

Liste des Tests du cours

Charles Vin

2022

Table des matières

1	Template	1
2	Test de Kolmogorov-Smirnov	1
3	Le test du χ^2 d'ajustement	2
3.1	Le χ^2 d'ajustement à une famille paramétrique de loi	3
4	Le test d'homogénéité de Kolmogorov-Smirnov	4

1 Template

Conditions

Hypothèse

Statistique de test

Zone de Rejet

Méthode

2 Test de Kolmogorov-Smirnov

Conditions

1. Les X_i semblent provenir d'une loi à fonction de répartition continue. \Rightarrow on n'a pas plusieurs fois la même valeur (sauf si celle-ci on était arrondi).
2. Fonctionne $\forall n$: même si n est petit, ce test est pertinent
3. Si $n \geq 100$, on fait un test asymptotique.

Hypothèse

- H_0 = les X_i ont pour fdr. F_X
- H_1 = les X_i n'ont pas pour fdr. F_X

Statistique de test

$$\begin{aligned} h(F_n, F) &= \sup_{t \in \mathbb{R}} |F_n(t) - F(t)| \\ &= \max_{1 \leq i \leq n} \left(\max \left(\left| \frac{i}{n} - F(X_{(i)}) \right|, \left| \frac{i-1}{n} - F(X_{(i)}) \right| \right) \right) \end{aligned}$$

Zone de Rejet

Si n est petit

La loi de $h(F_n, F)$ est tabulé alors :

$$\mathcal{R} = \{h(F_n, F_X) \geq h_{1-\alpha}\}.$$

avec F_n fonction de répartition empirique, $h_{1-\alpha}$ le quantile à aller chercher dans la table

Si n est grand $n \geq 30$

Attention pas souvenir de l'avoir fait en TD.
On a pas la table de $h(F_n, F)$ mais on sait que

$$\sqrt{n}h_n \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{\mathcal{L}} W_\infty.$$

Donc on pose la zone de rejet

$$\mathcal{R} = \{h(F_n, F_X) \geq \frac{k_\alpha}{\sqrt{n}}\}.$$

avec F_n fonction de répartition empirique, k_α le quantile de W_∞ à aller chercher dans sa table

Méthode

Pour trouver la valeur de $h(F_n, F_X)$: Faire le grand tableau puis trouver le max. Exemple :

i	1	2	3	4	5
$X_{(i)}$	0.3	0.7	0.9	1.2	1.4
$X_{(i)} - 2$	-1.70	-1.30	-1.10	-0.80	-0.60
$F_0(X_{(i)})$	0.04	0.10	0.14	0.21	0.27
$\frac{i}{n}$	0.05	0.1	0.15	0.2	0.25
$ \frac{i}{n} - F_0(X_{(i)}) $	0.01	0.00	0.01	0.01	0.02
$ \frac{i-1}{n} - F_0(X_{(i)}) $	0.04	0.05	0.04	0.06	0.07

Table 1 – Ici le max c'est 0.07 à la dernière case

3 Le test du χ^2 d'ajustement

Conditions

1. Les X_i sont à valeur dans un ensemble fini (loi discrète). Si a valeur dans \mathbb{N} , on fusionne les classes à partir d'un certain rang choisis
2. Test asymptotique : $\forall k \in \{1, \dots, d\}, np_k^{ref}(1 - p_k^{ref}) \geq 5 \Leftrightarrow n \geq 20$

Si on ne remplit pas les conditions, on peut fusionner les classes

Hypothèse

$$H_0 = p = p^{ref} \text{ i.e. } \forall k \in \{1, \dots, d\}, p_k = p_k^{ref}$$

$$H_1 = p \neq p^{ref} \text{ i.e. } \exists k \in \{1, \dots, d\} : p_k \neq p_k^{ref}$$

Avec p^{ref} un vecteur fixé à tester (par exemple pour un lancé de dé $(\frac{1}{6}, \dots, \frac{1}{6})$)

Statistique de test

$$\begin{aligned} D(\bar{p}_n, p^{ref}) &= n \sum_{k=1}^d \frac{(\bar{p}_{k,n} - p_k^{ref})^2}{p_k^{ref}} \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{\mathcal{L}} \mathcal{X}^2(d-1) \\ &= \sum_{k=1}^d \frac{(N_{k,n} - np_k^{ref})^2}{np_k^{ref}} \end{aligned}$$

avec

- $N_{k,n} = \sum_{i=1}^n \mathbb{1}_{X_i = x_k}$ (ce qu'il y a dans le tableau de la consigne)
- $\bar{p}_{k,n} = \frac{N_{k,n}}{n}$ les proportions observés

