

## Fiche des exercices de TD 03

**Exercice 1** Dans le cadre de travaux de recherche sur la *Biomasse* ( $mg$ ), d'un certain type de plante, en fonction de la concentration de l'Azote  $NH_4^+$  ( $\mu mol$ ), nous avons réalisé des expériences dont la biomasse moyenne ( $Y$ ) ainsi que la concentration de l'Azote ( $X$ ) en question sont données dans le tableau ci-dessus :

Concentration $\mu mol$	0	100	200	400	600
Biomasse $mg$	305	378	458	540	565

On donne :  $\sum x_i = 1300$ ;  $\sum y_i = 2246$ ;  $\sum x_i^2 = 570000$ ;  $\sum y_i^2 = 1056498$ ;  $\sum x_i y_i = 684400$ ;

Afin de modéliser ces données, nous avons proposé le modèle linéaire suivant :

$$Y = a + bx.$$

1. Présenter graphiquement le nuage des points  $(X_i, Y_i)$ . Que peut-on conclure sur le modèle proposé?
2. Calculer les estimations des paramètres  $a$  et  $b$  et donner la droite de régression.
3. Calculer le coefficient de corrélation linéaire. Que peut-on conclure?
4. Pour un seuil de risque  $\alpha = 5\%$ , le modèle proposé est-il pertinent?
5. Quelle Biomasse prévoyez-vous à une concentration  $500 \mu mol$ ?

**Exercice 2** Dans le cadre de travaux de recherche sur la durée de la saison de végétation en montagne, des stations météorologiques sont installées à différentes altitudes. La température moyenne (variable  $Y$  en degrés Celsius) ainsi que l'altitude (variable  $X$  en mètres) de chaque station données dans le tableau ci-dessous :

<i>altitude</i>	1040	1230	1500	1600	1740	1950	2200	2530	2800	3100
<i>température</i>	7.4	6	4.5	3.8	2.9	1.9	1	-1.2	-1.5	-4.5

On donne :  $\sum x_i = 19690$ ;  $\sum y_i = 20.3$ ;  $\sum x_i^2 = 42925500$ ;  $\sum y_i^2 = 162.41$ ;  $\sum x_i y_i = 17671$ ;

1. Calculer le coefficient de corrélation linéaire.
2. Calculer les estimations des paramètres  $a$ ,  $b$  et  $\sigma^2$  pour la régression linéaire de  $Y$  sur  $X$ .
3. Quelle température moyenne prévoyez-vous à 1100 m? à 2300 m?

**Exercice 3** Dans le cadre d'une enquête visant à comparer, selon certains critères, différents *Sandwich* vendus dans les fast-foods, nous avons retenu les informations se trouvant dans le tableau ci-dessous.

Sandwich	$S_1$	$S_2$	$S_3$	$S_4$	$S_5$	$S_6$
Poids (g)	150	92	193	90	135	169
Prix (DA)	190	140	270	90	180	130

On donne :

$\sum Poids = 829$ ;  $\sum Poids^2 = 123099$ ;  $\sum Prix = 1000$ ;  $\sum Prix^2 = 186000$ ; et  
 $\sum Poids * Prix = 147860$ ;

1. Y-a-t-il une relation linéaire entre les variables Poids et Prix ? Pour répondre à cette question, faire un graphique, calculer le coefficient de corrélation des deux variables et l'équation de la droite de régression.
2. Supposons qu'on désire d'augmenter le poids du Sandwich  $S_6$  à 180 g, alors quelle sera son nouveau prix?
3. Le modèle linéaire proposé est-il adéquat pour la description de la relation entre les variables Poids et Prix?

**Exercice 4** On veut prédire la hauteur  $H$  d'un arbre en fonction de son diamètre  $D$ . Pour faire une régression linéaire, on effectue un changement de variable en posant  $X = \ln(D)$  et  $Y = \ln(H)$ . Voici les mesures faites sur 5 arbres :

$D$	0.1999	0.3012	0.3791	0.6005	0.6570
$H$	9.2073	9.6794	10.8049	13.4637	14.1540

1. Donner le coefficient de corrélation linéaire entre  $X$  et  $Y$ .
2. Donner l'équation de la droite de régression de  $Y$  par rapport à  $X$ .
3. Tester la pertinence de la régression au seuil de 5%.
4. Donner la hauteur prévue d'un arbre de diamètre 0.7.

