



*Análise e Previsão de Séries Temporais com Inteligência Artificial*

# Análise e Previsão de Séries Temporais com Inteligência Artificial

## Compreendendo o Conceito de Quantile Loss

O "quantile loss" é uma métrica de erro utilizada na avaliação de modelos de previsão para séries temporais, especialmente quando estamos interessados em quantificar a incerteza associada às previsões. Ele é frequentemente utilizado em modelos de regressão quantílica, que buscam prever diferentes quantis da distribuição condicional da variável de resposta, em vez de apenas sua média.

A perda quantílica é útil quando diferentes tipos de erros (subestimação ou superestimação) têm diferentes custos ou consequências. Isso pode ser crítico em áreas como finanças, onde subestimar riscos pode ter consequências muito mais graves do que superestimá-los.

Ao treinar modelos usando o "quantile loss", é possível gerar previsões para vários quantis, o que permite criar intervalos de confiança em torno das previsões. Por exemplo, pode-se prever os quantis 0.1 e 0.9 para obter um intervalo de confiança de 80% para as previsões futuras.