



TP2 : Analyse bivariée

Croisement Quantitatif-Quantitatif

Durée : 3h

L'objectif de ce TP est d'étudier un lien éventuel entre deux variables quantitatives et de construire un modèle prédictif le cas échéant.

Le TP est assez long. Il faut absolument faire les exo 1, 2 et 3. L'exo 4 sera peut-être fait la séance d'après

Exercice 1

Un peu de géométrie

Dans une population Ω de taille n , on observe deux variables quantitatives continues, $x = \{x_k\}_{k=1, \dots, n}$, et $y = \{y_k\}_{k=1, \dots, n}$, de moyennes \bar{x} et \bar{y} et de variances s_x^2 et s_y^2 .

On définit le produit scalaire,

$$\langle x, y \rangle = \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n x_k y_k.$$

- 1) Exprimez la covariance en fonction du produit scalaire.

$$C_{xy} = \langle x - \bar{x}, y - \bar{y} \rangle$$

- 2) Déterminez la norme du vecteur centré $x - \bar{x}$?

$$\|x - \bar{x}\|^2 = \langle x - \bar{x}, x - \bar{x} \rangle = \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n (x_k - \bar{x})^2 = s_x^2$$

- 3) Comment peut-on écrire la moyenne \bar{x} à l'aide du produit scalaire ?

$$\bar{x} = \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n x_k = \langle x, 1 \rangle$$

- 4) D'un point de vue géométrique à quoi correspond le coefficient de corrélation linéaire ?

$$r_{xy} = \frac{C_{xy}}{s_x s_y} = \frac{\langle x - \bar{x}, y - \bar{y} \rangle}{\|x - \bar{x}\| \|y - \bar{y}\|} = \cos(x - \bar{x}, y - \bar{y})$$

- 5) On dit que les deux variables x et y sont non corrélées si $r_{xy} = 0$ et entièrement corrélées si $r_{xy} = \pm 1$. Qu'est-ce que cela signifie géométriquement ?

D'après ce qui précède,

si $r_{xy}=0$ alors il y a un angle droit entre les variables donc elles sont orthogonales

si $r_{xy}=\pm 1$ alors il y a un angle plat ou nul entre les variables donc elles sont liées par une équation de droite.

6) A l'aide du produit scalaire, montrez que

a) la moyenne des valeurs prédites est égale à la moyenne de la série observée,

$$\bar{\hat{y}} = \langle \hat{y}, 1 \rangle = \langle \hat{a}x + \hat{b}, 1 \rangle = \hat{a} \langle x, 1 \rangle + \hat{b} \langle 1, 1 \rangle = \hat{a}\bar{x} + \hat{b} = \hat{a}\bar{x} + (\bar{y} - \hat{a}\bar{x}) = \bar{y}$$

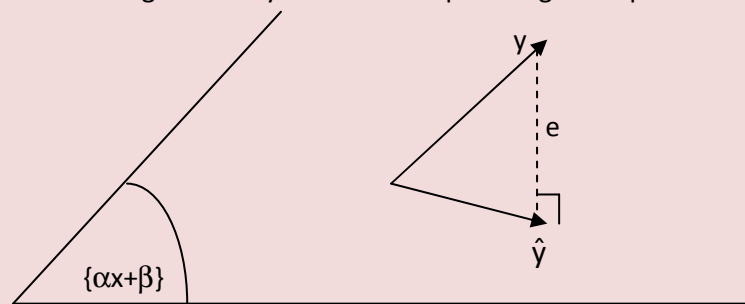
b) les résidus sont de moyenne nulle,

Immédiat d'après question a)

c) les résidus sont non corrélés avec la série observée x.

$$\begin{aligned} \langle e, x \rangle &= \langle y - \hat{y}, x \rangle = \langle y - \hat{a}x - \hat{b}, x \rangle = \langle y, x \rangle - \hat{a} \langle x, x \rangle - \hat{b} \langle 1, x \rangle \\ &= (c_{xy} + \bar{x}\bar{y}) - \hat{a}(s_x^2 + \bar{x}^2) - \hat{b}\bar{x} = (c_{xy} + \bar{x}\bar{y}) - \hat{a}(s_x^2 + \bar{x}^2) - (\bar{y} - \hat{a}\bar{x})\bar{x} \\ &= c_{xy} - \hat{a}s_x^2 = c_{xy} - \frac{c_{xy}}{s_x^2} s_x^2 = 0 \end{aligned}$$

En fait \hat{y} est la projection orthogonale de y sur le sous-espace engendré par les fonctions affines de x.



