



е известно, че с увеличаване на порядъка коефициентите на автокорелация имат свойството да намаляват при стационарен процес, за оценка на спектъра се използва само част от тях. Грейнджър и Хатанака (Гренджер, Хатанака, 1972, с. 69) дават като общо правило броят на коефициентите да е една трета от дължината на реда при дълги редове и по-малък от една шеста до една пета от дължината на динамичния ред при къси редове.

- При оценка на дисперсията в модел, при който се наблюдава автокорелация в остатъчните елементи, Нью и Уест (Newey, West, 1987) съветват да се експериментира, като се възприеме, че остатъците следват модел на плъзгащи се средни от определен порядък. Като ориентир се използват тези частни автокорелационни коефициенти, които са статистически значими.

- При проверка за стохастичен тренд в подобрените тестове на Дики и Фулър се изчиства автокорелацията в остатъците, като се прибавят елементи на авторегресия. Броят на тези елементи се определя по правилото на Шверт (Schwert, 1989):

$$l_4 = 4 \frac{1}{100^4} N^{\frac{1}{4}} \quad \text{или}$$

$$l_{12} = 12 \frac{1}{100^4} N^{\frac{1}{4}} \quad \text{- за месечни данни.}$$

- При определяне на порядъка на моделите на авторегресия Бокс и Дженкинс съветват да се използват  $k$  на брой автокорелационни коефициенти, като:

$$k \leq \frac{N}{4}.$$

При това трябва да се осигурят минимум 50 наблюдения за оценяване на всеки автокорелационен коефициент (Box, Jenkins, Reinsel, 1994, p. 32).

Всичко това дава основание да предложим при оценка на коефициента на автодетерминация да се използват повече автокорелационни коефициенти. В същото време броят им не бива да е твърде висок, тъй като това означава оценките им да стават все по-неточни, което води и до по-големи грешки при оценяването на автодетерминацията. Правилото на Бокс и Дженкинс изглежда най-подходящо - да се използват най-малко толкова коефициенти, колкото е една четвърт от дължината на реда, и при възможност да се осигуряват поне 50 наблюдения за оценка на автокорелационните коефициенти:

$$p \leq \frac{N}{4} \quad \text{и}$$

$$p \leq N - 50.$$

При къси редове се налага да се използват повече коефициенти, въпреки че оценките им ще са с по-големи грешки.