

Palavras-cDensity forecasting time series

Autores	Ano	Nome do a	Categorias	Resumo	Comentário	Pontos em comum com o nosso
Carlier, Ch	2016	Vector Qu	Quantile R	Definição da RQ Con	Estimação de regressão quantilic	
Castillo, Be	2016	On-line qu	Wind Pow	Utilização do Reprodu	Penalização na função objetivo. 7	
Swift e Jan	1991	Forecasting Non-Normal Time Series				
Takeuchi e	2016	Nonparam	Nonparam	Define e motiva a RQ	Motivação da restrição de non-cr	
Haque et al	2014	A Hybrid Ir	Wind Pow	Utiliza algoritmos com	Utilização de RQ para determinai	
Wan et al.	2016	Direct Qua	Wind Pow	Utilização de Redes N	Utilização de RQ para determinai	
Bacher et al	2009	Online short-term sol		Método simples para p	Ideia dos modelos horários	
Moller et al	2007	Time-adaptive quantile regression				
Machado e	2005	Counterfac	Quantile Regression			
Bertsimas	2014	Least Qua	Quantile Regression, MILP			

regressão conjunta, em que há mais variáveis explicativas.  
Tratamento de series de vento

crossing e estimação conjunta de todos os quantis. Utilização de uma função livre com penalização. N  
r a distribuição dos erros  
r a distribuição dos erros

Jo entanto, nós não utilizamos funções kernel

<b>Autores</b>	<b>Ano</b>	<b>Nome do artigo</b>	<b>QR</b>	<b>Empirical Distribution</b>
Bacher et al	2009	Online short-term solar power forecasting		
Bertsimas e Mazumder	2014	Least Quantile Regression via Modern Optimization	1	
Bertsimas et al	2015	Best Subset Selection via a Modern Optimization Lens		
Bosch et al	1995	A convergent algorithm for quantile regression with smoothing splines	1	1
Cai	2002	Regression Quantiles for time series	1	1
Carlier, Chernozhukov, Galichon	2016	Vector Quantile Regression: an optimal transport approach	1	
Castillo, Bessa et al	2016	On-line quantile regression in the RKHS (Reproducing Kernel Hilbert Space) for operational probabilistic forecasting of wind power	1	
Ciuperca	2013	Adaptive LASSO model selection in a multiphase quantile regression	1	
Gaglianone e Lima	2012	Constructing Density Forecasts from Quantile Regressions	1	1
Gaglianone et al	2009	Evaluating Value-at-Risk models via Quantile Regression	1	
Haque et al	2014	A Hybrid Intelligent Model for Deterministic and Quantile Regression Approach for Probabilistic Wind Power Forecasting	1	
Machado e Mata	2005	Counterfactual decomposition of changes in wage distributions using quantile regression		
Moller et al	2007	Time-adaptive quantile regression	1	

Swift e Janacek	1991	Forecasting Non-Normal Time Series		
Takeuchi e Le	2016	Nonparametric Quantile Estimation	1	1
Wan et al.	2016	Direct Quantile Regression for Nonparametric Probabilistic Forecasting of Wind Power Generation	1	

Distribution-based TS	Model identification	Energy application	MILP
			1
			1
		1	1
1			
			1
		1	
1			
			1
1			

---

1

---

---

1

---

1

---



Resumo	Pontos em comum com o nosso
Método simples (ARX) para previsão de dados solares online. Propõe normalização dos dados horários.	Ideia dos modelos horários na estimação das séries solares
Resolve o problema de Least Quantile Regression através de otimização MILP	Resolução de um problema de regressão quantílica com uso de MILP
Propõe a utilização de MILP para encontrar o melhor subconjunto	Parte quantílica não-paramétrica. Nossa estimação é diferente
Encontra funções quantílicas não lineares com auxílio de splines cúbicos. A função objetivo é $\int_a^b [f'(x)]^2 dx$	
Propõe um modelo de TS em que a distribuição do erro $\varepsilon_t$ é estimado através de regressão quantílica. Utiliza como principal motivação problemas em que há heterogeneidade	
Definição da RQ Condicional Multivariada, em que há dependência entre as variáveis aleatórias que se calculam os quantis	Estimação de regressão quantílica conjunta, em que há mais variáveis explicativas.
Utilização do Reproducing Kernel Hilbert Space. Utiliza-se a norma RKHS para penalização da complexidade da funções quantílica. A função quantílica é um somatório de funções Kernel.	Penalização na função objetivo. Tratamento de series de vento
Adaptive ADALASSO para selecionar variáveis em regressão quantílica. Também introduz a possibilidade de mudança de modelo	Mesmo setup para seleção de variáveis. Utilização do Adalasso
Foco na estimação e avaliação de quantis específicos, para aplicações de VAR. Propõe novo teste de cobertura	
Utiliza algoritmos como Wavelet e SVM para fornecer previsões pontuais de vento, para em seguida utilizar RQ. A RQ é formada com B-Spline.	Utilização de RQ para determinar a distribuição dos erros

Define e motiva a RQ não-paramétrica. Utiliza o RKHS	Motivação da restrição de non-crossing e estimação conjunta de todos os quantis. Utilização de uma função livre com penalização. No entanto, nós não utilizamos funções kernel
Utilização de Redes Neurais com 2 layers e RQ para fazer previsões probabilísticas de vento	Utilização de RQ para determinar a distribuição dos erros