Cela signifie qu'il ne reste plus « d'information » pour expliquer y par x dans les résidus.

Exercice 2

Exercice pour mettre en place les formules. Pas de tableur. Très rapide à faire

On donne pour les six premiers mois de l'année 1982 les nombres d'offres d'emploi (concernant des emplois durables à temps plein) et de demandes d'emploi (déposées par des personnes sans emploi, immédiatement disponibles, à la recherche d'un emploi durable à plein temps). Les nombres sont exprimés en milliers.

Offres (x_i)	61	66,7	75,8	78,6	82,8	87,2
Demandes (y_i)	2034	2003,8	1964,5	1928,2	1885,3	1867,1

On a les résultats suivants

$$\bar{x} = 75,35 \quad \bar{y} = 1947,15 \quad s_x^2 = 97,49 \quad s_y^2 = 4329,14 \quad c_{xy} = -639,90$$

1) Calculer le coefficient de corrélation linéaire. Conclusion

$$r_{xy} = \frac{c_{xy}}{s_x s_y} = \frac{-639,90}{\sqrt{97,49 \times 4329,14}} = -0,98$$

- $|r_{xy}| \cong 1$ il y a donc une relation sous forme de droite entre l'offre et la demande.
 → $r_{xy} < 0$ donc plus l'offre augmente et plus la demande diminue.

- 2) Déterminer la droite de régression.

$$\hat{a} = \frac{c_{xy}}{s_x^2} = \frac{-639,90}{97,49} = -6,56 \quad \hat{b} = \bar{y} - \hat{a}\bar{x} = 1947,15 - (-6,56) \times 75,35 = 2441,73$$

$$y = -6,56x + 2441,73$$

- 3) Calculer la prévision de la demande d'emploi s'il y a 61 milliers d'offres. Comparer avec la demande réelle.

$$y = -6,56 \times 61 + 2441,73 = 2041,34$$

- 4) Vérifier la formule de la décomposition de la variance. En déduire le coefficient de détermination.

$$s_{\hat{y}}^2 = r_{xy}^2 s_y^2 = (-0,98)^2 * 4329,14 = 4200,14$$

$$s_e^2 = s_y^2 (1 - r_{xy}^2) = (1 - 0,98^2) * 4329,14 = 129$$

On a bien

$$s_{\hat{y}}^2 + s_e^2 = 4200,14 + 129 = 4329,14 = s_y^2$$

Le coefficient de détermination est

$$R^2 = s_{\hat{y}}^2 / s_y^2 = 4200,14 / 4329,14 = 0,97 \quad (=r_{xy}^2)$$

97% de la variabilité des demandes observées est expliquée par la droite de régression.

Exercice 3

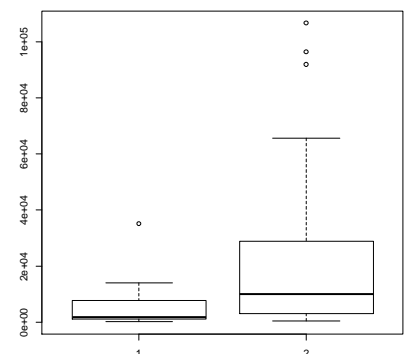
Données : DepensesEdu.xls

Le fichier DepencesEdu.xls recense les dépenses publiques de certains états pour l'éducation ainsi que le nombre d'élèves (donnée Eurostat 2008).

```
tab <- read.table("DepensesEduData.csv",header=T,sep=";",dec=",")
```

```
> summary(tab)
```

```
nbEleves    Depenses
Min.   : 74   Min.   : 492.9
1st Qu.: 1055 1st Qu.: 3048.1
Median : 1864 Median : 10030.8
Mean   : 4847 Mean   : 25399.6
3rd Qu.: 6687 3rd Qu.: 27863.8
Max.   :35062 Max.   :106626.4
```