**Exercice 5** Dans le cadre de travaux de recherche sur l'absorbance, d'un produit en fonction de sa concentration, par une certaine plante, nous avons réalisé des expériences dont l'absorbance moyenne ( $Y$ ) ainsi que la concentration du produit ( $x$ ) en question sont données dans le tableau ci-dessus :

							Somme
$X \mu g/\mu l$	0	20	40	60	80	100	300
$Y$	0	0.205	0.331	0.515	0.584	0.671	2.3060

a) Afin de modéliser ces données, nous avons proposé le modèle linéaire suivant :

$$Y = a_1 x + b_1.$$

1. Calculer les estimations des paramètres  $a_1$  et  $b_1$  et donner la droite de régression.
2. Quelle absorbance prévoyez-vous à une concentration  $40 \mu g/\mu l$ ? Que peut-on conclure?
3. Calculer le coefficient de corrélation linéaire, ce résultat confirme-t-il les résultats obtenus en 3)?
4. Pour un seuil de risque  $\alpha = 5\%$ , le modèle proposé est-il pertinent?

b) Vu les doutes qu'on a sur le modèle précédent, nous avons proposé le modèle suivant :

$$Z = e^Y = a_2 x + b_2.$$

1. Complétez le tableau suivant :

							Somme
$X \mu g/\mu l$	0	20	40	60	80	100	300
$Z$	1.0000						

2. Calculer les estimations des paramètres  $a_2$  et  $b_2$  pour la régression linéaire de  $Z$  sur  $X$ .
3. Quelle absorbance prévoyez-vous à une concentration  $40 \mu\text{g}/\mu\text{l}$ . Que peut-on conclure par rapport au premier modèle?
4. Calculer le coefficient de corrélation linéaire de ce nouveau modèle.
5. Indiquer quel est le meilleur modèle parmi les deux proposés (avec justification).

## Solution des exercices

### Solution de l'Exercice 1 (*Régression linéaire simple*)

- À partir de la présentation graphique (voir figure 1), on constate que le nuage des points est distribué sous une forme linéaire, à priori le modèle proposé est adéquat pour l'explication de  $Y$  en fonction de  $x$ .

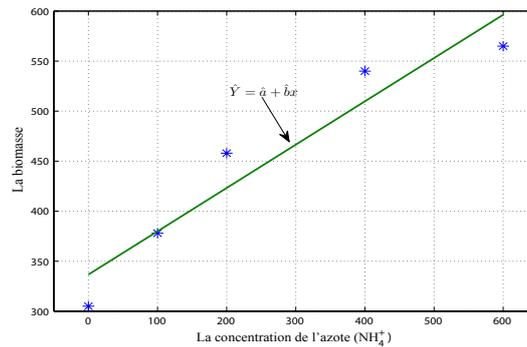


Figure 1: Présentation graphique du nuage des points  $(X_i, Y_i)$

- On a d'une part :

$$\hat{b} = \frac{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i y_i - \bar{X} \bar{Y}}{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2 - \bar{X}^2} \quad \text{et} \quad \hat{a} = \bar{Y} - \hat{b} \bar{X}. \quad (1)$$

et d'autre part :

$$\begin{aligned} \bar{X} &= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i = \frac{1}{5} 1300 = 260, & \bar{Y} &= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n y_i = \frac{1}{5} 2246 = 449.2, \\ \text{Cov}(x, y) &= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i y_i - \bar{X} \bar{Y} = \frac{1}{5} (684400) - (260) (449.2) = 20088, \\ \text{Var}(x) &= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2 - \bar{X}^2 = \frac{1}{5} (570000) - (260)^2 = 46400, \end{aligned}$$

ainsi,

$$\hat{b} = 0.4329, \quad \text{et} \quad \hat{a} = 336.6460,$$

de ce fait, la droite de régression de la biomasse ( $Y$ ) en fonction de la concentration ( $x$ ) est :

