

Tabla 1. Dickey-Fuller Ampliado para LnPIB_t

Contraste aumentado de Dickey-Fuller para l_PIB_c
incluyendo 5 retardos de $(1-L)\text{l_PIB}_c$
(el máximo fue 6, el criterio AIC)
tamaño muestral 14
hipótesis nula de raíz unitaria: $a = 1$

con constante y tendencia
modelo: $(1-L)y = b_0 + b_1*t + (a-1)*y(-1) + \dots + e$
valor estimado de $(a - 1)$: 0,997923
Estadístico de contraste: $\text{tau_ct}(1) = 0,960187$
valor p asintótico 0,9999
Coef. de autocorrelación de primer orden de e: 0,046
diferencias retardadas: $F(5, 6) = 0,657 [0,6695]$

Tabla 2. Dickey-Fuller para $\text{Ln}\Delta\text{PIB}_t$

Contraste aumentado de Dickey-Fuller para d_l_PIB_c
incluyendo 0 retardos de $(1-L)\text{d_l_PIB}_c$
(el máximo fue 6, el criterio AIC)
tamaño muestral 18
hipótesis nula de raíz unitaria: $a = 1$

contraste sin constante
modelo: $(1-L)y = (a-1)*y(-1) + e$
valor estimado de $(a - 1)$: -0,171098
Estadístico de contraste: $\text{tau_nc}(1) = -1,31757$
Valor p 0,1666
Coef. de autocorrelación de primer orden de e: -0,007

Tabla 3. Dickey Fuller para $\Delta^2\text{LnPIB}_t$

Contraste aumentado de Dickey-Fuller para d_d_l_PIB_c
incluyendo 0 retardos de $(1-L)\text{d_d_l_PIB}_c$
(el máximo fue 6, el criterio AIC)
tamaño muestral 17
hipótesis nula de raíz unitaria: $a = 1$

contraste sin constante
modelo: $(1-L)y = (a-1)*y(-1) + e$
valor estimado de $(a - 1)$: -1,07228
Estadístico de contraste: $\tau_{nc}(1) = -3,99678$
Valor p 0,000501
Coef. de autocorrelación de primer orden de e: -0,037

Tabla 4. Dickey Fuller para $\ln K_t$

Contraste aumentado de Dickey-Fuller para $\ln K$
incluyendo un retardo de $(1-L)\ln K$
(el máximo fue 6, el criterio AIC)
tamaño muestral 18
hipótesis nula de raíz unitaria: $a = 1$

con constante y tendencia
modelo: $(1-L)y = b_0 + b_1*t + (a-1)*y(-1) + \dots + e$
valor estimado de $(a - 1)$: -0,136788
Estadístico de contraste: $\tau_{ct}(1) = -3,21236$
valor p asintótico 0,08192
Coef. de autocorrelación de primer orden de e: 0,100

Tabla 5. Dickey Fuller para ΔLnK_t

Contraste aumentado de Dickey-Fuller para d_{1_K}
incluyendo un retardo de $(1-L)d_{1_K}$
(el máximo fue 7, el criterio AIC)

tamaño muestral 17

hipótesis nula de raíz unitaria: $a = 1$

contraste sin constante

modelo: $(1-L)y = (a-1)*y(-1) + \dots + e$

valor estimado de $(a - 1)$: -0.0272384

Estadístico de contraste: $\tau_{nc}(1) = -0.935921$

valor p asintótico 0.3114

Coef. de autocorrelación de primer orden de e : 0.014

Tabla 6. Dickey Fuller para $\Delta^2 \text{LnK}_t$

Contraste aumentado de Dickey-Fuller para $d_{d_{1_K}}$
incluyendo 0 retardos de $(1-L)d_{d_{1_K}}$
(el máximo fue 6, el criterio AIC)

tamaño muestral 17

hipótesis nula de raíz unitaria: $a = 1$

contraste sin constante

modelo: $(1-L)y = (a-1)*y(-1) + e$

valor estimado de $(a - 1)$: -0,341471

Estadístico de contraste: $\tau_{nc}(1) = -1,81553$

Valor p 0,06706

Coef. de autocorrelación de primer orden de e : 0,050

Tabla 8. Dickey Fuller para $\ln L_t$

Contraste aumentado de Dickey-Fuller para l_L
incluyendo un retardo de $(1-L)l_L$
(el máximo fue 6, el criterio AIC)
tamaño muestral 18
hipótesis nula de raíz unitaria: $a = 1$

con constante y tendencia
modelo: $(1-L)y = b_0 + b_1*t + (a-1)*y(-1) + \dots + e$
valor estimado de $(a - 1)$: -0,114771
Estadístico de contraste: $\tau_{ct}(1) = -1,47396$
valor p asintótico 0,8386
Coef. de autocorrelación de primer orden de e: -0,070

Tabla 9. Dickey Fuller para $\Delta \ln L_t$

Contraste aumentado de Dickey-Fuller para d_l_L
incluyendo 0 retardos de $(1-L)d_l_L$
(el máximo fue 6, el criterio AIC)
tamaño muestral 18
hipótesis nula de raíz unitaria: $a = 1$

sin constante
modelo: $(1-L)y = (a-1)*y(-1) + e$
valor estimado de $(a - 1)$: -0,22022
Estadístico de contraste: $\tau_{nc}(1) = -1,45929$
Valor p 0,1306
Coef. de autocorrelación de primer orden de e: 0,020

Tabla 10. Dickey Fuller para $\Delta^2 \text{LnL}_t$

Contraste aumentado de Dickey-Fuller para $d_d_l_L$
incluyendo 0 retardos de $(1-L)d_d_l_L$
(el máximo fue 6, el criterio AIC)
tamaño muestral 17
hipótesis nula de raíz unitaria: $a = 1$

contraste sin constante
modelo: $(1-L)y = (a-1)*y(-1) + e$
valor estimado de $(a - 1)$: -1,08314
Estadístico de contraste: $\tau_{nc}(1) = -4,13882$
Valor p 0,0003616
Coef. de autocorrelación de primer orden de e: -0,038

Tabla 11. Dickey-Fuller residuos.

