

# 1 Le modèle

On a un modèle génératif  $M$  complexe qui se décompose en trois morceaux  $M = (M_1, M_2, M_3)$  comme suit :

$$M_1 : Y|X^{I_1}, X^{I_2}, Z \sim X^{I_1} A_{I_1} + X^{I_2} A_{I_2} + \varepsilon \quad (1)$$

$$M_2 : X^{I_2}|X^{I_1}, Z \sim X^{I_1} B_{I_1}^{I_2} + \varepsilon_{X^{I_2}} \quad (2)$$

$$M_3 : X^{I_1}|Z \sim GM(\alpha) \quad (3)$$

On pose  $\theta = (\alpha, \Sigma, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}, A_{I_1}, A_{I_2})$  Pour un  $Z$  donné on a donc

$$P_{M,Z}(Y, X^{I_1}, X^{I_2}|\theta) = P_{M,Z}(X^{I_1}|\theta)P_{M,Z}(X^{I_2}|X^{I_1};\theta)P_{M,Z}(Y|X^{I_2}, X^{I_1};\theta) \quad (4)$$

$$= P_{M_3,Z}(X^{I_1}|\alpha)P_{M_1,M_2,Z}(X^{I_2}|X^{I_1};\Sigma, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}, A_{I_1}, A_{I_2})P_{M_1,M_2,Z}(Y|X^{I_2}, X^{I_1};\Sigma, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}, A_{I_1}, A_{I_2}) \quad (5)$$

$P_{M_3,Z}(X^{I_1}|\alpha)$  vit tout seul et est estimé par Mixmod. On sait également que

$$P_{M_2,Z}(X^{I_2}|X^{I_1};\Sigma, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}, A_{I_1}, A_{I_2}) = P_{M_2,Z}(X^{I_2}|X^{I_1};\Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}) \text{ et} \quad (6)$$

$$P_{M_1,Z}(Y|X^{I_2}, X^{I_1};\Sigma, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}, A_{I_1}, A_{I_2}) = P_{M_1,Z}(Y|X^{I_2}, X^{I_1};\Sigma, A_{I_1}, A_{I_2}) \quad (7)$$

De manière générale les gens s'arrêtent là, et obtiennent le modèle complet... qui ne tient pas compte de la structure. Mais nous, nous ne sommes pas juste sous  $M_2$  pour les sous-régression ni juste sous  $M_1$  pour  $Y$ . Donc la dépendance persiste (c'est ce qui permet que la contrainte aie une utilité, sinon elle serait inutile).

Du coup, il faut définir proprement  $P_{M_1,M_2,Z}(X^{I_2}|X^{I_1};\Sigma, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}, A_{I_1}, A_{I_2})$  et  $P_{M_1,M_2,Z}(Y|X^{I_2}, X^{I_1};\Sigma, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}, A_{I_1}, A_{I_2})$ . Or il semble que ces vraisemblances ne soient pas explicites.

Vu que  $P_{M_1,M_2,Z}(X^{I_2}|X^{I_1};\theta) \neq P_{M_2,Z}(X^{I_2}|X^{I_1};\theta)$  et  $P_{M_1,M_2,Z}(Y|X^{I_2}, X^{I_1};\theta) \neq P_{M_1,Z}(Y|X^{I_2}, X^{I_1};\theta)$ , on se limite donc à une décomposition partielle de la vraisemblance et on obtient :

$$P_{M,Z}(Y, X^{I_1}, X^{I_2}|\theta) = P_{M_3,Z}(X^{I_1}|\alpha)P_{M_1,M_2,Z}(Y, X^{I_2}|X^{I_1};\Sigma, A_{I_1}, A_{I_2}, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}) \quad (8)$$

Pour alléger les notations, on va pour la suite de cette partie considérer les individus séparément (sans perte de généralité vu qu'ils sont *i.i.d*). On a alors  $Y$  scalaire et  $X$  vecteur de taille  $p$ . Le second membre suit une loi normale mulivariée :

$$(Y, X^{I_2}|X^{I_1}) \sim \mathcal{N} \left( \begin{pmatrix} X^{I_1}(A_{I_1} + B_{I_1}^{I_2}A_{I_2}) \\ (X^{I_1}B_{I_1}^{I_2})^t \end{pmatrix}; \begin{pmatrix} \sigma_Y^2 + \sum_{i \in I_2} (\sigma_i^2 a_i^2) & \dots & a_j \sigma_j^2 & \dots \\ \vdots & \ddots & 0 & 0 \\ a_j \sigma_j^2 & 0 & \sigma_j^2 & 0 \\ \vdots & 0 & 0 & \ddots \end{pmatrix} \right) = \mathcal{N} \left( \begin{pmatrix} X^{I_1}(A_{I_1} + B_{I_1}^{I_2}A_{I_2}) \\ (X^{I_1}B_{I_1}^{I_2})^t \end{pmatrix}; \begin{pmatrix} \sigma_Y^2 + \sum_{i \in I_2} (\sigma_i^2 a_i^2) & \dots & a_j \sigma_j^2 \dots \\ \vdots & & \\ a_j \sigma_j^2 & & \Sigma_X^{I_2} \\ \vdots & & \end{pmatrix} \right) \quad (9)$$

On note  $\bar{\Sigma}$  la matrice de variance-covariance correspondante Avec par conséquent une vraisemblance de la forme :

$$P_{M_1, M_2, Z}(Y, X^{I_2} | X^{I_1}; \Sigma, A_{I_1}, A_{I_2}, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}) = \mathcal{L}_{M_1, M_2, Z}(\Sigma, A_{I_1}, A_{I_2}, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}; Y, X^{I_2} | X^{I_1}) \quad (10)$$

$$= \frac{1}{(2\pi)^{\frac{p_2+1}{2}} |\bar{\Sigma}|^{\frac{1}{2}}} \exp \left( -\frac{1}{2} \begin{pmatrix} Y - X^{I_1}(A_{I_1} + B_{I_1}^{I_2} A_{I_2}) \\ (X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2})^t \end{pmatrix}^t \bar{\Sigma}^{-1} \begin{pmatrix} Y - X^{I_1}(A_{I_1} + B_{I_1}^{I_2} A_{I_2}) \\ (X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2})^t \end{pmatrix} \right) \quad (11)$$

avec  $|\bar{\Sigma}|$  le déterminant de  $\bar{\Sigma}$ .

