

Exercices, 6

EXERCICE 1. — On observe un échantillon iid (X_1, \dots, X_n) de lois de Laplace, c'est-à-dire de densité $x \mapsto e^{-\lambda|x-m|}/2\lambda$, où $\lambda > 0$ et $m \in \mathbb{R}$.

1. En supposant λ connu, proposer un estimateur de m par la méthode des moments, et un estimateur par la méthode du maximum de vraisemblance. Étudier leurs propriétés et les comparer.
2. Même question lorsque ni λ ni m ne sont connus.

EXERCICE 2. — Soit $n \geq 1$ un entier. On observe X_1, \dots, X_n où les variables aléatoires X_i sont indépendantes, de même loi exponentielle de paramètre $\lambda > 0$, c'est-à-dire de densité $x \mapsto \lambda \exp(-\lambda x) \mathbb{1}_{x \geq 0}$.

1. Ecrire le modèle statistique engendré par l'observation de (X_1, \dots, X_n) .
2. Calculer l'estimateur du maximum de vraisemblance $\hat{\lambda}_n^{\text{mv}}$ de λ .
3. Montrer que $\hat{\lambda}_n^{\text{mv}}$ est asymptotiquement normal et calculer sa variance limite.
4. Soient $0 < \lambda_0 < \lambda_1$. Construire un test d'hypothèses de

$$H_0 : \lambda = \lambda_0 \quad \text{contre} \quad H_1 : \lambda = \lambda_1$$

de niveau α et uniformément plus puissant. Expliciter le choix du seuil définissant la région critique. Montrer que l'erreur de seconde espèce de ce test tend vers 0 lorsque $n \rightarrow \infty$.

EXERCICE 3. — On lance 60 fois un dé et on obtient les résultats suivants :

1	2	3	4	5	6
10	13	8	12	9	8

Au seuil de 0,025 peut-on conclure que le dé est bien équilibré? A titre indicatif le quantile d'une loi $\chi^2(5)$ d'ordre 95% est 11.07.

EXERCICE 4. — Soit E un sous-espace vectoriel de \mathbb{R}^n de dimension $p < n$. On observe un vecteur gaussien X de dimension n et de loi $\mathcal{N}(\mu, \sigma^2 I_n)$, où $\mu \in E$ et $\sigma^2 > 0$ sont inconnus. On s'intéresse aux hypothèses :

$$H_0 : \mu \in F \quad \text{contre} \quad H_1 : \mu \notin F,$$

où F est un sous-espace vectoriel de E de dimension $q < p$. On note X_V la projection orthogonale de X sur un sous-espace vectoriel V .

1. Montrer que $\|X - X_E\|^2$ et $\|X_E - X_F\|^2$ sont indépendants et décrire leur loi.
2. En déduire que si

$$T = \frac{\|X_E - X_F\|^2 / (p - q)}{\hat{\sigma}^2}, \quad \text{où} \quad \hat{\sigma}^2 = \frac{1}{n - p} \|X - X_E\|^2,$$

alors T suit une loi de Fisher sous H_0 .

3. Si $c > 0$ est une constante, montrer que la puissance du test $\mathbb{1}_{\{T > c\}}$ au point (μ, σ^2) est une fonction croissante de $\|\mu - \mu_F\|^2 / \sigma^2$.

EXERCICE 5 (ANOVA). — On observe k échantillons gaussiens de tailles respectives n_1, n_2, \dots, n_k , notés $X_i = (X_{i,j})_{1 \leq j \leq n_i}$, $1 \leq i \leq k$, tels que $X_{i,j} \sim \mathcal{N}(m_i, \sigma^2)$, où $m = (m_1, \dots, m_k) \in \mathbb{R}^k$ et $\sigma^2 > 0$ sont inconnus. On s'intéresse aux hypothèses :

$$H_0 : m_1 = m_2 = \dots = m_k \quad \text{contre} \quad H_1 : \exists i \neq i' \text{ tels que } m_i \neq m_{i'}.$$

1. On considère le vecteur aléatoire $X = (X_{ij})_{1 \leq i \leq k, 1 \leq j \leq n_i}$ de dimension $n = n_1 + \dots + n_k$. Montrer que $\mu = \mathbb{E}[X]$ appartient à un sous-espace vectoriel E de dimension k . Calculer X_E .
2. Montrer que l'hypothèse nulle s'écrit $H_0 : \mu \in F$, où F est un sous-espace vectoriel de E de dimension 1. Calculer X_F .
3. En déduire la forme du test de Fisher dans ce contexte.

EXERCICE 6 (Un test asymptotique de gaussianité, le test de Jarque-Bera). — Soit (X_1, \dots, X_n) un n -échantillon de loi inconnue F ayant au moins un moment d'ordre 4 et de moyenne nulle et de variance non nulle.

1. On pose, pour $k = 1, \dots, 4$,

$$T_n^{(k)} = \frac{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i^k}{\left(\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i^2\right)^{k/2}}.$$

Montrer que si F est une distribution gaussienne, on a

$$\frac{n}{15} \left(T_n^{(3)}\right)^2 + \frac{n}{96} \left(T_n^{(4)} - 3\right)^2 \xrightarrow{\mathcal{L}} \chi_2^2,$$

où χ_2^2 désigne la loi du χ^2 à 2 degrés de liberté.

2. En déduire un test de l'hypothèse nulle $H_0 : "F \text{ est gaussienne}"$ contre l'alternative $H_1 : "F \text{ n'est pas gaussienne}"$.
3. Le test est-il consistant ?

EXERCICE 7 (Test du signe). — On observe n couples aléatoires $(X_1, Y_1), (X_2, Y_2), \dots, (X_n, Y_n)$ indépendants mais pas nécessairement de même loi. On suppose de plus que les variables X_i et Y_i sont indépendantes et qu'elles ont une loi diffuse pour tout $i \in \{1, \dots, n\}$. On considère le test d'hypothèses

$$\begin{aligned} H_0 : & X_i = Y_i \text{ en loi pour tout } i, \\ H_1 : & \text{il existe } i \neq j \text{ tels que } X_i \neq Y_i \text{ en loi.} \end{aligned}$$

1. Montrer que $P(X_i = Y_i) = 0$ et en déduire que sous H_0 , on a $P(X_i > Y_i) = \frac{1}{2}$.
2. On pose $N = \sum_{i=1}^n \mathbb{1}_{X_i > Y_i}$. Quelle est la loi de N sous H_0 ?
3. En déduire que le test défini par la région critique

$$\left\{ \left| N - \frac{n}{2} \right| \geq c \right\}$$

permet de construire un test de niveau inférieur à $\alpha \in]0, 1[$ de H_0 contre H_1 pour un choix $c = c(\alpha) > 0$ que l'on précisera. Parmi tous les choix possibles de $c(\alpha)$, lequel préférer ?

4. Les moyennes générales de la première et de la deuxième année de cinquième de 12 redoublants ont été relevées:

Elève	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
Année 1	8,2	6,9	7,0	6,2	6,4	6,3	7,2	7,6	7,8	6,4	7,3	8
Année 2	10,1	6,7	7,9	10,5	5,3	8,3	9,6	11,4	7,9	9,9	10,0	9,8

Le redoublement a-t-il une influence sur la moyenne générale, sachant que le quantile d'ordre 0.975 d'une $\mathcal{B}(12, 0.5)$ est 9.