

Outils Statistiques pour la data intelligence (Module 1)

Introduction

La Statistique inférentielle a pour but de dégager des renseignements sur une population à partir de renseignements obtenus sur un échantillon.

Rappels

Quelques rappels de statistique descriptive :

- **Moyenne** : $\bar{x} = \frac{1}{n} \sum r_i \cdot x_i$
- **Variance (Unités²)** : $Var(x) = \overline{x^2} - \bar{x}^2 = \frac{1}{n} \cdot \sum r_i \cdot (x_i)^2 - (\bar{x})^2 = \frac{1}{n} \sum r_i \cdot (x_i - \bar{x})^2$
- **Ecart-Type** : $\sigma(x) = \sqrt{Var(x)}$

Estimation des paramètres

Estimation ponctuelle, notion d'estimateur

une **estimation ponctuelle du paramètre** (estimateur) : paramètre dont la valeur sera calculée sur l'échantillon.

Notations

Variable	Estimateur
p	f
m	\bar{x}
σ^2	S_n^2

N: taille de la population

n: taille de l'échantillon

m : moyenne pour la population

\bar{x} : moyenne pour l'échantillon

p: proportion pour la population

f : fréquence pour l'échantillon

σ^2 : variance pour la population

S_n^2 : variance pour l'échantillon

Les paramètres n, \bar{x} et S_n^2 sont des estimateurs. On constate que n et \bar{x} sont des estimateurs **sans biais** tandis que S_n^2 est **biaisé** de θ^2 . tandis que S_{n-1}^2 (**variance corrigée**) est un estimateur **sans biais** (non exhaustif).

Echantillons exhaustifs ou non exhaustifs

Un échantillon est dit **exhaustif** si un même individu ne peut être interrogé plus d'une fois. Sinon, il est **non exhaustif**. La méthode non-exhaustive fournit des résultats numériquement proches de la méthode exhaustive tout en utilisant des formules plus simples.

La variable aléatoire "estimateur"

Un estimateur est une *variable aléatoire* qui dépends de l'échantillon choisi.

Non-Exhaustif

- $E(\bar{x}) = m$
- $Var(\bar{x}) = \frac{\sigma^2}{n}$
- $E(f) = p$
- $Var(f) = \frac{p \cdot (1-p)}{n}$
- $E(S_n^2) = \frac{n-1}{n} \cdot \sigma^2$
- $E(S_{n-1}^2) = \sigma^2$ ($S_{n-1}^2 = \frac{n}{n-1} \cdot S_n^2$)

Exhaustif

- $E(\bar{x}) = m$
- $Var(\bar{x}) = \frac{\sigma^2}{n} \cdot \frac{N-n}{N-1}$
- $E(f) = p$
- $Var(f) = \frac{p \cdot (1-p)}{n} \cdot \frac{N-n}{N-1}$
- $E(S_n^2) = \frac{n-1}{n} \cdot \frac{N}{N-1} \cdot \sigma^2$
- $E(\frac{N-1}{N} \cdot S_{n-1}^2) = \sigma^2$

Qualités d'un estimateur

Un bon estimateur se doit d'être le plus proche possible du paramètre qu'il estime. Il est d'autant plus efficace que sa *variance est petite*.

D'une manière générale, on décrit θ comme le paramètre à estimer et $\hat{\theta}$ son estimateur.

- $\hat{\theta}$ doit être **consistant** (au plus l'échantillon de personnes interrogées grandit, au plus $\hat{\theta}$ se rapproche de θ
- $\hat{\theta}$ doit être **sans biais** (cad : $E(\hat{\theta}) = \theta$).

Un estimateur est **absolument correct** si il est **sans biais** et **consistant**

