

CRITERE D'INFORMATION (G, H, I)

(21 / 05 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

(i) De façon générale, on appelle **critère d'information** une **statistique** composée de deux termes :

(a) le premier dépend de l'**information** ou de la **dispersion** apportée par un **modèle** donné ;

(b) le second a pour but de pénaliser la « **dimension** » du modèle (cf **critère de AKAIKE**, **critère de SCHWARTZ**).

(ii) Ainsi, dans le cas d'un modèle associé à un **processus autorégressif** vectoriel var (p) :

(a) le premier terme du critère contient le **déterminant** de la **matrice de covariance** estimée des **résidus** du modèle (qui décroît avec p) ;

(b) le second terme pénalise le nombre p de **retards**.

On choisit le nombre p qui minimise le critère d'information retenu (cf **ordre d'un processus**).