

CRITÈRE DE SCHWARTZ (G, H, I)

(11 / 06 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

Le critère de SCHWARTZ est un **critère** de **sélection de modèles** comparable au **critère de AKAIKE**.

Dans le même cadre que ce dernier, on suppose que les paramètres θ_i ($i \in I$) sont estimables (cf **estimabilité**).

Le **critère de G. SCHWARTZ** est la **statistique** $S_i = s_i(Q_i, X)$ définie par la fonction $s_i : \mathbf{N}^* \times \mathcal{A}(\mathcal{X}, \mathcal{B}) \mapsto \mathbf{R}$ et tq :

$$(1) \quad S_i = \sup_{\theta(i) \in \Theta(i)} \{ \ln f(X, \theta_i) - Q_i \cdot \ln N^{1/2} \}.$$

où $\theta(i)$ (resp $\Theta(i)$) désigne, par commodité, θ_i (resp Θ_i) et \ln la fonction Logarithme népérien.

On choisit donc le **modèle statistique** (indiqué par) $i \in I$ pour lequel S_i est maximale.