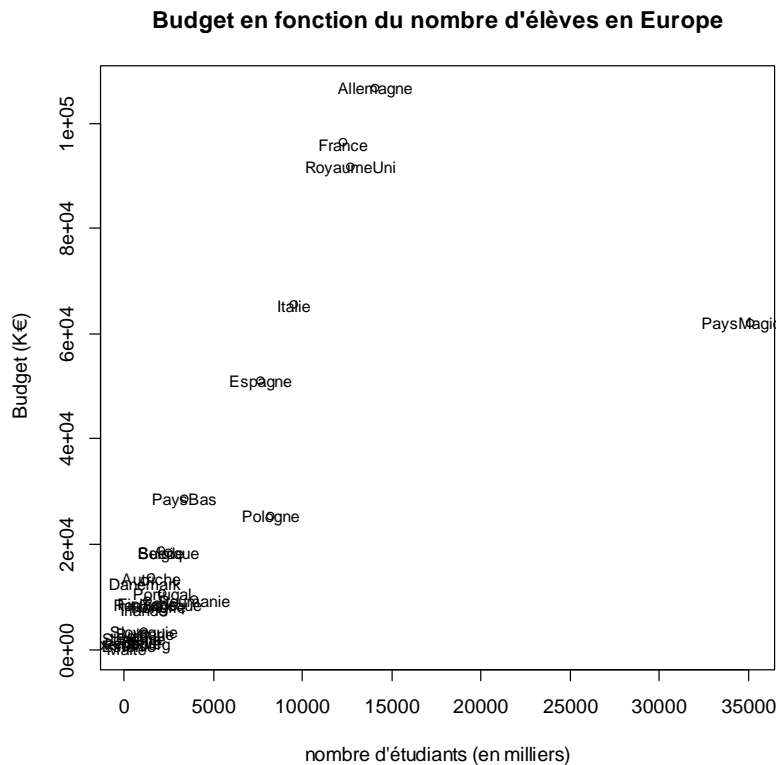


On constate qu'il y a des individus atypiques dans les deux séries qu'il faudra peut être supprimer

- 1) Tracer le nuage de points des dépenses en fonction du nombre d'élèves.

```
> plot(tab$nbEleves,tab$Depenses,main="Budget en fonction du nombre d'élèves en Europe",
xlab="nombre d'étudiants (en milliers)",ylab="Budget (K€)")
```

```
> text(tab$nbEleves,tab$Depenses,row.names(tab),cex=0.8) # cex=taille de la police
```



Commenter le graphique : beaucoup de pays en amas proche de l'origine. Forme allongée avec pays ayant de fortes dépenses (France, Allemagne,..). Un pays qui est très éloigné des autres,

Prendre l'habitude de commenter et pas uniquement taper une ligne de code pour obtenir un graphique ou un chiffre.

2) Calculer le coefficient de corrélation linéaire. Conclusion

```
> cor(tab)
      nbEleves  Depenses
nbEleves 1.0000000 0.7236921
Depenses 0.7236921 1.0000000
```

- $|r_{xy}| \sim 1$ donc relation droite entre le nombre d'élèves et les dépenses
- $r_{xy} > 0$ donc plus le nombre d'élèves augmente plus la dépense augmente

