

5

Conclusões

Este estudo teve como objetivo encontrar metodologias robustas para previsões não condicionadas de séries de energia elétrica sujeitas a quebras estruturais de qualquer natureza. Sendo assim, procurou-se contribuir com o processo de planejamento do setor elétrico brasileiro.

Para este trabalho, utilizaram-se dados mensais, de janeiro de 2003 a dezembro de 2009, relativos à produção física industrial, pessoal ocupado na indústria e tarifa média industrial para prever o consumo industrial de energia elétrica do Brasil para os doze meses de 2010.

Propuseram-se duas metodologias de modelos multivariados de correção de erros: uma clássica (VAR/VEC) e a outra Bayesiana (BVAR/BVEC). Os dois modelos foram estimados com ordem $p=1$.

Com relação as previsões para os meses de 2010, estas se mostraram próximas aos valores efetivamente observados, o que indica que os modelos utilizados são adequados. Como se pretendia, foram encontrados modelos robustos as quebras estruturais decorrentes de choques externos.

Quando confrontadas, através do MAPE, as duas metodologias de MCEV, a metodologia Bayesiana se fez ligeiramente superior a Clássica.

Uma proposta para estudos futuros é a comparação das duas metodologias nas outras classes de consumo. Pode-se estudar também a utilização de outras *prior's* na literatura buscando obter melhores resultados.