

б) при постоянно изменение на точността (ефективността) на една от индивидуалните прогнози, теглата трябва бързо да се приспособяват към новите ѝ стойности;

в) стойностите на теглата трябва незначително да се колебаят около оптималната стойност.

Изискването в) допълва изискването а), което само не е достатъчно да се използва като критерий при оценка на начина за получаване на теглата в комбинираните прогнози.

ВАРИАНТИ ЗА ТЕГЛА НА ИНДИВИДУАЛНИТЕ ПРОГНОЗИ

Както вече бе отбелязано, съществуват различни начини за определяне теглата на

индивидуалните прогнози при съставяне на комбинирани прогнози.

Вариант 1:

$$k_T = \frac{\sum_{t=T-\nu}^{T-1} (\epsilon_{2,t})^2}{\sum_{t=T-\nu}^{T-1} (\epsilon_{1,t})^2 + \sum_{t=T-\nu}^{T-1} (\epsilon_{2,t})^2}, \quad (6)$$

където: $\epsilon_{1,t}$ е грешката на първата индивидуална прогноза в момента t ;

$\epsilon_{2,t}$ — грешката на втората индивидуална прогноза в момента t .

В този вариант за определяне на теглата се отчитат последните ν на брой грешки $\epsilon_{1,t}$ и $\epsilon_{2,t}$ на индивидуалните прогнози, а стойностите на теглата се изменят с течение на времето t . Изменяйки стойността на ν (увеличавайки или намалявайки я), може да се влияе на получените тегла, а оттам и на точността на съставените комбинирани прогнози¹. Този вариант за определяне на теглата е

¹ В представения първи вариант за определяне теглата на индивидуалните прогнози с помощта на формула (6) може да се работи не с дисперсиите на грешките на прогнозите, а с техните абсолютни стойности. В този случай формула (6) придобива следния вид:

$$k_T = \frac{\sum_{t=T-\nu}^{T-1} |\epsilon_{1,t}|}{\sum_{t=T-\nu}^{T-1} |\epsilon_{1,t}| + \sum_{t=T-\nu}^{T-1} |\epsilon_{2,t}|}, \quad (6a)$$

като се отчитат предимствата и недостатъците при работа с абсолютните стойности на грешките на индивидуалните прогнози.