

Statistiques pour les sciences (MAT-4681)

Arthur Charpentier

12 - Proportions et fréquences

été 2022

Fréquence

Considérons un échantillon $\{x_1, \dots, x_n\}$, prenant des valeurs A ou B (voire davantage). Supposons que l'on s'intéresse à la fréquence d'apparition de la modalité A.

Notons $y_i = \mathbf{1}_A(x_i)$, et $\{y_1, \dots, y_n\}$ l'échantillon prenant les valeurs 0 ou 1. La **fréquence** (d'apparition de A) est

$$f = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n y_i = \bar{y} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \mathbf{1}_A(x_i)$$

(on parle aussi parfois de proportion)

Considérons maintenant une collection de variables aléatoires indépendantes et identiquement distribuées, Y_1, \dots, Y_n , de loi $\mathcal{B}(p)$. Posons

$$F = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n Y_i = \bar{Y}$$

Fréquence

Si les variables Y_1, \dots, Y_n sont i.i.d. de loi $\mathcal{B}(p)$

$$\mathbb{E}[F] = p \text{ et } \text{Var}[F] = \frac{p(1-p)}{n}$$

Plus précisément, comme $nF \sim \mathcal{B}(n, p)$,

$$\mathbb{P}\left(F = \frac{k}{n}\right) = \binom{n}{k} p^k (1-p)^{n-k}, \quad \forall k = 0, 1, \dots, n.$$

Si n est suffisamment grand, d'après le théorème central limite

$$Z_n = \sqrt{n} \frac{F - p}{\sqrt{p(1-p)}} \xrightarrow{\mathcal{L}} \mathcal{N}(0, 1)$$

En pratique, on suppose l'approximation normale valide si $n \geq 30$, $np \geq 15$ et $n(1-p) \geq 15$

Intervalle de confiance

Modèle binomial, avec n assez grand

Intervalle de confiance, $\{x_1, \dots, x_n\}$, $\mathcal{B}(p)$, n grand

Soit $\mathbf{x} = \{x_1, \dots, x_n\}$ de loi $\mathcal{B}(p)$.

$$\left[\hat{p} \pm u_{1-\alpha/2} \sqrt{\frac{\hat{p}(1-\hat{p})}{n}} \right], \text{ où } \hat{p} = \bar{x}$$

Note parfois l'intervalle de confiance dépasse 0 ou 1

```
1 > sum_x = 12
2 > n = 14
3 > sum_x/n + qnorm(c(.025, .975))*sqrt(sum_x*(n-sum_x)/n
  ^3)
4 [1] 0.6738432 1.0404425
```

Intervalle de confiance

Il existe de nombreux intervalles de confiance. Par exemple sur nos données avec 12 fois '1' et 2 fois '0' ($n = 14$),

```
1 > library(binom)
2 > binom.confint(12, 14, methods = "all")
3           method  x  n      mean      lower      upper
4 1  agresti-coull 12 14 0.8571429 0.5881065 0.9723858
5 2    asymptotic 12 14 0.8571429 0.6738432 1.0404425
6 3      bayes    12 14 0.8333333 0.6517227 0.9853611
7 4    cloglog    12 14 0.8571429 0.5394482 0.9622319
8 5     exact    12 14 0.8571429 0.5718708 0.9822055
9 6     logit    12 14 0.8571429 0.5731738 0.9640393
10 7     probit    12 14 0.8571429 0.6007290 0.9699396
11 8     profile    12 14 0.8571429 0.6206505 0.9742387
12 9        lrt    12 14 0.8571429 0.6206560 0.9747079
13 10    prop.test 12 14 0.8571429 0.5615066 0.9748606
14 11      wilson 12 14 0.8571429 0.6005862 0.9599061
```

Intervalle de confiance

Il existe de nombreux intervalles de confiance. Par exemple sur nos données avec 12 fois '1' et 2 fois '0' ($n = 14$),

```
1 > library(DescTools)
2 > BinomCI(12, 14, sides = "two.sided", method = c("
    wald", "wilson", "agresti-coull", "arcsine"))
3           est      lwr.ci      upr.ci
4 wald          0.8571429 0.6738432 1.0000000
5 wilson          0.8571429 0.6005862 0.9599061
6 agresti-coull 0.7802461 0.5881065 0.9723858
7 arcsine          0.8389831 0.6096856 0.9773745
```

Intervalle de confiance

Modèle binomial, avec n assez grand

Intervalle de confiance, $\{x_1, \dots, x_n\}$, $\mathcal{B}(p)$, Agresti–Coull

Soit $\mathbf{x} = \{x_1, \dots, x_n\}$ de loi $\mathcal{B}(p)$.

