Question 5 :

Apres de construction de chaque matrice pour analyser, on d’abord utilise commande princomp pour obtenir des composantes principales de chaque matrice.

Et puis on choisisse des valeurs propres superieure a 1. Pour gas, il y 10 comps >1, puis on peut construire la regression de gas avec ses 10 premiere colonnes de projections.

Et puis on fait de meme pour la matrice de Oil, et on trouve qu’il y a 11 comps>1, et puis on peut construire la regression de gas avec ses 11 premieres colonnes de projections.

Pour le test, on recupere des donnees d’apres indice et puis on calcule le score.

Quand on calcule q1\_inf=0.15, q1\_sup=0.15,et q2\_inf=0.15, q2\_sup=0.15, on peut obtenir un score de 8,78. donc, en comparant avec des autres modeles, cette modele ne marche pas tres bien. C’est pas necessaire de continuer a discuter le score en changuant les intervalles de confiance pour cette modele.