	1	9.101	0.026	8.990	9.101	0.026	8.990
y1, gcf, I2	0	3	43.135	28.693	<u>28.890</u>	83.390	52.328	57.985
	1	2	23.129	18.062	<b>18.392</b>	40.255	23.635	<u>29.095</u>
	2	1	17.126	5.573	10.703	17.126	5.573	<b>10.703</b>
y1, gcf, I2	0	3	39.092	24.770	<u>25.378</u>	78.925	50.304	52.442
	1	2	24.043	15.949	<b>16.859</b>	39.833	25.533	<u>27.064</u>
	2	1	15.790	9.584	10.205	15.790	9.584	<b>10.205</b>
y1, cfc, I2	0	3	33.351	27.856	31.290	71.870	46.486	56.838
	1	2	21.603	<u>16.937</u>	19.809	38.520	<u>18.630</u>	25.547
	2	1	16.917	<b>1.693</b>	5.738	16.917	<b>1.693</b>	5.738
y2, gcf, I2	0	3	30.631	<u>24.415</u>	<b>25.088</b>	67.025	37.876	56.356
	1	2	23.759	12.729	22.725	36.393	<b>13.461</b>	31.268
	2	1	12.634	0.732	8.544	12.634	0.732	8.544
y2, gcf, I2	0	3	28.750	<b>15.758</b>	28.896	58.833	33.346	56.033
	1	2	15.630	14.857	14.862	30.083	<u>17.588</u>	17.137
	2	1	14.453	2.732	12.274	14.453	<b>2.732</b>	12.274
y2, cfc, I2	0	3	42.759	40.457	47.720	79.402	57.944	83.371
	1	2	<u>19.160</u>	17.484	19.697	36.643	<u>17.487</u>	35.652
	2	1	17.483	<b>0.003</b>	15.955	17.483	<b>0.003</b>	15.955

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