

Combinação Linear de Previsões com Ajuste MINIMAX

Aluno: Luiz Albino Teixeira Júnior

Orientador: Prof. Reinaldo Castro Souza

RESUMO

Esta monografia propõe a combinação linear das previsões obtidas por três métodos preditivos de séries temporais (ARIMA, Amortecimento Exponencial e Redes Neurais Artificiais) com pesos adaptativos determinados por meio de um problema de programação multiobjetivo em que se busca minimizar, simultaneamente, as estatísticas: MAE, MAPE e MSE. Os resultados obtidos são comparados com os métodos individuais.

Palavras-chave: Previsão. Combinação de Previsões. Programação Multiobjetivo.