

делите ARIMA; по метода на Браун и метода на Холт; по метода на Холт, моделите ARIMA и стъпковата авторегресия¹. В същото време съществува дискусия в литературата, доколкото такива модели, като моделите на Браун, Холт, Уинтерс и стъпковата авторегресия представляват частен случай на моделите ARIMA, дали тяхното обединение в някакъв комбиниран модел довежда до частен случай на някакъв хипотетичен ARIMA-модел. И не е ли по-просто в такъв случай да се откажем от комбинирането на индивидуални прогнози, а да построим точно този ARIMA-модел, усъвършенствайки методиката на идентификацията на тези модели. Някои автори не оспорват и такъв подход, но обръщат внимание на обстоятелството, че не винаги се получават задоволителни резултати при построяване на ARIMA-моделите по метода на Бокс и Дженкинс. Не винаги може да се гарантира адекватност на тези модели, особено при използване на къси динамични редове, а също така и при използване на модели с по-големи стойности за параметри p , d и q .

Освен това трябва да се има предвид, че такъв статистически детерминиран генератор, като моделът ARIMA, едва ли би могъл да генерира с такава сложност динамичния ред, каквато е съответната реална икономическа система. Когато се казва, че моделите на Браун, Холт и стъпковата авторегресия представляват частен случай на ARIMA-моделите, то съвсем не следва, че това трябва да бъде един и същи ARIMA-модел. Могат да бъдат различни ARIMA-модели. Практиката показва, че при построяване на ARIMA-модели в някои случаи могат да се получат няколко модела, близки по своите свойства. Едва ли усъвършенстването на методиката на идентификацията на тези модели може съществено да промени това положение, доколкото то се прави по пътя на подобряване на статистическите критерии. Тези разсъждения отново потвърждават обстоятелството, че нито един модел (колкото и съвършен да е той), отразяващ абстрактно действителността, не може напълно и изцяло да отрази тази реалност. Това означава, че какъвто и модел да построим, който е адекватен по определени статистически критерии, винаги може да се построи и друг, който също да е адекватен по съответните статистически критерии и едновременно с това да отразява същата реалност по друг начин, от друга страна, от друг ъгъл.

Всички тези разсъждения водят до извода, че е полезно да се комбинират индивидуални прогнози, получени както с помощта на различни модели, така и с помощта на различни варианти и модификации на един и същи модел. Проблемите в случая са свързани с

¹ За теоретико-методологическите постановки и практико-приложните проблеми при използването на изброените модели вж. (1, 3, 4, 6, 7, 9).