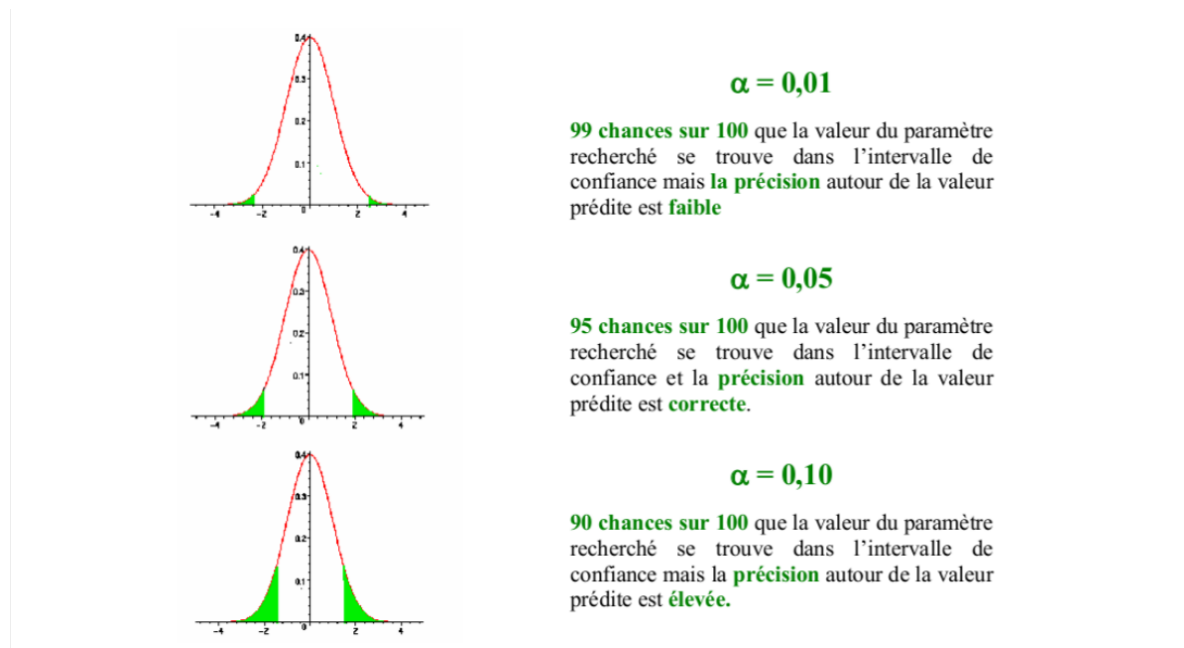
Estimation par intervalle de confiance

Introduction

L'estimation par intervalle de confiance d'un paramètre est un procédé qui consiste à déterminer un intervalle dans lequel le paramètre à une certaine probabilité de se trouver. En général, on fixe l'intervalle de confiance à 95% soit un niveau de confiance de 0,95. En opposition au niveau de confiance se situe le niveau d'incertitude α qui vaut ici $(1 - 0,95)$ soit $\alpha = 0,05$.

Niveau d'incertitude

Le niveau d'incertitude est fonction de la précision souhaitée lors de l'étude. On aura donc tendance à diminuer celui-ci dans le cadre d'une étude nécessitant une haute précision.



La zone colorée représente la **marge d'erreur tolérée**.

Procédé

On cherche donc à estimer un paramètre. On décide d'un niveau d'incertitude (généralement 0,05). On peut ensuite calculer sur cet échantillon : une moyenne sur l'échantillon. Le but est donc d'obtenir 95% des résultats entre 2 bornes. On aura donc les 2 bornes suivantes : (Moyenne $\pm 2.\sigma^2$).

L_i et L_s vont donc représenter respectivement la limite inférieure et la limite supérieure.

Il faut donc déterminer L_i et L_s tels que $\Pr\{L_i \leq \theta \leq L_s\} = 1 - \alpha$

La variable aléatoire recherchée suivra généralement une loi binomiale. Cette loi peut être approximée par une gaussienne si elle respecte les critères suivants :

- Le nombre de personnes interrogées est supérieur à 30. ($n > 30$)
- Au moins 5 personnes dans les personnes interrogées valident le préposât ($n.p > 5$)

Si tel est le cas, on peut approximer cette variable aléatoire par une gaussienne d'espérance $n.p$

Intervalle de confiance d'une proportion

Il faut donc trouver L_i et L_s tels que $\Pr\{L_i \leq p \leq L_s\} = 0.95$

La variable aléatoire est une binomiale qui peut être, sur un échantillon de grande taille approximé par une loi normale d'espérance np et de variance $np.(1-p)$. on s'intéresse donc aux échantillons $n \geq 30$ et $n.p \geq 5$ et $n.(1-p) \geq 5$

$n.f$ suit donc une loi normale $\frac{f-E(f)}{\sqrt{\text{var}(f)}} \approx X_G^*$

