

Zeitschrift: L'Enseignement Mathématique
Herausgeber: Commission Internationale de l'Enseignement Mathématique
Band: 6 (1960)
Heft: 1: L'ENSEIGNEMENT MATHÉMATIQUE

Artikel: LES MODÈLES LINÉAIRES EN ANALYSE STATISTIQUE
Autor: Breny, H.
Kapitel: 3, 1. Remarques théoriques
DOI: <https://doi.org/10.5169/seals-36341>

Nutzungsbedingungen

Die ETH-Bibliothek ist die Anbieterin der digitalisierten Zeitschriften auf E-Periodica. Sie besitzt keine Urheberrechte an den Zeitschriften und ist nicht verantwortlich für deren Inhalte. Die Rechte liegen in der Regel bei den Herausgebern beziehungsweise den externen Rechteinhabern. Das Veröffentlichen von Bildern in Print- und Online-Publikationen sowie auf Social Media-Kanälen oder Webseiten ist nur mit vorheriger Genehmigung der Rechteinhaber erlaubt. [Mehr erfahren](#)

Conditions d'utilisation

L'ETH Library est le fournisseur des revues numérisées. Elle ne détient aucun droit d'auteur sur les revues et n'est pas responsable de leur contenu. En règle générale, les droits sont détenus par les éditeurs ou les détenteurs de droits externes. La reproduction d'images dans des publications imprimées ou en ligne ainsi que sur des canaux de médias sociaux ou des sites web n'est autorisée qu'avec l'accord préalable des détenteurs des droits. [En savoir plus](#)

Terms of use

The ETH Library is the provider of the digitised journals. It does not own any copyrights to the journals and is not responsible for their content. The rights usually lie with the publishers or the external rights holders. Publishing images in print and online publications, as well as on social media channels or websites, is only permitted with the prior consent of the rights holders. [Find out more](#)

Download PDF: 28.01.2026

ETH-Bibliothek Zürich, E-Periodica, <https://www.e-periodica.ch>

LES MODÈLES LINÉAIRES EN ANALYSE STATISTIQUE

par H. BRENY

(suite)

3. CAS OU $\text{rg } \mathfrak{A} = \dim \mathbf{B}$.

3, 1. *Remarques théoriques.*

3, 11. Lorsque $r = p$, $\mathfrak{G} \equiv \mathfrak{A}^T \mathfrak{A}$ est une matrice symétrique $p \times p$, régulière, dont on peut former l'inverse \mathfrak{G}^{-1} . Alors, de

$$\mathfrak{G} \hat{\mathbf{b}}_H = \mathfrak{A}^T \mathbf{x}$$

on tire

$$\hat{\mathbf{b}}_H = \mathfrak{G}^{-1} \mathfrak{A}^T \mathbf{x} ,$$

et on en déduit

$$\begin{aligned} \mathbf{C} \hat{\mathbf{b}}_H &= \mathbf{E} (\hat{\mathbf{b}}_H - \mathbf{b}_H) (\hat{\mathbf{b}}_H - \mathbf{b}_H)^T \\ &= \mathbf{E} \mathfrak{G}^{-1} \mathfrak{A}^T (\mathbf{x} - \mathbf{E} \mathbf{x}) (\mathbf{x} - \mathbf{E} \mathbf{x})^T \mathfrak{A} \mathfrak{G}^{-1} . \end{aligned}$$

Mais

$$\mathbf{E} (\mathbf{x} - \mathbf{E} \mathbf{x}) (\mathbf{x} - \mathbf{E} \mathbf{x})^T = \mathbf{C} \mathbf{x} = \mathfrak{J}_n \sigma^2 ,$$

donc

$$\mathbf{C} \hat{\mathbf{b}}_H = \mathfrak{G}^{-1} \mathfrak{A}^T (\mathfrak{J}_n \sigma^2) \mathfrak{A} \mathfrak{G}^{-1} = (\mathfrak{G}^{-1} \mathfrak{A}^T \mathfrak{A} \mathfrak{G}^{-1}) \sigma^2 = \mathfrak{G}^{-1} \sigma^2 . \quad (13)$$

Le calcul de \mathfrak{G}^{-1} équivaut donc à celui de $\mathbf{C} \hat{\mathbf{b}}_H$.