On passe à la log-vraisemblance :

$$L_{M_1, M_2, Z}(\Sigma, A_{I_1}, A_{I_2}, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}; Y, X^{I_2} | X^{I_1}) = -\frac{1}{2} \left[ (p_2 + 1) \ln(2\pi) + \ln(|\bar{\Sigma}|) + \begin{pmatrix} Y - X^{I_1}(A_{I_1} + B_{I_1}^{I_2} A_{I_2}) \\ (X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2})^t \end{pmatrix}^t \bar{\Sigma}^{-1} \begin{pmatrix} Y - X^{I_1}(A_{I_1} + B_{I_1}^{I_2} A_{I_2}) \\ (X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2})^t \end{pmatrix} \right] \quad (12)$$

## 2 estimation

On veut maximiser la vraisemblance sous la contrainte  $A_{I_1} + B_{I_1}^{I_2} A_{I_2} = \hat{A}_{I_1}$  où  $\hat{A}_{I_1}$  a été préalablement calculé lors de l'étape explicative. Cette contrainte n'est pas linéaire mais devient linéaire si on se limite à  $A$  ou à  $B$ . On va donc procéder par optimisation alternée, en maximisant la vraisemblance pour un  $B$  fixé puis en recommençant avec le  $A$  obtenu, et ainsi de suite. La contrainte étant d'égalité, on utilisera le théorème de Lagrange. La partie de la vraisemblance relative à  $X^{I_1}$  ne dépend pas de la contrainte ni de l'autre membre et on la maximise donc en amont par Mixmod.

On commence par expliciter la matrice  $\bar{\Sigma}^{-1}$

$$\bar{\Sigma} = \begin{pmatrix} E & C^t \\ C & \Sigma_{X^{I_2}} \end{pmatrix} \quad (13)$$

$$E = \sigma_Y^2 + \sum_{i \in I_2} (\sigma_i^2 A_i^2) = \sigma_Y^2 + A_{I_2}^t \Sigma_{X^{I_2}} A_{I_2} \text{ scalaire} \quad (14)$$

$$C = \begin{pmatrix} \vdots \\ a_i \sigma_i^2 \\ \vdots \end{pmatrix} = \Sigma_{X^{I_2}} A_{I_2} \text{ de taille } p_2 \times 1 \quad (15)$$

$$C^t = A_{I_2}^t \Sigma_{X^{I_2}}^t = A_{I_2}^t \Sigma_{X^{I_2}} \text{ de taille } 1 \times p_2 \quad (16)$$

On a donc à l'aide du complément de Schur :

$$\bar{\Sigma}^{-1} = \begin{pmatrix} [E - C^t \Sigma_{X^{I_2}}^{-1} C]^{-1} & \cdot \\ -\Sigma_{X^{I_2}}^{-1} C (E - C^t \Sigma_{X^{I_2}}^{-1} C)^{-1} & [\Sigma_{X^{I_2}}^{-1} + \Sigma_{X^{I_2}}^{-1} C (E - C^t \Sigma_{X^{I_2}}^{-1} C)^{-1} C^t \Sigma_{X^{I_2}}^{-1}] \end{pmatrix} \text{ matrice symétrique} \quad (17)$$

Le complément de Schur est récurrent, on le note  $S = E - C^t \Sigma_{X^{I_2}}^{-1} C$ . Après calculs on obtient  $S^{-1} = \frac{1}{\sigma_Y^2}$  On obtient alors :

$$-\Sigma_{X^{I_2}}^{-1} C (E - C^t \Sigma_{X^{I_2}}^{-1} C)^{-1} = -\Sigma_{X^{I_2}}^{-1} C S^{-1} = -\Sigma_{X^{I_2}}^{-1} \Sigma_{X^{I_2}} A_{I_2} S^{-1} = -\frac{1}{\sigma_Y^2} A_{I_2} \text{ de taille } p_2 \times 1 \quad (18)$$

et enfin :

$$[\Sigma_{X^{I_2}}^{-1} + \Sigma_{X^{I_2}}^{-1} C (E - C^t \Sigma_{X^{I_2}}^{-1} C)^{-1} C^t \Sigma_{X^{I_2}}^{-1}] = \Sigma_{X^{I_2}}^{-1} + \frac{1}{\sigma_Y^2} A_{I_2} A_{I_2}^t \Sigma_{X^{I_2}} \Sigma_{X^{I_2}}^{-1} = \Sigma_{X^{I_2}}^{-1} + \frac{1}{\sigma_Y^2} A_{I_2} A_{I_2}^t \text{ matrice symétrique pleine} \quad (19)$$

On a donc :

$$\bar{\Sigma}^{-1} = \begin{pmatrix} \frac{1}{\sigma_Y^2} & -\frac{1}{\sigma_Y^2} A_{I_2}^t \\ -\frac{1}{\sigma_Y^2} A_{I_2} & [\Sigma_{X^{I_2}}^{-1} + \frac{1}{\sigma_Y^2} A_{I_2} A_{I_2}^t] \end{pmatrix} \text{ matrice symétrique pleine} \quad (20)$$

