

IBM SPSS Regression V27

IBM

Important

Avant d'utiliser le présent document et le produit associé, prenez connaissance des informations générales figurant à la section «Remarques», à la page 31.

Notice d'édition

La présente édition s'applique à la version V27.0.0 d'IBM® SPSS Statistics et à toutes les éditions et modifications ultérieures sauf mention contraire dans les nouvelles éditions.

LE PRESENT DOCUMENT EST LIVRE EN L'ETAT SANS AUCUNE GARANTIE EXPLICITE OU IMPLICITE. IBM DECLINE NOTAMMENT TOUTE RESPONSABILITE RELATIVE A CES INFORMATIONS EN CAS DE CONTREFACON AINSI QU'EN CAS DE DEFAUT D'APTITUDE A L'EXECUTION D'UN TRAVAIL DONNE.

Ce document est mis à jour périodiquement. Chaque nouvelle édition inclut les mises à jour. Les informations qui y sont fournies sont susceptibles d'être modifiées avant que les produits décrits ne deviennent eux-mêmes disponibles. En outre, il peut contenir des informations ou des références concernant certains produits, logiciels ou services non annoncés dans ce pays. Cela ne signifie cependant pas qu'ils y seront annoncés.

Pour plus de détails, pour toute demande d'ordre technique, ou pour obtenir des exemplaires de documents IBM, référez-vous aux documents d'annonce disponibles dans votre pays, ou adressez-vous à votre partenaire commercial.

Vous pouvez également consulter les serveurs Internet suivants :

- <http://www.fr.ibm.com> (serveur IBM en France)
- <http://www.ibm.com/ca/fr> (serveur IBM au Canada)
- <http://www.ibm.com> (serveur IBM aux Etats-Unis)

*Compagnie IBM France
Direction Qualité
17, avenue de l'Europe
92275 Bois-Colombes Cedex*

© Copyright IBM France 2020. Tous droits réservés.

© **Copyright International Business Machines Corporation .**

Table des matières

Avis aux lecteurs canadiens.....	V
Chapitre 1. Régression.....	1
Choix d'une procédure pour la régression logistique binaire.....	1
Régression logistique	2
Définition de la règle de régression logistique.....	3
Méthodes de sélection des variables de régression logistique.....	3
Régression logistique : définition des variables catégorielles.....	4
Régression logistique : enregistrer les nouvelles variables.....	4
Options de régression logistique.....	5
Fonctions supplémentaires de la commande REGRESSION LOGISTIQUE.....	6
Régression logistique multinomiale.....	6
Régression logistique multinomiale.....	7
Régression logistique multinomiale : Catégorie de référence.....	8
Régression logistique multinomiale : Statistiques.....	8
Régression logistique multinomiale : Critères.....	9
Options de régression logistique multinomiale.....	9
Régression logistique multinomiale : Enregistrer.....	10
Fonctions supplémentaires de la commande NOMREG.....	10
Régression probits	10
Analyse par la méthode des probits : définir une plage.....	12
Options des analyses par la méthode des probits.....	12
Fonctions supplémentaires de la commande NLR.....	12
Régression quantile	12
Régression quantile : Critères.....	14
Régression quantile : Modèle.....	15
Régression quantile : Affichage.....	16
Régression quantile : Enregistrer.....	17
Régression quantile : Exporter.....	18
Régression non linéaire	19
Logique conditionnelle (régression non linéaire).....	20
Paramètres de régression non linéaire.....	20
Modèles courants de régression non linéaire.....	20
Fonction de perte de la régression non linéaire.....	21
Options de contraintes de la régression non linéaire.....	21
Régression non linéaire : enregistrer les nouvelles variables.....	22
Options de régression non linéaire.....	22
Interprétation des résultats de la régression non linéaire.....	22
Fonctions supplémentaires de la commande NLR.....	23
Pondération estimée	23
Options de la pondération estimée.....	24
Fonctions supplémentaires de la commande WLS.....	25
Régression par les doubles moindres carrés.....	25
Options de régression par les doubles moindres carrés.....	26
Fonctions supplémentaires de la commande 2SLS.....	26
Méthodes de codification des variables qualitatives.....	26
Déviation.....	26
Simple.....	27
Helmert.....	27
Différence.....	28

Polynomial.....	28
Répété.....	29
Spécial.....	29
Indicateur.....	30
Remarques.....	31
Marques.....	32
Index.....	35

Avis aux lecteurs canadiens

Le présent document a été traduit en France. Voici les principales différences et particularités dont vous devez tenir compte.

Illustrations

Les illustrations sont fournies à titre d'exemple. Certaines peuvent contenir des données propres à la France.

Terminologie

La terminologie des titres IBM peut différer d'un pays à l'autre. Reportez-vous au tableau ci-dessous, au besoin.

IBM France	IBM Canada
ingénieur commercial	représentant
agence commerciale	succursale
ingénieur technico-commercial	informaticien
inspecteur	technicien du matériel

Claviers

Les lettres sont disposées différemment : le clavier français est de type AZERTY, et le clavier français-canadien de type QWERTY.

OS/2 et Windows - Paramètres canadiens

Au Canada, on utilise :

- les pages de codes 850 (multilingue) et 863 (français-canadien),
- le code pays 002,
- le code clavier CF.

Nomenclature

Les touches présentées dans le tableau d'équivalence suivant sont libellées différemment selon qu'il s'agit du clavier de la France, du clavier du Canada ou du clavier des États-Unis. Reportez-vous à ce tableau pour faire correspondre les touches françaises figurant dans le présent document aux touches de votre clavier.

France	Canada	Etats-Unis
⌫ (Pos1)	⌫	Home
Fin	Fin	End
⬆ (PgAr)	⬆	PgUp
⬇ (PgAv)	⬇	PgDn
Inser	Inser	Ins
Suppr	Suppr	Del
Echap	Echap	Esc
Attn	Intrp	Break
Impr écran	ImpEc	PrtSc
Verr num	Num	Num Lock
Arrêt défil	Défil	Scroll Lock
🔒 (Verr maj)	FixMaj	Caps Lock
AltGr	AltCar	Alt (à droite)

Brevets

Il est possible qu'IBM détienne des brevets ou qu'elle ait déposé des demandes de brevets portant sur certains sujets abordés dans ce document. Le fait qu'IBM vous fournisse le présent document ne signifie pas qu'elle vous accorde un permis d'utilisation de ces brevets. Vous pouvez envoyer, par écrit, vos demandes de renseignements relatives aux permis d'utilisation au directeur général des relations commerciales d'IBM, 3600 Steeles Avenue East, Markham, Ontario, L3R 9Z7.

Assistance téléphonique

Si vous avez besoin d'assistance ou si vous voulez commander du matériel, des logiciels et des publications IBM, contactez IBM direct au 1 800 465-1234.

Chapitre 1. Régression

Les fonctions de régression suivantes sont incluses dans SPSS Statistics Standard Edition ou l'option Régression.

Choix d'une procédure pour la régression logistique binaire

Les modèles de régression logistique binaire peuvent être ajustés à l'aide des procédures Régression logistique et Régression logistique multinomiale. Chacune de ces procédures comporte des options qui lui sont propres. Il convient de faire une importante distinction théorique entre les deux procédures : la procédure de régression logistique génère toutes les prévisions, résidus, statistiques d'influence et tests de qualité d'ajustement en utilisant les données au niveau des observations individuelles, quelle que soit la façon dont ces données ont été entrées et que le nombre de motifs de covariable soit inférieur ou non au nombre total d'observations ; alors que la procédure de régression logistique multinomiale agrège les observations au niveau interne pour constituer des sous-populations présentant des motifs de covariable identiques pour les prédicteurs, générant ainsi des prévisions, des résidus et des tests de qualité d'ajustement en fonction de ces sous-populations. Si tous les prédicteurs sont catégoriels ou que des prédicteurs continus prennent en compte un nombre limité de valeurs, de sorte qu'il existe plusieurs observations pour chaque motif de covariable distinct, la méthode de constitution de sous-populations peut générer des tests de qualité d'ajustement et des résidus informatifs valides, ce qui n'est pas le cas de la procédure effectuée au niveau des observations individuelles.

Régression logistique

Offre les fonctions spécifiques suivantes :

- test Hosmer-Lemeshow de la qualité d'ajustement du modèle ;
- analyses pas à pas ;
- contrastes permettant de définir le paramétrage du modèle ;
- césures alternatives pour le classement ;
- tracés de classement ;
- modèle ajusté sur un ensemble d'observations par rapport à un ensemble d'observations restant ;
- enregistrement des prévisions, des résidus et des statistiques d'influence.

Régression logistique multinomiale

Offre les fonctions spécifiques suivantes :

- tests du khi-deux de Pearson et de déviance pour la qualité d'ajustement du modèle ;
- définition de sous-populations pour le regroupement de données afin d'effectuer des tests de qualité d'ajustement ;
- énumération des effectifs, des effectifs prédits et des résidus par sous-population ;
- correction des estimations de variance pour la surdispersion ;
- matrice de covariance des estimations de paramètres ;
- tests des combinaisons linéaires de paramètres ;
- définition explicite des modèles imbriqués ;
- ajustement 1-1 de modèles de régression logistique conditionnels correspondants au moyen de variables différenciées.

Remarques :

- Ces deux procédures permettent d'ajuster un modèle pour des données binaires qui est un modèle linéaire généralisé avec une distribution binomiale et la fonction de lien logit. Si une autre fonction de lien est plus appropriée pour vos données, utilisez la procédure Modèles linéaires généralisés.

- Si vous possédez des mesures répétées de données binaires ou des enregistrements corrélés, vous devez envisager d'utiliser les procédures Modèles linéaires mixtes généralisés ou Equations d'estimation généralisées.

Régression logistique

La régression logistique est utile lorsque vous souhaitez être capable de prévoir la présence ou l'absence d'une caractéristique ou d'un résultat en fonction de certaines valeurs ou d'un groupe de variables de prédicteur. Elle est similaire à la régression linéaire mais elle convient aux modèles dans lesquelles les variables sont dichotomiques. Les coefficients de la régression logistique peuvent servir à estimer des rapports des cotes pour chacune des variables indépendantes d'un modèle. La régression logistique s'applique à une plus large gamme de situations de recherche que l'analyse discriminante.

