

STA212 - Données catégorielles

Présentation

Prérequis

Ce cours s'adresse en priorité aux auditeurs préparant le master MR0085.
Il s'adresse également à des auditeurs préparant le diplôme d'actuaire.
Niveau requis: STA102 (régression et analyse de la variance) et STA104 (statistique mathématique).

Objectifs pédagogiques

Permettre aux ingénieurs, cadres d'entreprises ou d'administrations, médecins, chercheurs, de construire des modèles explicatifs de variables qualitatives. Le cours s'appuie sur la pratique du logiciel SAS, mis à disposition des auditeurs.

Programme

Contenu

Présentation des méthodes statistiques traitant des variables qualitatives

Principes généraux d'estimation d'un modèle (maximum de vraisemblance)

La régression logistique simple

Notion de variable latente

Les modèles PROBIT, LOGIT

Le modèle logistique et son interprétation

Analyse des résidus, des observations

La régression logistique multiple

Le modèle : prédicteurs quantitatifs ou qualitatifs

Sélection de variables

Résumé des tests de validité générale d'un modèle

Tables de classement, courbe ROC

Interprétation des coefficients de la régression logistique : odds ratio

La régression logistique dans le cas où Y est une variable polytomique ordonnée

Aspects pratiques de la mise en oeuvre des méthodes de régression logistique

La procédure LOGISTIC

Présentation des modèles linéaires généralisés et de la procédure GENMOD

Régression de Poisson

Etude de contrastes

Modélisation d'une réponse multinomiale

Estimation par maximum de vraisemblance ou par moindres carrés généralisés

Etude de cas avec la procédure CATMOD

Comparaison de la régression logistique avec d'autres méthodes de modélisation d'une réponse qualitative

Analyse discriminante sur variables quantitatives et qualitatives

Arbres de décision

Éléments pratiques de création d'un score

Méthodes PLS

Présentation de NIPALS, PLS1, PLS2

Applications: régression logistique PLS, analyse discriminante PLS

Modèles linéaires généralisés PLS

🌟 Valide le 25-03-2019

Code : STA212

9 crédits

Responsabilité nationale :

EPN06 - Mathématique et statistique / Vincent AUDIGIER

Contact national :

EPN06 Mathématiques et statistiques

2 rue conté

Accès 35 3 ème étage porte 19

75003 Paris

Sabine Glodkowski

formation.maths@cnam.fr

Description des modalités de validation

Rédaction d'un mémoire utilisant les méthodes présentées en cours

Bibliographie

Titre	Auteur(s)
Applied logistic regression 2ième édition (Wiley, 2000)	HOSMER D., LEMESHOW S.
Statistique explicative appliquée (Technip, 2003)	NAKACHE J.P., CONFAIS J.
Modèles statistiques pour données qualitatives (Technip 2005)	Editeurs DROESBEKE, LEJEUNE, SAPORTA; Auteurs: CROUX, GONZALEZ....
Categorical Data Analysis using the SAS System (SAS Institute Inc, Cary, NC, 2000)	STOKES M.E., DAVIS C.S. & KOCH G.G.
Analyse discriminante (Dunod, 2001)	BARDOS M.
Categorical data analysis 2ième édition (Wiley, 2002)	AGRESTI A.