

Вижда се, че в началото, след включването на нови автокорелационни коефициенти, величината на коефициента на автодетерминация рязко нараства. След това обаче нарастването става все по-слабо, с тенденция да се стабилизира около 0.32. Близка до тази стойност се получава още при 13-ия автокорелационен коефициент (една четвърт от 52). Тя е 0.293 срещу 0.316 при включването на всичките 36 коефициента. Разликата е едва 0.023. При спазването на правилото на Бокс и Дженкинс се получава сравнително добра апроксимация.

Величината от 0.316 показва, че в стационарната част на реда на brutния вътрешен продукт съществуват определени закономерности, но те не са определящи, тъй като обясняват по-малко от 50% от вариацията му. Дисперсията на динамичния ред е:

$$\sigma_y^2 = 0.0046,$$

а дисперсията на първите разлики:

$$\sigma_{\Delta y}^2 = 0.0023.$$

Оттук коефициентът на автодетерминация за нестационарния ред на brutния вътрешен продукт се получава:

$$\begin{aligned} AUD &= 1 - \frac{\sigma_{\Delta y}^2}{\sigma_y^2} [1 - R_d' \cdot R R_d^{-1} \cdot R_d] = \\ &= 1 - \frac{0.0046}{0.0023} (1 - 0.316) = 0.665. \end{aligned}$$

След включването на тенденцията

делът на закономерностите нараства, за да достигне до две трети от вариацията. Това дава основание за извода, че brutният вътрешен продукт може да се прогнозира, но точността на прогнозиите ще бъде ниска. Съществуват силни колебания, които не са породени от закономерности, а от случайности, което ще влоши точността на прогнозиите.

Динамичният ред на индексите на потребителските цени може да се проследи на фиг. 3. Наличието на тенденция в него е добре изразено и за нейното елиминирание се използват логаритмите на верижните индекси. Дължината на реда е 150 наблюдения, което позволява да се изчислят първите 100 автокорелационни коефициента. Стойностите на коефициента на автодетерминация за трансформирания стационарен ред могат да се проследят на фиг. 4.

Коефициентите нарастват непрекъснато, но се стабилизират след включването на 90 автокорелационни коефициента. Ако се използват само първите 37 коефициента, величината на коефициента на автодетерминация би била 0.295. В същото време след включването на всичките 100 коефициента стойността му се стабилизира на 0.397. Разликата от 0.100 е сериозна. В случая е необходимо да се използва максималният брой коефициенти, за които може да се направи оценка.