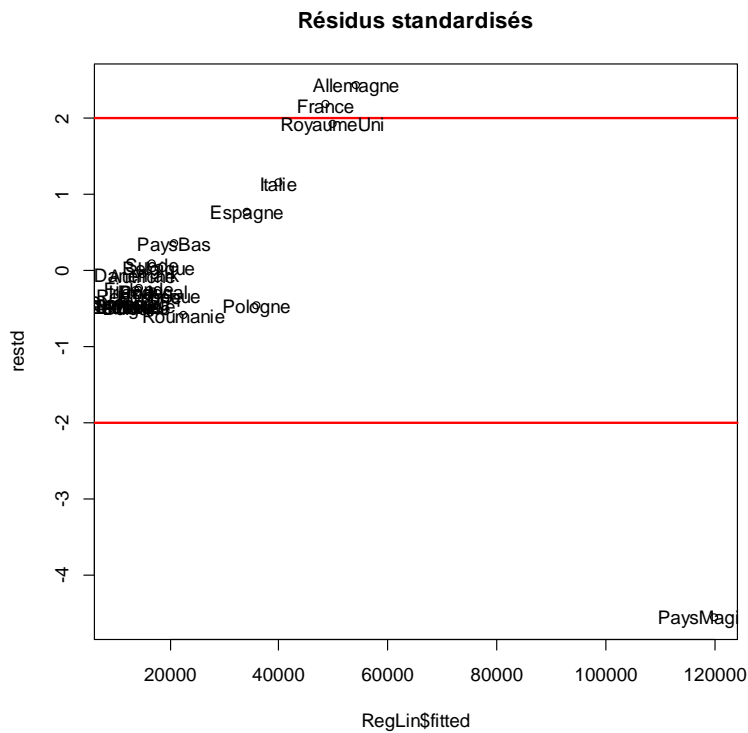
3) Déterminer la droite de régression. Tracer la droite sur le graphique.

Call:

```
lm(formula = y ~ x)
```

Residuals:

```
Min 1Q Median 3Q Max
```

Là encore le Pays Magique est détecté comme atypique. On le supprime de l'étude.

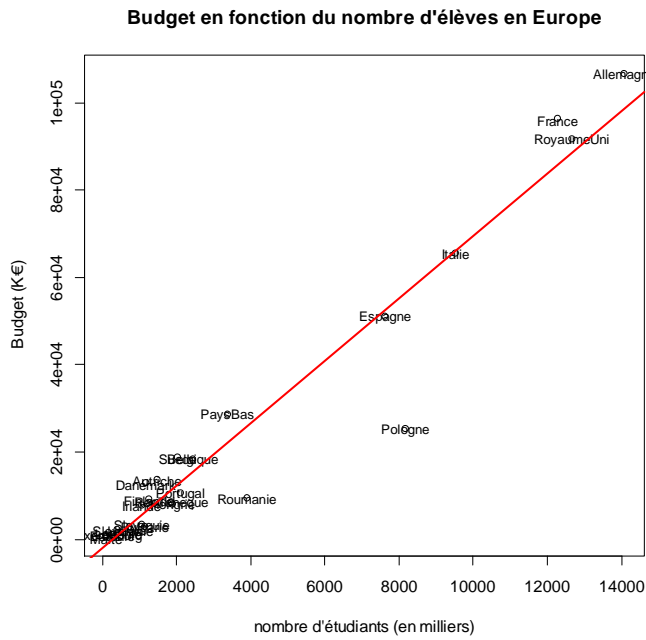
5)

```
x=as.vector(tab$nbEleves)[1:25]
y=as.vector(tab$Depenses)[1:25]
plot(x,y,main="Budget en fonction du nombre d'élèves en Europe", xlab="nombre d'étudiants
(en milliers)",ylab="Budget (K€)")
text(x,y,row.names(tab),cex=0.8)      # cex=taille de la police
RegLin <- lm(y~x) # construit le modèle de régression linéaire / lm = linear model

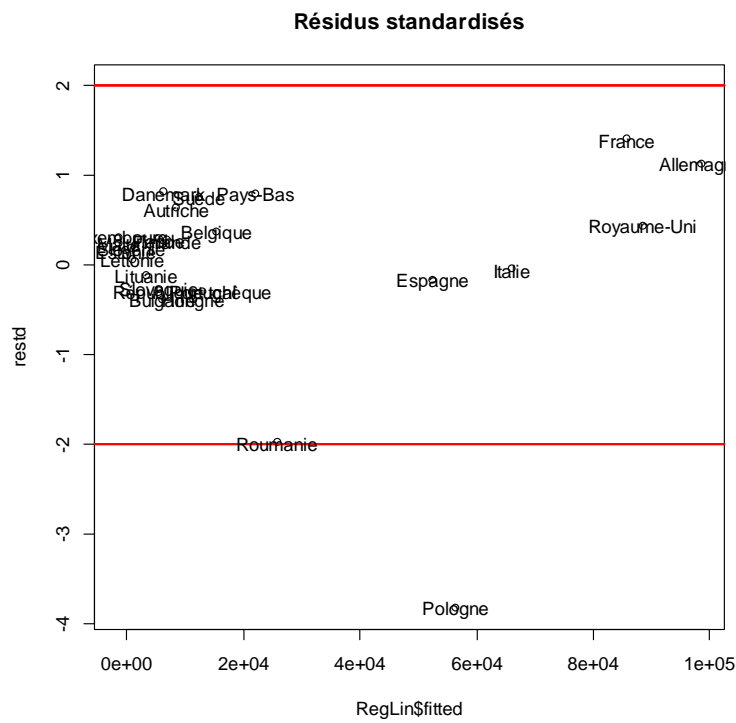
RegLin$coef          # donne les coefficients de la droite
(Intercept)         x
-2093.810192      7.153621
```

