

Резултатите от тестовете на НЕГУ и Дики и Фулър показват, че динамичният ред на брутния вътрешен продукт е интегриран от първи порядък, при липса на сезонна интегрираност. Включването на изкуствени сезонни променливи представя сезонния компонент добре, тъй като в остатъците на модела няма автокорелация при сезонните лагове. Допълнително се оказва, че през втората част на изследвания период вариацията на остатъците от регресионните уравнения намалява. Статистически значимата стойност на константите в уравнението подкрепя предположението за присъствие и на детерминистичен тренд.

ОЦЕНКА НА ARIMA МОДЕЛ НА ЦИКЛИЧНИЯ КОМПОНЕНТ

След като доказахме, че динамичният ред съдържа един единичен корен, може да се продължи с оценката на модел

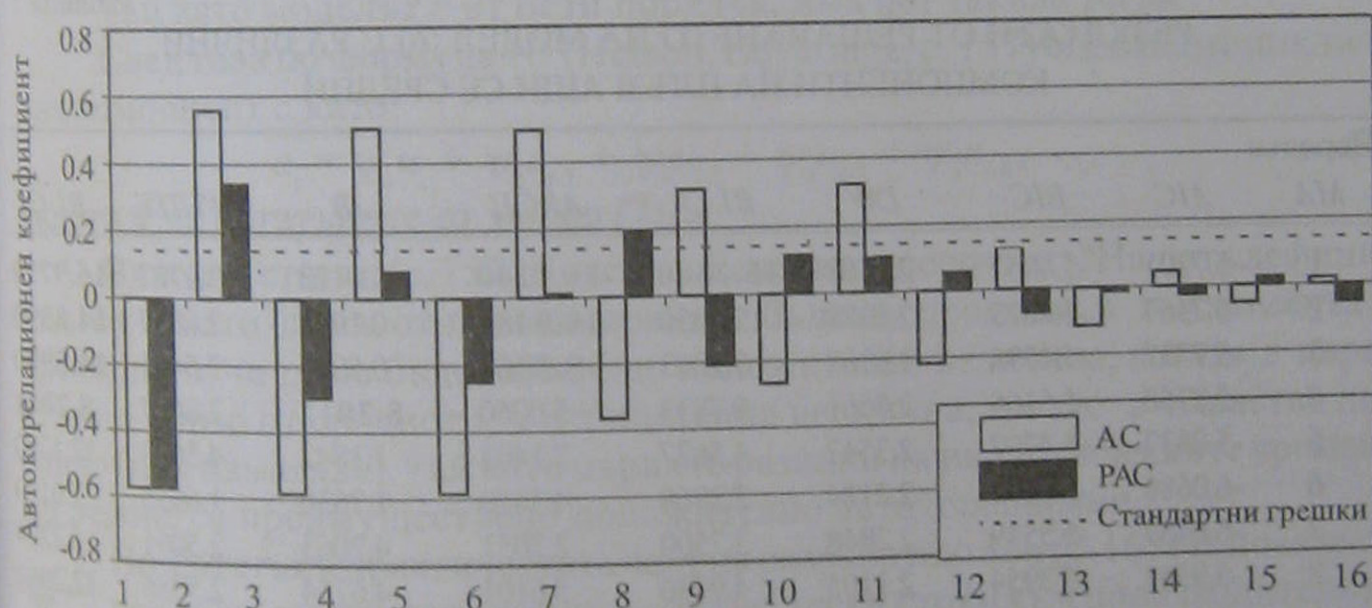
от типа ARIMA. За да се идентифицират възможните ARIMA представяния на реда, ще се изследват автокорелационните и частните автокорелационни коефициенти. Те са изчислени за остатъците u_t от модела:

$$\Delta y_t = a + b_2 D_2 + b_3 D_3 + b_4 D_4 + u_t \quad (5)$$

където:

D_i са изкуствените сезонни променливи;

a, b_i - параметри на модела.



Фиг. 4. Автокорелационни (АС) и частни автокорелационни коефициенти (РАС) на остатъците от модел (5)

Както може да се проследи на фиг. 4, автокорелационните коефициенти намаляват по абсолютна стойност (и са статистически значими до лаг 10), като в същото време частните показват по-проста структура и имат високи