$$\hat{Y} = 0.4329 x + 336.6460.$$

- On a d'une part,

$$r = r(x, y) = \frac{\text{Cov}(x, y)}{\sigma_x \sigma_y}, \quad (2)$$

et d'autre part :  $Cov(x, y) = 20088$ ,  $\text{Écart-type}(x) = \sqrt{46400} = 215.4066$  et  
 $\text{Écart-type}(Y) = \sqrt{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n y_i^2 - \bar{Y}^2} = \sqrt{\frac{1}{5}(1056498) - (449.2)^2} = \sqrt{9518.36} = \mathbf{97.5621}$ , alors

$$\rho = \rho(x, y) = \frac{Cov(x, y)}{\sigma_x \sigma_y} = 0.9559 = 95.59\%, \quad (3)$$

Le fait que la valeur de  $\rho \approx 1$ , on déduit qu'il y a une forte liaison linéaire entre  $x$  et  $Y$ .

4. Afin de valider le modèle nous aurons besoin des  $\hat{Y}_i = 0.4329 x_i + 336.6460$  dont leurs valeurs sont rangées dans le tableau suivant :

Concentration ( $\mu mol$ )	0	100	200	400	600
Biomasse ( $mg$ )	305	378	458	540	565
$\hat{y}_i$ ( $mg$ )	336.646	379.936	423.226	509.806	596.386
$e_i = y_i - \hat{y}_i$	-31.646	-1.936	34.774	30.194	-31.386

On a d'une part

$$f_c = \frac{\sum_{i=1}^n (\hat{y}_i - \bar{Y})^2 / 1}{\sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2 / (n-2)} = \frac{\sum_{i=1}^n (\hat{y}_i - \bar{Y})^2 / 1}{\sum_{i=1}^n e_i^2 / (n-2)} = \frac{43477.3591 / 1}{4111.2071 / (5-2)} = 31.7260,$$

et d'autre par

$$f_\alpha = f(1, n-2, 1-\alpha) = f(1, 3, 0.95) = 10.1.$$

On constate que  $f_c > f_\alpha$ , alors le modèle est valide (pertinent), c'est-à-dire on admet qu'on peut expliquer la Biomasse de la plante en fonction de la concentration de l'azote par la droite

$$\hat{Y} = 0.4329 x + 336.6460.$$

5. On a :  $\hat{Y} = 0.4329 x + 336.6460$  alors la Biomasse qu'on peut prévoir à une concentration  $500 \mu mol$  est  $\hat{Y} = 0.4329 * 500 + 336.6460 = 553.0960 mg$ .

### Solution de l'Exercice 2 (Régression linéaire simple)

1. Par définition le coefficient de corrélation linéaire est donné par :

$$r = \frac{Cov(x, y)}{\sigma_x \sigma_y}.$$

on a :  $\bar{X} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i = \frac{19690}{10} = 1969$ ,  $\bar{Y} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n y_i = \frac{20.3}{10} = 2.03$ ,

$$\sigma_x = \sqrt{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2 - \bar{X}^2} = \sqrt{\frac{1}{10} 42925500 - 1969^2} = 679.5333,$$

$$\sigma_y = \sqrt{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n y_i^2 - \bar{Y}^2} = \sqrt{\frac{1}{10} 162.4100 - 2.03^2} = 3.6697,$$

$$Cov(x, y) = \left( \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i y_i \right) - \bar{X} \bar{Y} = \left( \frac{1}{10} 17671 \right) - 1969 \times 2.03 = -2.22997,$$

alors le coefficient de corrélation est :

$$r = -0.9936$$

- Calculer les estimations des paramètres  $a$ ,  $b$  et  $\sigma^2$  pour la régression linéaire de  $Y$  sur  $X$ .
- Le modèle linéaire de  $Y$  sur  $X$  est donné par :

$$Y = aX + b + \epsilon,$$

en utilisant la méthode des moindres carrés les estimateurs de  $a$  et  $b$  sont définis comme suite :

$$\hat{a} = \frac{Cov(x,y)}{Var(x)} = -0.0054. \quad \text{et} \quad \hat{b} = \bar{Y} - \hat{a}\bar{X} = 12.5953 \quad (4)$$

c'est-à-dire, la droite de régression est :

$$\hat{Y} = -0.0054X + 12.5953.$$

on a,

$$\hat{\sigma}_c^2 = var(\epsilon) = var(y - \hat{a} - \hat{b}x) = \frac{1}{n-2} \sum_{i=1}^n (y_i - \hat{a} - \hat{b}x_i)^2, \quad (5)$$

donc

$$\hat{\sigma}_c^2 = \frac{1}{10-2} \sum_{i=1}^{10} (y_i - \hat{a} - \hat{b}x_i)^2 = 0.1931.$$

