

RESUMO

A combinação de previsões é um procedimento que tenta melhorar a precisão das previsões, que aproveita a disponibilidade de vários métodos de previsão individual. Este trabalho tem como objetivo aplicar os conhecimentos aprendidos durante o curso e fazer um estudo sobre o desempenho de diferentes combinações de previsões. . Realizamos uma comparação entre métodos de previsão individuais e métodos de combinação, escolhendo para isso apenas uma medida de desempenho, o erro quadrático médio (MSE). As previsões individuais foram feitas pelo método de Amortecimento Exponencial de Holt, por modelos ARIMA e por modelos estruturais de tendência local. Realizamos seis tipos de combinação: média simples, mediana, média dos extremos, regressão, combinação ótima e combinação ótima com independência. Para verificar o melhor desempenho das combinações de previsões, ajustamos diversos métodos em dez séries reais, estacionárias e não-sazonais.

Palavras-chave: Amortecimento Exponencial; Combinação de Previsões; Métodos de Previsão; Modelos ARIMA; Modelos Estruturais; Previsão; Séries Temporais.