

кациите на БНБ. Графичният образ показва вълново движение, като за втората част от реда величината определено има по-високи стойности. В същото време автокорелационните коефициенти показват висока стойност (близка до единицата) на първия лаг и бавно намаление при нарастването на лага. Стационарните авторегресионни процеси от първи порядък показват експоненциално намаление, а не линейно, както е в случая. Наблюдаваната картина е по-типична за процесите, съдържащи някаква форма на нестационарност от типа на "единичен корен" или "случаен ход". Анализът на автокорелационните коефициенти на първите разлики, от своя страна, дава основание да се заключи, че те са стационарни, тъй като е налице затихваща синусоидална функция.

В подкрепа на подобно заключение говорят и резултатите от формалните тестове за единичен корен на Дики и Фулър (1979, с. 427-431). Моделът за равнището на показателя има вида (в скобите са посочени стандартните грешки на параметрите и наблюдаваното равнище на значимост за тестовите характеристики):

$$\begin{aligned} \Delta y_t = & 0.4133 + 0.0013t - 0.0363 y_{t-1} + 0.6327 \Delta y_{t-1} - \\ & (0.1693) (0.0009) (0.0141) (0.0666) \\ & - 0.1344 \Delta y_{t-7} + 0.1389 \Delta y_{t-9} + 0.56556 \Delta y_{t-12} - 0.4022 \Delta y_{t-13} \cdot \quad (8) \\ & (0.0670) (0.0655) (0.0756) (0.0836) \end{aligned}$$

$$JB = 0.688 (0.709);$$

$$Q = 10.495 (0.573);$$

$$Q^* = 7.708 (0.808);$$

$$ARCH = 6.440 (0.892),$$

където:

y_t е равнището на безработица;

JB - тестът на Жак-Бера за нормалност на остатъците (χ^2 с две степени на свобода);

Q - тестът на Бокс-Люнг за наличие на автокорелация в остатъците (χ^2 с 12 степени на свобода);

Q^* - тестът на Бокс-Люнг за наличие на автокорелация в квадратите на остатъците (χ^2 с 12 степени на свобода);

$ARCH$ - тестът на Енгъл за наличие на условна хетероскедастичност (χ^2 с 12 степени на свобода).

Диагностичната проверка дава основание да се приеме моделът за адекватен, тъй като остатъците са нормално разпределени, не съдържат