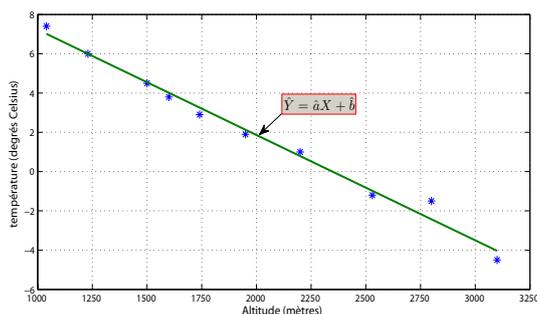


Figure 2: Nuage des points observés et la droite de régression

- Les températures moyennes correspondantes à aux altitudes 1100 m et 2300 m.
  - 1100m est :  $y = -0.0054 * 1100 + 12.5953 = 6.6929$ .
  - 2300m est :  $y = -0.0054 * 2300 + 12.5953 = 0.2539$ .

**Solution de l'Exercice 3** On note  $X$  est le poids,  $Y$  est le Prix et le modèle de régression est  $Y = aX + b$ .

- A partir des données on a :

variable	Moyenne	Variance	Carrée Moyenne
$X$	138.1667	1426.4722	20516.50
$Y$	166.6667	3222.2222	31000
$X * Y$	24643.33		

d'où :  $Cov(X, Y) = 1615.54$ ,  $\rho = 0.754$ ,  $\hat{a} = 1.133$ ,  $\hat{b} = 10.186$  et  $\hat{Y} = 1.133X + 10.186$ .

2. Si on augmente le poids du Sandwich  $S_6$  à 180 g, alors son nouveau prix sera :  
 $\hat{Y} = 1.133(180) + 10.186 = 214.126DA$ .

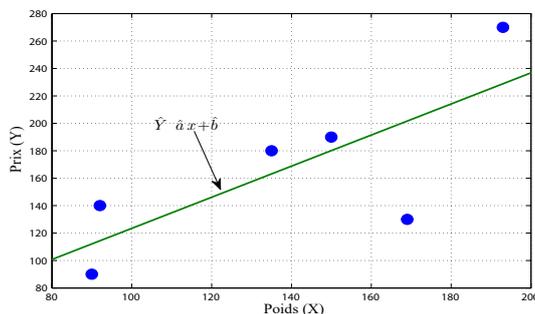


Figure 3: Nuage de variation du Prix des Sandwichs en fonction de leurs Poids.

3. La table d'analyse de la variance, du modèle, est donnée comme suite :

Source	SC	ddl	MC	$f_c$	Sig.
Régression	10978.215	1	10978.215	5.256	0.084
Résidu	8355.118	4	2088.780		
Total	19333.333	5			

Table 1: Table d'ANOVA du modèle

A partir de ces résultats, on constate que pour un risque de 5%, le modèle linéaire n'est pas adéquat pour la description de la relation entre les variables Poids et Prix. Mais on peut conclure que ce modèle est adéquat pour un risque de 10%.

**Solution de l'Exercice 4** (*Régression linéaire simple et transformation des variables*)

Pour faire une régression linéaire, on effectue un changement de variable en posant  $X = \ln(D)$  et  $Y = \ln(H)$ . Après le calcul des valeurs des variable  $X$  et  $Y$  on aura les résultats suivants :

$X$	-1.61	-1.20	-0.97	-0.51	-0.42
$Y$	2.22	2.27	2.38	2.60	2.65
$\hat{Y}$	2.1690	2.3255	2.4133	2.5889	2.6232
$\epsilon$	0.0510	-0.0555	-0.0333	0.0111	0.0268