3, 12. Pour le calcul de **SCN**, il faut former les équations (7); ici, les \mathfrak{u}_i^* sont représentés par les lignes de \mathfrak{A}^T , \mathfrak{c}_i^T , de sorte que, aux inconnues près, le système (7) n'est autre que le système normal (donc, $\lambda_i = \hat{\mathbf{b}}_{H,i}$); il résulte alors de (8) que

$$\begin{aligned} \mathbf{SCN} &= \sum_1^p \hat{\mathbf{b}}_{H,i} \mathfrak{c}_i^T \mathbf{x} = \hat{\mathbf{b}}_H^T \mathfrak{A}^T \mathbf{x} \\ &= (\mathbf{x}^* \mathfrak{A}) \mathfrak{G}^{-1} (\mathfrak{A}^T \mathbf{x}) . \quad (14) \end{aligned}$$

3, 13. **SCE** acquiert ici une signification très simple. En effet, si on pose

$$\mathbf{e} = \mathbf{A} \hat{\mathbf{b}}_H + \mathbf{r}$$

(de sorte que les composantes $r_{H,i}$ de \mathbf{r}_H sont les «résidus»), on a, d'une part,

$$\mathbf{A}^T \mathbf{e} = \mathbf{A}^T \mathbf{A} \hat{\mathbf{b}}_H,$$

et, d'autre part,

$$\mathbf{A}^T \mathbf{e} = \mathbf{A}^T \mathbf{A} \hat{\mathbf{b}}_H + \mathbf{A}^T \mathbf{r};$$

on a donc $\mathbf{A}^T \mathbf{r} = 0$; dès lors

$$\begin{aligned} \mathbf{e}^* \mathbf{e} &= (\hat{\mathbf{b}}_H^T \mathbf{A}^T + \mathbf{r}^T) (\mathbf{A} \hat{\mathbf{b}}_H + \mathbf{r}) \\ &= \hat{\mathbf{b}}_H^T \mathbf{A}^T \mathbf{A} \hat{\mathbf{b}}_H + \mathbf{r}^T \mathbf{r} + \hat{\mathbf{b}}_H^T \mathbf{A}^T \mathbf{r} + \mathbf{r}^T \mathbf{A} \hat{\mathbf{b}}_H \\ &= \hat{\mathbf{b}}_H^T \mathbf{A}^T \mathbf{e} + \mathbf{r}^T \mathbf{r} = \mathbf{SCN} + \mathbf{r}^T \mathbf{r}, \end{aligned}$$

d'où, puisque $\mathbf{e}^* \mathbf{e} = \mathbf{SCT}$,

$$\mathbf{SCE} = \mathbf{r}^T \mathbf{r} = \sum_1^n \mathbf{r}_{H,i}^2.$$

3, 14. Si \mathfrak{G} est diagonale (ce qui arrive si et seulement si les lignes de \mathbf{A}^T correspondent à des vecteurs deux à deux orthogonaux de \mathbf{V}_+), les $\hat{\mathbf{b}}_{H,i}$ sont deux à deux orthogonaux, et

$$\mathbf{SCN} = \sum_1^p \mathbf{SC}\{\hat{\mathbf{b}}_{H,i}\}.$$

3, 2. *Exécution des calculs.*

3, 21. La résolution des équations normales peut évidemment se faire par un procédé quelconque. On sait toutefois, depuis Benoît et Banachiewicz, que les procédés «compacts» habituels constituent tous des variations plus ou moins heureuses de la méthode de «factorisation triangulaire», particulièrement simple à appliquer dans le cas d'une matrice symétrique, comme l'est \mathfrak{G} (cfr. [VI, VII]).

3, 22. Il s'agit, en principe, de trouver une matrice \mathfrak{S} , triangulaire supérieure, telle que

$$\mathfrak{G} = \mathfrak{S}^T \mathfrak{S} = \mathfrak{S} \times^0 \mathfrak{S}.$$