Contraste aumentado de Dickey-Fuller para residuos
incluyendo 7 retardos de $(1-L)$ residuos
(el máximo fue 7, el criterio AIC)
tamaño muestral 12
hipótesis nula de raíz unitaria: $a = 1$

contraste sin constante
modelo: $(1-L)y = (a-1)*y(-1) + \dots + e$
Coef. de autocorrelación de primer orden de e: -0,372
diferencias retardadas: $F(7, 4) = 1,870 [0,2846]$
valor estimado de $(a - 1)$: -2,59594
Estadístico de contraste: $\tau_{nc}(1) = -2,37478$
valor p asintótico 0,01698

Tabla 12. Contraste de normalidad de los residuos.

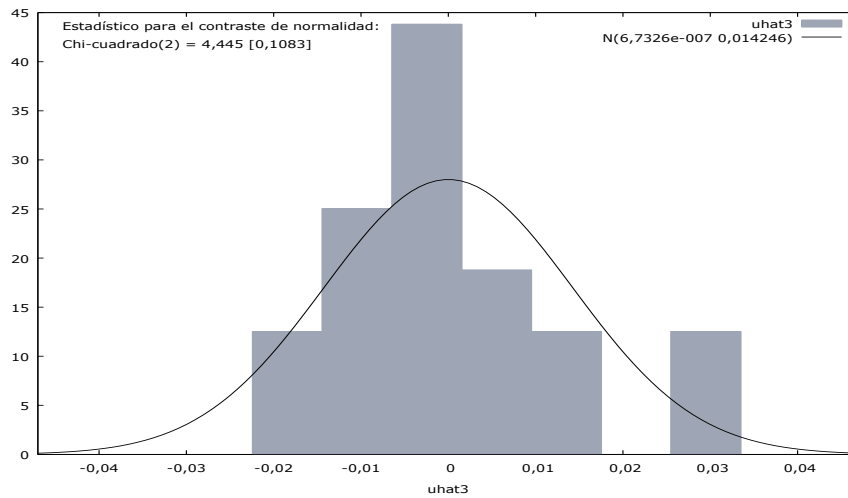


Tabla 13. Contraste de autocorrelación.

Contraste Breusch-Godfrey de autocorrelación de primer orden
MCO, usando las observaciones 1995-2014 (T = 20)
Variable dependiente: uhat

Valor p	Coefficiente	Desv. Típica	Estadístico t	
l_K	0,00268986	0,0222905	0,1207	0,9055
hpt_uhat1	-0,0174489	0,168138	-0,1038	0,9186
hpt_l_L	-0,00217996	0,0182470	-0,1195	0,9064
uhat_1	0,460905	0,226311	2,037	0,0586

*

R-cuadrado = 0,205866

Estadístico de contraste: LMF = 4,147742,
con valor p = $P(F(1,16) > 4,14774) = 0,0586$

Estadístico alternativo: $TR^2 = 4,117327$,
con valor p = $P(\text{Chi-cuadrado}(1) > 4,11733) = 0,0424$

Ljung-Box $Q' = 4,62017$,
con valor p = $P(\text{Chi-cuadrado}(1) > 4,62017) = 0,0316$

Tabla 14. Contraste RESET. Forma funcional.

Regresión auxiliar para el contraste de especificación RESET
MCO, usando las observaciones 1995-2014 (T = 20)
Variable dependiente: l_PIBc

	Coeficiente	Desv. Típica	Estadístico t	Valor p	
l_K	4,20406	2,15154	1,954	0,0696	*
hpt_uhat1	21,4345	11,5397	1,857	0,0830	*
hpt_l_L	2,25577	0,662575	3,405	0,0039	***
yhat^2	-1,85826	0,780397	-2,381	0,0309	**
yhat^3	0,119236	0,0457143	2,608	0,0198	**

Estadístico de contraste: F = 3,999727,
con valor p = P(F(2,15) > 3,99973) = 0,0405

Tabla 16. Contraste Dickey Fuller para LnL Filtrada.

Contraste aumentado de Dickey-Fuller para hpt_l_L
incluyendo 7 retardos de (1-L)hpt_l_L
(el máximo fue 7, el criterio AIC)
tamaño muestral 12
hipótesis nula de raíz unitaria: a = 1

con constante y tendencia
modelo: $(1-L)y = b_0 + b_1*t + (a-1)*y(-1) + \dots + e$
valor estimado de (a - 1): 0.00352648
Estadístico de contraste: tau_ct(1) = 0.0156063
valor p asintótico 0.9965
Coef. de autocorrelación de primer orden de e: -0.637
diferencias retardadas: F(7, 2) = 1072.274 [0.0009]