⇒ dépenses=7,15*Nb Elèves-2093,81

```
plot(x,y,main="Budget en fonction du nombre d'élèves en Europe", xlab="nombre d'étudiants
(en milliers)",ylab="Budget (K€)")
text(x,y,row.names(tab)[1:25],cex=0.8)      # cex=taille de la police
abline(RegLin$coef[1],RegLin$coef[2],col="red",lwd=2) # trace la droite
```



Le modèle semble plus représentatif des données excepté pour la Pologne.



Les résidus sont de moyenne nulle, le graphique des résidus ne présente pas de forme particulière. Cela signifie qu'il ne reste pas « d'information » dans les résidus. La Pologne est détectée atypique par rapport au modèle. On pourrait la supprimer pour voir si le modèle change. Cela n'est pas le cas ici.

- 6) Quel pourcentage de variabilité des dépenses est expliqué par la droite de régression ?
 > summary(RegLin) # résume toutes les caractéristiques du modèle

Call:

`lm(formula = y ~ x)`

Residuals:

Min	1Q	Median	3Q	Max
-30943	-2196	1633	3284	10673

Coefficients:

	Estimate	Std. Error	t value	Pr(> t)
(Intercept)	-2093.8102	2230.1957	-0.939	0.358
x	7.1536	0.3989	17.935	5.13e-15 ***

Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1

Residual standard error: 8467 on 23 degrees of freedom

Multiple R-squared: 0.9333, Adjusted R-squared: 0.9304

F-statistic: 321.6 on 1 and 23 DF, p-value: 5.131e-15

La droite de régression explique 93% (coef. de détermination) de la variabilité du budget.

7) Calculer les budgets prédits par le modèle pour 1000, 6000 et 9500 milliers d'étudiants. Placer les sur le graphique.

prev

1	2	3
5059.811	44404.724	62288.776

Exercice 4

(PY Bernard, exercices corrigés de statistique descriptive, ed. economica)

Une étude a été menée auprès d'entreprises afin d'établir le lien entre les quantités commandées d'un bien, Y, et son prix, X et on obtient les observations suivantes.

Prix de vente (€)	Quantités commandées
95	104
130	58
148	42
210	12
250	8
330	5

1) Tracer le nuage de points.

```
tab <- read.table("Commandes.csv", header=T, sep=";")
plot(tab$Prix, tab$Vente, main="Nombre de commandes en fonction du prix")
```

2) Calculer le coefficient de corrélation linéaire entre X et Y. Conclusion
`cor(tab$Prix, tab$Vente)`

[1] -0.8685478

⇒

- $|r_{xy}| \sim 1$ donc relation droite
- $r_{xy} < 0$ donc plus le prix augmente et moins il y a de commandes

3) Déterminer la droite de régression de Y en fonction de X.

```
> RegLin=lm(tab$Vente~tab$Prix)
```

```
> summary(RegLin)
```

Call:

```
lm(formula = tab$Vente ~ tab$Prix)
```

Residuals:

```
 1    2    3    4    5    6
27.809 -4.726 -13.800 -19.947 -8.557 19.222
```

Coefficients:

```
      Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
(Intercept) 112.7414   22.9958   4.903 0.00803 **
tab$Prix    -0.3847    0.1098  -3.505 0.02478 *
---
Signif. codes:  0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
```

Residual standard error: 21.37 on 4 degrees of freedom

Multiple R-squared: 0.7544, Adjusted R-squared: 0.693

F-statistic: 12.29 on 1 and 4 DF, p-value: 0.02478

4) Quel est le pourcentage de variation des quantités de commande expliquée par la droite de régression ?