Posons $\tilde{n} = n + u_{1-\alpha/2}^2$ et $\tilde{p} = \frac{1}{\tilde{n}} \left(n\bar{x} + \frac{u_{1-\alpha/2}^2}{2} \right)$, alors un intervalle de confiance de niveau α est

$$\left[\tilde{p} \pm u_{1-\alpha/2} \sqrt{\frac{\tilde{p}(1 - \tilde{p})}{\tilde{n}}} \right]$$

Une version approchée est d'utiliser $\tilde{p} = \frac{x_1 + \dots + x_n + 2}{n + 4}$

Intervalle de confiance ★★★

Comme on l'a vu dans le chapitre 11, dans un modèle binomial, avec n assez grand

Intervalle de confiance, $\{x_1, \dots, x_n\}$, $\mathcal{B}(p)$, Wilson

Soit $\mathbf{x} = \{x_1, \dots, x_n\}$ de loi $\mathcal{B}(p)$.

Un intervalle de confiance de niveau α pour p est

$$\left[\frac{1}{1 + \frac{u_{1-\alpha/2}^2}{n}} \left(\hat{p} + \frac{u_{1-\alpha/2}^2}{2n} \right) \pm \frac{u_{1-\alpha/2}}{1 + \frac{u_{1-\alpha/2}^2}{n}} \sqrt{\frac{\hat{p}(1 - \hat{p})}{n} + \frac{u_{1-\alpha/2}^2}{4n^2}} \right]$$

On obtient ces bornes en notant qu'elle correspondent aux p tels que $(\hat{p} - p)^2 = u_{1-\alpha/2}^2 \cdot \frac{p(1-p)}{n}$ qui est l'équation de degré 2

$$\left(1 + \frac{u_{1-\alpha/2}^2}{n} \right) p^2 + \left(-2\hat{p} - \frac{u_{1-\alpha/2}^2}{n} \right) p + \left(\hat{p}^2 \right) = 0 .$$

Intervalle de confiance ★★★

Modèle binomial, avec n assez grand

Intervalle de confiance, $\{x_1, \dots, x_n\}$, $\mathcal{B}(p)$, arcsinus

Soit $\mathbf{x} = \{x_1, \dots, x_n\}$ de loi $\mathcal{B}(p)$.

Un intervalle de confiance de niveau α pour p est

$$\left[\sin^2 \left(\arcsin(\sqrt{\hat{p}}) \pm \frac{u_{1-\alpha/2}}{2\sqrt{n}} \right) \right]$$

L'idée est de noter que comme $\text{Var}[\hat{P}] = \frac{p(1-p)}{n}$,

$$\text{Var} \left(\arcsin \left(\sqrt{P} \right) \right) \approx \frac{\text{Var}(P)}{4p(1-p)} = \frac{p(1-p)}{4np(1-p)} = \frac{1}{4n}.$$

Intervalle de confiance ★★★

Modèle binomial, avec n assez grand

Intervalle de confiance pour $p_x - p_y$ $\mathcal{B}(p_x)$ et $\mathcal{B}(p_y)$, Wald

Soient $\mathbf{x} = \{x_1, \dots, x_m\}$ de loi $\mathcal{B}(p_x)$ et $\mathbf{y} = \{y_1, \dots, y_n\}$ de loi $\mathcal{B}(p_y)$.