1. Le calcul du coefficient de corrélation linéaire entre  $X$  et  $Y$  nécessite les quantités suivantes :  $\bar{X} =$

$$\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i = -0.9420, \bar{Y} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n y_i = 2.4240,$$

$$\sigma_x = \sqrt{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2 - \bar{X}^2} = \sqrt{0.1945} = 0.4410,$$

$$\sigma_y = \sqrt{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n y_i^2 - \bar{Y}^2} = \sqrt{0.0299} = 0.1728,$$

$$Cov(x, y) = \left( \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i y_i \right) - \bar{X} \bar{Y} = 0.0742,$$

ainsi on aura le coefficient de corrélation :

$$r = 0.9737.$$

2. On a,

$$\hat{a} = \frac{Cov(x, y)}{Var(x)} = 0.3817 \text{ et } \hat{b} = \bar{Y} - \hat{a} \bar{X} = 2.7836.$$

alors,

$$Y = 0.38172X + 2.78358, \quad (6)$$

3. Le test de validation du modèle se base sur la statistique :

$$F = \frac{\sum_{i=1}^n (\hat{y}_i - \bar{Y})^2 / 1}{\sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2 / (n - 2)} \rightsquigarrow f_{(1, n-2)},$$

or on a,

$$\sum_{i=1}^n (\hat{y}_i - \bar{Y})^2 / 1 = 0.1417$$

et

$$\sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2 / (n - 2) = 0.0025$$

alors la réalisation,  $f$ , de la statistique  $F$  est égale à : 55.7266.

A partir de la table de Fisher pour un seuil de risque  $\alpha = 5\%$ , on obtient  $f_{(1, n-2, 1-\alpha)} = f_{(1, 3, 0.95)} = 10.1$ , on constate que la valeurs de la réalisation de la statistique  $F$  est supérieur à la valeurs tabulée de fisher, cela signifier que le modèle est valide c'est-à-dire le modèle linéaire définie dans (6) est adéquat pour l'explication de la variable  $Y$  en fonction de la variable  $X$ .

4. Donner la hauteur prévue d'un arbre de diamètre 0.7. on a,

$$\hat{Y} = 0.38172X + 2.78358 \Rightarrow \ln(\hat{H}) = 0.38172 \ln(D) + 2.78358 \Rightarrow \hat{H} = e^{0.38172 \ln(D) + 2.78358}.$$

Alors, pour un diamètre  $D=0.7$ , on prévoit une hauteur  $H = e^{0.38172 \ln(0.7) + 2.78358} = 14.1177$ .

### Solution de l'Exercice 5 (Régression linéaire simple et changement des variables)

							Somme
X $\mu g/\mu l$	0	20	40	60	80	100	300
Y	0	0.205	0.331	0.515	0.584	0.671	2.3060
$X^2$	0	400	1600	3600	6400	10000	22000
$Y^2$	0	0.0420	0.1096	0.2652	0.3411	0.4502	1.2081
$X * Y$	0	4.10	13.24	30.90	46.72	67.10	162.06

a) Afin de modéliser ces données, nous avons proposé le modèle linéaire suivant :

$$Y = a_1 x + b_1.$$

1. Calcul des estimateurs des paramètres  $a_1$  et  $b_1$ . On a :

$$\bar{X} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i = \frac{1}{6} 300 = 50.$$

$$\bar{Y} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n y_i = \frac{1}{6} 3002.3060 = 0.3843.$$

$$Cov(x, y) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i y_i - \bar{X} \bar{Y} = \frac{1}{6} (162.06) - (50) (0.3843) = 7.7950$$

$$Var(x) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2 - \bar{X}^2 = \frac{1}{6} (22000) - (50)^2 = 1166.6667$$

alors,

$$\hat{a}_1 = \frac{Cov(x, y)}{Var(x)} = \frac{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i y_i - \bar{X} \bar{Y}}{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2 - \bar{X}^2} = 0.0067.$$

$$\hat{b}_1 = \bar{Y} - \hat{a}_1 \bar{X} = 0.0503,$$

de ce fait la droite de régression de l'absorbance ( $Y$ ) en fonction de la concentration ( $x$ ) est donnée par :

$$\hat{Y} = 0.0067 x + 0.0503.$$

2. Quelle absorbance prévoyez-vous à une concentration 50  $\mu\text{g}/\mu\text{l}$ ?

$$\hat{Y} = 0.0067 (50) + 0.0503 = 0.3853.$$

3. Quelle absorbance prévoyez-vous à une concentration 40  $\mu\text{g}/\mu\text{l}$ ? Que peut-on conclure?

$$\hat{Y} = 0.0067 (40) + 0.0503 = 0.3183.$$

On constate que la valeur de régression est très proche de la vraie valeur (0.331), donc à priori le modèle retenu est adéquate pour la représentation des données du tableau.

