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

$$\begin{aligned}
M_1 : \quad & Y|X^{I_1}, X^{I_2}, Z \sim X^{I_1}A_{I_1} + X^{I_2}A_{I_2} + \varepsilon && (1)\\
M_2 : \quad & X^{I_2}|X^{I_1}, Z \sim X^{I_1}B_{I_1}^{I_2} + \varepsilon_{X^{I_2}} && (2)\\
M_3 : \quad & X^{I_1}|Z \sim GM(\alpha) && (3)
\end{aligned}$$

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

$$\begin{aligned}
P_{M,Z}(Y, X^{I_1}, X^{I_2}|\theta) &= P_{M,Z}(X^{I_1}|\theta)P_{M,Z}(X^{I_2}|X^{I_1};\theta)P_{M,Z}(Y|X^{I_2}, X^{I_1};\theta) && (4)\\
&= P_{M_3,Z}(X^{I_1}|\alpha)P_{M_1,M_2,Z}(X^{I_2}|X^{I_1};\Sigma, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}, A_{I_1}, A_{I_2})P_{M_1,M_2,Z}(Y|X^{I_2}, X^{I_1};\Sigma, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}, A_{I_1}, A_{I_2}) && (5)
\end{aligned}$$

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

$$\begin{aligned}
P_{M_2,Z}(X^{I_2}|X^{I_1};\Sigma, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}, A_{I_1}, A_{I_2}) &= P_{M_2,Z}(X^{I_2}|X^{I_1};\Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}) \text{ et} && (6)\\
P_{M_1,Z}(Y|X^{I_2}, X^{I_1};\Sigma, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}, A_{I_1}, A_{I_2}) &= P_{M_1,Z}(Y|X^{I_2}, X^{I_1};\Sigma, A_{I_1}, A_{I_2}) && (7)
\end{aligned}$$

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

On a $Y|Z \sim X^{I_1}A_{I_1} + X^{I_2}A_{I_2} + \varepsilon$ mais le modèle $M$ signifie aussi que :

$$Y|Z \sim X^{I_1}A_{I_1} + X^{I_1}B_{I_1}^{I_2}A_{I_2} + \varepsilon_{X^{I_2}}A_{I_2} + \varepsilon \tag{8}$$

on sait que quand on connaît $X_{I_1}$ ,$X_{I_2}$, et $B_{I_1}^{I_2}$, on connaît aussi (par $M_2$) $\varepsilon_{X^{I_2}}$ de manière exacte (pas son paramètre $\Sigma_{X^{I_2}}$ mais bien la valeur de la variable elle-même).

On se demande si $P_{M_1,Z}(Y|X^{I_2}, X^{I_1};\Sigma, A_{I_1}, A_{I_2})$ est différent de $P_{M_1,M_2,Z}(Y|X^{I_2}, X^{I_1};\Sigma, \Sigma_{X^{I_2}}, B_{I_1}^{I_2}, A_{I_1}, A_{I_2})$. donc si (sous l'hypothèse du modèle $M_2$) $\Sigma_{X^{I_2}}$ et $B_{I_1}^{I_2}$ sont indépendants de $(Y|X^{I_2}, X^{I_1};\Sigma, A_{I_1}, A_{I_2})$ .

Pour moi, il y a dépendance mais je n'arrive pas à l'expliciter. C'est a priori pour cela qu'on a besoin de faire du séquentiel en s'appuyant sur le $A$ explicatif. Je vais continuer avec les formules d'indépendance, ne sachant pas faire autrement.

$\Sigma_{X^{I_2}}$ matrice diagonale constituée des $\sigma_{X,j}$ (pour la variable $j$ à gauche).

$$
\begin{aligned}
P_{M_3,Z}(X^{I_1}|\alpha) & \quad \text{maximisé de manière indépendante (du reste et de la contrainte) par mixmod} && (9)\\
P_{M_2,Z}(X^{I_2}|X^{I_1};\Sigma_{X^{I_2}},B_{I_1}^{I_2}) &= \prod_j \frac{1}{\sigma_{X,j}\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{(X^j - X^{I_1}B_{I_1}^j)^2}{2\sigma_{X,j}^2}} && (10)\\
P_{M_1,Z}(Y|X^{I_2},X^{I_1};\Sigma,A_{I_1},A_{I_2}) &= \frac{1}{\sigma_Y\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{(Y - X^{I_1}A_{I_1} - X^{I_2}A_{I_2})^2}{2\sigma_Y^2}} && (11)
\end{aligned}
$$

On a $P_{M,Z}(Y,X|\theta) = \mathcal{L}_{M,Z}(\theta;Y,X)$. On passe à la log-vraisemblance :

$$
\begin{aligned}
L_{M_2,Z}(\Sigma_{X^{I_2}},B_{I_1}^{I_2};X^{I_2}|X^{I_1}) &= \sum_j -\ln(\sigma_{X,j}\sqrt{2\pi}) - \frac{(X^j - X^{I_1}B_{I_1}^j)^2}{2\sigma_{X,j}^2} && (12)\\
L_{M_1,Z}(\Sigma,A_{I_1},A_{I_2};Y|X^{I_2},X^{I_1}) &= -\ln(\sigma_Y\sqrt{2\pi}) - \frac{(Y - X^{I_1}A_{I_1} - X^{I_2}A_{I_2})^2}{2\sigma_Y^2} && (13)
\end{aligned}
$$

On va donc maximiser cette somme sous la contrainte $A_{I_1} + B_{I_1}^{I_2}A_{I_2} = \hat{\hat{A}}_{I_1}$ où $\hat{\hat{A}}_{I_1}$ est l'estimateur des coefficients des variables de $X^{I_1}$ dans le modèle explicatif. La contrainte s'écrit aussi $B_{I_1}A - \hat{\hat{A}}_{I_1} = 0$ avec $B$ tel que $X = XB + \varepsilon_X$ donc$B_{I_1}^{I_1} = I_{p_1}$ .