Un intervalle de confiance de niveau α pour $p_x - p_y$ est

$$[\text{xxxxxx}]$$

Intervalle de confiance

Si on a deux échantillons, x , $m = 14$ et 12 fois '1' ($\bar{x} = 0.857$) et y , $n = 15$ et 11 fois '1' ($\bar{y} = 0.7333$)

```
1 > library(DescTools)
2 > BinomDiffCI(12, 14, 11, 15, sides = "two.sided",
   method = c("wald", "score"))
3           est      lwr.ci    upr.ci
4 wald  0.1238095 -0.1654654  0.4130845
5 score 0.1238095 -0.1773352  0.3967329
```

Région de rejet I

Soit $n = 9$, on a dans le tableau suivant $f_{\theta}(x)$ pour $x \in \{0, 1, 2, \dots, 7, 8, 9\}$ pour plusieurs valeurs possibles de θ

| | 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
|-----|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 0.1 | 0.387 | 0.387 | 0.172 | 0.045 | 0.007 | 0.001 | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.000 |
| 0.2 | 0.134 | 0.302 | 0.302 | 0.176 | 0.066 | 0.017 | 0.003 | 0.000 | 0.000 | 0.000 |
| 0.3 | 0.040 | 0.156 | 0.267 | 0.267 | 0.172 | 0.074 | 0.021 | 0.004 | 0.000 | 0.000 |
| 0.4 | 0.010 | 0.060 | 0.161 | 0.251 | 0.251 | 0.167 | 0.074 | 0.021 | 0.004 | 0.000 |
| 0.5 | 0.002 | 0.018 | 0.070 | 0.164 | 0.246 | 0.246 | 0.164 | 0.070 | 0.018 | 0.002 |
| 0.6 | 0.000 | 0.004 | 0.021 | 0.074 | 0.167 | 0.251 | 0.251 | 0.161 | 0.060 | 0.010 |
| 0.7 | 0.000 | 0.000 | 0.004 | 0.021 | 0.074 | 0.172 | 0.267 | 0.267 | 0.156 | 0.040 |
| 0.8 | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.003 | 0.017 | 0.066 | 0.176 | 0.302 | 0.302 | 0.134 |
| 0.9 | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.001 | 0.007 | 0.045 | 0.172 | 0.387 | 0.387 |

Région de rejet II

Région de rejet pour un test bilatéral de niveau $\alpha = 10\%$

$H_0 : p = 1/2$ contre $H_1 : p \neq 1/2$

| | 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
|-----|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 0.1 | 0.387 | 0.387 | 0.172 | 0.045 | 0.007 | 0.001 | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.000 |
| 0.2 | 0.134 | 0.302 | 0.302 | 0.176 | 0.066 | 0.017 | 0.003 | 0.000 | 0.000 | 0.000 |
| 0.3 | 0.040 | 0.156 | 0.267 | 0.267 | 0.172 | 0.074 | 0.021 | 0.004 | 0.000 | 0.000 |
| 0.4 | 0.010 | 0.060 | 0.161 | 0.251 | 0.251 | 0.167 | 0.074 | 0.021 | 0.004 | 0.000 |
| 0.5 | 0.002 | 0.018 | 0.070 | 0.164 | 0.246 | 0.246 | 0.164 | 0.070 | 0.018 | 0.002 |
| 0.6 | 0.000 | 0.004 | 0.021 | 0.074 | 0.167 | 0.251 | 0.251 | 0.161 | 0.060 | 0.010 |
| 0.7 | 0.000 | 0.000 | 0.004 | 0.021 | 0.074 | 0.172 | 0.267 | 0.267 | 0.156 | 0.040 |
| 0.8 | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.003 | 0.017 | 0.066 | 0.176 | 0.302 | 0.302 | 0.134 |
| 0.9 | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.001 | 0.007 | 0.045 | 0.172 | 0.387 | 0.387 |