On note  $\Sigma_{X^{I_2}(-k)}$  la matrice  $\Sigma_X^{I_2}$  dépourvue de la ligne  $k$  et de la colonne  $k$ . On note  $\bar{\Sigma}(-1, -k)$  la matrice  $\bar{\Sigma}$  dépourvue de sa première colonne et de sa ligne  $k$ . On a alors

$$|\bar{\Sigma}| = (\sigma_Y^2 + A_{I_2}^t \Sigma_{X^{I_2}} A_{I_2}) |\Sigma_X^{I_2}| + \sum_{k=1}^{p_2} (-1)^k A_{I_2(k)} \sigma_{I_2(k)}^2 |\bar{\Sigma}(-1, -(k+1))| \text{ développement 1 colonne} \quad (21)$$

$$= (\sigma_Y^2 + A_{I_2}^t \Sigma_{X^{I_2}} A_{I_2}) |\Sigma_X^{I_2}| + \sum_{k=1}^{p_2} (-1)^k A_{I_2(k)} \sigma_{I_2(k)}^2 [(-1)^{k+1} A_{I_2(k)} \sigma_{I_2(k)}^2 \frac{1}{\sigma_{I_2(k)}^2} \prod_{j \in I_2} \sigma_j^2] \text{ developpements k colonne} \quad (22)$$

$$= \sigma_Y^2 \prod_{j \in I_2} \sigma_j^2 + \sum_{k=1}^{p_2} A_{I_2(k)}^2 \sigma_{I_2(k)}^2 \prod_{j \in I_2} \sigma_j^2 - \sum_{k=1}^{p_2} A_{I_2(k)}^2 \sigma_{I_2(k)}^2 \prod_{j \in I_2} \sigma_j^2 \quad (23)$$

$$= \sigma_Y^2 \prod_{j \in I_2} \sigma_j^2 \quad (24)$$

On peut donc calculer plus finement la log-vraisemblance :

$$L_{M,Z}(\Sigma, A_{I_1}, A_{I_2}, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}; Y, X^{I_2} | X^{I_1}) = -\frac{1}{2} \left[ (p_2 + 1) \ln(2\pi) + \ln(|\bar{\Sigma}|) + \begin{pmatrix} Y - X^{I_1} (A_{I_1} + B_{I_1}^{I_2} A_{I_2}) \\ (X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2})^t \end{pmatrix}^t \bar{\Sigma}^{-1} \begin{pmatrix} Y - X^{I_1} (A_{I_1} + B_{I_1}^{I_2} A_{I_2}) \\ (X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2})^t \end{pmatrix} \right] \quad (25)$$

$$= \dots \quad (26)$$

$$= -\frac{1}{2} \left[ (p_2 + 1) \ln(2\pi) + \ln(|\bar{\Sigma}|) + (X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2}) \Sigma_{X^{I_2}}^{-1} (X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2})^t + \frac{1}{\sigma_Y^2} (Y - XA)^2 \right] \quad (27)$$

## 2.1 initialisation

On commence par choisir une valeur de  $B$ . On pourrait en prendre une arbitraire, mais on choisit de commencer par le  $B$  obtenu par estimation indépendante des sous-régressions (par maximisation de  $P_{M_2, Z}(X^{I_2}|X^{I_1}; \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2})$ ). Cela peut se faire par moindres carrés classiques appliqués de manière indépendante à chacune des sous-régressions.

## 2.2 étape A

pour cette étape, les paramètres  $\Sigma_{X^{I_2}}$  et  $B_{I_1}^{I_2}$  sont fixés. On se ramène à la maximisation de

$$\max_A f(A) = \max_A L_{M_1, M_2, Z}(\Sigma, A_{I_1}, A_{I_2}, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}; Y, X^{I_2}|X^{I_1}) \quad (28)$$

$$s.c. \quad A_{I_1} + B_{I_1}^{I_2} A_{I_2} - \hat{A}_{I_1} = 0 \quad (29)$$

En notant  $\psi(A) = A_{I_1} + B_{I_1}^{I_2} A_{I_2} - \hat{A}_{I_1} = B_{I_1} A - \hat{A}_{I_1}$  la contrainte, le théorème de Lagrange permet de dire qu'il existe un unique  $\lambda$  pour lequel résoudre notre maximisation sous contrainte revient à résoudre :

$$g(A, \lambda) = \nabla f(A, \sigma_Y^2) + \lambda \nabla \psi(A) = 0 \quad (30)$$

pour  $i \in I$  :

$$\frac{\partial g(A, \lambda, \sigma_Y^2)}{\partial A_i} = \frac{\partial}{\partial A_i} \left( -\frac{1}{2\sigma_Y^2} (Y - XA)^t (Y - XA) + \lambda (B_{I_1} A - \hat{A}_{I_1}) \right) \quad (31)$$

$$= -\frac{1}{2\sigma_Y^2} \left( -2(X^i)^t Y + 2(X^i)^t XA \right) + \lambda B_{I_1}^i \quad (32)$$

$$= \frac{1}{\sigma_Y^2} (X^i)^t (Y - XA) + \lambda B_{I_1}^i \quad (33)$$

On a pour  $i \in I_1$  :  $\lambda B_{I_1}^i = \lambda_i$  et pour  $i \in I_2$  :  $\lambda B_{I_1}^i = \sum_{j \in I_1} \lambda_j B_{j,i}$   
et  $\forall i \in I_1$  on a :

$$\frac{\partial g(A, \lambda, \sigma_Y^2)}{\partial \lambda_i} = \frac{\partial \lambda \psi(A)}{\partial \lambda_i} = (B_i A - \hat{A}_i) = A_i + \sum_{j \in I_2} B_{i,j} A_j - \hat{A}_i \quad (34)$$

$$\frac{\partial g(A, \lambda, \sigma_Y^2)}{\partial \sigma_Y} = -\frac{1}{2} \frac{\partial}{\partial \sigma_Y} \left( \ln(\sigma_Y^2 \prod_{j \in I_2} \sigma_j^2) + \frac{1}{\sigma_Y^2} (Y - XA)^t (Y - XA) \right) = -\frac{1}{2} \left[ \frac{2}{\sigma_Y} - \frac{2}{\sigma_Y^3} (Y - XA)^t (Y - XA) \right] \quad (35)$$

