

MÉTHODE À INFORMATION LIMITÉE (G6, H, J1)

(07 / 06 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

(i) Une **méthode à information limitée** est une **procédure statistique** qui ne fait usage que de certaines **observations** ou de certaines conditions a priori portant sur les **lp** mises en jeu dans l'analyse d'un **phénomène** (cf aussi **méthode à information complète**).

(ii) Quoique plus « légère » qu'une méthode à information complète, une méthode à information limitée peut cependant posséder des propriétés intéressantes, et permettre notamment une estimation convergente des **paramètres** de certaines équations dans un **modèle d'interdépendance**. Dans ce cas, les informations relatives aux autres équations ne sont pas prises en compte (cf **estimateur convergent**).

Ainsi en est-il :

(a) des méthodes d'estimation basées sur la seule **forme réduite** (eg **méthode des moindres carrés indirects**, dans le cas d'un **modèle identifié**) ;

(b) de la **méthode des variables instrumentales**.