Région de rejet III

Région de rejet pour un test bilatéral de niveau $\alpha = 5\%$

$H_0 : p = 1/2$ contre $H_1 : p \neq 1/2$

| | 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
|-----|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 0.1 | 0.387 | 0.387 | 0.172 | 0.045 | 0.007 | 0.001 | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.000 |
| 0.2 | 0.134 | 0.302 | 0.302 | 0.176 | 0.066 | 0.017 | 0.003 | 0.000 | 0.000 | 0.000 |
| 0.3 | 0.040 | 0.156 | 0.267 | 0.267 | 0.172 | 0.074 | 0.021 | 0.004 | 0.000 | 0.000 |
| 0.4 | 0.010 | 0.060 | 0.161 | 0.251 | 0.251 | 0.167 | 0.074 | 0.021 | 0.004 | 0.000 |
| 0.5 | 0.002 | 0.018 | 0.070 | 0.164 | 0.246 | 0.246 | 0.164 | 0.070 | 0.018 | 0.002 |
| 0.6 | 0.000 | 0.004 | 0.021 | 0.074 | 0.167 | 0.251 | 0.251 | 0.161 | 0.060 | 0.010 |
| 0.7 | 0.000 | 0.000 | 0.004 | 0.021 | 0.074 | 0.172 | 0.267 | 0.267 | 0.156 | 0.040 |
| 0.8 | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.003 | 0.017 | 0.066 | 0.176 | 0.302 | 0.302 | 0.134 |
| 0.9 | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.000 | 0.001 | 0.007 | 0.045 | 0.172 | 0.387 | 0.387 |

Test de proportion

Modèle binomial, avec n assez grand

Test $H_0 : p = p_0$ contre $H_1 : p = p_1$, $\mathcal{B}(p)$

Soit $\mathbf{x} = \{x_1, \dots, x_n\}$ de loi $\mathcal{B}(p)$.

Pour tester $H_0 : p = p_0$ contre $H_1 : p = p_1$, on utilise

$$Z = \frac{(\bar{x} - p_0) - 1/2n}{\sqrt{\frac{p_0(1 - p_0)}{n}}}$$

Si H_0 est vraie, $Z \sim \mathcal{N}(0, 1)$.

- ▶ si $p_1 > p_0$, on rejette H_0 si $z > \Phi^{-1}(1 - \alpha)$
- ▶ si $p_1 < p_0$, on rejette H_0 si $z < \Phi^{-1}(\alpha)$

Test de proportion

Modèle binomial, avec n assez grand

Test $H_0 : p = p_0$ contre $H_1 : p \neq p_0$, $\mathcal{B}(p)$

Soit $\mathbf{x} = \{x_1, \dots, x_n\}$ de loi $\mathcal{B}(p)$.

Pour tester $H_0 : p = p_0$ contre $H_1 : p \neq p_0$, on utilise

$$Z = \frac{(\bar{x} - p_0) - 1/2n}{\sqrt{\frac{p_0(1-p_0)}{n}}}$$

Si H_0 est vraie, $Z \sim \mathcal{N}(0, 1)$.

► on rejette H_0 si $|z| > \Phi^{-1}(1 - \alpha/2)$

Note: on peut remplacer $\hat{p} = \bar{x}$ par $\tilde{p} = \frac{x_1 + \dots + x_n + 2}{n + 4}$

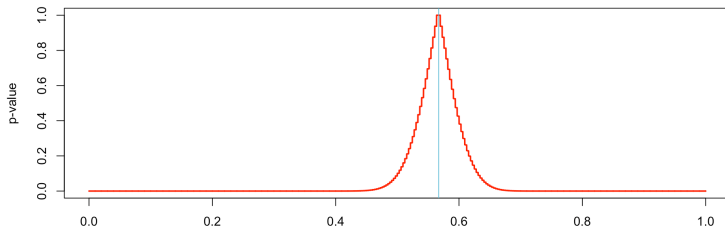
Test de proportion

Considérons un échantillon suivant une loi binomiale $\mathcal{B}(164, 3/5)$

```
1 > set.seed(1)
2 > x = sample(0:1, size=164, probability=c(.4,.6))
3 > binom.test(sum(x),length(x) ,0.6 , alternative ="two
  .sided")
4
5     Exact binomial test
6
7 data:  sum(x) and length(x)
8 number of successes = 93, number of trials = 164, p-
  value = 0.4255
9 alternative hypothesis: true probability of success is
  not equal to 0.6
10 95 percent confidence interval:
11  0.4875629 0.6441149
12 sample estimates:
13 probability of success
14                0.5670732
```

