

Фиг. 6А показва, че едно стандартно отклонение, шок в собственото развитие на БВП, води до слаба промяна в обема на БВП в рамките на 4 месеца, след което динамиката се нормализира. Абсолютно същото е и поведението на БВП в резултат на един стандартен шок на СИИ, но амплитудата е по-слаба.

Фиг. 6В показва идентична реакция на СИИ на един стандартен шок на БВП и СИИ. Два месеца след шока динамиката се нормализира.

Фиг. 6С показва разлагането на дисперсията на БВП. През първите 5 месеца вариацията на БВП, обяснена с вътрешни причини, варира от 100 до 70%. Съответно вариацията, дължаща се на външни причини, (СИИ) се движи от 0 до 30%. След 5-месечен лаг съотношението 70:30% остава постоянно.

Фиг. 6D показва разлагането на дисперсията на СИИ. За първите 5 месеца лаг вариацията на СИИ, обяснена с вътрешни причини, намалява от 58 до 50%, като съответно за същата дължина на лага влиянието на БВП върху вариацията на СИИ се движи от 42 до 50%. От лаг 6 и повече месеца по-голямата част от вариацията на СИИ се дължи на външни причини (БВП), като се движи от 50 до 58%.

Зависимост на Грейнджър (Granger Causality test - англ. термин)

1. БВП е причина на Грейнджър за СИИ ($F = 22.68, p < 0.001, \text{лаг} = 2$).
2. СИИ е причина на Грейнджър за БВП ($F = 60.57, p < 0.001, \text{лаг} = 2$).

Заклучение: Двата временни реда са взаимно зависими и всеки един ред може да бъде използван за прогнозиране или оценка на другия.