

Quadro 2

Saída para teste de causalidade de Granger

<i>Pairwise Granger Causality Tests</i>				
Sample: 2009Q1 2015Q4				
Lags: 3				
<i>Null Hypothesis:</i>	Obs	F-Statistic	Prob.	Direção da causalidade
<i>BENSCAP does not Granger Cause M2</i> <i>M2 does not Granger Cause BENSCAP</i>	25	111,774 350,295	0.0002*** 0.0368**	Moeda ↔ Indústria
<i>DURAVEIS does not Granger Cause M2</i> <i>M2 does not Granger Cause DURAVEIS</i>	25	689,031 203,724	0.0028*** 0.1447	Indústria → Moeda
<i>EXTRATIVA does not Granger Cause M2</i> <i>M2 does not Granger Cause EXTRATIVA</i>	25	234,492 0.54252	0.1071* 0.6594	Indústria ⇄ Moeda
<i>IBC does not Granger Cause M2</i> <i>M2 does not Granger Cause IBC</i>	25	146,650 391,395	4.E-05*** 0.0259**	Moeda ↔ Produto
<i>IND_GERAL does not Granger Cause M2</i> <i>M2 does not Granger Cause IND_GERAL</i>	25	762,549 703,688	0.0017*** 0.0025***	Moeda ↔ Indústria
<i>INTERMED does not Granger Cause M2</i> <i>M2 does not Granger Cause INTERMED</i>	25	750,293 894,388	0.0018*** 0.0008***	Moeda ↔ Indústria
<i>SEMI does not Granger Cause M2</i> <i>M2 does not Granger Cause SEMI</i>	25	403,994 0.25814	0.0233** 0.8545*	Moeda ↔ Indústria
<i>TRANSF_ does not Granger Cause M2</i> <i>M2 does not Granger Cause TRANSF_</i>	25	864,128 820,060	0.0009*** 0.0012***	Moeda ↔ Indústria
<i>UTILIZACAO does not Granger Cause M2</i> <i>M2 does not Granger Cause UTILIZACAO</i>	25	388,086 317,835	0.0266** 0.0492**	Moeda ↔ Utilização

Fonte: Resultados da pesquisa. (2024)

Legenda: Referente ao período 2009t1 a 2015t4. (*), (**) e (***) denotam significância de 10%, 5% e 1%, respectivamente.