Test de proportion

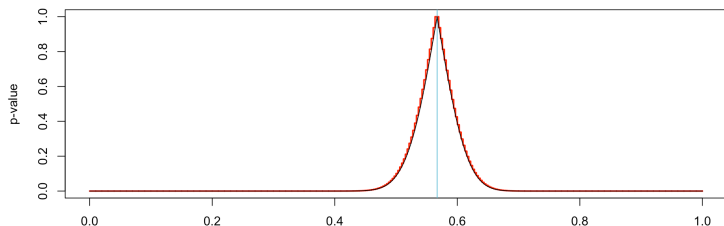
```
1 > binom.test(sum(x),length(x) ,0.5 , alternative ="two
    .sided")
2
3     Exact binomial test
4
5 data:  sum(x) and length(x)
6 number of successes = 93, number of trials = 164, p-
    value = 0.1007
7 alternative hypothesis: true probability of success is
    not equal to 0.5
```



Test de proportion

On peut utiliser la p -value avec une approximation Gaussienne,

$$p - \text{value} = 2 \times \left(1 - \Phi \left(\sqrt{n} \cdot \frac{|\bar{x} - p_0|}{\sqrt{p_0(1 - p_0)}} \right) \right)$$



Test de proportion

Modèle binomial avec 2 échantillons, avec n et m assez grands

Test $H_0 : p_x - p_y = p_0$ contre $H_1 : p_x - p_y = p_1$, $\mathcal{B}(p)$

Soient $\mathbf{x} = \{x_1, \dots, x_m\}$ de loi $\mathcal{B}(p_x)$ et $\mathbf{y} = \{y_1, \dots, y_n\}$ de loi $\mathcal{B}(p_y)$.

Pour tester $H_0 : p_x - p_y = p_0$ contre $H_1 : p_x - p_y = p_1$, on utilise

$$Z = \frac{(\bar{x} - \bar{y}) - p_0}{\sqrt{p(1-p) \left(\frac{1}{m} + \frac{1}{n} \right)}}, \quad p = \frac{m\bar{x} + n\bar{y}}{m+n}$$

Si H_0 est vraie, $Z \sim \mathcal{N}(0, 1)$.

- ▶ si $p_1 > p_0$, on rejette H_0 si $z > \Phi^{-1}(1 - \alpha)$
- ▶ si $p_1 < p_0$, on rejette H_0 si $z < \Phi^{-1}(\alpha)$

Test de proportion

Modèle binomial avec 2 échantillons, avec n et m assez grands

Test $H_0 : p_x - p_y = p_0$ contre $H_1 : p_x - p_y \neq p_0$, $\mathcal{B}(p)$

Soient $\mathbf{x} = \{x_1, \dots, x_m\}$ de loi $\mathcal{B}(p_x)$ et $\mathbf{y} = \{y_1, \dots, y_n\}$ de loi $\mathcal{B}(p_y)$.

Pour tester $H_0 : p_x - p_y = p_0$ contre $H_1 : p_x - p_y \neq p_0$, on utilise

$$Z = \frac{(\bar{x} - \bar{y}) - p_0}{\sqrt{p(1-p)\left(\frac{1}{m} + \frac{1}{n}\right)}}, \quad p = \frac{m\bar{x} + n\bar{y}}{m+n}$$

Si H_0 est vraie, $Z \sim \mathcal{N}(0, 1)$.

► on rejette H_0 si $|z| > \Phi^{-1}(1 - \alpha/2)$

Quelques tests

On peut aussi utiliser les tests sur des lois binomiales dans d'autres contextes. Par exemple, on peut faire un test sur la **médiane**. Pour un échantillon $\mathbf{x} = \{x_1, x_2, \dots, x_n\}$, notons m la médiane.

Test $H_0 : m = m_0$ contre $H_1 : m = m_1$

Soit $\mathbf{x} = \{x_1, \dots, x_n\}$ de même loi (inconnue).

