

Compléments sur la régression multiple

Frédéric Bertrand et Myriam Maumy¹

¹IRMA, Université Louis Pasteur
Strasbourg, France

Master 2ème Année 28-03-2009

- Tester l'hypothèse nulle :

$$H_0 : \beta_j = 0$$

contre l'hypothèse alternative :

$$H_1 : \beta_j \neq 0 \text{ pour un certain } j \text{ entre } 0 \text{ et } p - 1.$$

- Calculer la statistique :

$$t_{obs} = \frac{\hat{\beta}_j}{s(\hat{\beta}_j)}.$$

- Comparer t_{obs} à la valeur théorique lue dans une table de Student à $(n - p)ddl$ et à $\alpha = 0,05$.

- Un intervalle de confiance au niveau $(1 - \alpha)$ où α est la probabilité d'erreur pour β_j est défini par :

$$\left[\hat{\beta}_j - t_{\alpha/2, n-p} \times s(\hat{\beta}_j); \hat{\beta}_j + t_{\alpha/2, n-p} \times s(\hat{\beta}_j) \right].$$

- Cet intervalle de confiance est construit de telle sorte qu'il contienne le paramètre inconnu β_j avec une probabilité de $(1 - \alpha)$.

- Tester l'hypothèse nulle :

$$H_0 : \beta_1 = \beta_2 = \dots = \beta_{p-1} = 0$$

contre l'hypothèse alternative :

$$H_1 : \exists j \text{ pour lequel } \beta_j \neq 0 \text{ où } j \text{ varie de } 1 \text{ à } p - 1.$$

- Si l'hypothèse nulle H_0 est vérifiée alors le modèle s'écrit :

$$y_i = \beta_0 + \varepsilon_i.$$

Par conséquent :

$$F_{obs} = \frac{MC_{reg}}{MC_{res}}$$

suit une loi de Fisher avec $(p - 1)$ et $(n - p)$ ddl, où

$$MC_{reg} = \frac{SC_{reg}}{p - 1} = \frac{\sum(\hat{y}_i - \bar{y})^2}{p - 1}$$

et

$$MC_{res} = \frac{SC_{res}}{n - p} = \frac{\sum(y_i - \hat{y}_i)^2}{n - p}.$$

Source de variation	SC	ddl	MC	F_{obs}
Régression	$SC_{reg} = \sum_{i=1}^n (\hat{y}_i - \bar{y})^2$	$p - 1$	$\frac{SC_{reg}}{p - 1}$	$\frac{MC_{reg}}{MC_{res}}$
Résiduelle	$SC_{res} = \sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2$	$n - p$	$\frac{SC_{res}}{n - p}$	
Totale	$SC_{tot} = \sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2$	$n - 1$		

Test F partiel :

la nullité d'un certain nombre r de paramètres dans un modèle de p paramètres.

H_0 : modèle réduit avec $(p - r)$ paramètres

H_1 : modèle complet avec p paramètres.

Exemples :

- Tester la nullité d'un paramètre, par exemple : β_1 .

$$H_0 : y_i = \beta_0 + \beta_2 x_{i2} + \cdots + \beta_p x_{ip} + \varepsilon_i \text{ contre}$$

$$H_1 : y_i = \beta_0 + \beta_1 x_{i1} + \beta_2 x_{i2} + \cdots + \beta_p x_{ip} + \varepsilon_i.$$

- Tester la nullité de plusieurs paramètres, par exemple les pairs : β_{2j} .

$$H_0 : y_i = \beta_1 x_{i1} + \beta_3 x_{i3} + \cdots + \beta_{p-1} x_{ip-1} + \varepsilon_i \text{ contre}$$

$$H_1 : y_i = \beta_0 + \beta_1 x_{i1} + \beta_2 x_{i2} + \cdots + \beta_p x_{ip} + \varepsilon_i \text{ avec } p \text{ pair.}$$

La procédure :

- Calculer les valeurs estimées \hat{y}_i en utilisant la méthode des MC pour chacun des 2 modèles définis par H_0 et H_1 , notées : $\hat{y}_i(H_0)$ et $\hat{y}_i(H_1)$.
- Calculer ensuite $SC_{res}(H_0)$ et $SC_{res}(H_1)$.
- Calculer la statistique :

$$F_{obs} = \frac{SC_{res}(H_0) - SC_{res}(H_1)}{SC_{res}(H_1)} \times \frac{n-p}{r}$$

- Rejeter l'hypothèse nulle au seuil α si

$$F_{obs} > F_{\alpha;r,n-p}$$

où $F_{\alpha;r,n-p}$ est le $(1 - \alpha)$ -quantile d'une loi de Fisher avec r et $n - p$ ddl que l'on trouve dans une table de Fisher.