Exemple : Quelles sont les caractéristiques du mode de vie qui constituent des facteurs de risques coronariens ? Sur un échantillon de patients choisis en fonction de leur statut de fumeur, leur régime alimentaire, leur consommation d'alcool et leur historique cardiaque, vous pouvez construire un modèle à l'aide de quatre variables du mode de vie pour expliquer la présence ou l'absence de déficiences coronariennes sur l'échantillon de patients. Le modèle peut alors servir à dériver les prévisions des rapports des cotes pour chaque facteur afin de vous indiquer, par exemple, que les fumeurs sont plus susceptibles de développer des déficiences coronariennes que les non-fumeurs.

Statistiques : Pour chaque analyse : observations totales, observations sélectionnées, observations valides. Pour chaque variable catégorielle : codage de paramètre. Pour chaque pas : variable(s) introduites ou éliminées, historique des itérations, log de vraisemblance -2 , qualité de l'ajustement, statistique de qualité d'ajustement de Hosmer-Lemeshow, khi-deux du modèle, khi-deux d'amélioration, table de classification, corrélations entre variables, groupes observés et graphique des probabilités prévues, khi-deux résiduel. Pour chaque variable de l'équation : coefficient (B), erreur standard de B , statistique de Wald, rapport des cotes estimé ($\exp(B)$), intervalle de confiance pour $\exp(B)$, log de vraisemblance si un terme a été éliminé du modèle. Pour chaque variable hors de l'équation : statistiques de scores. Pour chaque observation : groupe observé, probabilité prédite, groupe prévu, résidu, résidu standard.

Méthodes : Vous pouvez estimer des modèles à l'aide des entrées en bloc de variables ou de n'importe laquelle des méthodes détaillées pas à pas suivantes : ascendante conditionnelle, ascendante rapport de vraisemblance, ascendante Wald, descendante conditionnelle, descendante rapport de vraisemblance, descendante Wald.

Remarques sur les données de régression logistique

Données : Les variables dépendantes et indépendantes doivent être dichotomiques. Les variables indépendantes peuvent être de niveaux d'intervalles ou des variables catégorielles. Dans ce dernier cas, elles doivent être factices ou codées numériquement (il existe une option dans la procédure pour recoder les variables catégorielles automatiquement).

Hypothèses : La régression logistique ne s'appuie pas sur des hypothèses de distribution au même sens que l'analyse discriminante. Cependant, votre solution peut être plus stable si vos prédicteurs suivent une distribution multivariée gaussienne. De surcroît, comme avec les autres formes de régression, la multicollinéarité parmi les prédicteurs peut entraîner une altération des estimations et l'augmentation des erreurs standard. La procédure est plus efficace lorsque l'appartenance au groupe est une variable purement catégorielle, si l'appartenance au groupe est fondée sur des valeurs d'une variable continue (par exemple "QI élevé" opposé à "QI faible"), vous devez envisager d'utiliser la régression linéaire pour profiter de la richesse des informations offertes par la variable continue elle-même.

Procédures apparentées : Utilisez le nuage de points pour étudier la multicollinéarité de vos données. Si les hypothèses de normalité multivariées et d'égalité des matrices de variance/covariance sont satisfaites, vous devez obtenir une solution plus rapide à l'aide de la procédure d'analyse discriminante. Si toutes vos variables de prédicteur sont catégorielles, vous pouvez également utiliser la procédure log-linéaire. Si votre variable dépendante est continue, utilisez la procédure de régression linéaire. Vous

pouvez utiliser la procédure Courbe ROC pour tracer sous forme graphique les probabilités enregistrées avec la procédure Régression logistique.

Obtenir une analyse de la régression logistique

1. A partir des menus, sélectionnez :

Analyse > Régression > Logistique binaire...

2. Sélectionnez une Variable dépendante dichotomique. Il peut s'agir d'une variable numérique ou d'une chaîne.

3. Sélectionnez une ou plusieurs covariables. Pour ajouter des termes d'interaction, sélectionnez toutes les variables impliquées dans l'interaction, puis sélectionnez **>a*b>**.

Pour saisir les variables en groupe (**blocs**), sélectionnez les covariables pour un bloc, puis cliquez sur **Suivant** pour spécifier un nouveau bloc. Répétez jusqu'à ce que tous les blocs soient spécifiés.

Vous pouvez éventuellement sélectionner des observations pour analyse. Choisissez une variable de sélection, puis entrez les critères de règle.

Définition de la règle de régression logistique

Les observations définies par la règle de sélection sont incluses dans l'estimation du modèle. Par exemple, si vous avez sélectionné une variable ainsi que l'opérateur **égal à** et que vous avez spécifié la valeur 5, seules les observations pour lesquelles la variable sélectionnée a une valeur égale à 5 sont incluses dans l'estimation du modèle.

Les résultats des statistiques et de classification sont générés pour les observations sélectionnées et celles qui ne le sont pas. Cette procédure met en oeuvre un mécanisme de classification des nouvelles observations à partir des données précédemment existantes, ou de partitionnement de vos données en sous-ensembles d'entraînement et de test, afin d'effectuer la validation du modèle généré.

Méthodes de sélection des variables de régression logistique

La sélection d'une méthode vous permet de spécifier la manière dont les variables indépendantes sont entrées dans l'analyse. En utilisant différentes méthodes, vous pouvez construire divers modèles de régression à partir du même groupe de variables.

- *Introduction*. Procédure de sélection de variables dans laquelle toutes les variables d'un bloc sont introduites en une seule étape.
- *Sélection ascendante (conditionnelle)*. Méthode de sélection étape par étape avec test d'entrée fondé sur la signification de la statistique de score et avec test de suppression fondé sur la probabilité d'une statistique du rapport de vraisemblance s'appuyant sur des estimations de paramètres conditionnels.
- *Sélection ascendante (rapport de vraisemblance)*. Méthode de sélection étape par étape avec test d'entrée fondé sur la signification de la statistique de score et avec test de suppression fondé sur la probabilité d'une statistique du rapport de vraisemblance s'appuyant sur des estimations de vraisemblance partielle maximale.
- *Sélection ascendante (Wald)*. Méthode de sélection étape par étape avec test d'entrée fondé sur la signification de la statistique de score et avec test de suppression fondé sur la probabilité de la statistique de Wald.
- *Elimination descendante (conditionnelle)*. Sélection pas à pas descendante. Le test de suppression se base sur la probabilité du rapport de vraisemblance calculé à partir d'estimations de paramètres conditionnels.
- *Elimination descendante (rapport de vraisemblance)*. Sélection pas à pas descendante. Le test de suppression se base sur la probabilité de la statistique du rapport de vraisemblance calculé à partir des estimations de vraisemblance partielle maximale.
- *Elimination descendante (Wald)*. Sélection pas à pas descendante. Le test de suppression se base sur la probabilité de la statistique de Wald.

Les valeurs de signification dans vos sorties sont basées sur l'adéquation à un modèle unique. Par conséquent, les valeurs de signification ne sont généralement pas valides lorsqu'une méthode détaillée pas à pas est utilisée.

Toutes les variables indépendantes sélectionnées sont ajoutées dans un seul modèle de régression. Cependant, vous pouvez spécifier différentes méthodes d'entrée pour les sous-groupes de variables. Par exemple, vous pouvez entrer un bloc de variables dans le modèle de régression en utilisant la sélection étape par étape, et un second bloc en utilisant la sélection ascendante. Pour ajouter un second bloc de variables au modèle de régression, cliquez sur **Suivant**.

Régression logistique : définition des variables catégorielles

Vous pouvez spécifier les détails de la manière dont la procédure de régression logistique gère les variables catégorielles :

Covariables : Contient la liste de toutes les covariables spécifiées dans la boîte de dialogue principale, soit par elles-mêmes, soit comme partie d'une interaction, à n'importe quelle couche. Si certaines de ces covariables sont des variables de chaîne, vous pouvez utiliser des covariables catégorielles.

Covariables catégorielles : Etablit la liste de toutes les variables identifiées comme étant catégorielles. Chaque variable comprend une notation entre parenthèses indiquant la codification de contraste à utiliser. Les variables de chaîne (identifiées par le symbole < suivi de leurs noms) sont déjà présentes dans la liste des covariables catégorielles. Sélectionnez n'importe quelle autre covariable catégorielle à partir de la liste des covariables catégorielles.

Modifier le contraste : Permet de modifier la méthode de contraste. Les méthodes de contraste disponibles sont :

- **Indicateur** : Les contrastes indiquent la présence ou l'absence d'appartenance à la catégorie. La catégorie de référence est représentée par la matrice de contraste sous la forme d'une ligne de zéros.
- **Simple** : Chaque catégorie de la variable de prédicteur (hormis la catégorie de référence) est comparée à la catégorie de référence.
- **Différence** : Chaque catégorie de la variable de prédicteur (hormis la première catégorie) est comparée avec l'effet moyen des catégories précédentes. (Aussi connu sous le nom de contrastes inversés d'Helmert.)
- **Helmert** : Chaque catégorie de la variable de prédicteur (hormis la dernière catégorie) est comparée avec l'effet moyen des catégories suivantes.
- **Répété** : Chaque catégorie de la variable de prédicteur (hormis la dernière catégorie) est comparée à la catégorie suivante.
- **Modèle polynomial** : Contraste polynomial orthogonal. On part de l'hypothèse que les catégories sont espacées de manière équivalente. Les contrastes polynomiaux sont utilisables pour les variables numériques seulement.
- **Déviation** : Chaque catégorie de la variable de prédicteur (hormis la catégorie de référence) est comparée à l'effet global.

Si vous sélectionnez **Déviation**, **Simple** ou **Indicateur**, sélectionnez **Première** ou **Dernière** comme catégorie de référence. Remarquez que vous ne changez pas réellement de méthode avant de cliquer sur **Changer**.

Les covariables de chaîne doivent impérativement être des covariables catégorielles. Pour supprimer une variable de chaîne de la liste des covariables catégorielles, vous devez supprimer tous les termes contenant cette variable de la liste des covariables de la boîte de dialogue principale.

Régression logistique : enregistrer les nouvelles variables

Vous pouvez enregistrer les résultats de la régression logistique sous forme de nouvelles variables dans le jeu de données actif :

Prévisions : Enregistre les valeurs prévues par le modèle. Les options disponibles sont Probabilités et Groupe d'affectation.

- *Probabilités*. Enregistre pour chaque observation la probabilité d'occurrence prévue pour l'événement. Dans les sorties, un tableau affiche le nom et le contenu de toutes les nouvelles variables. L'événement est la catégorie de la variable dépendante qui a la plus haute valeur, par exemple, si la valeur dépendante prend les valeurs 0 et 1, la probabilité prédite de la catégorie 1 est enregistrée.
- *Appartenance au groupe prévu*. Groupe qui possède la probabilité a posteriori la plus élevée, basé sur les écarts discriminants. Le groupe prévu par le modèle est celui auquel appartient l'observation.

