

Информационный критерий Акаике скорректированный (Akaike's information criterion corrected)

Синонимы: AICc

Разделы: [Метрики](#)

Loginom: [Отчет по регрессии](#)

Модифицированный [критерий Акаике](#), применяемый для [выборок](#) малого размера, когда отношение числа содержащихся в выборке [примеров](#) к числу параметров модели меньше 40 (т.е. вводится поправка на ограниченный объем выборки). Значение критерия вычисляется следующим образом:

$$AIC_c = AIC + 2k \frac{k+1}{n-k-1},$$

где k — число параметров модели, n — объем обучающей выборки, AIC — информационный критерий Акаике.

Для моделей, построенных на выборочных данных, характерны смещенные оценки всех параметров и статистик. Поэтому для компенсации смещения используются специальные критерии и методы, к которым относится и модифицированный критерий Акаике.

Несложно увидеть, что критерий «штрафует» модель на величину, пропорциональную отношению числа параметров модели к числу наблюдений выборки. Критерий предложен в 1978 году Nariaki Sugiura.