

Теоретични проблеми при използване на претеглена сума от индивидуални прогнози като начин за комбиниране на прогнози

Прогнозирането на икономическите процеси се осъществява обикновено на основата на динамични редове за съответните статистически показатели, отразяващи в количествен вид икономическата динамика. Съставянето на различни видове прогнози (и особено на краткосрочни и средносрочни) за редица основни статистически показатели е важен и актуален проблем, свързан със съвременното и бъдещото развитие на икономиката у нас.



Както е известно, в теорията на динамичните редове е приет определен подход към структурата на икономическата динамика, изразена във вид на динамични редове. Предполага се, че тази динамика (съответният динамичен ред) в общия случай се състои от няколко компонента и динамичният ред се представя във вид на сума (произведение) от тези компоненти. Това означава, че ние фактически постулираме определен модел на икономическата динамика и трябва да сме готови да се откажем от нашата хипотеза за вида на този модел всеки път, когато той не съответства (по определен критерий) на данните от динамичния ред. При това трябва да се има предвид, че в литературата са разработени различни (понякога противоречащи си) критерии за съответствие на моделите, които не винаги се отнасят за всички модели, а са свързани и с използваните методи за оценка на коефициентите на отделните модели.

Често в литературата се среща хипотезата, че съществува един най-подходящ за даден динамичен ред математико-статистически модел и че задачата на изследователя се състои именно в това, да идентифицира и специфицира този модел. В същото време статистическата практика показва, че може да се получи цяла група модели (от един и същ или от различен вид) със сходни статистически свойства, в която да е трудно да се даде предпочитание на един или друг модел. Много често това се получава при използване на различни варианти на един и същ модел, а също така и при приложение на един и същ вариант на даден модел, като се имат предвид: различни стойности на адаптационните параметри; различни по дължина анализирани и (или) ретроспективен период; различни критерии