Influence : Enregistre des valeurs à partir des statistiques qui mesurent l'influence des observations sur les prévisions. Les options disponibles sont Statistique de Cook, Bras de levier et Différence de bêta.

- *Cook*. Régression logistique analogue à la statistique de Cook. Mesure permettant de savoir de combien les résidus de toutes les observations seraient modifiés si une observation donnée était exclue du calcul des coefficients de régression.
- *Valeur influente*. Mesure de l'influence d'un point sur l'ajustement de la régression.
- *DfBêta(s)*. La différence de bêta correspond au changement des coefficients de régression qui résulte du retrait d'une observation particulière. Une valeur est calculée pour chaque terme du modèle, y compris la constante.

Résidus : Enregistre les résidus. Les options disponibles sont Non standardisés, Logit, Studentisés, Standardisés et Déviance.

- *Résidus non standardisés*. Différence entre la valeur observée et la valeur prévue par le modèle.
- *Résidu logit*. Résidu de l'observation lorsque celle-ci est prévue dans l'échelle logit. Le résidu logit est le résidu divisé par la probabilité prévue fois 1, moins la probabilité prévue.
- *Résidu de Student*. Evolution de la déviance du modèle lorsqu'une observation est exclue.
- *Résidus standardisés*. Résidu, divisé par une estimation de son écart type. Egalement appelés résiduels de Pearson, les résiduels standardisés ont une moyenne de 0 et un écart type de 1.
- *Déviance*. Résidus fondés sur la déviance du modèle.

Exporter les informations du modèle dans un fichier XML : Les estimations de paramètres et leurs covariances (facultatif) sont exportées vers le fichier spécifié au format XML (PMML). Vous pouvez utiliser ce fichier de modèle pour appliquer les informations du modèle aux autres fichiers de données à des fins d'évaluation.

Options de régression logistique

Vous pouvez sélectionner les options suivantes pour votre analyse :

Tracés et statistiques : Vous permet de demander statistiques et tracés. Les options disponibles sont Tracés de classement, Qualité d'ajustement d'Hosmer-Lemeshow, Liste des résidus par observation, Corrélations des estimations, Historique des itérations et CI pour $\exp(B)$. Sélectionnez l'une des options dans le groupe Affichage pour consulter les statistiques et les tracés soit A chaque étape, soit uniquement pour le modèle final, A la dernière étape.

- *Statistique de qualité d'ajustement de Hosmer-Lemeshow*. Cette statistique de qualité d'ajustement est plus robuste que la statistique de qualité d'ajustement traditionnellement utilisée pour la régression logistique, particulièrement pour les modèles ayant des covariables continues et les études d'échantillons de petite taille. Elle est basée sur le regroupement des observations en déciles de risque et la comparaison de la probabilité observée avec la probabilité théorique à l'intérieur de chaque décile.

Probabilité dans étape par étape : Vous permet de contrôler les critères d'insertion ou de suppression des variables dans l'équation. Vous pouvez spécifier les critères d'insertion ou de suppression des variables.

- *Probabilité pour la méthode détaillée étape par étape*. Une variable est ajoutée au modèle si la probabilité de sa statistique de score est inférieure à la valeur Entrée et elle est éliminée si la probabilité est supérieure à la valeur Suppression. Pour remplacer les paramètres par défaut, indiquez des valeurs entières positives pour Entrée et Suppression. La valeur Entrée doit être inférieure à Suppression.

Limite de classification : Vous permet de définir la césure pour les observations de la classification. Les observations avec des prévisions qui excèdent la limite de classification sont classées positives tandis que celles dont les prévisions sont inférieures à la limite sont classées négatives. Pour modifier la valeur par défaut, entrez une valeur entre 0.01 et 0.99.

Maximum des itérations : Vous permet de modifier le nombre maximal d'itérations du modèle avant interruption.

Inclure terme constant dans le modèle : Vous permet d'indiquer si le modèle doit inclure un terme constant. Si cette option est désactivée, la constante est égale à 0.

Fonctions supplémentaires de la commande REGRESSION LOGISTIQUE

Le langage de syntaxe de commande vous permet également d'effectuer les actions suivantes :

- Identifier la sortie en fonction des observations par les valeurs ou les libellés d'une variable.
- Contrôler l'espacement des rapports d'itération. Plutôt que d'imprimer les estimations après chaque itération, vous pouvez demander les estimations après chaque *énième* itération.
- Modifier les critères d'interruption d'une itération et de contrôle de la redondance.
- Spécifier une liste de variables pour les listes par observations.
- Garder une trace en plaçant les données de chaque groupe de fichiers scindés dans un fichier vierge au cours du traitement.

Reportez-vous au manuel *Command Syntax Reference* pour plus d'informations sur la syntaxe.

Régression logistique multinomiale

La régression logistique multinomiale est utile dans le cas où vous souhaitez classer des sujets en fonction des valeurs d'un groupe de variables de prédicteur. Ce type de régression est similaire à la régression logistique, mais s'avère plus général puisque la variable dépendante n'est pas limitée à deux catégories.

Exemple : Afin de mieux rentabiliser la commercialisation de leurs films, les studios souhaitent prévoir le type de film que les cinéphiles sont susceptibles d'aller voir. En effectuant une régression logistique multinomiale, le studio peut déterminer l'impact de l'âge, du sexe et de la situation de famille d'une personne sur les types de films qu'elle préfère. Le studio peut alors orienter la campagne promotionnelle d'un film particulier en fonction du groupe de spectateurs susceptibles d'aller le voir.

Statistiques : Historique des itérations, coefficients de paramètre, covariance asymptotique et matrices de corrélation, tests du rapport de vraisemblance pour les effets de modèle et les effets partiels, log de vraisemblance -2 . Qualité d'ajustement du khi-deux de Pearson et de déviance. R^2 de Cox et Snell, de Nagelkerke et de McFadden. Classification : effectifs observés par rapport aux effectifs prédits par catégorie de réponse. Tableaux croisés : effectifs observés et prédits (avec résidus) et proportions par motif de covariables et par catégorie de réponse.

Méthodes : Un modèle logit multinomial est ajusté pour le modèle factoriel complet ou pour un modèle défini par l'utilisateur. L'estimation des paramètres est effectuée au moyen d'un algorithme itératif calculant le maximum de vraisemblance.

Remarques sur les données de régression logistique multinomiale

Données : La variable dépendante doit être catégorielle. Les variables indépendantes peuvent correspondre à des facteurs ou à des covariables. En général, les facteurs doivent être des variables catégorielles et les covariables, des variables continues.

Hypothèses : On suppose que les rapports des cotes de deux catégories quelconques sont indépendants de toutes les autres catégories de réponse. Par exemple, lorsqu'un nouveau produit est introduit sur un marché, ce postulat signifie que les parts de marché de tous les autres produits sont toutes affectées proportionnellement de la même façon. En outre, d'après un motif de covariable, les réponses sont supposées correspondre à des variables multinomiales indépendantes.

Obtention d'une régression logistique multinomiale

1. A partir des menus, sélectionnez :

Analyse > Régression > Régression logistique multinomiale...

2. Sélectionnez une variable dépendante.

3. Les facteurs sont facultatifs et peuvent être numériques ou catégoriels.

4. Les covariables sont facultatives, mais doivent être numériques si elles sont spécifiées.

Régression logistique multinomiale

Par défaut, la procédure Régression logistique multinomiale crée un modèle contenant des effets principaux de covariable et de facteur, mais vous pouvez spécifier un modèle personnalisé ou choisir un modèle pas à pas dans cette boîte de dialogue.

Spécifier le modèle : Un modèle comportant des effets principaux contient des effets principaux de covariable et de facteur, mais aucun effet d'interaction. Un modèle factoriel complet contient tous les effets principaux et toutes les interactions entre facteurs. Il ne contient pas de d'interactions de covariable. Vous pouvez créer un modèle personnalisé pour définir des sous-groupes d'interactions entre facteurs ou de covariables, ou demander une sélection pas à pas de termes de modèle.

Facteurs et covariables : Les facteurs et les covariables sont répertoriés.

Termes de l'introduction forcée : Les termes ajoutés à la liste d'introduction forcée sont systématiquement inclus dans le modèle.

Termes étape par étape : Les termes ajoutés à la liste pas à pas sont inclus dans le modèle, en fonction de l'une des méthodes détaillées pas à pas suivantes sélectionnées par l'utilisateur :

- **Introduction ascendante :** A la première étape de cette méthode, le modèle ne contient aucun terme pas à pas. A chaque étape, le terme le plus significatif est ajouté au modèle jusqu'à ce qu'aucun terme pas à pas exclu du modèle n'ait de contribution statistiquement significative s'il est inséré dans ce modèle.
- **Élimination descendante :** La première étape de cette méthode consiste à insérer dans le modèle tous les termes de la liste pas à pas. A chaque étape, le terme pas à pas le moins significatif est supprimé du modèle jusqu'à ce que tous les termes pas à pas restants aient une contribution statistiquement significative pour ce modèle.
- **Pas à pas ascendante :** La première étape de cette méthode consiste à sélectionner le modèle par la méthode d'introduction ascendante. A partir de là, l'algorithme alterne entre élimination descendante des termes pas à pas du modèle et introduction ascendante des termes exclus de ce modèle. Ce processus se poursuit jusqu'à ce que plus aucun terme ne réponde aux critères d'ajout ou de suppression.
- **Pas à pas descendante :** La première étape de cette méthode consiste à sélectionner le modèle par la méthode d'élimination descendante. A partir de là, l'algorithme alterne entre introduction ascendante des termes exclus du modèle et élimination descendante des termes pas à pas de ce modèle. Ce processus se poursuit jusqu'à ce que plus aucun terme ne réponde aux critères d'ajout ou de suppression.

Inclure ordonnée à l'origine dans le modèle : Cette option vous permet d'inclure ou d'exclure une constante pour le modèle.

Termes construits

Pour les facteurs et covariables sélectionnés :

Interaction : Crée le terme d'interaction du plus haut niveau de toutes les variables sélectionnées.

Effets principaux : Crée un terme d'effet principal pour chaque variable sélectionnée.

Toutes d'ordre 2 : Crée toutes les interactions d'ordre 2 possibles des variables sélectionnées.

Toutes d'ordre 3 : Crée toutes les interactions d'ordre 3 possibles des variables sélectionnées.

Toutes d'ordre 4 : Crée toutes les interactions d'ordre 4 possibles des variables sélectionnées.

Toutes d'ordre 5 : Crée toutes les interactions d'ordre 5 possibles des variables sélectionnées.

