

Zkoumáme obecnou metodu kombinování několika odhadů stejného reálného parametru v parametrickém modelu. Uvažujeme vážený průměr daných počátečních odhadů, kde součet váh je roven jedné. Metoda je založena na minimalizaci střední kvadratické chyby. Váhový vektor se vypočte pomocí matice čtvercové chyby. Danou matici můžeme teoreticky spočítat nebo numericky odhadnout na základě počátečních odhadů. Výsledný kombinovaný odhad je pak konstruován jako součin příslušného váhového vektoru a vektoru počátečních odhadů parametru. Metoda je aplikovatelná ve většině situacích, kde máme k dispozici více odhadů jednoho parametru. Často je používána v predikcích například časových řad.