

k = 32: AIC = -28506,8
 k = 31: AIC = -28507,4
 k = 30: AIC = -28506,2
 k = 29: AIC = -28508,0
 k = 28: AIC = -28508,9
 k = 27: AIC = -28510,9
 k = 26: AIC = -28509,1
 k = 25: AIC = -28510,5
 k = 24: AIC = -28511,3
 k = 23: AIC = -28512,5
 k = 22: AIC = -28510,8
 k = 21: AIC = -28512,8
 k = 20: AIC = -28513,7
 k = 19: AIC = -28514,4
 k = 18: AIC = -28516,3
 k = 17: AIC = -28514,8
 k = 16: AIC = -28516,6
 k = 15: AIC = -28518,4
 k = 14: AIC = -28520,3
 k = 13: AIC = -28522,2
 k = 12: AIC = -28523,5
 k = 11: AIC = -28515,4
 k = 10: AIC = -28517,3
 k = 9: AIC = -28515,2
 k = 8: AIC = -28517,2
 k = 7: AIC = -28510,4
 k = 6: AIC = -28512,4
 k = 5: AIC = -28513,5
 k = 4: AIC = -28504,3
 k = 3: AIC = -28504,8
 k = 2: AIC = -28506,0
 k = 1: AIC = -28507,6
 k = 0: AIC = -28503,3

Rozszerzony test Dickeya-Fullera dla procesu lc3
 testowano istotność opóźnienia od rzędu 32, dla kryterium AIC
 liczebność próby 5202
 Hipoteza zerowa: występuje pierwiastek jednostkowy $\alpha = 1$; proces I(1)

test z wyrazem wolnym (const)
 dla opóźnienia rzędu 12 procesu (1-L)lc3
 model: $(1-L)y = b_0 + (a-1)*y(-1) + \dots + e$
 estymowana wartość (a-1) wynosi: -0,000398216
 Statystyka testu: $\tau_c(1) = -1,20567$
 asymptotyczna wartość p = 0,6744
 Autokorelacja reszt rzędu pierwszego: -0,000
 opóźnione różnice: $F(12, 5188) = 3,730$ [0,0000]

Równanie regresji rozszerzonego testu Dickeya-Fullera
 Estymacja KMNK, wykorzystane obserwacje 1998-01-22:2017-12-29 (N = 5202)
 Zmienna zależna (Y): d_lc3

	współczynnik	błąd standardowy	t-Studenta	wartość p	
const	0,00355357	0,00275198	1,291	0,1967	
lc3_1	-0,000398216	0,000330284	-1,206	0,6744	
d_lc3_1	-0,0356802	0,0138683	-2,573	0,0101	**
d_lc3_2	-0,0101633	0,0138774	-0,7324	0,4640	
d_lc3_3	-0,0132230	0,0138727	-0,9532	0,3406	
d_lc3_4	0,0160277	0,0138687	1,156	0,2479	
d_lc3_5	0,0451401	0,0138581	3,257	0,0011	***
d_lc3_6	-0,0123507	0,0138698	-0,8905	0,3733	
d_lc3_7	-0,00145544	0,0138694	-0,1049	0,9164	
d_lc3_8	0,0417447	0,0138562	3,013	0,0026	***
d_lc3_9	0,00404693	0,0138654	0,2919	0,7704	
d_lc3_10	0,0286125	0,0138652	2,064	0,0391	**
d_lc3_11	0,00430004	0,0138702	0,3100	0,7566	
d_lc3_12	0,0440859	0,0138568	3,182	0,0015	***

AIC: -28645,5 BIC: -28553,7 HQC: -28613,4

k = 32: AIC = -28506,0
 k = 31: AIC = -28506,6
 k = 30: AIC = -28505,3
 k = 29: AIC = -28507,0
 k = 28: AIC = -28507,9
 k = 27: AIC = -28509,9
 k = 26: AIC = -28508,0
 k = 25: AIC = -28509,4
 k = 24: AIC = -28510,2
 k = 23: AIC = -28511,4
 k = 22: AIC = -28509,8
 k = 21: AIC = -28511,8
 k = 20: AIC = -28512,8
 k = 19: AIC = -28513,4
 k = 18: AIC = -28515,3
 k = 17: AIC = -28513,7
 k = 16: AIC = -28515,5
 k = 15: AIC = -28517,3
 k = 14: AIC = -28519,2
 k = 13: AIC = -28521,2
 k = 12: AIC = -28522,4
 k = 11: AIC = -28514,1
 k = 10: AIC = -28516,1
 k = 9: AIC = -28513,9
 k = 8: AIC = -28515,9
 k = 7: AIC = -28508,9
 k = 6: AIC = -28510,9
 k = 5: AIC = -28512,1
 k = 4: AIC = -28502,8
 k = 3: AIC = -28503,3
 k = 2: AIC = -28504,5
 k = 1: AIC = -28506,1
 k = 0: AIC = -28501,8

z wyrazem wolnym i trendem liniowym

dla opóźnienia rzędu 12 procesu (1-L)lc3
 model: $(1-L)y = b_0 + b_1t + (a-1)y(-1) + \dots + e$
 estymowana wartość (a-1) wynosi: -0,000850538
 Statystyka testu: tau_ct(1) = -1,52194
 asymptotyczna wartość p = 0,8224
 Autokorelacja reszt rzędu pierwszego: -0,000
 opóźnione różnice: $F(12, 5187) = 3,759$ [0,0000]

Równanie regresji rozszerzonego testu Dickeya-Fullera
 Estymacja KMNK, wykorzystane obserwacje 1998-01-22:2017-12-29 (N = 5202)
 Zmienna zależna (Y): d_lc3

	współczynnik	błąd standardowy	t-Studenta	wartość p	
const	0,00667929	0,00415670	1,607	0,1081	
lc3_1	-0,000850538	0,000558852	-1,522	0,8224	
d_lc3_1	-0,0354076	0,0138709	-2,553	0,0107	**
d_lc3_2	-0,00989415	0,0138800	-0,7128	0,4760	
d_lc3_3	-0,0129441	0,0138755	-0,9329	0,3509	
d_lc3_4	0,0163114	0,0138716	1,176	0,2397	
d_lc3_5	0,0454379	0,0138612	3,278	0,0011	***
d_lc3_6	-0,0120386	0,0138733	-0,8678	0,3856	
d_lc3_7	-0,00114638	0,0138729	-0,08263	0,9341	
d_lc3_8	0,0420706	0,0138600	3,035	0,0024	***
d_lc3_9	0,00438387	0,0138694	0,3161	0,7520	
d_lc3_10	0,0289516	0,0138693	2,087	0,0369	**
d_lc3_11	0,00464198	0,0138743	0,3346	0,7380	
d_lc3_12	0,0444123	0,0138606	3,204	0,0014	***
time	2,41412e-07	2,40604e-07	1,003	0,3157	

AIC: -28644,6 BIC: -28546,2 HQC: -28610,1