Régression logistique multinomiale : Catégorie de référence

Par défaut, la procédure Régression logistique multinomiale utilise la dernière catégorie comme catégorie de référence. Cette boîte de dialogue vous permet de contrôler la catégorie de référence et le type de tri des catégories.

Catégorie de référence : Spécifiez la première ou la dernière catégorie, ou une catégorie personnalisée.

Ordre des catégories : Dans l'ordre croissant, la valeur minimale définit la première catégorie et la valeur maximale, la dernière catégorie. Dans l'ordre décroissant, la valeur maximale définit la première catégorie et la valeur minimale, la dernière catégorie.

Régression logistique multinomiale : Statistiques

Les statistiques pouvant être définies pour la régression logistique multinomiale sont les suivantes :

Récapitulatif du traitement des observations : Ce tableau contient les informations relatives aux variables catégorielles fournies.

Modèle : Statistiques du modèle global.

- **Pseudo R-carré :** Imprime les statistiques R^2 de Cox et Snell, de Nagelkerke et de McFadden.
- **Récapitulatif des pas :** Ce tableau récapitule les effets ajoutés à chaque étape d'une méthode détaillée pas à pas ou supprimés de cette dernière. Il n'est créé que si un modèle pas à pas est spécifié dans la boîte de dialogue [Modèle](#).
- **Informations sur l'ajustement du modèle :** Ce tableau compare les modèles ajustés et les modèles avec constante seulement ou les modèles nuls.
- **Critères d'information :** Ce tableau imprime le critère d'information d'Akaike (AIC) et le critère d'information bayésien de Schwarz (BIC).
- **Probabilités des cellules :** Imprime un tableau des effectifs observés et des effectifs théoriques (avec résidu), et des proportions par motif de covariable et par catégorie de réponse.
- **Table de classification :** Imprime un tableau comparatif des réponses observées et des réponses prédites.
- **Qualité d'ajustement de statistiques de khi-carré :** Imprime les statistiques khi-carré de Pearson et khi-carré du rapport de vraisemblance. Les statistiques sont calculées pour les motifs de covariable déterminés par tous les facteurs et covariables ou par un sous-ensemble de facteurs et de covariables défini par l'utilisateur.
- **Mesures de monotonie :** Affiche un tableau contenant des informations sur les nombres de paires concordantes, de paires discordantes et de paires liées. Le D de Somers, le Gamma de Goodman et Kruskal, le Tau-a de Kendall et l'Indice de concordance C apparaissent également dans ce tableau.

Paramètres : Statistiques liées aux paramètres du modèle.

- **Estimations :** Imprime les estimations des paramètres du modèle, avec un niveau de confiance défini par l'utilisateur.
- **Test du rapport de vraisemblance :** Imprime les tests du rapport de vraisemblance pour les effets partiels du modèle. Le test du modèle global est imprimé automatiquement.
- **Corrélations asymptotiques :** Imprime la matrice de corrélation des estimations de paramètres.
- **Covariances asymptotiques :** Imprime la matrice de covariance des estimations de paramètres.

Définir les sous-populations : Cette option vous permet de sélectionner un sous-ensemble de facteurs et de covariables afin de définir les motifs de covariable utilisés par les probabilités des cellules et par les tests de qualité d'ajustement.

Régression logistique multinomiale : Critères

Les critères pouvant être définis pour la régression logistique multinomiale sont les suivants :

Itérations : Cette option vous permet d'indiquer le nombre de fois où vous souhaitez répéter l'algorithme, le nombre maximal d'étapes de la procédure de méthode dichotomique, les tolérances de convergence relatives aux modifications du log de vraisemblance et des paramètres, l'effectif des impressions de l'état d'avancement de l'algorithme itératif, ainsi que l'itération à laquelle la procédure doit commencer à rechercher une séparation complète ou quasi-complète des données.

- **Convergence de log de vraisemblance** : La convergence est supposée si la variation absolue de la fonction log de vraisemblance est inférieure à une valeur donnée. Le critère n'est pas utilisé si la valeur est 0. Indiquez une valeur non négative.
- **Convergence des paramètres** : La convergence est prise en compte si la modification absolue des estimations du paramètre est inférieure à cette valeur. Le critère n'est pas utilisé si la valeur est 0.

Delta : Cette option vous permet de définir une valeur non négative inférieure à 1. Cette valeur est ajoutée à chacune des cellules vides du tableau croisé des catégories de réponse par motif de covariable. Ceci vous permet de stabiliser l'algorithme et d'éviter les estimations biaisées.

Tolérance de singularité : Cette option vous permet de définir la tolérance utilisée lors du contrôle des particularités.

Options de régression logistique multinomiale

Les statistiques pouvant être définies pour la régression logistique multinomiale sont les suivantes :

Echelle de dispersion : Cette option vous permet de définir la valeur d'échelle de dispersion qui sera utilisée pour corriger l'estimation de la matrice de covariance des paramètres. L'option **Déviante** estime la valeur d'échelle au moyen de la statistique fonction de déviance (khi-deux du rapport de vraisemblance). L'option **Pearson** estime la valeur d'échelle à l'aide de la statistique khi-carré de Pearson. Vous pouvez également spécifier votre propre valeur d'échelle. Il doit s'agir d'une valeur numérique positive.

Options étape par étape : Ces options vous permettent de contrôler les critères statistiques lorsque des méthodes détaillées pas à pas servent à créer un modèle. Elles sont ignorées sauf si un modèle pas à pas est spécifié dans la boîte de dialogue Modèle.

- **Probabilité d'entrée** : Il s'agit de la probabilité de la statistique du rapport de vraisemblance pour l'introduction de variables. La facilité avec laquelle une variable est ajoutée au modèle dépend directement de la valeur de la probabilité fournie. Plus cette valeur est élevée, plus la variable a de chances d'être insérée dans le modèle. Ce critère est ignoré sauf si la méthode d'introduction ascendante, ou la méthode détaillée pas à pas ascendante ou descendante est sélectionnée.
- **Test de saisie** : Il s'agit de la méthode permettant de saisir des termes selon des méthodes détaillées pas à pas. Choisissez entre le test du rapport de vraisemblance et le test de score. Ce critère est ignoré sauf si la méthode d'introduction ascendante, ou la méthode détaillée pas à pas ascendante ou descendante est sélectionnée.
- **Probabilité de suppression** : Il s'agit de la probabilité de la statistique du rapport de vraisemblance pour la suppression de variables. La facilité avec laquelle une variable est conservée dans le modèle dépend directement de la valeur de la probabilité fournie. Plus cette valeur est élevée, plus la variable a de chances de rester dans le modèle. Ce critère est ignoré sauf si la méthode d'élimination descendante, ou la méthode détaillée pas à pas ascendante ou descendante est sélectionnée.
- **Test de suppression** : Il s'agit de la méthode permettant d'éliminer des termes selon des méthodes détaillées pas à pas. Choisissez entre le test du rapport de vraisemblance et le test de Wald. Ce critère est ignoré sauf si la méthode d'élimination descendante, ou la méthode détaillée pas à pas ascendante ou descendante est sélectionnée.
- **Effets étape par étape minimum dans le modèle** : Lorsque la méthode détaillée pas à pas descendante ou la méthode d'élimination descendante est utilisée, cette option spécifie le nombre minimal de termes à inclure dans le modèle. La constante n'est pas considérée comme terme de modèle.

- **Effets étape par étape maximum dans le modèle :** Lorsque la méthode détaillée pas à pas ascendante ou la méthode d'introduction ascendante est utilisée, cette option spécifie le nombre maximal de termes à inclure dans le modèle. La constante n'est pas considérée comme terme de modèle.
- **Appliquer une contrainte hiérarchique à l'entrée et à la suppression des termes :** Cette option vous permet d'indiquer si des restrictions doivent s'appliquer à l'ajout de termes de modèle. La hiérarchie exige que, pour tout terme à inclure, l'ensemble des termes de niveau inférieur appartenant à ce terme figure avant tout dans le modèle. Par exemple, si cette exigence de la hiérarchie est appliquée, les facteurs *Situation familiale* et *Sexe* doivent être contenus dans le modèle pour que l'interaction *Situation familiale*Sexe* puisse être ajoutée. Les trois boutons radio déterminent le rôle que jouent les covariables dans l'établissement de la hiérarchie.

Régression logistique multinomiale : Enregistrer

La boîte de dialogue Enregistrer vous permet d'enregistrer des variables dans le fichier de travail et d'exporter les informations du modèle vers un fichier externe.

Variables enregistrées : Les variables pouvant être enregistrées sont les suivantes :

- **Probabilités des réponses estimées :** Il s'agit des probabilités estimées de classement d'un motif de facteur/covariable dans les catégories de réponse. Il y a autant de probabilités estimées que de catégories de variables de réponse ; jusqu'à 25 probabilités seront enregistrées.
- **Catégorie estimée :** Il s'agit de la catégorie de réponse dont le nombre de probabilités théorique est le plus élevé pour un motif de facteur/covariable.
- **Probabilité de catégorie estimée :** Il s'agit du nombre maximum de probabilités de réponses estimées.
- **Probabilité de catégorie actuelle :** Il s'agit de la probabilité estimée sur un motif de classement d'un motif de facteur/covariable dans la catégorie observée.

Exporter les informations du modèle dans un fichier XML : Les estimations de paramètres et leurs covariances (facultatif) sont exportées vers le fichier spécifié au format XML (PMML). Vous pouvez utiliser ce fichier de modèle pour appliquer les informations du modèle aux autres fichiers de données à des fins d'évaluation.

Fonctions supplémentaires de la commande NOMREG

Le langage de syntaxe de commande vous permet également d'effectuer les actions suivantes :

- Spécifier la catégorie de référence de la variable dépendante.
- Inclure les observations avec valeurs manquantes de l'utilisateur.
- Personnaliser les tests d'hypothèse en spécifiant des hypothèses nulles comme combinaisons linéaires de paramètres.

Reportez-vous au manuel *Command Syntax Reference* pour plus d'informations sur la syntaxe.

Régression probits

Cette procédure mesure la relation entre l'intensité d'un stimulus et la proportion des observations montrant une certaine réponse au stimulus. Elle est utile lorsque vous avez une sortie dichotomique qu'on pense être influencée ou causée par des niveaux de certaines variables indépendantes et être particulièrement bien adaptée aux données expérimentales. Elle est de ce fait bien adaptée aux données expérimentales. Cette procédure vous permet d'estimer la force d'un stimulus requise pour induire une certaine proportion de réponses, telle que la dose médiane efficace.

