

SIMPLIFICAÇÃO DO MELHOR PREVISOR LINEAR NÃO VICIADO DE OBSERVAÇÕES FUTURAS NO MODELO DE REGRESSÃO LINEAR GERAL

Silvia N. Elian

Depto. de Estatística - IME - USP

No modelo de regressão linear geral, com matriz de variância e covariância não diagonal, de modo que os dados são correlacionados, o melhor preditor linear não viciado de um vetor de dados futuros tem uma expressão complexa, obtida por Goldberger (1962).

Neste trabalho, apresentaremos condições necessárias e suficientes para que o melhor preditor linear não viciado de observações futuras nesse modelo tenha uma forma mais simples.

Válidas essas condições, o preditor terá uma expressão similar à do caso de inexistência de correlação. Dessa maneira, além da simplificação na forma matemática do preditor, teríamos a vantagem de poder calculá-lo sem o conhecimento de parâmetros relacionados com a covariância entre algumas observações.

Referências

Goldberger, A.S. (1962), "Best Linear Unbiased Prediction in the Generalized Linear Regression Model", *Journal of the American Statistical Association*, 57, 369-375.

Elian, S.N. (2000), "Simple Forms of the Best Linear Unbiased Predictor in the General Linear Regression Model", *The American Statistician*, 54, 25-28.

selian@ime.usp.br