Pour tester $H_0 : m = m_0$ contre $H_1 : m = m_1$, on utilise

$$V = \sum_{i=1}^n d_i^0, \quad d_i^0 = \mathbf{1}(x_i - m_0 > 0) = \begin{cases} 1 & \text{si } x_i > m_0 \\ 0 & \text{si } x_i < m_0 \end{cases}$$

Si H_0 est vraie, V suit une loi binomiale $\mathcal{B}(n, 1/2)$

- ▶ si $m_1 > m_0$, on rejette H_0 si $v > F_n^{-1}(1 - \alpha)$
- ▶ si $m_1 < m_0$, on rejette H_0 si $v < F_n^{-1}(\alpha)$

Où F_n est la fonction de répartition de la loi $\mathcal{B}(n, 1/2)$.

Quelques tests dérivés ★★★

... avec bien entendu la version bilatérale

Test $H_0 : m = m_0$ contre $H_1 : m \neq m_0$

Soit $\mathbf{x} = \{x_1, \dots, x_n\}$ de même loi (inconnue).

Pour tester $H_0 : m = m_0$ contre $H_1 : m \neq m_0$, on utilise

$$V = \sum_{i=1}^n d_i^0, \quad d_i^0 = \mathbf{1}(x_i - m_0 > 0) = \begin{cases} 1 & \text{si } x_i > m_0 \\ 0 & \text{si } x_i < m_0 \end{cases}$$

Si H_0 est vraie, V suit une loi binomiale $\mathcal{B}(n, 1/2)$

► on rejette H_0 si $v > F_n^{-1}(1 - \alpha/2)$ ou $v < F_n^{-1}(\alpha/2)$

Où F_n est la fonction de répartition de la loi $\mathcal{B}(n, 1/2)$.

Quelques tests dérivés ★★★

Classiquement, la p -value dans le cas où $H_1 : m_0 \neq m_1$ sera $p = \mathbb{P}(V > v)$ soit $1 - F_n(v)$.

```
1 > loc = "http://freakonometrics.free.fr/MAT4681/
   blood_pressure.txt"
2 > download.file(loc, "blood_pressure.txt")
3 > blood_pressure = read.table("blood_pressure.txt",
   header=TRUE, sep=",")
4 > median(blood_pressure$mmhg)
5 [1] 134
```

On pourrait tester $m = 120$,

```
1 > mu0 <- 120
2 > d = blood_pressure$mmhg - mu0
3 > n = length(d[d != 0])
4 > v = length(d[d > 0])
5 > mean(d[d != 0] > 0)
6 [1] 0.6111111
7 > v/n
8 [1] 0.6111111
```


Quelques tests dérivés ★★★

On peut aussi avoir un intervalle de confiance pour m

```
1 > MedianCI(blood_pressure$mmhg, sides = "two.sided",  
  method = "exact")  
2 median lwr.ci upr.ci  
3      134      118      141  
4 > MedianCI(blood_pressure$mmhg, sides = "two.sided",  
  method = "boot")  
5 median lwr.ci upr.ci  
6      134      127      150
```

Quelques tests dérivés ★★★

```
1 > binom.test(v,n,0.5,alternative="greater")
2
3   Exact binomial test
4
5 data:  v and n
6 number of successes = 33, number of trials = 54, p-
   value = 0.06684
7 alternative hypothesis: true probability of success is
   greater than 0.5
8 95 percent confidence interval:
9  0.490144 1.000000
```

Quelques tests dérivés ★★★

```
1 > binom.test(v,n,0.5,alternative="two.sided")
2
3   Exact binomial test
4
5 data:  v and n
6 number of successes = 33, number of trials = 54, p-
   value = 0.1337
7 alternative hypothesis: true probability of success is
   not equal to 0.5
8 95 percent confidence interval:
9   0.4687878 0.7408017
```

Quelques tests dérivés ★★★

Test $H_0 : m = m_0$ contre $H_1 : m \neq m_0$

Soit $\mathbf{x} = \{x_1, \dots, x_n\}$ de même loi inconnue, de médiane m .
Pour tester $H_0 : m = m_0$ contre $H_1 : m \neq m_0$ on utilise la statistique de test

$$w_+ = \sum_{i=1}^n r_i \mathbf{1}_{\mathbb{R}_+}(x_i - m_0) = \sum_{i=1}^n r_i \mathbf{1}(x_i > m_0)$$

où r_i est le rang de x_i dans l'échantillon \mathbf{x} .