Exemple : Quelle est l'efficacité d'un nouveau pesticide contre les fourmis et quelle concentration doit-on utiliser ? Vous devez mener une expérience dans laquelle vous exposez des échantillons de fourmis à différentes concentrations de pesticide et vous enregistrez le nombre de fourmis tuées et le nombre de fourmis exposées. En appliquant la méthode des probits à ces données, vous pouvez déterminer la force de la relation entre la concentration du produit et l'élimination de fourmis, ainsi que la concentration de

pesticide nécessaire si vous souhaitez être sûr de vous débarrasser de, disons, 95 % des fourmis exposées.

Statistiques : Coefficients de régression et erreurs standard, constante et erreur standard, khi-deux de la qualité de l'ajustement de Pearson, fréquences attendues et théoriques et intervalle de confiance pour les niveaux efficaces des variables indépendantes. Tracés : tracés de réponse transformés.

Cette procédure fait appel aux algorithmes proposés et mis en oeuvre dans NPSOL[®] par Gill, Murray, Saunders & Wright pour estimer les paramètres du modèle.

Remarques sur les données de régression probit

Données : Pour chaque valeur de la variable indépendante (ou chaque combinaison de valeurs de plusieurs variables indépendantes), votre variable de réponse doit être l'effectif du nombre d'observations avec celles des valeurs qui montrent la réponse d'intérêt, et la variable observée totale doit être un effectif du nombre total d'observations avec celles des valeurs de la variable indépendante. Le facteur doit être catégoriel, codé sous la forme de nombres entiers.

Hypothèses : Les observations doivent être indépendantes. Si vous avez un grand nombre de valeurs pour les variables indépendantes relatives au nombre d'observations, comme c'est peut-être le cas dans votre étude, le khi-deux et les statistiques de qualité d'ajustement ne sont peut-être pas valables.

Procédures apparentées : Les analyses par la méthode des probits sont étroitement liées à la régression logistique. En fait, si vous sélectionnez la transformation logit, cette procédure calculera essentiellement une régression logistique. En général, les analyses par la méthode des probits s'adaptent à des plans d'expériences, tandis que la régression logistique est plus appropriée pour des études par observation. Les différences au niveau de la sortie reflètent ces différentes emphases. La procédure des analyses par la méthode des probits offre des estimations de valeurs effectives pour divers niveaux de réponse (incluant la dose effective médiane), tandis que la procédure de la régression logistique offre des estimations des rapports des cotes pour les variables indépendantes.

Obtention d'une analyse de régression probit

1. A partir des menus, sélectionnez :

Analyse > Régression > Probit...

2. Sélectionnez une variable de fréquence des réponses. Cette variable indique le nombre d'observations présentant une réponse au stimulus test. Les valeurs de cette variable ne peuvent pas être négatives.
3. Sélectionnez une variable totale observée. Cette variable indique le nombre d'observations auxquelles le stimulus a été appliqué. Les valeurs de cette variable ne peuvent pas être négatives et ne peuvent pas être inférieures à la variable de fréquence de réponse pour chaque observation.

Vous pouvez également sélectionner un facteur. Dans ce cas, utilisez **Définir plage** pour définir la plage pour les groupes.

4. Sélectionnez une ou plusieurs covariables. Cette variable contient le niveau du stimulus appliqué à chaque observation. Si vous désirez transformer la covariable, sélectionnez une transformation dans la liste déroulante **Transformation**. Si vous n'appliquez aucune transformation et qu'il existe un groupe de contrôle, ce groupe de contrôle est alors inclus dans l'analyse.

5. Sélectionnez le modèle **Probit** ou le modèle **Logit**.

Modèle Probit

Applique la transformation probit (inverse de la fonction de distribution normale standard cumulée) aux proportions de réponses.

Modèle logit

Applique la transformation logit (probabilités logarithmiques) aux proportions de réponses.

Analyse par la méthode des probits : définir une plage

Cela vous permet de spécifier les facteurs qui seront analysés. Les niveaux de facteur doivent être codés sous la forme de nombres entiers consécutifs, et tous les niveaux que vous indiquez doivent être analysés.

Options des analyses par la méthode des probits

Vous pouvez spécifier certaines options pour vos analyses par la méthode des probits :

Statistiques : Vous permet de demander les options statistiques suivantes : Effectifs, Impact relatif médian, Test de parallélisme et Intervalles de confiance de référence.

- *Impact relatif médian.* Affiche le rapport des impacts médians pour chaque paire de niveaux de facteurs. Montre également les intervalles de confiance à 95 % pour chacun des impacts relatifs médians. Les impacts relatifs médians ne sont pas disponibles s'il n'y a pas de facteur ou s'il existe plusieurs covariables.
- *Test de parallélisme.* Test de l'hypothèse selon laquelle tous les niveaux de facteur ont une pente commune.
- *Intervalles de confiance de référence.* Intervalles de confiance pour que le dosage de l'agent nécessaire produise une certaine probabilité de réponse.

Les intervalles de confiance de référence et l'impact relatif médian ne sont pas disponibles si vous avez sélectionné plus d'une covariable. L'impact relatif médian et le test de parallélisme sont disponibles uniquement lorsque vous avez sélectionné un facteur.

Taux de réponse naturel : Vous permet d'indiquer un taux de réponse naturel même en l'absence de stimulus. Les options disponibles sont Aucun, Calculer à partir des données ou Valeur.

- *A calculer sur les données.* Calcule le taux de réponse naturel à partir des données de l'échantillon. Vos données doivent contenir une observation représentant le niveau de contrôle pour lequel la valeur des covariables est 0. Probit estime le taux de réponse naturel à partir de la proportion de réponses pour le niveau de contrôle comme une valeur initiale.
- *Valeur.* Définit le taux de réponse naturel du modèle (sélectionnez cette option lorsque vous souhaitez connaître le taux de réponse naturel à l'avance). Tapez la proportion de réponse naturelle (cette proportion doit être inférieure à 1). Si, par exemple, une réponse existe dans 10 % des cas lorsque le stimulus est de 0, tapez 0,10.

Critères : Vous permet de contrôler les paramètres de l'algorithme itératif d'estimations. Vous pouvez passer outre les valeurs par défaut pour le maximum des itérations, la stabilité des coefficients et la précision à l'optimum.

Fonctions supplémentaires de la commande NLR

Le langage de syntaxe de commande vous permet également d'effectuer les actions suivantes :

- Demander une analyse parmi les deux analyses, Probit et Logit.
- Contrôler le traitement des valeurs manquantes.
- Transformer les covariables par des bases différentes de la base 10 ou des logarithmes naturels.

Reportez-vous au manuel *Command Syntax Reference* pour plus d'informations sur la syntaxe.

Régression quantile

La régression est une méthode statistique couramment utilisée en modélisation quantitative. La régression linéaire multiple est une approche de base standard où les chercheurs utilisent les valeurs de plusieurs variables pour expliquer ou prédire les valeurs d'une échelle de résultats. Cependant, dans de nombreux cas, nous sommes davantage intéressés par la médiane, ou un quantile arbitraire de l'échelle de résultat.

La régression quantile modélise la relation entre un ensemble de variables de prédicteur (indépendantes) et des percentiles spécifiques (ou "quantiles") d'une variable cible (dépendante), le plus souvent la médiane. Cette méthode présente deux principaux avantages par rapport à la régression aux moindres carrés :

- Elle n'émet aucune hypothèse sur la distribution de la variable cible.
- Elle tend à résister à l'influence des observations aberrantes.

Elle est couramment utilisée pour les recherches dans des secteurs tels que l'écologie, la santé et l'économie financière.

Exemple

Quelle est la relation entre le revenu total du ménage et la proportion du revenu consacrée à l'alimentation ? La loi d'Engel est une observation en économie selon laquelle plus le revenu augmente, plus la part du revenu consacrée à l'alimentation diminue, même si les dépenses absolues en nourriture augmentent. Appliquée à ces données, la régression quantile permet de déterminer la dépense alimentaire qui concerne 90 % des familles (pour 100 familles disposant d'un revenu donné) lorsque la dépense alimentaire moyenne n'est pas pertinente.

Statistiques

Régression quantile, approche simplex, algorithme d'optimisation non linéaire de points intérieurs de Frisch et Newton, Barrodale et Roberts, Bofinger, Hall Sheather, bande passante, niveau de signification, manipulation de matrices, critère de convergence, pondérations de régression, terme de la constante, cible prévue, résidus de prévision, mise en tableau, tracés de prévisions, estimations de paramètres, matrice de covariance, matrice de corrélation, valeurs observées, intervalle de confiance.

Cette procédure utilise les algorithmes proposés par Koenker, R. W. et Bassett, G. W. (1978). Regression quantiles, *Econometrica*, 46, 33–50.

Remarques sur les données de régression quantile

Données

Une seule variable dépendante numérique est requise. La variable cible doit être une variable continue. Les prédicteurs peuvent être des variables continues ou des variables dummy pour des prédicteurs catégoriels. Pour exécuter une analyse, vous devez disposer du terme de constante ou d'au moins un prédicteur.

Hypothèses

La régression quantile n'émettez pas d'hypothèse sur la distribution de la variable cible et résiste à l'influence des observations aberrantes.

Procédures apparentées

L'analyse quantile est liée à la régression par la méthode des moindres carrés ordinaires (OLS).

Obtention d'une analyse de régression quantile

1. A partir des menus, sélectionnez :

Analyse > Régression > Quantile...

La boîte de dialogue permet d'indiquer les variables (cible, facteur, covariable et pondération) à utiliser pour l'analyse de régression quantile. Elle permet également de conserver de la mémoire pour les analyses complexes ou les jeux de données volumineux.

2. Sélectionnez une variable cible numérique. Une seule variable cible est requise pour exécuter une analyse. Seules les variables numériques sont autorisées.
3. Vous pouvez également sélectionner une ou plusieurs variables de facteur. Les variables d'échelle ne sont pas autorisées.
4. Vous pouvez également sélectionner une ou plusieurs variables de covariable. Les variables de chaîne ne sont pas autorisées.

Remarque : Lorsque les listes **Facteur(s)** et **Covariable(s)** sont vides et que **Inclure une constante dans le modèle** est sélectionné dans la boîte de dialogue Modèle, le message suivant s'affiche :

Aucun effet n'a été indiqué. Par conséquent, un modèle avec constante seulement sera ajusté.
Souhaitez-vous ajuster un modèle avec constante seulement ?

