

Contrôle continu de mai

Exercice 1 *Tests de Student et Fisher.* —

- 1) Soit un échantillon de taille $n = 9$ de la variable aléatoire X suivant une loi de Gauss de paramètres (m, σ^2) inconnus. L'expérience a permis d'observer les $n = 9$ valeurs suivantes.

-1.3	1.5	1.1	-1.6	0.7	0.2	0.4	0.7	-0.1
------	-----	-----	------	-----	-----	-----	-----	------

On donne les valeurs numériques suivantes : $\bar{x} = \frac{1.6}{9} = 0.1778$, et $\overline{x^2} = \frac{8.9}{9} = 0.9889$. On considère l'hypothèse $\Theta_0 = \{m = 0\}$ contre $\Theta_1 = \{m \neq 0\}$

- Calculer le seuil c du test de Student, au niveau $\alpha = 5\%$ (on précisera le nombre de degrés de liberté intervenant dans le calcul de c).
 - Calculer la valeur t de la statistique de Student $T = \sqrt{n} \frac{\bar{X}}{\sqrt{S^2}}$.
 - Donner la conclusion du test.
 - Calculer la p-value.
- 2) Soit un échantillon de taille $n' = 9$ de la variable aléatoire X' suivant une loi de Gauss de paramètres (m', σ'^2) inconnus.

-0.2	-1.0	1.0	-1.0	0.8	1.5	-0.2	-0.1	-0.5
------	------	-----	------	-----	-----	------	------	------

On donne les valeurs numériques suivantes : $\bar{x} = \frac{0.3}{9} = 0.0333$, et $\overline{x^2} = \frac{6.23}{9} = 0.6922$. On suppose connu que $\sigma = \sigma'$, et on considère l'hypothèse $\Theta_0 = \{m = m'\}$ contre $\Theta_1 = \{m \neq m'\}$

- Calculer la valeur t'' de la statistique de Student
- $$T'' = \frac{\bar{X} - \bar{X}'}{\sqrt{\frac{1}{n} + \frac{1}{n'}}} \frac{1}{\sqrt{\frac{(n-1)S^2 + (n'-1)S'^2}{n+n'-2}}}$$
- Calculer le seuil c'' du test de Student, au niveau $\alpha = 5\%$ (on précisera le nombre de degrés de liberté intervenant dans le calcul de c).
 - Donner la conclusion du test.
 - Calculer la p-value.
- 3) On ne suppose plus connu que $\sigma = \sigma'$, et on considère l'hypothèse $\Theta_0 = \{\sigma = \sigma'\}$ contre $\Theta_1 = \{\sigma \neq \sigma'\}$
- Calculer la valeur f de la statistique de Fisher $F = S^2/S'^2$.
 - Trouver des seuils c_1, c_2 tel que le test consistant à rejeter Θ_0 si $F \notin [c_1, c_2]$ soit de niveau $\alpha = 5\%$ (on précisera les nombres de degrés de liberté intervenant dans le calcul de c).
 - Donner la conclusion du test.

Exercice 2 *Test sur la moyenne m avec variance connue.* — Soit un échantillon $(X_i)_{i \leq n}$ de taille n d'une loi de Gauss $\mathcal{N}(m, \sigma^2)$ de paramètre m inconnu, la variance σ^2 étant connue. Soit $m_0 \in \mathbb{R}$. Soient les hypothèses $\Theta_0 = \{m_0\}$ et $\Theta_1 = \mathbb{R} \setminus \Theta_0$. On considère la statistique

$$Z = \frac{\bar{X} - m_0}{\sqrt{\frac{\sigma^2}{n}}},$$

et le test ϕ consistant à rejeter Θ_0 lorsque $|Z_n| > z$.