4. Calcul du coefficient de corrélation linéaire.

$$r = r(x, y) = \frac{Cov(x, y)}{\sigma_x \sigma_y} = 0.9851,$$

avec  $\sigma_y = \sqrt{var(Y)} = \sqrt{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n y_i^2 - \bar{Y}^2} = \sqrt{0.0536} = 0.2316$ ; La valeur du coefficient de corrélation est très proche de 1, i.e. X et Y sont fortement linéairement liés donc le modèle est efficace ce qui confirme les résultats de la question 3).

5. Pour un seuil de risque  $\alpha = 5\%$ , le modèle proposé est-il pertinent?

Pour répondre à cette question on utilise le test de validation du modèle (Fisher). On d'une part

$$f_c = \frac{\sum_{i=1}^n (\hat{y}_i - \bar{Y})^2 / 1}{\sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2 / (n - 2)} = \frac{0.3124 / 1}{0.0095 / (6 - 2)} = 131.5368,$$

et d'autre par

$$f_\alpha = f(1, n - 2, 1 - \alpha) = f(1, 4, 0.95) = 7.71.$$

On constate que  $f_c > f_\alpha$ , alors on accepte le modèle proposé, c'est-à-dire le modèle est valide (pertinent)

- b) Vue les doutes qu'on a sur le modèle précédent, nous avons proposé le modèle suivant :

$$Z = e^Y = a_2 x + b_2.$$

1. Complétez le tableau suivant :

							Somme
X $\mu\text{g}/\mu\text{l}$	0	20	40	60	80	100	300
Z	1.0000	1.2275	1.3924	1.6736	1.7932	1.9562	9.0429
Z <sup>2</sup>	1.0000	1.5068	1.9387	2.8011	3.2156	3.8267	14.2888
X * Z	0	24.5505	55.6944	100.4183	143.4558	195.6193	519.7382

2. Calculer les estimations des paramètres  $a_2$  et  $b_2$  pour la régression linéaire de  $Z$  sur  $X$ .

$$\begin{aligned}\bar{X} &= 50. \\ \bar{Z} &= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n z_i = \frac{1}{6}(9.0429) = 1.5072. \\ Cov(x, z) &= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i z_i - \bar{X} \bar{Z} = \frac{1}{6}(162.06) - (50)(1.5072) = 7.7950 \\ Var(x) &= 1166.6667\end{aligned}$$

alors,

$$\hat{a}_2 = \frac{Cov(x, z)}{Var(x)} = 0.0097.$$

$$\hat{b}_2 = \bar{Z} - \hat{a}_2 \bar{X} = 1.0243,$$

de ce fait la droite de régression de ( $Z$ ) en fonction de ( $x$ ) est donnée par :

$$\hat{Z} = 0.0097 x + 1.0243.$$

3. Quelle absorbance prévoyez-vous à une concentration  $40 \mu\text{g}/\mu\text{l}$ . Que peut-on conclure par rapport au premier modèle?

On  $Z = 0.0097 (40) + 1.0243 = 1.4123$  donc l'absorbance  $y = \log(z) = \log(1.4123) = 0.3452$ .

On constate que ce modèle nous fournit une valeur proche à la vraie valeur mais c'est le premier modèle qui nous fournit une valeur plus proche de la vraie valeur il se peut que c'est le premier modèle qui est meilleur.

4. Calculer le coefficient de corrélation linéaire de ce nouveau modèle.

$$r = r(x, y) = \frac{Cov(x, z)}{\sigma_x \sigma_z} = 0.9946,$$

5. On constate que le coefficient de corrélation est plus grand pour le deuxième modèle donc le meilleur modèle est le deuxième.