5. Vous pouvez également sélectionner une variable de pondération de régression. Les variables de chaîne ne sont pas autorisées.
6. Eventuellement, sélectionnez **Conserver de la mémoire pour les analyses complexes et les jeux de données importants**. Ce paramètre indique si les données doivent être placées dans un fichier externe pendant le traitement. Cela peut vous permettre d'économiser des ressources mémoire lorsque vous effectuez des analyses complexes ou avec des jeux de données volumineux.

Régression quantile : Critères

La boîte de dialogue Critères propose les options suivantes :

Quantile

Propose des options pour indiquer le ou les quantiles.

Spécifier des quantiles uniques

Si cette option est sélectionnée, vous devez entrer au moins une valeur pour exécuter l'analyse. Les valeurs multiples sont admises et chaque valeur doit être comprise dans l'intervalle $[0, 1]$. Vous pouvez spécifier plusieurs valeurs en les séparant par un ou plusieurs espaces. Utilisez les boutons **Ajouter**, **Changer** et **Retirer** pour utiliser les valeurs de la liste de valeurs de quantile.

Toutes les valeurs doivent être uniques (les valeurs en double sont interdites). La valeur par défaut est 0,5.

Spécifier les quantiles de grille

Si cette option est sélectionnée, une grille de quantiles peut être spécifiée entre une valeur **Début** (value1) et une valeur **Fin** (value2) avec l'incrément **Par** (value3). Si cette option est spécifiée, un seul ensemble $[value1 \text{ TO } value2 \text{ BY } value3]$ valide est autorisé. Il doit satisfaire la condition $0 \leq value1 \leq value2 \leq 1$. Si $value1 = value2$, cela revient à spécifier une valeur value1 unique, quelle que soit la valeur value3.

Méthode d'estimation

Propose des options pour indiquer la méthode d'estimation du modèle.

Choisie automatiquement par le programme

Permet à la procédure de sélectionner automatiquement la méthode d'estimation appropriée. Il s'agit du paramètre par défaut.

Algorithme Simplex

Appelle l'algorithme Simplex développé par Barrodale et Roberts.

Optimisation non linéaire de points intérieurs de Frisch et Newton

Appelle l'algorithme d'optimisation non linéaire de points intérieurs de Frisch et Newton.

Post-estimation

Propose des options pour la post-estimation de la variance-covariance des estimations de paramètre et des intervalles de confiance pour les valeurs cible prévues.

Supposer que les observations sont IID

Sélectionné, ce paramètre permet de supposer que les termes d'erreur sont indépendants et identiquement distribués (IID). Lorsque ce paramètre n'est pas sélectionné, le temps de calcul peut augmenter considérablement pour les modèles volumineux. Ce paramètre est sélectionné par défaut.

Type de bande passante

Détermine la méthode de bande passante utilisée pour estimer la matrice variance-covariance des estimations de paramètre (**Bofinger** ou **Hall-Sheather**). **Bofinger** est le paramètre par défaut.

Méthode numérique

Propose les options suivantes :

Tolérance de singularité

Indique la valeur de tolérance pour les manipulations de matrice dans la méthode des points intérieurs. Il doit s'agir d'une seule valeur double précision comprise dans l'intervalle (0, 10^{-3}). La valeur par défaut est 10^{-12} .

Convergence

Indique le critère de convergence pour la méthode numérique. Il doit s'agir d'une seule valeur double précision comprise dans l'intervalle (0, 10^{-3}). La valeur par défaut est 10^{-6} .

Nombre maximum d'itérations

Spécifie le nombre maximal d'itérations. Il doit s'agir d'un nombre entier positif. La valeur par défaut est 2000.

Valeurs manquantes

Permet d'indiquer comment traiter les valeurs manquantes.

Exclure les valeurs manquantes de l'utilisateur et les valeurs système manquantes

Lorsque cette option est sélectionnée, les valeurs manquantes de l'utilisateur et système sont exclues.

Les valeurs manquantes de l'utilisateur sont traitées comme des données valides

Lorsque cette option est sélectionnée, les valeurs manquantes de l'utilisateur sont traitées comme des données non valides.

Intervalle de confiance (%)

Indique le niveau d'importance. Si vous indiquez ce paramètre, il doit s'agir d'une valeur double précision comprise entre 0 et 100. La valeur par défaut est 95.

Régression quantile : Modèle

La boîte de dialogue Modèle propose des options pour définir les effets et les pondérations utilisés dans le modèle. Omis ou auto-défini, le modèle contient le terme d'interception ainsi que tous les effets principaux, avec les covariables de la liste des covariables et les facteurs de la liste des facteurs.

Spécifier les effets du modèle

Le modèle par défaut est à constante seulement, c'est pourquoi vous devez spécifier explicitement les autres effets du modèle. Vous pouvez aussi construire des termes imbriqués ou non imbriqués. Lorsque **Termes construits** est sélectionné, l'effet et les options d'interaction ci-après sont disponibles pour les termes non imbriqués.

Effets principaux

Crée un terme d'effet principal pour chaque variable sélectionnée.

Interaction

Crée le terme d'interaction du plus haut niveau pour toutes les variables sélectionnées.

Factoriel

Crée toutes les interactions et les effets principaux possibles pour les variables sélectionnées.

Tous d'ordre 2

Crée toutes les interactions d'ordre 2 possibles des variables sélectionnées.

Tous d'ordre 3

Crée toutes les interactions d'ordre 3 possibles des variables sélectionnées.

Tous d'ordre 4

Crée toutes les interactions d'ordre 4 possibles des variables sélectionnées.

Tous d'ordre 5

Crée toutes les interactions d'ordre 5 possibles des variables sélectionnées.

Lorsque **construction de termes imbriqués** est sélectionné, vous pouvez construire des termes imbriqués. Les termes imbriqués sont utiles pour modéliser l'effet d'un facteur ou d'une covariable dont les valeurs n'interagissent pas avec les niveaux d'un autre facteur. Par exemple, une chaîne d'épicerie peut suivre les habitudes d'achat de ses clients à divers emplacements de magasin. Puisque chaque client ne fréquente qu'un seul de ces magasins, l'effet *Client* peut être considéré comme étant **imbriqué dans** l'effet *Emplacement des magasins*.

En outre, vous pouvez inclure des effets d'interaction, tels que des termes polynomiaux impliquant la même covariable, ou ajouter plusieurs niveaux d'imbrication au terme imbriqué.

Imbrication de notes :

- Afin d'inclure un effet relatif à une interaction entre des facteurs, utilisez le mot clé BY ou un astérisque (*) afin de joindre les facteurs impliqués dans l'interaction.
- Les facteurs d'un effet d'interaction doivent être distincts.
- Pour imbriquer un terme dans un autre, incluez l'effet entre une paire de parenthèses.
- En présence de plusieurs paires de parenthèses, placez ou imbriquez chaque paire dans une autre paire de parenthèses.
- L'imbrication multiple est autorisée.
- Les interactions entre effets imbriqués ne sont pas prises en charge.

Limites : Les termes imbriqués comportent les restrictions suivantes :

- Tous les facteurs d'une interaction doivent être uniques. Ainsi, si A est un facteur, la spécification $A*A$ n'est pas valide.
- Tous les facteurs d'un effet imbriqué doivent être uniques. Ainsi, si A est un facteur, la spécification $A(A)$ n'est pas valide.
- Aucun effet ne peut être imbriqué dans un effet de covariable. Ainsi, si A est un facteur et X une covariable, la spécification $A(X)$ n'est pas valide.

Inclure une constante au modèle

Lorsque cette option est sélectionnée, les termes de constante sont inclus dans le modèle.

Lorsqu'elle n'est pas sélectionnée, vous devez entrer au moins un prédicteur pour exécuter l'analyse. Ce paramètre est activé par défaut.

Régression quantile : Affichage

La boîte de dialogue Affichage propose des paramètres de contrôle de tracé et de sortie.

Imprimer

Les options de sortie suivantes sont disponibles :

Estimations des paramètres

Affiche les estimations des paramètres, ainsi que les statistiques de test et les intervalles de confiance correspondants. Vous pouvez éventuellement afficher les estimations de paramètres exponentielles, en plus des estimations de paramètres brutes.

Matrice de covariance des estimations des paramètres

Affiche la matrice de covariance des paramètres estimés.

Matrice de corrélation des estimations des paramètres

Affiche la matrice de corrélation des paramètres estimés.

Présenter sous forme de graphique et de tableau

Les options de traçage suivantes sont disponibles :

Présenter sous forme de graphique les estimations de paramètres pour

Vous pouvez tracer les estimations de paramètre pour un nombre précis d'effets principaux, ou pour tous les effets du modèle. Le paramètre identifiant les **xx effets principaux** permet de contrôler le nombre de catégories (ou de combinaisons de catégories) qui, dans un effet mixte, sont tracées dans l'interaction d'une covariable et d'un facteur (ou de deux facteurs). La valeur doit être un entier positif unique (50 est le paramètre par défaut).

Remarques :

- Les tracés de prévisions sont créés pour tous les effets lorsque la valeur entière indiquée est supérieure au nombre de catégories ou de combinaisons.

- Ce paramétrage n'est valide que lorsque plusieurs valeurs sont indiquées pour le paramètre **Valeurs quantiles** dans la boîte de dialogue Critères. Aucun tracé n'est créé lorsqu'un seul quantile est spécifié.

Afficher les prévisions par tracé observé

Permet de contrôler la création du tracé des valeurs observées par rapport aux prévisions.

Activée, cette option crée un tracé unique contenant les points (les quantiles étant représentés en pointillés de différentes couleurs). Ce paramètre est désactivé par défaut.

Prédire les effets dans le modèle

Lorsque ce paramètre est activé, les options suivantes sont disponibles :

Présenter sous forme de graphique ou de tableau les x effets principaux

Indiquez le nombre d'effets principaux pour lesquels vous allez créer un tracé ou une table de prévisions. La valeur par défaut est 3.

Remarque : Les tracés (ou les tables) de prévisions sont créés pour tous les effets lorsque la valeur entière indiquée est supérieure au nombre d'effets valides dans le modèle.

Tracer les effets spécifiés par l'utilisateur ou les présenter sous forme de tableau

Voici les règles relatives aux effets valides :

- Effet à une seule covariable (y compris une puissance élevée de la covariable proprement dite) : créez un tracé unique contenant les lignes prévues par quantiles.
- Effet à un seul facteur : mettez en tableau les prévisions pour les catégories du facteur par quantiles.
- Effet avec interaction de deux facteurs : pour chaque quantile, mettez en tableau les prévisions pour les catégories des deux facteurs.
- Effet avec interaction d'une covariable et d'un ou de deux facteurs : pour chaque quantile, créez un tracé contenant les lignes pour chaque catégorie ou combinaison de catégories dans l'effet d'interaction.
- Le nombre maximal des combinaisons à tracer est contrôlé par la valeur indiquée dans **Présenter sous forme de graphique au maximum xx catégories ou combinaisons de catégories dans un effet mixte**.