$$= \frac{1}{\sigma_Y^3} (Y - XA)^t (Y - XA) - \frac{1}{\sigma_Y} \quad (36)$$

On revient maintenant à la notation matricielle  $Y$  vecteur de taille  $n$  et  $X$  matrice de taille  $n \times p$ . On a donc un système à résoudre de la forme (individus iid+log-vraisemblance)

$$n(A_{I_1} + B_{I_1}^{I_2} A_{I_2} - \hat{A}_{I_1}) = 0 \quad (37)$$

$$\frac{1}{\sigma_Y^2} (X^{I_1})^t (Y - X^{I_1} A_{I_1} - X^{I_2} A_{I_2}) + n\lambda^t = 0 \quad (38)$$

$$\frac{1}{\sigma_Y^2} (X^{I_2})^t (Y - X^{I_1} A_{I_1} - X^{I_2} A_{I_2}) + n(B_{I_1}^{I_2})^t \lambda^t = 0 \quad (39)$$

$$\frac{1}{\sigma_Y^3} (Y - XA)^t (Y - XA) - \frac{n}{\sigma_Y} = 0 \quad (40)$$

On annule la différentielle de la vraisemblance, qui est la somme des vraisemblances des individus donc par linéarité de la différentielle on annule la somme des différentielles des vraisemblances des individus.

ce système s'écrit également :

$$A_{I_1} = \hat{A}_{I_1} - B_{I_1}^{I_2} A_{I_2} \quad (41)$$

$$\frac{1}{\sigma_Y^2} (X^{I_1})^t (Y - X^{I_1} (\hat{A}_{I_1} - B_{I_1}^{I_2} A_{I_2}) - X^{I_2} A_{I_2}) + n\lambda^t = 0 \quad (42)$$

$$\frac{1}{\sigma_Y^2} (X^{I_2})^t (Y - X^{I_1} (\hat{A}_{I_1} - B_{I_1}^{I_2} A_{I_2}) - X^{I_2} A_{I_2}) + n(B_{I_1}^{I_2})^t \lambda^t = 0 \quad (43)$$

$$\sigma_Y^2 = \frac{1}{n} (Y - XA)^t (Y - XA) \quad (44)$$

On en déduit :

$$n\lambda^t = -\frac{1}{\sigma_Y^2} (X^{I_1})^t (Y - X^{I_1} A_{I_1} - X^{I_2} A_{I_2}) \quad (45)$$

$$\text{d'où } 0 = \sigma_Y^2 \frac{1}{\sigma_Y^2} (X^{I_2})^t (Y - X^{I_1} (\hat{A}_{I_1} - B_{I_1}^{I_2} A_{I_2}) - X^{I_2} A_{I_2}) - \sigma_Y^2 \frac{1}{\sigma_Y^2} (B_{I_1}^{I_2})^t (X^{I_1})^t (Y - X^{I_1} A_{I_1} - X^{I_2} A_{I_2}) \quad (46)$$

$$0 = (X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2})^t (Y - X^{I_1} \hat{A}_{I_1} - (X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2}) A_{I_2}) \quad (47)$$

$$\text{d'où } (X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2})^t (Y - X^{I_1} \hat{A}_{I_1}) = (X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2})^t (X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2}) A_{I_2} \quad (48)$$

$$\text{et enfin } \hat{A}_{I_2} = \left( (X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2})^t (X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2}) \right)^{-1} (X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2})^t (Y - X^{I_1} \hat{A}_{I_1}) \quad (49)$$

$$\text{puis } \hat{A}_{I_1} = \hat{A}_{I_1} - B_{I_1}^{I_2} A_{I_2} \quad (50)$$

On remarque que  $(X^{I_2} - X^{I_1} B_{I_1}^{I_2}) = \varepsilon_{X^{I_2}}$  résidu des sous-régressions et que  $Y - X^{I_1} \hat{A}_{I_1} = \tilde{\varepsilon}$  résidu du modèle explicatif. On se contente donc en fait d'estimer les résidus du modèle explicatif par une seconde régression linéaire.

$$Y - X^{I_1} \hat{A}_{I_1} = \varepsilon_{X^{I_2}} A_{I_2} + \varepsilon_Y \quad (51)$$

$\sigma_Y$  se calcule tout simplement comme l'écart-type empirique du résidu de la régression :  $\hat{\sigma}_Y^2 = \frac{1}{n}(Y - X\hat{A})^t(Y - X\hat{A})$ .

De ce fait, on peut utiliser tout estimateur et méthode de sélection propre à la régression linéaire en l'appliquant à ces données modifiées. Ce modèle est appelé modèle prédictif. L'idée est maintenant d'optimiser  $B$  sachant  $A$  pour ensuite venir recalculer ce modèle, et ainsi de suite jusqu'à convergence vers le maximum de vraisemblance de la loi jointe du modèle (M).

### 2.3 étape B

Pour cette étape, les paramètres  $\Sigma, A_{I_1}$  et  $A_{I_2}$  sont fixés (ici aussi, la connaissance de  $A$  permet d'obtenir le  $\Sigma$  associé). Comme pour l'étape A, on va résoudre :

$$\nabla f(B) + \lambda \nabla \psi(B) = 0 \quad (52)$$

où  $f(B) = L_{M_1, M_2, Z}(\Sigma, A_{I_1}, A_{I_2}, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}; Y, X^{I_2} | X^{I_1})$

$$g(B, \lambda, \Sigma_{X^{I_2}}) = \nabla f(B, \Sigma_{X^{I_2}}) + \lambda \nabla \psi(B) = 0 \quad (53)$$