- 1) On note $\beta_\phi(m)$ la puissance de ϕ . Exprimer cette fonction à l'aide de la fonction de répartition F de la loi $\mathcal{N}(0, 1)$.
- 2) Vérifier que β_ϕ est une fonction symétrique par rapport à m_0 (c'est-à-dire vérifie $\beta_\phi(m_0 + u) = \beta_\phi(m_0 - u)$, pour tout $u \in \mathbb{R}$), décroissante sur $] -\infty, m_0]$, et croissante sur $[m_0, +\infty[$.
- 3) En déduire que

$$\begin{aligned}\beta_\phi(m_0) &= \alpha_\phi, \\ \beta'_\phi(m_0) &= 0,\end{aligned}$$

où α_ϕ désigne le niveau ϕ en temps que test de Θ_0 contre Θ_1 .

- 4) Soit ψ un test de Θ_0 contre Θ_1 . Vérifier que $\beta_\psi(m_0) = \alpha_\psi$.
- 5) Démontrer que si de plus ψ est un test sans biais alors la fonction β_ψ atteint son minimum en m_0 . En déduire que $\beta'_\psi(m_0) = 0$.
- 6) Calculer la vraisemblance \mathcal{L} , définie par $\mathcal{L}(m, \omega) = \frac{d\mathbf{P}_{m, \sigma^2}}{d\mathbf{P}_{m_0, \sigma^2}}(\omega)$.
- 7) Déduire des deux questions précédentes que $\mathbf{E}_{m_0, \sigma^2}((\bar{X} - m_0)\psi) = 0$ (on pourra exprimer β_ψ à l'aide de \mathcal{L}).
- 8) Vérifier d'autre part que pour toute valeur fixée $m \neq m_0$, il existe deux constantes λ_m et λ'_m tels que

$$\phi = 1 \Leftrightarrow \frac{d\mathbf{P}_{m, \sigma^2}}{d\mathbf{P}_{m_0, \sigma^2}} > \lambda_m + \lambda'_m \bar{X}.$$

- 9) Démontrer que pour tout test ψ on a

$$\left(\frac{d\mathbf{P}_{m, \sigma^2}}{d\mathbf{P}_{m_0, \sigma^2}} - \lambda_m - \lambda'_m \bar{X} \right) (\phi - \psi) \geq 0.$$

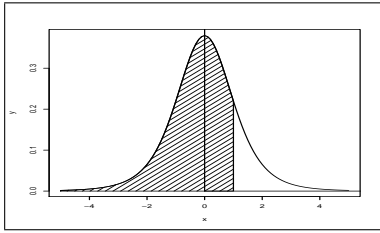
- 10) En déduire que si de plus ψ est sans biais alors

$$\beta_\phi(m) - \beta_\psi(m) \geq K_m(\alpha_\phi - \alpha_\psi),$$

où $K_m = \lambda_m + m_0 \lambda'_m > 0$.

- 11) Démontrer que ϕ est un test UPPB de Θ_0 contre Θ_1 .
- 12) Démontrer que ϕ est l'unique test UPPB de Θ_0 contre Θ_1 .

Table des Quantiles de la loi de Student.



Quantiles $st_m(\beta)$ d'ordre β de la loi de Student à m degrés de liberté. Pour les degrés $m \geq 51$, utiliser la loi $\mathcal{N}(0, 1)$. Pour les quantiles d'ordre $\beta < 0.5$ utiliser $st_m(\beta) = -st_m(1 - \beta)$.