Les effets déplacés de **Effets de modèle** vers la liste **Lignes de prévision** sont utilisés pour le traçage. Les tracés ne sont pas créés lorsque les effets spécifiés sont constants (supprimés de la génération de modèle).

Les effets déplacés depuis **Effets de modèle** vers la liste **Tables de prévision** sont utilisés pour la mise en tableau. Les tables ne sont pas créées lorsque les effets spécifiés sont constants (supprimés de la génération de modèle).

Présenter sous forme de graphique au maximum xx catégories ou combinaisons de catégories dans un effet mixte

Contrôle le nombre maximal de combinaisons de catégories à tracer. La valeur par défaut est 10.

Régression quantile : Enregistrer

La boîte de dialogue Enregistrer propose des options pour évaluer le modèle.

Valeur prévue de la réponse

Lorsque cette option est sélectionnée, la valeur cible prévue est évaluée.

Résidu

Si cette option est sélectionnée, les résidus de prévision sont évalués.

Limite inférieure de l'intervalle de prévision

Lorsque cette option est sélectionnée, les limites inférieures des intervalles de prévision sont évaluées.

Limite supérieure de l'intervalle de prévision

Lorsque cette option est sélectionnée, les limites supérieures des intervalles de prévision sont évaluées.

Remarque : Un nom de variable peut être indiqué pour chaque option d'enregistrement. Si un nom de racine est spécifié, il doit s'agir d'un nom de variable valide. Un nom de racine, suivi d'un trait de soulignement "_" et d'un suffixe de quantile significatif sont utilisés lorsque plusieurs valeurs sont indiquées pour les **valeurs de quantile** dans la boîte de dialogue Critères.

Régression quantile : Exporter

La boîte de dialogue Exporter propose des options pour définir les statistiques à exporter et leur mode d'exportation (dans un fichier de données externe ou dans des jeux de données). Elle permet également de contrôler le mode de gestion des données au cours du traitement (traitées en mode normal ou conservées dans un fichier temporaire).

Matrice de covariance des estimations de paramètres

Sélectionnée, cette option active les options d'écriture de la matrice de covariance des estimations de paramètre dans un fichier de données externe ou dans un jeu de données déjà déclaré.

Matrice de corrélation des estimations de paramètres

Sélectionnée, cette option active les options d'écriture de la matrice de corrélation des estimations de paramètre dans un fichier de données externe ou dans un jeu de données déjà déclaré.

La matrice de covariance/corrélation sera enregistrée dans un seul jeu de données ou fichier externe en présence de plusieurs quantiles de régression

En présence de plusieurs quantiles, cette option permet d'activer l'enregistrement des matrices de covariance/corrélation dans un ou plusieurs fichiers de données externes ou jeux de données. Lorsqu'elle n'est pas activée, les matrices sont enregistrés dans un seul fichier de données externe ou jeu de données. Lorsque cette option est activée, les matrices sont enregistrées dans plusieurs fichiers de données externes ou jeux de données. Ce paramétrage n'est valide qu'en présence de plusieurs **valeurs de quantile** dans la boîte de dialogue Critères.

Remarque : Cette option n'est valide que lorsque **Matrice de covariance des estimations de paramètres** ou **Matrice de corrélation des estimations de paramètres** est sélectionnée.

Exporter les informations du modèle dans un fichier XML

Lorsqu'elle est sélectionnée, cette option propose des options pour exporter les informations du modèle dans un fichier XML (ayant un nom et un emplacement spécifiques).

Exporter au format XML

Lorsque l'option **Exporter les informations du modèle dans un fichier XML** est sélectionnée, vous pouvez exporter les estimations de paramètre et les matrices de covariance, ou les estimations de paramètre uniquement. La valeur par défaut est **Estimations des paramètres et matrice de covariance**.

Conventions relatives aux noms de fichier

- Lorsqu'une seule **valeur de quantile** est indiquée dans la boîte de dialogue Critères, `savefile` et `dataset` sont utilisés pour nommer le fichier de données externe ou le jeu de données.
- Lorsque plusieurs **valeurs de quantile** sont indiquées dans la boîte de dialogue Critères, chaque quantile est enregistré dans un fichier de données externe ou un jeu de données.
- Un caractère de soulignement "_", suivi d'un suffixe significatif de quantile, est automatiquement ajouté au nom du fichier de données ou du jeu de données. Par exemple, lorsque la **valeur quantile** 0,25, 0,50 ou 0,75 est indiquée, le suffixe `_25`, `_50` ou `_75` est ajouté au nom du fichier de données (avant l'extension `.sav`).
- Des chiffres supplémentaires peuvent être indiqués pour chaque quantile de suffixe (si nécessaire).
- Le zéro non significatif et le séparateur décimal des **valeurs de quantile** ne sont pas utilisés dans le suffixe.

- Lorsque la notation scientifique est indiquée pour les **valeurs de quantile**, elle est convertie en valeur décimale lorsqu'elle s'affiche dans le suffixe.

Régression non linéaire

La régression non linéaire est une méthode permettant de déterminer un modèle non linéaire de relation entre la variable dépendante et un groupe de variables indépendantes. A l'inverse de la régression linéaire classique, qui se limite aux modèles linéaires de prévision, la régression non linéaire peut élaborer des modèles avec des relations arbitraires entre variables dépendantes et indépendantes. Elle emploie pour cela des algorithmes itératifs d'estimation. Remarquez que cette procédure n'est pas indispensable pour les simples modèles polynomiaux de forme : $Y = A + BX^{**2}$. Si on pose $W = X^{**2}$, il s'agit d'un simple modèle linéaire de type $Y = A + BW$ qui peut être estimé à partir de méthodes traditionnelles comme la procédure de régression linéaire.

Exemple : Peut-on estimer l'évolution de la population par rapport au temps ? Un nuage de points montre qu'il semble y avoir une forte relation entre la population et le temps mais cette relation n'est pas linéaire. Il faut donc employer des méthodes d'estimation particulières de la procédure de régression non linéaire. En déterminant une équation appropriée, tel qu'un modèle logistique d'évolution de la population, nous pouvons obtenir une bonne approximation du modèle, ce qui nous permet de prévoir la population à des dates pour lesquelles elle n'a pas encore été mesurée.

Statistiques : Pour chaque itération : estimations des paramètres et somme résiduelle des carrés. Pour chaque modèle : somme des carrés pour la régression, résidu, total correct ou incorrect, estimations de paramètres, erreurs standard asymptotiques et matrice de corrélation asymptotique des estimations de paramètres.

Remarque : La régression non linéaire restreinte fait appel aux algorithmes proposés et mis en oeuvre dans NPSOL[®] par Gill, Murray, Saunders et Wright pour estimer les paramètres du modèle.

Remarques sur les données de régression non linéaire

Données : Les variables dépendantes et indépendantes doivent être quantitatives. Les variables catégorielles, comme la religion, la qualification, la zone de résidence, doivent être enregistrées sous forme de variables binaires (factices) ou sous de tout autre type de variables de contraste.

Hypothèses : Les résultats ne sont valides que si vous avez indiqué une fonction qui décrit correctement la relation entre les variables dépendantes et indépendantes. De surcroît, le choix des bonnes valeurs de départ est très important. Même si vous avez spécifié la forme fonctionnelle correcte du modèle, si vous utilisez de mauvaises valeurs de départ, votre modèle risque de ne pas réussir à converger et vous n'obtiendrez qu'un modèle optimal locale et non pas globale.

Procédures apparentées : De nombreux modèles qui n'apparaissent pas linéaires à première vue peuvent être transformés en modèles linéaires et analysés à l'aide une procédure de régression linéaire. Si vous n'êtes pas sûr du modèle à employer, la procédure d'estimation de courbe peut vous permettre d'identifier les relations fonctionnelles utiles dans vos données.

Obtenir une analyse de la régression non linéaire

1. A partir des menus, sélectionnez :

Analyse > Régression > Non linéaire...

2. Sélectionnez une variable dépendante (numérique) dans la liste des variables de votre jeu de données actif.

3. Pour construire une expression de modèle, entrez celle-ci dans le champ **Expression de modèle** ou collez des composantes (variables, paramètres, fonctions) dans le champ.

4. Pour identifier les paramètres de votre modèle, cliquez sur **Paramètres**.

Un modèle segmenté (qui prend différentes formes dans les différentes parties du domaine) peut être spécifié à l'aide d'une logique conditionnelle au sein d'une même instruction de modèle.

Logique conditionnelle (régression non linéaire)

Vous pouvez spécifier un modèle segmenté à l'aide d'une logique conditionnelle. Pour employer une logique conditionnelle dans l'expression d'un modèle ou une fonction de perte, vous formez la somme d'une série de termes pour chaque condition. Chaque terme contient une expression logique (entre parenthèses) multipliée par l'expression qui doit résulter lorsque l'expression logique est vraie.

Par exemple, considérez un modèle segmenté qui est égal à 0 pour $X \leq 0$, X pour $0 < X < 1$ et à 1 pour $X \geq 1$. L'expression de ce modèle est la suivante :

$$(X \leq 0) * 0 + (X > 0 \ \& \ X < 1) * X + (X \geq 1) * 1.$$

Les expressions logiques entre parenthèses ont toutes pour résultat 1 (vrai) ou 0 (faux). Donc :

Si $X \leq 0$, l'expression se réduit à $1 * 0 + 0 * X + 0 * 1 = 0$.

Si $0 < X < 1$, elle se réduit à $0 * 0 + 1 * X + 0 * 1 = X$.

Si $X \geq 1$, elle devient $0 * 0 + 0 * X + 1 * 1 = 1$.

Des exemples plus complexes peuvent se construire facilement en substituant les différentes expressions logiques et les expressions de sortie. Gardez en mémoire que les doubles inégalités, telles que $0 < X < 1$, doivent être écrites sous forme d'expressions composées de type $(X > 0 \ \& \ X < 1)$.

Les variables de chaîne peuvent être utilisées dans les expressions logiques :

$$(\text{ville} = \text{'Paris'}) * \text{pouvach} + (\text{ville} = \text{'Maubeuge'}) * 0.59 * \text{pouvach}$$

Cela produit l'expression (la valeur de la variable *pouvach*) pour les Parisiens et une autre (59 % de cette valeur) pour les habitants de Maubeuge. Les constantes alphanumériques doivent être présentées entre guillemets ou apostrophes, comme dans cet exemple.