On note  $I_1^j = \{i \in I_1 | Z_{i,j} \neq 0\}$ . Alors  $\forall j \in I_2, \forall i \in I_1^j$  :

$$\frac{\partial g(B, \lambda, \Sigma_{X^{I_2}})}{\partial B_{i,j}} = \frac{\partial}{\partial B_{i,j}} \sum_{k=1}^n \left( -\frac{1}{2} [(X_k^{I_2} - X_k^{I_1} B_{I_1}^{I_2}) \Sigma_{X^{I_2}}^{-1} (X_k^{I_2} - X_k^{I_1} B_{I_1}^{I_2})^t] \right) + n \frac{\partial}{\partial B_{i,j}} (\lambda (B_{I_1} A - \hat{A})) \quad (54)$$

$$= -\frac{1}{2} \frac{\partial}{\partial B_{i,j}} \left( \sum_{l \in I_2} \frac{1}{\sigma_l^2} (X^l - \sum_{k \in I_1} X^k B_{k,l})^t (X^l - \sum_{k \in I_1} X^k B_{k,l}) \right) + n \lambda_i A_j \quad (55)$$

$$= \frac{1}{\sigma_j^2} (X^j - \sum_{k \in I_1} X^k B_{k,j})^t X^i + n \lambda_i A_j \quad (56)$$

$$= \frac{1}{\sigma_j^2} (X^j - \sum_{k \in I_1^j} X^k B_{k,j})^t X^i + n \lambda_i A_j \quad (57)$$

$$\frac{\partial g(B, \lambda, \Sigma_{X^{I_2}})}{\partial B_{I_1^j}^j} = \frac{1}{\sigma_j^2} (X^{I_1^j})^t (X^j - X^{I_1^j} B_{I_1^j}^j) + n A_j \lambda_{I_1^j}^t \quad (58)$$

avec  $\lambda_{I_1^j}$  qui désigne le vecteur des  $\lambda_i$  associés aux éléments de  $I_1^j$ . et pour tout  $i \in I_1$  :

$$\frac{\partial g(B, \lambda, \Sigma_{X^{I_2}})}{\partial \lambda_i} = \frac{\partial \lambda \psi(B)}{\partial \lambda_i} = (B_i A - \hat{A}_i) = n(A_i + \sum_{j \in I_2} B_{i,j} A_j - \hat{A}_i) = 0 \quad (59)$$

$$\frac{\partial g(B, \lambda, \Sigma_{X^{I_2}})}{\partial \sigma_j} = -\frac{1}{2} \left[ \frac{\partial}{\partial \sigma_j} \left( \sum_{i=1}^n \sum_{k \in I_2} \frac{1}{\sigma_k^2} (X_i^k - X_i^{I_1} B_{I_1}^k)^2 \right) + n \frac{\partial}{\partial \sigma_j} \ln(\sigma_Y^2 \prod_{j \in I_2} \sigma_j^2) \right] \quad (60)$$

$$= -\frac{1}{2} \left[ -\frac{2}{\sigma_j^3} \sum_{i=1}^n (X_i^j - X_i^{I_1} B_{I_1}^j)^2 + n \frac{2}{\sigma_j} \right] = n \frac{1}{\sigma_j} - \frac{1}{\sigma_j^3} (X^j - X^{I_1} B_{I_1}^j)^t (X^j - X^{I_1} B_{I_1}^j) \quad (61)$$

$$= n \frac{1}{\sigma_j} - \frac{1}{\sigma_j^3} (X^j - X^{I_1} B_{I_1}^j)^t (X^j - X^{I_1} B_{I_1}^j) \quad (62)$$

Et donc on obtient le système :

$$\forall j \in I_2 : \frac{1}{\sigma_j^2} (X^{I_1^j})^t (X^j - X^{I_1} B_{I_1}^j) + A_j n \lambda_{I_1^j}^t = 0 \quad (63)$$

$$A_{I_1} + \sum_{j \in I_2} A_j B_{I_1}^j - \hat{A}_{I_1} = 0 \quad (64)$$

$$\forall j \in I_2 : \sigma_j^2 = \frac{1}{n} (X^j - X^{I_1} B_{I_1}^j)^t (X^j - X^{I_1} B_{I_1}^j) \quad (65)$$

On a donc

$$\frac{1}{\sigma_j^2} (X^{I_1^j})^t X^j - \frac{1}{\sigma_j^2} (X^{I_1^j})^t X^{I_1} B_{I_1}^j + A_j n \lambda_{I_1^j}^t = 0 \quad (66)$$

$$(X^{I_1^j})^t X^{I_1} B_{I_1}^j = \sigma_j^2 \frac{1}{\sigma_j^2} (X^{I_1^j})^t X^j + \sigma_j^2 A_j n (\lambda_{I_1^j})^t \quad (67)$$

$$B_{I_1}^j = \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1} \right)^{-1} \left[ (X^{I_1^j})^t X^j + \sigma_j^2 A_j n (\lambda_{I_1^j})^t \right] \quad (68)$$

On constate ici que si  $A_j$  ou  $\sigma_j$  est nul, alors on revient à l'estimateur des moindres carrés classiques pour la sous-régression concernée. On peut donc continuer en supposant que  $A_j$  et  $\sigma_j$  sont strictement non nuls (puisque sinon, on connaît les  $B_{i,j}$  correspondant et donc on n'a plus besoin de les chercher).

$$B_{I_1}^j = \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1} \right)^{-1} \left[ (X^{I_1^j})^t X^j + \sigma_j^2 A_j n (\lambda_{I_1^j})^t \right] \quad (69)$$

$$B_{I_1^j}^j = \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} (X^{I_1^j})^t X^j + \sigma_j^2 A_j \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} n (\lambda_{I_1^j})^t \quad (70)$$