$m \backslash \beta$	0.60	0.70	0.80	0.90	0.95	0.9750	0.9900	0.9950	0.9990	0.9995
1	0.325	0.727	1.376	3.078	6.314	12.706	31.821	63.657	318.309	636.619
2	0.289	0.617	1.061	1.886	2.920	4.303	6.965	9.925	22.327	31.599
3	0.277	0.584	0.978	1.638	2.353	3.182	4.541	5.841	10.215	12.924
4	0.271	0.569	0.941	1.533	2.132	2.776	3.747	4.604	7.173	8.610
5	0.267	0.559	0.920	1.476	2.015	2.571	3.365	4.032	5.893	6.869
6	0.265	0.553	0.906	1.440	1.943	2.447	3.143	3.707	5.208	5.959
7	0.263	0.549	0.896	1.415	1.895	2.365	2.998	3.499	4.785	5.408
8	0.262	0.546	0.889	1.397	1.860	2.306	2.896	3.355	4.501	5.041
9	0.261	0.543	0.883	1.383	1.833	2.262	2.821	3.250	4.297	4.781
10	0.260	0.542	0.879	1.372	1.812	2.228	2.764	3.169	4.144	4.587
11	0.260	0.540	0.876	1.363	1.796	2.201	2.718	3.106	4.025	4.437
12	0.259	0.539	0.873	1.356	1.782	2.179	2.681	3.055	3.930	4.318
13	0.259	0.538	0.870	1.350	1.771	2.160	2.650	3.012	3.852	4.221
14	0.258	0.537	0.868	1.345	1.761	2.145	2.624	2.977	3.787	4.140
15	0.258	0.536	0.866	1.341	1.753	2.131	2.602	2.947	3.733	4.073
16	0.258	0.535	0.865	1.337	1.746	2.120	2.583	2.921	3.686	4.015
17	0.257	0.534	0.863	1.333	1.740	2.110	2.567	2.898	3.646	3.965
18	0.257	0.534	0.862	1.330	1.734	2.101	2.552	2.878	3.610	3.922
19	0.257	0.533	0.861	1.328	1.729	2.093	2.539	2.861	3.579	3.883
20	0.257	0.533	0.860	1.325	1.725	2.086	2.528	2.845	3.552	3.850
21	0.257	0.532	0.859	1.323	1.721	2.080	2.518	2.831	3.527	3.819
22	0.256	0.532	0.858	1.321	1.717	2.074	2.508	2.819	3.505	3.792
23	0.256	0.532	0.858	1.319	1.714	2.069	2.500	2.807	3.485	3.768
24	0.256	0.531	0.857	1.318	1.711	2.064	2.492	2.797	3.467	3.745
25	0.256	0.531	0.856	1.316	1.708	2.060	2.485	2.787	3.450	3.725
26	0.256	0.531	0.856	1.315	1.706	2.056	2.479	2.779	3.435	3.707
27	0.256	0.531	0.855	1.314	1.703	2.052	2.473	2.771	3.421	3.690
28	0.256	0.530	0.855	1.313	1.701	2.048	2.467	2.763	3.408	3.674
29	0.256	0.530	0.854	1.311	1.699	2.045	2.462	2.756	3.396	3.659
30	0.256	0.530	0.854	1.310	1.697	2.042	2.457	2.750	3.385	3.646
31	0.256	0.530	0.853	1.309	1.696	2.040	2.453	2.744	3.375	3.633
32	0.255	0.530	0.853	1.309	1.694	2.037	2.449	2.738	3.365	3.622
33	0.255	0.530	0.853	1.308	1.692	2.035	2.445	2.733	3.356	3.611
34	0.255	0.529	0.852	1.307	1.691	2.032	2.441	2.728	3.348	3.601
35	0.255	0.529	0.852	1.306	1.690	2.030	2.438	2.724	3.340	3.591
36	0.255	0.529	0.852	1.306	1.688	2.028	2.434	2.719	3.333	3.582
37	0.255	0.529	0.851	1.305	1.687	2.026	2.431	2.715	3.326	3.574
38	0.255	0.529	0.851	1.304	1.686	2.024	2.429	2.712	3.319	3.566
39	0.255	0.529	0.851	1.304	1.685	2.023	2.426	2.708	3.313	3.558
40	0.255	0.529	0.851	1.303	1.684	2.021	2.423	2.704	3.307	3.551
41	0.255	0.529	0.850	1.303	1.683	2.020	2.421	2.701	3.301	3.544
42	0.255	0.528	0.850	1.302	1.682	2.018	2.418	2.698	3.296	3.538
43	0.255	0.528	0.850	1.302	1.681	2.017	2.416	2.695	3.291	3.532
44	0.255	0.528	0.850	1.301	1.680	2.015	2.414	2.692	3.286	3.526
45	0.255	0.528	0.850	1.301	1.679	2.014	2.412	2.690	3.281	3.520
46	0.255	0.528	0.850	1.300	1.679	2.013	2.410	2.687	3.277	3.515
47	0.255	0.528	0.849	1.300	1.678	2.012	2.408	2.685	3.273	3.510
48	0.255	0.528	0.849	1.299	1.677	2.011	2.407	2.682	3.269	3.505
49	0.255	0.528	0.849	1.299	1.677	2.010	2.405	2.680	3.265	3.500
50	0.255	0.528	0.849	1.299	1.676	2.009	2.403	2.678	3.261	3.496