⇒ 75% de la variabilité des commandes s'explique par la droite de régression :

Commandes= 112.74-0.38×Prix

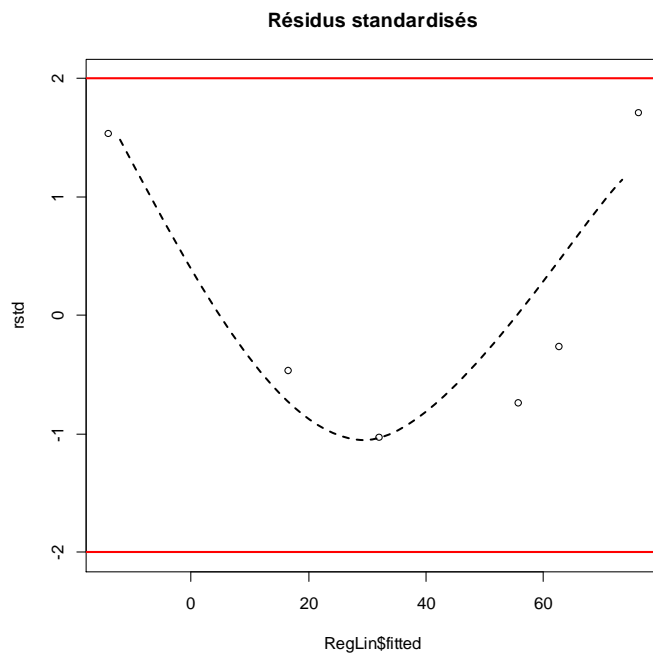
5) Calculer les résidus et vérifier les hypothèses sur les résidus. Conclusion.

```
rstd=rstandard(RegLin)
```

```
plot(RegLin$fitted,rstd,ylim=range(-2,2,rstd),main="Résidus standardisés")
```

```
abline(h=2,col="red",lwd=2)
```

```
abline(h=-2,col="red",lwd=2)
```



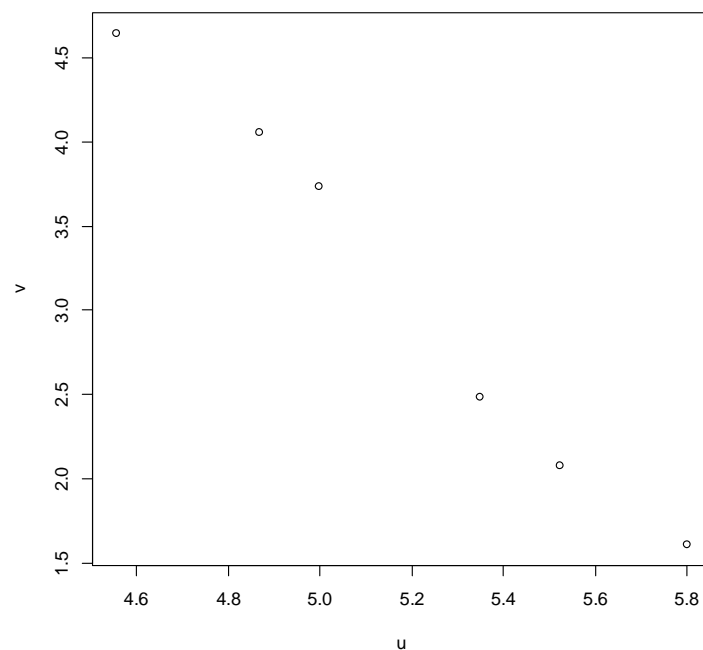
⇒ Forme quadratique. Il reste de l'information dans les résidus. Malgré un pourcentage d'explication important, on ne peut pas valider le modèle

6) On pose $u = \log(x)$ et $v = \log(y)$. Quelle est la relation entre u et v ?

`u=log(tab$Prix)`

`v=log(tab$Vente)`

`plot(u,v)`



⇒ Relation linéaire entre u et v

7) Calculer le coefficient de corrélation linéaire entre u et v .

