

Séries Temporais e Análises Preditivas

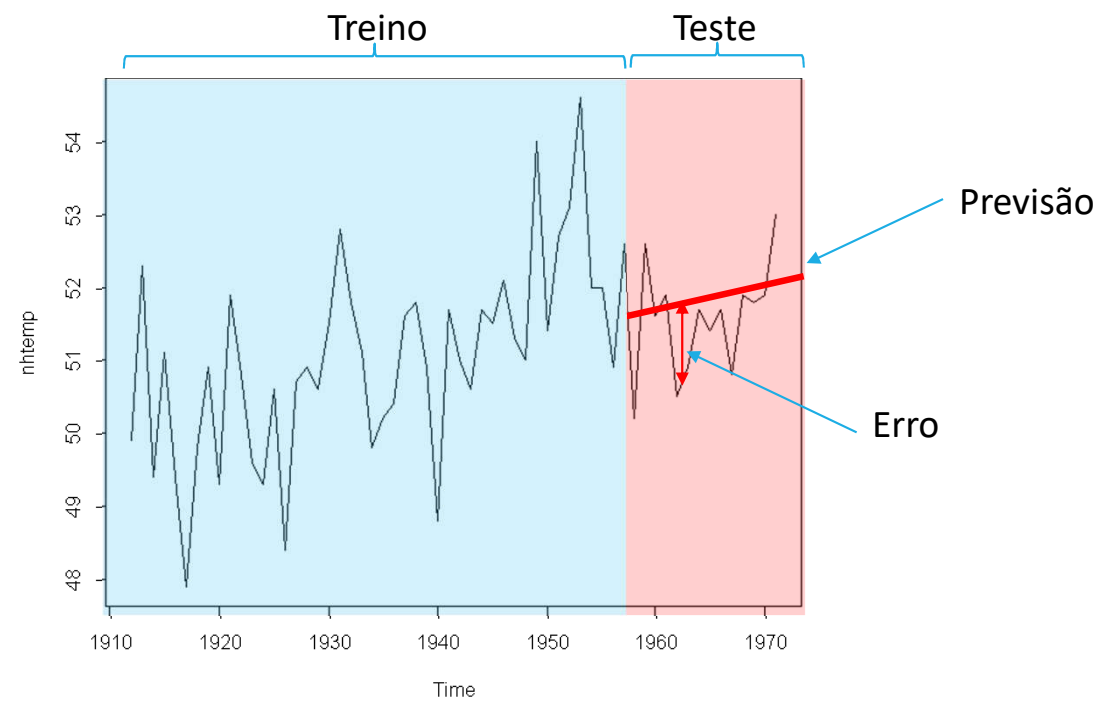
MÉTRICAS DE DESEMPENHO

Erros

- Diferença entre o previsto e o ocorrido
- Como se mede?
 - Separando dados para teste
 - Avaliando após a ocorrência do Evento



Hold-out



Cross Validation

- Semelhante ao método utilizado em machine learning:



Medindo o Erro

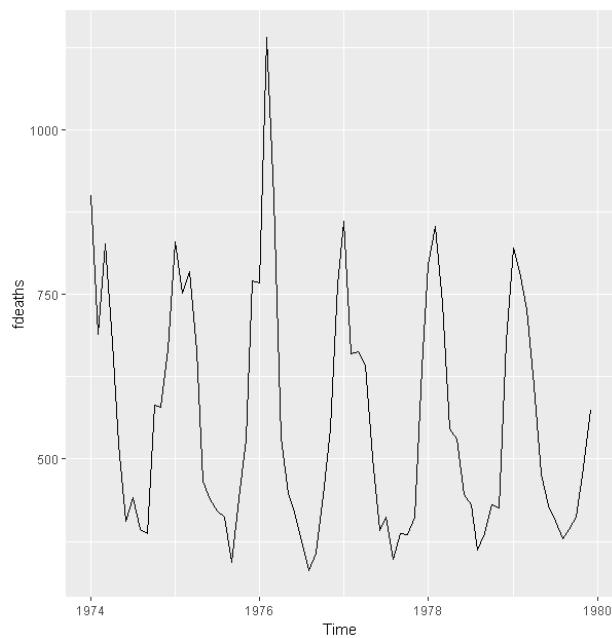
- Dependentes de Escala
 - MAE: mean absolute erro
 - RMSE: root mean squared error
- Independente da escala
 - MAPE: mean absolute percentage error (Percentuais)
- Erros com escalas
 - MASE: mean absolute scaled error

	ME	RMSE	MAE	MPE	MAPE	MASE	ACF1
Training set	31.77273	36.31574	32.0303	11.12439	11.24871	1	0.7464603



Exemplo: Hold out com fdeaths

Treino 1974 até 1977 Teste – 1978 até 1979



- Avaliação de Performance:

- Fazer previsão usando treino
- Avaliar performance da previsão com métodos simples com os dados de teste