Nous cherchons donc $-a$ et a tels que

$$\Pr\{-a \leq X_G^* \leq a\} = 0.95 \Leftrightarrow \Pr\{X_G^* \leq a\} = 0.975$$

$$0.975 = 1 - \frac{1-0.95}{2}$$

$$X = 1 - \frac{\alpha}{2}$$

à la lecture de la table, 0.975 nous donne un a équivalent à 1,96. On remplace ensuite X_G^* dans la formule, ce qui donne : $Pr\{f - 1.96 \cdot \sqrt{\frac{p \cdot (1-p)}{n}} \leq p \leq f + 1.96 \cdot \sqrt{\frac{p \cdot (1-p)}{n}}\}$

On se retrouve cependant à estimer p qui contient p dans son expression. On peut soit

- remplacer p par son estimation ponctuelle f
- remplacer p par 0.5 qui maximise la quantité $p \cdot (1-p)$

Que faire si l'on traite le cas d'un échantillon exhaustif ?

Si l'échantillon avait été **exhaustif**, l'intervalle recherché aurait été :

$$\left[f - 1.96 \cdot \sqrt{\frac{N-n}{N-1}} \cdot \sqrt{\frac{p \cdot (1-p)}{n}}; f + 1.96 \cdot \sqrt{\frac{N-n}{N-1}} \cdot \sqrt{\frac{p \cdot (1-p)}{n}} \right]$$

Que faire si Le niveau de confiance n'existe pas dans la table ?

Dans le cas d'un niveau de confiance $(1 - \alpha)$ où α qui vaut $(1 - \frac{\alpha}{2})$ n'existerait pas dans la table directement.

Nous allons donc chercher les deux valeurs qui l'encadrent soit a^- qui est équivalent à la valeur précédente dans la table (avec une valeur associée de g^-) et une valeur a^+ qui est la valeur suivante dans la table (avec une valeur associée de g^+).

par interpolation linéaire, $a \approx g^- + \frac{a-a^-}{a^+-a^-} \cdot (g^+ - g^-) = g$

Si on prends l'exemple d'un $\alpha = 0,99$. Le g vaut donc 2.575714 par interpolation linéaire.

Intervalle de confiance d'une moyenne

Les échantillons de grande taille ($n \geq 30$)

Le raisonnement utilisé pour le calcul de p à partir de f peut être étendu à \bar{x} . ce qui nous donne pour un échantillon non-exhaustif :

$$\bar{x} \approx X_G \text{ et donc par conséquent } \frac{\bar{x} - E(\bar{x})}{\sqrt{\text{var}(\bar{x})}} \approx X_G^*$$

On peut donc en déduire les formules suivantes :

$$\left[\bar{x} - g \cdot \frac{\sigma}{\sqrt{n}}; \bar{x} + g \cdot \frac{\sigma}{\sqrt{n}} \right]$$

et pour un échantillon exhaustif :

$$\left[\bar{x} - g \cdot \sqrt{\frac{N-n}{N-1}} \cdot \frac{\sigma}{\sqrt{n}}; \bar{x} + g \cdot \sqrt{\frac{N-n}{N-1}} \cdot \frac{\sigma}{\sqrt{n}} \right]$$

Les échantillons de petite taille ($n < 30$)

Si la population est **distribuée normalement**, c'est-à-dire dans l'exemple ci-dessus, si la durée des interventions étudiées *suit une loi normale*, on peut dire que la variable aléatoire « **moyenne standardisée des échantillons** » **suit une loi t de Student à $(n - 1)$ degrés de liberté**.

Une variable aléatoire de Student est une variable aléatoire définie de $-\infty$ à $+\infty$ et symétrique par rapport à l'axe verticale.

Notée t_v , elle dépend de v (nombre de degrés de liberté). et son graph ressemble à celui de gauss plus aplati. mais il s'en approche en $v \rightarrow \infty$ et $E(t_v) = 0$, $Var(t_v) = \frac{v}{v-2}$ avec ($v > 2$)

v peut être calculé sur base du nombre de personnes interrogées pour former l'échantillon : si $n = 20$, $v = 20-1$

Intervalle de confiance d'une variance

SKIP

Marge d'erreur associée à un intervalle de confiance

De façon générale, la marge d'erreur vaut :

- Pour l'intervalle de confiance d'une proportion : $a. \sqrt{\frac{p \cdot (1-p)}{n}}$
- Pour un intervalle de confiance de moyenne : $a. \frac{\sigma}{\sqrt{n}}$

Pour diminuer cette marge d'erreur, nous pouvons soit **augmenter la taille de l'échantillon**, soit **augmenter le niveau d'incertitude**. La marge d'erreur maximale est obtenue lorsque $p = 0.5$

\newpage