

Информационный критерий Ханнана-Куина (Hannan-Quinn criterion)

Синонимы: [HQ](#)

Разделы: [Метрики](#)

Loginom: [Отчет по регрессии](#)

В статистике и [анализе данных](#) информационный критерий Ханна-Куина используется для сравнения моделей с разным числом параметров, когда требуется выбрать лучший набор [независимых переменных](#). Лучшая модель имеет наименьшее значение критерия. Он является альтернативой информационным критериям [Акаике](#) и [Байеса](#).

Критерий был предложен [Ханнаном](#) и Куином в 1979 году. Статистика критерия вычисляется следующим образом:

$$HQ = 2k \frac{\ln(\ln(n))}{n} - \frac{2L}{n},$$

где L — максимальное значение логарифмической [функции правдоподобия](#) наблюдаемой [выборки](#) с известным числом параметров, k — число параметров модели, n — число наблюдений выборки.