Table 6

Loi de Fisher F

$$P(F_{v_1, v_2} < f_{v_1, v_2, \alpha}) = \alpha$$

$\alpha = 0,975$

		v ₁																		
		1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	15	20	30	50	100	200	500	•	
v ₂	1	648	800	864	900	922	937	948	957	963	969	985	993	1001	1008	1013	1016	1017	1018	
	2	38,5	39,0	39,2	39,3	39,3	39,4	39,4	39,4	39,4	39,4	39,4	39,4	39,4	39,5	39,5	39,5	39,5	39,5	39,5
	3	17,4	16,0	15,4	15,1	14,9	14,7	14,6	14,5	14,5	14,4	14,3	14,2	14,1	14,0	14,0	13,9	13,9	13,9	13,9
	4	12,2	10,6	9,98	9,60	9,36	9,20	9,07	8,98	8,90	8,84	8,66	8,56	8,46	8,38	8,32	8,29	8,27	8,26	8,26
	5	10,0	8,43	7,76	7,39	7,15	6,98	6,85	6,76	6,68	6,62	6,43	6,33	6,23	6,14	6,08	6,05	6,03	6,02	6,02
	6	8,81	7,26	6,60	6,23	5,99	5,82	5,70	5,60	5,52	5,46	5,27	5,17	5,07	4,98	4,92	4,88	4,86	4,85	4,85
	7	8,07	6,54	5,89	5,52	5,29	5,12	4,99	4,90	4,82	4,76	4,57	4,47	4,36	4,28	4,21	4,18	4,16	4,14	4,14
	8	7,57	6,06	5,42	5,05	4,82	4,65	4,53	4,43	4,36	4,30	4,10	4,00	3,89	3,81	3,74	3,70	3,68	3,67	3,67
	9	7,21	5,71	5,08	4,72	4,48	4,32	4,20	4,10	4,03	3,96	3,77	3,67	3,56	3,47	3,40	3,37	3,35	3,33	3,33
	10	6,94	5,46	4,83	4,47	4,24	4,07	3,95	3,85	3,78	3,72	3,52	3,42	3,31	3,22	3,15	3,12	3,09	3,08	3,08
	11	6,72	5,26	4,63	4,28	4,04	3,88	3,76	3,66	3,59	3,53	3,33	3,23	3,12	3,03	2,96	2,92	2,90	2,88	2,88
	12	6,55	5,10	4,47	4,12	3,89	3,73	3,61	3,51	3,44	3,37	3,18	3,07	2,96	2,87	2,80	2,76	2,74	2,72	2,72
	13	6,41	4,97	4,35	4,00	3,77	3,60	3,48	3,39	3,31	3,25	3,05	2,95	2,84	2,74	2,67	2,63	2,61	2,60	2,60
	14	6,30	4,86	4,24	3,89	3,66	3,50	3,38	3,29	3,21	3,15	2,95	2,84	2,73	2,64	2,56	2,53	2,50	2,49	2,49
	15	6,20	4,76	4,15	3,80	3,58	3,41	3,29	3,20	3,12	3,06	2,86	2,76	2,64	2,55	2,47	2,44	2,41	2,40	2,40
16	6,12	4,69	4,08	3,73	3,50	3,34	3,22	3,12	3,05	2,99	2,79	2,68	2,57	2,47	2,40	2,36	2,33	2,32	2,32	
