

PROPUESTA DE TRABAJO FIN DE MÁSTER (Modalidad A)
Curso 2020-2021
MÁSTER EN TÉCNICAS ESTADÍSTICAS

Título	Combinación de predicciones: Revisión y análisis
Director/es	José A. Vilar Fernández (UDC) y Rubén Fernández Casal (UDC)
Descripción del contenido	<p>Se propone una revisión de la literatura sobre la efectividad de combinar predicciones, enfatizando las condiciones bajo las cuales es particularmente recomendable y describiendo un amplio abanico de los principales métodos de combinación propuestos. Además de la combinación de predicciones individuales, se abordará el problema de combinar intervalos y densidades de predicción. La revisión se complementará con la implementación en R de algunos de los métodos lo que permitirá un análisis empírico de los mismos vía simulación y con el análisis de datos reales.</p> <p>Referencias:</p> <ul style="list-style-type: none">▪ Bates, J. M., Granger, C. W. J. (1969) The combination of forecasts. <i>Operational Research Quarterly</i>, 20, 451–468.▪ Gerda Claeskens, G., Magnus, J.R., Vasnev, A.L., Wang, W. (2016) The forecast combination puzzle: A simple theoretical explanation. <i>International Journal of Forecasting</i>, 32, 754–762.▪ Graefe, A., Armstrong, J. S., Jones Jr., R. J., Cuzán, A. G. (2014). Combining forecasts: An application to elections. <i>International Journal of Forecasting</i>, 30, 43–54.▪ Smith, J., Wallis, K. F. (2009). A simple explanation of the forecast combination puzzle. <i>Oxford Bulletin of Economics and Statistics</i>, 71, 331–355.▪ Winkler, R.L., Makridakis, S. (1983). The combination of forecasts. <i>J. R. Statist. Soc. A</i>, 146, Part 2, 150-157.
Recomendaciones	Haber cursado la materia optativa del MTE: Series de Tiempo.
Otras observaciones	