Soit  $J$  la matrice identité de taille  $p$ . On introduit une matrice de passage  $J_{I_1}^{I_1^j}$  matrice identité de taille  $p_1$  restreinte en nombre de colonnes. On peut donc écrire la contrainte sous la forme

$$A_{I_1} + \sum_{j \in I_2} J_{I_1}^{I_1^j} \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} \left[ (X^{I_1^j})^t X^j + \sigma_j^2 A_j (\lambda_{I_1})^t \right] A_j = \hat{A}_{I_1} \quad (71)$$

d'où

$$\sum_{j \in I_2} J_{I_1}^{I_1^j} \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} \left[ (X^{I_1^j})^t X^j + \sigma_j^2 A_j (\lambda_{I_1^j})^t \right] A_j = \hat{A}_{I_1} - A_{I_1} \quad (72)$$

$$\sum_{j \in I_2} J_{I_1}^{I_1^j} \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} (X^{I_1^j})^t X^j A_j + \sum_{j \in I_2} J_{I_1}^{I_1^j} \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} \sigma_j^2 A_j (\lambda_{I_1^j})^t A_j = \hat{A}_{I_1} - A_{I_1} \quad (73)$$

$$\sum_{j \in I_2} J_{I_1}^{I_1^j} \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} \sigma_j^2 A_j^2 (\lambda_{I_1^j})^t = (\hat{A}_{I_1} - A_{I_1}) - \sum_{j \in I_2} J_{I_1}^{I_1^j} \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} (X^{I_1^j})^t X^j A_j \quad (74)$$

$$\sum_{j \in I_2} J_{I_1}^{I_1^j} \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} \sigma_j^2 A_j^2 J_{I_1^j}^{I_1} \lambda^t = (\hat{A}_{I_1} - A_{I_1}) - \sum_{j \in I_2} J_{I_1}^{I_1^j} \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} (X^{I_1^j})^t X^j A_j \quad (75)$$

On a donc enfin

$$\lambda^t = \left[ \sum_{j \in I_2} J_{I_1}^{I_1^j} \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} \sigma_j^2 A_j^2 J_{I_1^j}^{I_1} \right]^{-1} \left[ (\hat{A}_{I_1} - A_{I_1}) - \sum_{j \in I_2} J_{I_1}^{I_1^j} \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} (X^{I_1^j})^t X^j A_j \right] \quad (76)$$

On en déduit donc,  $\forall j \in I_2$  :

$$B_{I_1^j}^j = \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} (X^{I_1^j})^t X^j + \sigma_j^2 A_j \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} (\lambda_{I_1^j})^t \quad (77)$$

$$= \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} (X^{I_1^j})^t X^j + \sigma_j^2 A_j \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} J_{I_1^j}^{I_1} \lambda^t \quad (78)$$

$$= \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} (X^{I_1^j})^t X^j \quad (79)$$

$$+ \sigma_j^2 A_j \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} J_{I_1^j}^{I_1} \left[ \sum_{k \in I_2} J_{I_1}^{I_1^k} \left( (X^{I_1^k})^t X^{I_1^k} \right)^{-1} \sigma_k^2 A_k^2 J_{I_1^k}^{I_1} \right]^{-1} \left[ (\hat{A}_{I_1} - A_{I_1}) - \sum_{k \in I_2} J_{I_1}^{I_1^k} \left( (X^{I_1^k})^t X^{I_1^k} \right)^{-1} (X^{I_1^k})^t X^k A_k \right] \quad (80)$$



On note  $\hat{\beta}_k$  le vecteur des paramètres de la sous-régression associée à  $X^k$  (à gauche) dans le cadre d'une estimation classique par moindres carrés sous la seule contrainte  $Z$ .

$$B_{I_1^j}^j = \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} (X^{I_1^j})^t X^j \quad (81)$$

$$+ \sigma_j^2 A_j \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} J_{I_1^j}^{I_1} \left[ \sum_{k \in I_2} J_{I_1^j}^{I_1^k} \left( (X^{I_1^k})^t X^{I_1^k} \right)^{-1} \sigma_k^2 A_k^2 J_{I_1^k}^{I_1} \right]^{-1} \left[ (\hat{A}_{I_1} - A_{I_1}) - \sum_{k \in I_2} J_{I_1^j}^{I_1^k} \left( (X^{I_1^k})^t X^{I_1^k} \right)^{-1} (X^{I_1^k})^t X^k A_k \right] \quad (82)$$

$$= \hat{\beta}_j + \sigma_j^2 A_j \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} J_{I_1^j}^{I_1} \left[ \sum_{k \in I_2} J_{I_1^j}^{I_1^k} \left( (X^{I_1^k})^t X^{I_1^k} \right)^{-1} \sigma_k^2 A_k^2 J_{I_1^k}^{I_1} \right]^{-1} \left[ (\hat{A}_{I_1} - A_{I_1}) - \sum_{k \in I_2} J_{I_1^j}^{I_1^k} \hat{\beta}_k A_k \right] \quad (83)$$

Dans le cadre d'un modèle naïf (toutes les variables à gauche dépendent de toutes les variables à droite), on a  $I_1^j = I_1$  et donc

$$B_{I_1}^j = \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} (X^{I_1^j})^t X^j \quad (84)$$

$$+ \sigma_j^2 A_j \left( (X^{I_1^j})^t X^{I_1^j} \right)^{-1} J_{I_1^j}^{I_1} \left[ \sum_{k \in I_2} J_{I_1^j}^{I_1^k} \left( (X^{I_1^k})^t X^{I_1^k} \right)^{-1} \sigma_k^2 A_k^2 J_{I_1^k}^{I_1} \right]^{-1} \left[ (\hat{A}_{I_1} - A_{I_1}) - \sum_{k \in I_2} J_{I_1^j}^{I_1^k} \left( (X^{I_1^k})^t X^{I_1^k} \right)^{-1} (X^{I_1^k})^t X^k A_k \right] \quad (85)$$

$$= \left( (X^{I_1})^t X^{I_1} \right)^{-1} (X^{I_1})^t X^j \quad (86)$$

$$+ \sigma_j^2 A_j \left( (X^{I_1})^t X^{I_1} \right)^{-1} \left[ \sum_{k \in I_2} \left( (X^{I_1})^t X^{I_1} \right)^{-1} \sigma_k^2 A_k^2 \right]^{-1} \left[ (\hat{A}_{I_1} - A_{I_1}) - \sum_{k \in I_2} \left( (X^{I_1})^t X^{I_1} \right)^{-1} (X^{I_1})^t X^k A_k \right] \quad (87)$$

$$= \hat{\beta}_j + \sigma_j^2 A_j \frac{1}{\sum_{k \in I_2} \sigma_k^2 A_k^2} \left[ (\hat{A}_{I_1} - A_{I_1}) - \sum_{k \in I_2} \hat{\beta}_k A_k \right] \quad (88)$$