Si $n > 20$, W_+ suit (approximativement) une loi normale, i.e.

$$Z = \frac{W_+ - n(n+1)/4}{\sqrt{n(n+1)(2n+1)/24}} \approx \mathcal{N}(0, 1)$$

► on rejette H_0 si $z > \Phi^{-1}(1 - \alpha/2)$ ou $z < \Phi^{-1}(\alpha/2)$

Quelques tests dérivés ★★★

```
1 > wilcox.test(blood_pressure$mmhg, mu=120, exact=FALSE,
2               correct=TRUE, alternative="two.sided")
3
4   Wilcoxon signed rank test with continuity correction
5
6 data:  blood_pressure$mmhg
7 V = 1144.5, p-value = 0.0005441
8
9 alternative hypothesis: true location is not equal to
10    120
```

Quelques tests dérivés ★★★

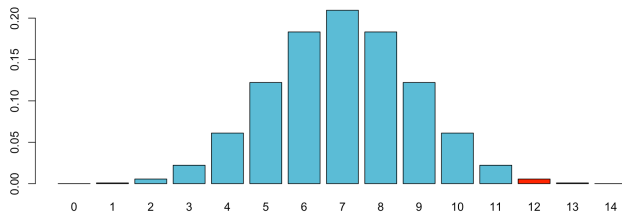
Comment faire quand on a peu d'observations (n) ? Paul de Poulpe
"sur 14 prédictions au total, 12 se sont révélées exactes"

On peut vouloir tester $H_0 : p = 1/2$ contre $H_1 : p > 1/2$.

```
1 > paul = c(rep(1,12),rep(0,2))
2 > binom.test(12 ,14 ,0.5 , alternative ="greater")
3
4     Exact binomial test
5
6 data:  12 and 14
7 number of successes = 12, number of trials = 14, p-
   value = 0.00647
8 alternative hypothesis: true probability of success is
   greater than 0.5
9 95 percent confidence interval:
10  0.6146103 1.0000000
11 sample estimates:
12 probability of success
13           0.8571429
```

Quelques tests dérivés ★★★

```
1 > 1 - pbinom(11,size = 14, prob = .5)
2 [1] 0.006469727
```



Intervalle de confiance pour des comptages

Intervalle de confiance, loi de Poisson $\mathcal{P}(\mu)$

Soit $\mathbf{x} = \{x_1, \dots, x_n\}$ de loi $\mathcal{P}(\mu)$. Si n est grand, un intervalle de confiance de niveau α pour μ est

$$\left[\bar{x} \pm u_{1-\alpha/2} \sqrt{\frac{\bar{x}}{n}} \right]$$

```
1 > set.seed(1)
2 > x = rpois(n = 60, lambda = 5)
3 > mean(x)
4 [1] 5.066667
5 > PoissonCI(sum(x), length(x), sides = "two.sided",
6             method = c("exact", "score", "wald"))
6             est      lwr.ci    upr.ci
7 exact 5.066667 4.513061 5.669440
8 score 5.066667 4.528228 5.669130
9 wald 5.066667 4.497114 5.636219
```


Intervalle de confiance pour des comptages ★★★

Intervalle de confiance, loi de Poisson $\mathcal{P}(\mu)$

Soit $\mathbf{x} = \{x_1, \dots, x_n\}$ de loi $\mathcal{P}(\mu)$. Si n est grand, un intervalle de confiance de niveau α pour μ est

$$\left[\frac{1}{2} Q_{2n\bar{x}}^{-1}(\alpha/2) ; \frac{1}{2} Q_{2(n\bar{x}+1)}^{-1}(1 - \alpha/2) \right]$$

où $Q_{\nu}^{-1}(u)$ est le quantile de niveau u de la loi du chi-deux à ν degrés de liberté.