`> cor(u,v)`

`[1] -0.9918848`

⇒

- $|r_{xy}| \sim 1$ donc relation droite confirmée
- $r_{xy} < 0$ donc plus u augmente et v diminue

8) Trouver la droite de régression de v sur u.

```
> RegLin=lm(v~u)
> summary(RegLin)
```

Call:

lm(formula = v ~ u)

Residuals:

```
 1    2    3    4    5    6
-0.1042 0.1350 0.1525 -0.1820 -0.1299 0.1286
```

Coefficients:

```
      Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
(Intercept) 16.6990    0.8742   19.1 4.43e-05 ***
u           -2.6242    0.1682  -15.6 9.85e-05 ***
---

```

Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1

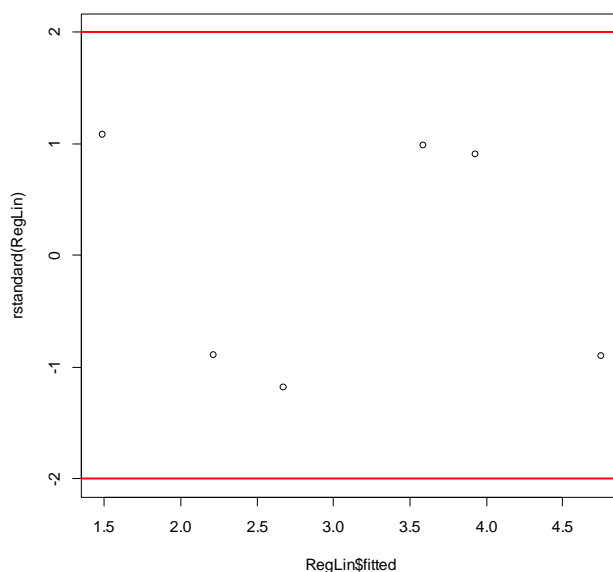
Residual standard error: 0.1724 on 4 degrees of freedom
Multiple R-squared: 0.9838, Adjusted R-squared: 0.9798
F-statistic: 243.5 on 1 and 4 DF, p-value: 9.852e-05

L'équation est $v=16.7-2.6 \times u$

9) Quel est le pourcentage de variation des quantités de commande expliquée par la droite de régression ?

Cette droite explique 98% de la variabilité de v

10) Valider le modèle.



Les résidus sont centrés, sans forme particulière et compris entre -2 et 2.

11) En déduire la quantité qui serait commandée si le prix était fixé à 75€.

```
newu <- data.frame(u = c(log(75)))
newv <- predict(RegLin,newdata=newu)
exp(newv)
1
214.6269
```

Pour un prix de 75€, la quantité commandée serait 214

Exercice 1 (suite – facultatif)

Montrer la formule de décomposition de la variance

$$s_y^2 = s_E^2 + s_R^2$$

où s_E^2 est la *variance expliquée* par la droite de régression, et s_R^2 est la *variance résiduelle*.

$$s_y^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i + \hat{y}_i - \bar{y})^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2 + (\hat{y}_i - \bar{y})^2 + 2(y_i - \hat{y}_i)(\hat{y}_i - \bar{y})$$

$$\triangleright \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n e_i^2 = s_e^2 \text{ car } \bar{e} = 0$$

$$\triangleright \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (\hat{y}_i - \bar{y})^2 = s_y^2 \text{ car } \bar{\hat{y}} = \bar{y}$$

$$\triangleright \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)(\hat{y}_i - \bar{y}) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n e_i(\hat{y}_i - \bar{y}) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n e_i \hat{y}_i - \bar{y} \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n e_i = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n e_i \hat{y}_i \text{ car } \bar{e} = 0$$

$$= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n e_i(\hat{a}x_i + \hat{b}) = \hat{a} \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n e_i x_i + \hat{b} \bar{e} = 0 \text{ d'après 3)}$$

On peut alors montrer que le *coefficient de détermination*

$$R^2 = \frac{s_E^2}{s_y^2},$$

qui donne le taux de variance expliquée par la droite de régression, est égale au coefficient de corrélation linéaire au carré, $R^2 = r_{xy}^2$.