17	6,04	4,62	4,01	3,66	3,44	3,28	3,16	3,06	2,98	2,92	2,72	2,62	2,50	2,41	2,33	2,29	2,26	2,25	2,25	
18	5,98	4,56	3,95	3,61	3,38	3,22	3,10	3,01	2,93	2,87	2,67	2,56	2,44	2,35	2,27	2,23	2,20	2,19	2,19	
19	5,92	4,51	3,90	3,56	3,33	3,17	3,05	2,96	2,88	2,82	2,62	2,51	2,39	2,30	2,22	2,18	2,15	2,13	2,13	
20	5,87	4,46	3,86	3,51	3,29	3,13	3,01	2,91	2,84	2,77	2,57	2,46	2,35	2,25	2,17	2,13	2,10	2,09	2,09	
22	5,79	4,38	3,78	3,44	3,22	3,05	2,93	2,84	2,76	2,70	2,50	2,39	2,27	2,17	2,09	2,05	2,02	2,00	2,00	
24	5,72	4,32	3,72	3,38	3,15	2,99	2,87	2,78	2,70	2,64	2,44	2,33	2,21	2,11	2,02	1,98	1,95	1,94	1,94	
26	5,66	4,27	3,67	3,33	3,10	2,94	2,82	2,73	2,65	2,59	2,39	2,28	2,16	2,05	1,97	1,92	1,90	1,88	1,88	
28	5,61	4,22	3,63	3,29	3,06	2,90	2,78	2,69	2,61	2,55	2,34	2,23	2,11	2,01	1,92	1,88	1,85	1,83	1,83	
30	5,57	4,18	3,59	3,25	3,03	2,87	2,75	2,65	2,57	2,51	2,31	2,20	2,07	1,97	1,88	1,84	1,81	1,79	1,79	
40	5,42	4,05	3,46	3,13	2,90	2,74	2,62	2,53	2,45	2,39	2,18	2,07	1,94	1,83	1,74	1,69	1,66	1,64	1,64	
50	5,34	3,98	3,39	3,06	2,83	2,67	2,55	2,46	2,38	2,32	2,11	1,99	1,87	1,75	1,66	1,60	1,57	1,55	1,55	
60	5,29	3,93	3,34	3,01	2,79	2,63	2,51	2,41	2,33	2,27	2,06	1,94	1,82	1,70	1,60	1,54	1,51	1,48	1,48	
80	5,22	3,86	3,28	2,95	2,73	2,57	2,45	2,36	2,28	2,21	2,00	1,88	1,75	1,63	1,53	1,47	1,43	1,40	1,40	
100	5,18	3,83	3,25	2,92	2,70	2,54	2,42	2,32	2,24	2,18	1,97	1,85	1,71	1,59	1,48	1,42	1,38	1,35	1,35	
200	5,10	3,76	3,18	2,85	2,63	2,47	2,35	2,26	2,18	2,11	1,90	1,78	1,64	1,51	1,39	1,32	1,27	1,23	1,23	
500	5,05	3,72	3,14	2,81	2,59	2,43	2,31	2,22	2,14	2,07	1,86	1,74	1,60	1,46	1,34	1,25	1,19	1,14	1,14	
•	5,02	3,69	3,12	2,79	2,57	2,41	2,29	2,19	2,11	2,05	1,83	1,71	1,57	1,43	1,30	1,21	1,13	1,00	1,00	