

ACT-2003 Modèles linéaires en actuariat

Chargée de cours : Marie-Pier CÔTÉ

AUTOMNE 2014

Le critère bayésien de Schwarz

Gideon E. Schwarz a développé son critère BIC à partir d'une argumentation bayésienne :

$$\text{BIC} = n \ln(SSE/n) + \ln(n)p'.$$

Le critère BIC est semblable au AIC, mais la pénalité pour le nombre de paramètres dépend de la taille de l'échantillon.

Un bon modèle est associé à une faible valeur de BIC.