### 3 Methode de Newton

On veut résoudre le système non linéaire suivant :

$$f1 : \forall j \in I_2 : \frac{1}{\sigma_j^2} (X^{I_1^j})^t (X^j - X^{I_1^j} B_{I_1^j}^j) + A_j n \lambda_{I_1^j}^t = 0 \quad (89)$$

$$f2 : A_{I_1} + \sum_{j \in I_2} A_j B_{I_1}^j - \hat{A}_{I_1} = 0 \quad (90)$$

$$f3 : \forall j \in I_2 : \sigma_j^2 - \frac{1}{n} (X^j - X^{I_1^j} B_{I_1^j}^j)^t (X^j - X^{I_1^j} B_{I_1^j}^j) = 0 \quad (91)$$

On commence donc par calculer la jacobienne associée :

$$\mathcal{J} = \begin{pmatrix} \mathcal{J}_1 & \mathcal{J}_2 & \mathcal{J}_3 \\ \mathcal{J}_4 & \mathcal{J}_5 & \mathcal{J}_6 \\ \mathcal{J}_7 & \mathcal{J}_8 & \mathcal{J}_9 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \frac{\partial f_1}{\partial B_i^j} & \frac{\partial f_1}{\partial \lambda_i} & \frac{\partial f_1}{\partial \sigma_j} \\ \frac{\partial f_2}{\partial B_i^j} & \frac{\partial f_2}{\partial \lambda_i} & \frac{\partial f_2}{\partial \sigma_j} \\ \frac{\partial f_3}{\partial B_i^j} & \frac{\partial f_3}{\partial \lambda_i} & \frac{\partial f_3}{\partial \sigma_j} \end{pmatrix} \quad (92)$$

On note  $p_Z = \sum i \in I_1, j \in I_2 Z_{i,j}$  le nombre de paramètres à estimer dans  $B$  et  $I_Z = \{1, \dots, p_Z\}$ . Les dimensions des blocs sont les suivantes :

- $\mathcal{J}_1 : p_Z \times p_Z$
- $\mathcal{J}_2 : p_Z \times p_1$
- $\mathcal{J}_3 : p_Z \times p_2$
- $\mathcal{J}_4 : p_1 \times p_Z$
- $\mathcal{J}_5 : p_1 \times p_1$
- $\mathcal{J}_6 : p_1 \times p_2$
- $\mathcal{J}_7 : p_2 \times p_Z$
- $\mathcal{J}_8 : p_2 \times p_1$
- $\mathcal{J}_9 : p_2 \times p_2$

On remarque tout de suite que  $\mathcal{J}_5, \mathcal{J}_6, \mathcal{J}_8$  sont nuls

$$\mathcal{J} = \begin{pmatrix} \frac{\partial f_1}{\partial B_i^j} & \frac{\partial f_1}{\partial \lambda_i} & \frac{\partial f_1}{\partial \sigma_j} \\ \frac{\partial f_2}{\partial B_i^j} & 0 & 0 \\ \frac{\partial f_3}{\partial B_i^j} & 0 & \frac{\partial f_3}{\partial \sigma_j} \end{pmatrix} \quad (93)$$

On note  $\bar{Z}$  la matrice  $p_Z \times 2$  des indices non nuls de  $Z$  ordonnés par colonne. On a donc en colonne  $k \in I_Z$  les dérivées partielles

$$\frac{\partial}{\partial B_{\bar{Z}_{k,1}}^{\bar{Z}_{k,2}}}$$

pour  $\mathcal{J}_9$

$$\forall (j, k) \in I_2 \times I_2 : \mathcal{J}_9(j, k) = \frac{\partial}{\partial \sigma_k} \left( \sigma_j^2 - \frac{1}{n} (X^j - X^{I_1^j} B_{I_1^j}^j)^t (X^j - X^{I_1^j} B_{I_1^j}^j) \right) \quad (94)$$

$$= 0 \text{ si } k \neq j \quad (95)$$

$$= 2\sigma_k \text{ sinon} \quad (96)$$

matrice diagonale.

pour  $\mathcal{J}_7$

$$\forall (j, k) \in I_2 \times I_Z, \mathcal{J}_7(j, k) = \frac{\partial}{\partial B_{\bar{Z}_{k,1}}^{\bar{Z}_{k,2}}} \left( \sigma_j^2 - \frac{1}{n} (X^j - X^{I_1^j} B_{I_1^j}^j)^t (X^j - X^{I_1^j} B_{I_1^j}^j) \right) = 0 \text{ si } \bar{Z}_{k,2} \neq j \quad (97)$$

donc  $\mathcal{J}_7$  est diagonale par blocs. Et pour  $\bar{Z}_{k,2} = j$  :

$$\mathcal{J}_7(j, k) = \frac{\partial}{\partial B_{\bar{Z}_{k,1}}^j} \left( \sigma_j^2 - \frac{1}{n} (X^j - X^{I_1^j} B_{I_1^j}^j)^t (X^j - X^{I_1^j} B_{I_1^j}^j) \right) \quad (98)$$

$$= -\frac{1}{n} \frac{\partial}{\partial B_{\bar{Z}_{k,1}}^j} \left( (X^j)^t X^j - 2(X^j)^t X^{I_1^j} B_{I_1^j}^j + (X^{I_1^j} B_{I_1^j}^j)^t X^{I_1^j} B_{I_1^j}^j \right) \quad (99)$$

$$= -\frac{1}{n} \frac{\partial}{\partial B_{\bar{Z}_{k,1}}^j} \left( -2(X^j)^t \sum_{i \in I_1^j} X^i B_i^j + \sum_{l=1}^n \sum_{i \in I_1^j} (X_l^i B_i^j)^2 \right) \quad (100)$$

$$= -\frac{1}{n} (-2(X^j)^t X^{\bar{Z}_{k,1}} + 2B_{\bar{Z}_{k,1}}^j (X^{\bar{Z}_{k,1}})^t X^{\bar{Z}_{k,1}}) \quad (101)$$

$$= \frac{2}{n} (X^j - X^{\bar{Z}_{k,1}} B_{\bar{Z}_{k,1}}^j)^t X^{\bar{Z}_{k,1}} \quad (102)$$

