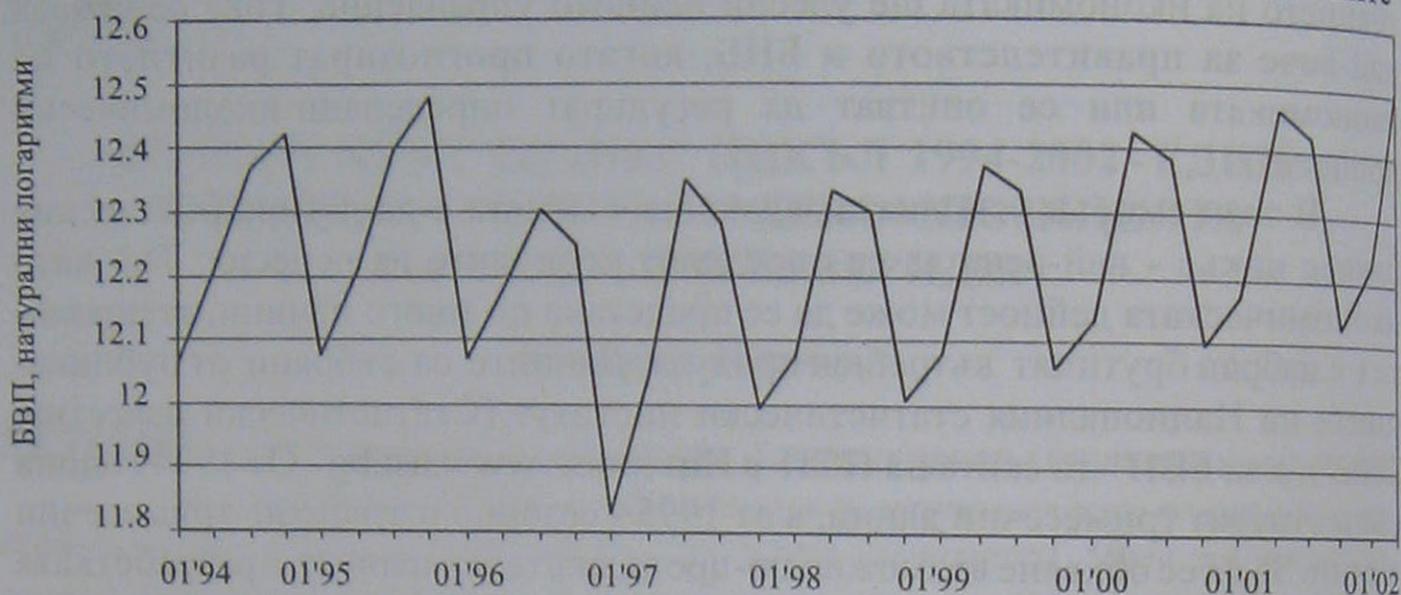
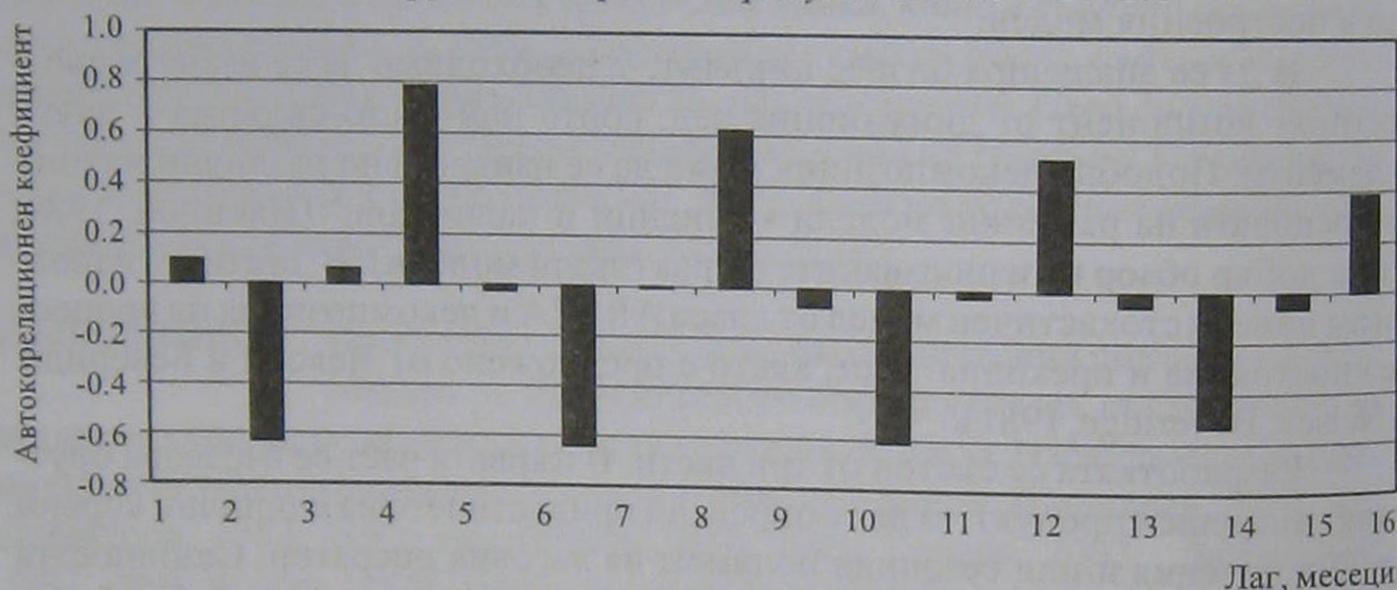


ПРОВЕРКА ЗА НАЛИЧИЕ НА ЕДИНИЧНИ КОРЕНИ

Първата задача е да се определи видът на тенденцията в динамичния ред. Декомпозицията на Нелсън и Беверидж изисква в данните



Фиг. 1. Брутен вътрешен продукт 1994:1 - 2002:3



Фиг. 2. Автокорелационни коефициенти за реда на БВП

да присъства единичен корен със или без детерминистичен тренд. Визуалното изследване на поведението на динамичния ред² (фиг. 1) разкрива силно присъствие на сезонен компонент. В същото време втората част на динамичния ред показва определено движение към нарастване на показателя. Следователно може да се предполага присъствие на детерминистичен тренд, както и на сезонен компонент около него.

Автокорелационните коефициенти (фиг. 2) имат най-висока стойност при лаг 4 (0.7822), която показва бавно линейно намаление в следващите

² Използвани са натурални логаритми на динамичния ред на брутния вътрешен продукт по съпоставими цени от 1995 година.