

A MEDIDA L COMO CRITÉRIO DE COMPARAÇÃO DE MODELOS: BREVE REVISÃO DA LITERATURA

Elayne Penha Veiga^{1,2}, Mário Javier Ferrua Vivanco^{1,2}

RESUMO

A Medida L é um critério que se utiliza de conceitos bayesianos e é construída a partir da distribuição preditiva a *posteriori* dos dados. Pode ser escrita como a soma de dois componentes: um envolve a média desta distribuição e outro envolve as variâncias: $L_m^2 = \sum_{i=1}^n [\{E(Z_i) - y_i\}^2 + var(z_i)]$. Mede o desempenho de um modelo pela combinação de quão próximas as predições estão dos dados observados e qual a variabilidade das predições. Tal medida é discutida usando os conceitos de Função Perda Quadrática e definida no contexto de modelos de regressão linear. Para o seu cálculo, a distribuição preditiva a *posteriori* deve ser calculada; e esta, por sua vez, depende das distribuições a *priori* e *posteriori*. Para modelos de regressão linear pode-se adotar dois tipos de *priori* a saber: a *priori* não informativa de Jeffrey's e a *priori* conjugada Normal-Gama. Ambas produzem densidades preditivas da distribuição t . Bons modelos terão pequenos valores para a medida L_m^2 .

Palavras-chave: *Medida L, Função Perda Quadrática, Seleção Preditiva de Modelos.*

¹DEX - Universidade Federal de Lavras, elayne_veiga@posgrad.ufla.br, ferrua@dex.ufla.br

²Agradecimento à FAPEMIG pelo apoio financeiro.