On passe à  $\mathcal{J}_4$  :

$$\forall (i, k) \in I_1 \times I_Z, \mathcal{J}_4(\tilde{i}, k) = \frac{\partial}{\partial B_{\bar{Z}_{k,1}}^{\bar{Z}_{k,2}}} \left( A_i + \sum_{j \in I_2} A_j B_i^j - \hat{A}_i \right) = 0 \text{ si } \bar{Z}_{k,1} \neq i \quad (103)$$

$$= A_{\bar{Z}_{k,2}} \text{ si } \bar{Z}_{k,1} = i \quad (104)$$

où  $\tilde{i}$  est la position de  $i$  dans  $I_1$ .

pour  $\mathcal{J}_3$  :

$$\forall j \in I_2, \forall k \in I_Z : \mathcal{J}_3(k, \tilde{j}) = \frac{\partial}{\partial \sigma_j} \left( \frac{1}{\sigma_j^2} (X^{\bar{Z}_{k,1}})^t (X^{\bar{Z}_{k,2}} - X^{\bar{Z}_{k,1}} B_{\bar{Z}_{k,1}}^{\bar{Z}_{k,2}}) + A_{\bar{Z}_{k,2}} n \lambda_{\bar{Z}_{k,1}}^t \right) \quad (105)$$

$$= 0 \text{ si } \bar{Z}_{k,2} \neq j \quad (106)$$

Donc  $\mathcal{J}_3$  est diagonale par blocs (verticaux). Pour un  $j$  donné tel que  $\bar{Z}_{k,2} = j$ , on a

$$\forall k \in I_Z : \mathcal{J}_3(k, \tilde{j}) = -\frac{2}{\sigma_j^3} (X^{\bar{Z}_{k,1}})^t (X^j - X^{\bar{Z}_{k,1}} B_{\bar{Z}_{k,1}}^j) \quad (107)$$

Où  $\tilde{j}$  est la position de  $j$  dans  $I_2$ . (sans perte de généralité, on peut supposer l'ordonnancement des indices mais

Pour  $\mathcal{J}_2$  :

$$\forall i \in I_1, \forall k \in I_Z : \mathcal{J}_2(k, i) = \frac{\partial}{\partial \lambda_i} \left( \frac{1}{\sigma_{\bar{Z}_{k,2}}^2} (X^{\bar{Z}_{k,1}})^t (X^{\bar{Z}_{k,2}} - X^{\bar{Z}_{k,1}} B_{\bar{Z}_{k,1}}^{\bar{Z}_{k,2}}) + A_{\bar{Z}_{k,2}} \lambda_{\bar{Z}_{k,1}}^t \right) \quad (108)$$

$$= \frac{\partial}{\partial \lambda_i} (A_{\bar{Z}_{k,2}} \lambda_{\bar{Z}_{k,1}}) \quad (109)$$

$$= 0 \text{ si } \bar{Z}_{k,1} \neq i \quad (110)$$

$$= A_{\bar{Z}_{k,2}} \text{ sinon} \quad (111)$$

Enfin, pour  $\mathcal{J}_1$  :

$$\forall (i, j) \in I_Z^2 : \mathcal{J}_1(i, j) = \frac{\partial}{\partial B_{\bar{Z}_{j,1}}^{\bar{Z}_{j,2}}} \left( \frac{1}{\sigma_{\bar{Z}_{i,2}}^2} (X^{\bar{Z}_{i,1}})^t (X^{\bar{Z}_{i,2}} - X^{\bar{Z}_{i,1}} B_{\bar{Z}_{i,1}}^{\bar{Z}_{i,2}}) + A_{\bar{Z}_{i,2}} \lambda_{\bar{Z}_{i,1}}^t \right) \quad (112)$$

$$= \frac{\partial}{\partial B_{\bar{Z}_{j,1}}^{\bar{Z}_{j,2}}} \left( -\frac{1}{\sigma_{\bar{Z}_{i,2}}^2} (X^{\bar{Z}_{i,1}})^t X^{\bar{Z}_{i,1}} B_{\bar{Z}_{i,1}}^{\bar{Z}_{i,2}} \right) \quad (113)$$

$$= 0 \text{ si } i \neq j \quad (114)$$

$$= -\frac{1}{\sigma_{\bar{Z}_{i,2}}^2} (X^{\bar{Z}_{i,1}})^t X^{\bar{Z}_{i,1}} \text{ sinon} \quad (115)$$

Donc  $\mathcal{J}_1$  est diagonale (au sens strict, pas seulement par blocs).

On va résoudre le système par récurrence, avec comme valeur initiale pour les paramètres recherchés les valeurs actuelles de  $\hat{B}$  et  $\hat{\Sigma}_{X^{I_2}}$ , et pour  $\lambda$  une valeur arbitraire (par exemple vecteur de 1). le terme général de la suite est le suivant :

$$\theta^{(n+1)} = \theta^{(n)} - \mathcal{J}^{-1}(\theta^{(n)}) F(\theta^{(n)}) \quad (116)$$

où  $F$  est le système (vecteur) des dérivées partielles à annuler.