Test pour des comptages

Modèle de Poisson avec 1 échantillon avec n assez grand

Test $H_0 : \mu = \mu_0$ contre $H_1 : \mu = \mu_1$, $\mathcal{P}(\mu)$

Soit $\mathbf{x} = \{x_1, \dots, x_n\}$ de loi $\mathcal{P}(\mu)$.

Pour tester $H_0 : \mu = \mu_0$ contre $H_1 : \mu = \mu_1$, on utilise

xxxxxx

Si H_0 est vraie, $Z \sim \mathcal{N}(0, 1)$.

► on rejette H_0 si $|z| > \Phi^{-1}(1 - \alpha/2)$

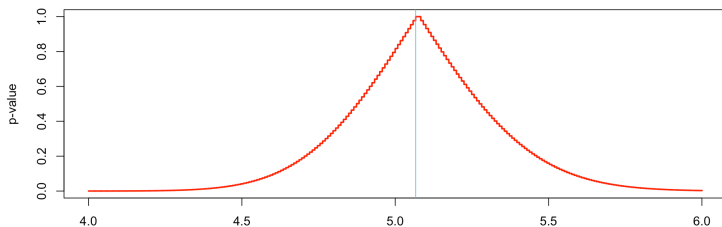
Test pour des comptages

```
1 > poisson.test(sum(x), length(x), r = 5, alternative =  
  "two.sided")  
2  
3   Exact Poisson test  
4  
5 data:  sum(x) time base: length(x)  
6 number of events = 304, time base = 60, p-value =  
  0.8173  
7 alternative hypothesis: true event rate is not equal  
  to 5  
8 95 percent confidence interval:  
9  4.513061 5.669440  
10 sample estimates:  
11 event rate  
12  5.066667
```

Test pour des comptages

```
1 > poisson.test(sum(x), length(x), r = 6, alternative =  
  "two.sided")  
2  
3 number of events = 304, time base = 60, p-value =  
  0.002657  
4 alternative hypothesis: true event rate is not equal  
  to 6
```

On peut visualiser l'évolution de la p -value du test $H_0 : \mu = \mu_0$ contre $H_1 : \mu \neq \mu_0$, en fonction de μ_0



Test pour des comptages

Modèle de Poisson avec 2 échantillons, avec n et m assez grands

Test $H_0 : \mu_x - \mu_y = p_0$ contre $H_1 : \mu_x - \mu_y \neq p_0$, $\mathcal{P}(\mu)$

Soient $\mathbf{x} = \{x_1, \dots, x_m\}$ de loi $\mathcal{P}(\mu_x)$ et $\mathbf{y} = \{y_1, \dots, y_n\}$ de loi $\mathcal{P}(\mu_y)$.

Pour tester $H_0 : \mu_x = \mu_y$ contre $H_1 : \mu_x \neq \mu_y$, on utilise

$$Z = \frac{\bar{x} - \bar{y}}{\sqrt{m\bar{x} + n\bar{y}}}$$

Si H_0 est vraie, $Z \sim \mathcal{N}(0, 1)$.

► on rejette H_0 si $|z| > \Phi^{-1}(1 - \alpha/2)$

Test pour des comptages ★★★

```
1 > mean(x)
2 [1] 5.066667
3 > library(vcd)
4 > goodfit(x, type = "poisson", method = "ML")
5
6 Observed and fitted values for poisson distribution
7 with parameters estimated by 'ML'
8
9 count observed      fitted pearson residual
10      0         0  0.3782038      -0.61498275
11      1         2  1.9162325       0.06051336
12      2         4  4.8544557      -0.38781027
13      3         7  8.1986364      -0.41861679
14      4        12 10.3849394       0.50117205
15      5        10 10.5234053      -0.16134664
16      6        11  8.8864311       0.70901059
17      7         8  6.4320835       0.61822577
18      8         3  4.0736529      -0.53195130
19      9         2  2.2933157      -0.19368829
20     10         0  1.1619466      -1.07793628
21     11         1  0.5351997       0.10909110
```

Test pour des comptages ★★★

```
1 > plot(goodfit(x, type = "poisson", method = "ML"))
```

On peut comparer l'histogramme empirique des x_i , et la fréquence théorique de la loi de Poisson $\mathcal{P}(\mu)$,