Zone de Rejet

$$\mathcal{R} = \{D(\bar{p}_n, p^{ref}) \geq h_\alpha\}.$$

avec h_α le quantile d'ordre $1 - \alpha$ de la loi $\mathcal{X}^2(d-1)$

Méthode

1. Etape 0 : On vérifie les conditions

$$\forall k \in \{1, \dots, d\}, n * p_k \geq 5.$$

C'est la condition de Cochran (1954), il avait testé cas possible en observant l'approximation faites.

2. Etape 1 : On calcule les effectifs et proportions observées : $N_{k,n}$ et $\hat{p}_{k,n}$
3. Etape 2 : Calcul de la statistique de test

$$D = n \sum_{k=1}^d \frac{(\hat{p}_{k,n} - p_k)^2}{p_k}.$$

4. Etape 3 : Détermination de la zone de rejet au niveau α . On lit h_α le quantile d'ordre $1 - \alpha$ de la loi $\mathcal{X}^2(d-1)$
5. Etape 4 : Décisions
 - si $D > h_\alpha$, on rejette H_0 (au niveau α).
 - Si $D \leq h_\alpha$ on conserve H_0

Bilan de la méthode

Aspects positifs :

- **Fonctionne pour toutes les lois**
- Facile à faire

Aspects négatifs :

- Problème de consistance. Regrouper les variables par intervalle ruiner l'erreur de seconde espèce.
- Asymptotique
- Dépendant du choix des intervalles. Ce qui n'est pas canonique.

3.1 Le \mathcal{X}^2 d'ajustement à une famille paramétrique de loi

Pratiquement comme avant, pas encore fait en TD, mais copier collé du cours quand même

1. Etape 1 : Soit $\hat{\theta}_n$ l'estimateur du maximum de vraisemblance de θ (pour P_θ). On estime **tous** les paramètres de la loi $(p_1^{\hat{\theta}_n}, \dots, p_d^{\hat{\theta}_n})$
2. Etape 2 : On va tester l'ajustement de X_1, \dots, X_n à $P_{\hat{\theta}_n}$. On calcule les fréquences observées $\hat{p}_{k,n}$.
3. Etape 3 : Vérification des conditions $np_k^{\hat{\theta}_n}$ et possible regroupement en classes

4. Etape 4 : Calcul de la stat de test D
5. Etape 5 : Zone de rejet : lecture de H_α le quantile d'ordre $1 - \alpha$ d'une $\mathcal{X}^2(d - 1 - M)$ avec M nombre de paramètre.
6. Etape 6 : Décision
 - $D > h_\alpha$ on rejette H_0
 - $D \leq h_\alpha$ on conserve H_0

4 Le test d'homogénéité de Kolmogorov-Smirnov

Conditions

- Deux échantillons indépendants de variable iid.

Hypothèse

- H_0 : les X_i et Y_i ont la même loi, c'est à dire $F_{X_1} = F_{Y_1}$ où F_{X_1}, F_{Y_1} sont continues.
- H_1 les lois sont différentes

Statistique de test

$$\sup_{s \in \mathbb{R}} \left| \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \mathbb{1}_{X_i \leq s} - \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n \mathbb{1}_{Y_j \leq s} \right|.$$

Zone de Rejet

- Ce test est de taille α , si on utilise la table de $h_{n,m} = \sup_{s \in \mathbb{R}} \left| \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \mathbb{1}_{U_i \leq s} - \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n \mathbb{1}_{V_j \leq s} \right|$.
- Si n et m sont trop grands, on utilise le résultat suivant :
Sous H_0

$$\sqrt{\frac{nm}{n+m}} h(F_n, G_n) \xrightarrow{\alpha}_{n,m \rightarrow +\infty} W_\infty \text{ voir KS asymptotique.}$$

On utilise alors comme zone de rejet $\sqrt{\frac{n+m}{nm}} W_\infty$ avec W_∞ le quantile d'ordre $1 - \alpha$ de W_∞ .

Méthode