Paramètres de régression non linéaire

Les paramètres constituent les parties de votre modèle que la procédure de régression non linéaire estime. Ces paramètres peuvent être des constantes additives, des coefficients multiplicateurs, des exposants ou des valeurs utilisés dans les fonctions d'évaluation. Tous les paramètres que vous avez définis apparaissent (avec leurs valeurs initiales) dans la liste Paramètres de la boîte de dialogue.

Nom : Vous devez attribuer un nom à chaque paramètre. Ce nom doit être un nom de variable valide et doit être le nom utilisé dans l'expression de modèle de la boîte de dialogue principale.

Valeur initiale : Vous permet de spécifier une valeur initiale pour le paramètre, de préférence aussi proche que possible de la solution finale escomptée. De mauvaises valeurs initiales peuvent entraîner des problèmes de convergence (impossibilité de converger ou convergence locale plutôt que globale).

Utiliser l'analyse précédente pour spécifier les valeurs initiales : Si vous avez déjà exécuté une régression non linéaire à partir de cette boîte de dialogue, vous pouvez sélectionner cette option pour obtenir les valeurs initiales des paramètres à partir des valeurs de la précédente exécution. Cela vous permet de continuer la recherche lorsque l'algorithme converge lentement. (Les valeurs initiales de départ apparaissent toujours dans la liste Paramètres de la boîte de dialogue principale.)

Remarque : Cette sélection persiste dans la boîte de dialogue pour le reste de la session. Si vous changez de modèle, assurez-vous de le désélectionner.

Modèles courants de régression non linéaire

Le tableau suivant présente un exemple de syntaxe de plusieurs modèles de régression non linéaire. Un modèle choisi au hasard a peu de chance de s'adapter à vos données. Les valeurs de départ appropriées pour les paramètres sont indispensables et certains modèles requièrent des contraintes afin de converger.

Tableau 1. Exemple de syntaxe

Nom	Expression
Régression asymptotique	$b1 + b2 * \exp(b3 * x)$
Régression asymptotique	$b1 - (b2 * (b3 ** x))$
Densité	$(b1 + b2 * x) ** (-1 / b3)$
Gauss	$b1 * (1 - b3 * \exp(-b2 * x ** 2))$
Gompertz	$b1 * \exp(-b2 * \exp(-b3 * x))$
Johnson-Schumacher	$b1 * \exp(-b2 / (x + b3))$
Log modifié	$(b1 + b3 * x) ** b2$
Log logistique	$b1 - \ln(1 + b2 * \exp(-b3 * x))$
Loi des réponses décroissantes de Metcherlich	$b1 + b2 * \exp(-b3 * x)$
Michaelis Menten	$b1 * x / (x + b2)$
Morgan-Mercer-Florin	$(b1 * b2 + b3 * x ** b4) / (b2 + x ** b4)$
Peal-Reed	$b1 / (1 + b2 * \exp(-(b3 * x + b4 * x ** 2 + b5 * x ** 3)))$
Rapport cubique	$(b1 + b2 * x + b3 * x ** 2 + b4 * x ** 3) / (b5 * x ** 3)$
Rapport quadratique	$(b1 + b2 * x + b3 * x ** 2) / (b4 * x ** 2)$
Richards	$b1 / ((1 + b3 * \exp(-b2 * x)) ** (1 / b4))$
Verhulst	$b1 / (1 + b3 * \exp(-b2 * x))$
Von Bertalanffy	$(b1 ** (1 - b4) - b2 * \exp(-b3 * x)) ** (1 / (1 - b4))$
Weibull	$b1 - b2 * \exp(-b3 * x ** b4)$
Densité de rendement	$(b1 + b2 * x + b3 * x ** 2) ** (-1)$

Fonction de perte de la régression non linéaire

La **fonction de perte** dans la régression non linéaire est la fonction minimisée par l'algorithme. Sélectionnez soit **Somme des carrés des résidus** pour minimiser la somme des carrés résiduels, soit **Fonction de perte spécifiée par l'utilisateur** pour minimiser une fonction différente.

Si vous sélectionnez **Fonction de perte spécifiée par l'utilisateur**, vous devez définir la fonction de perte dont la somme (sur toutes les observations) doit être minimisée par le choix des valeurs du paramètre.

- La plupart des fonctions de perte impliquent la variable spéciale *RESID_*, qui représente le résidu. (La fonction de perte par défaut Somme des carrés résiduels doit être saisie explicitement sous la forme *RESID_**2*.) Si vous avez besoin d'employer la valeur prévisionnelle dans votre fonction de perte, cette valeur est égale à la variable dépendante moins le résidu.
- Il est possible de spécifier une fonction de perte conditionnelle à l'aide de la logique conditionnelle.

Vous pouvez soit taper une expression dans le champ de la fonction de perte personnalisée (spécifiée par l'utilisateur), soit coller les composants de cette expression dans le champ. Les constantes alphanumériques doivent être saisies entre guillemets ou apostrophes, tandis que les constantes numériques doivent être en format Américain avec un point en tant que délimiteur décimal.

Options de contraintes de la régression non linéaire

Une **contrainte** est une restriction émise sur les valeurs permises d'un paramètre au cours du processus itératif de recherche d'une solution. Les expressions linéaires sont évaluées avant chaque étape. Vous pouvez donc utiliser les contraintes linéaires pour éviter les étapes qui risquent d'entraîner des dépassements positifs. Les expressions non linéaires sont évaluées après chaque étape.

Chaque équation ou inégalité requièrent les éléments suivants :

- Une expression impliquant au moins un paramètre dans le modèle. Saisissez l'expression ou employez le clavier qui vous permet de coller des nombres, des opérateurs ou des parenthèses dans une expression. Vous pouvez soit taper les paramètres requis avec le reste de l'expression ou les coller depuis la liste Paramètres sur la gauche. Vous ne pouvez pas utiliser de variables courantes dans une contrainte.
- Un des trois opérateurs logiques \leq , $=$ ou \geq .
- Une constante numérique à laquelle l'expression est comparée à l'aide de l'opérateur logique. Tapez la constante. Les constantes numériques doivent être saisies en format Américain avec un point en tant que délimiteur décimal.

Régression non linéaire : enregistrer les nouvelles variables

Vous pouvez enregistrer un certain nombre de nouvelles variables dans votre fichier de données actif. Les options disponibles sont Prévisions, Résidus, Calculées, et Valeurs de la fonction de perte. Ces variables peuvent servir dans les analyses suivantes pour tester l'adéquation du modèle ou pour identifier les observations problématiques.

- *Résidus*. Enregistre les résidus avec les noms de variable resid.
- *Prévisions*. Enregistre les valeurs prédites avec le nom de variable pred_.
- *Calculées*. Une dérivée est enregistrée pour chacun des paramètres du modèle. Le nom d'une dérivée est formé à partir du préfixe d suivi des six premiers caractères du nom du paramètre.
- *Valeurs de la fonction de perte*. Cette option est accessible si vous spécifiez votre propre fonction de perte. Le nom de variable loss_ est affecté aux valeurs de la fonction de perte.

Options de régression non linéaire

Ces options permettent de contrôler les différents aspects de votre analyse de régression non linéaire :

Estimations de bootstrap. Méthode d'estimation de l'erreur standard d'une statistique par échantillonnage répété du jeu de données d'origine. Pour cela, un échantillonnage (avec remise) est réalisé afin d'obtenir de nombreux échantillons de la même taille que le jeu de données d'origine. Une estimation de l'équation non linéaire est réalisée pour chacun de ces échantillons. L'erreur standard de chaque estimation de paramètres est alors calculée comme l'écart type estimé par le bootstrap. Les valeurs des paramètres des données d'origine servent de valeurs initiales à chaque échantillon du bootstrap. Cela nécessite un algorithme de programmation quadratique séquentielle.

Méthode d'estimation : Permet de sélectionner la méthode d'estimation, si c'est possible. (Certain choix dans cette boîte de dialogue comme dans d'autres impliquent l'utilisation d'un algorithme de programmation quadratique séquentielle). Les alternatives disponibles sont la programmation quadratique séquentielle et l'algorithme de Levenberg-Marquardt.

- *Programmation quadratique séquentielle*. Cette méthode est utilisable pour des modèles avec ou sans contraintes. La programmation quadratique séquentielle est utilisée automatiquement si vous spécifiez un modèle avec contraintes, une fonction de perte définie par l'utilisateur ou un bootstrap. Vous pouvez saisir de nouvelles valeurs pour le Maximum d'itérations et la stabilité des coefficients. Vous pouvez également modifier la sélection dans les listes déroulantes de précision à l'optimum, de Précision de la fonction et de critère de convergence.
- *Levenberg-Marquardt*. Algorithme par défaut des modèles non contraints. La méthode Levenberg-Marquardt n'est pas utilisable si vous sélectionnez un modèle avec contraintes, une fonction de perte définie par l'utilisateur ou un bootstrap. Vous pouvez saisir de nouvelles valeurs pour le Maximum des itérations et vous pouvez également modifier la sélection dans les listes Convergence de la somme des carrés et Convergence des paramètres.

Interprétation des résultats de la régression non linéaire

Les problèmes de régression non linéaire présentent souvent des difficultés de calcul :

- Le choix des valeurs initiales pour les paramètres influence la convergence. Essayez de choisir des valeurs raisonnables et, si possible, proches de la solution finale escomptée.
- Certains algorithmes se révèlent parfois meilleurs que d'autres pour résoudre un problème particulier. Dans la boîte de dialogue Options, sélectionnez l'autre algorithme, s'il est disponible. (Si vous indiquez une fonction de perte ou certains types de contrainte, vous ne pouvez pas employer l'algorithme de Levenberg-Marquardt.)
- Lorsque l'itération ne s'interrompt que lorsque le nombre maximal d'itérations est atteint, le modèle final n'est probablement pas une solution satisfaisante. Sélectionnez **Utiliser l'analyse précédente pour spécifier les valeurs initiales** dans la boîte de dialogue Paramètres pour poursuivre l'itération ou, encore mieux, choisissez des valeurs initiales différentes.
- Les modèles qui requièrent une mise en exposant de ou par des valeurs importantes peuvent engendrer des dépassements positifs ou négatifs (nombres trop grands ou trop petits pour être représentés sur l'ordinateur). En général, pour éviter cela, vous devez fixer des valeurs initiales appropriées ou fixer des contraintes sur les paramètres.

Fonctions supplémentaires de la commande NLR

Le langage de syntaxe de commande vous permet également d'effectuer les actions suivantes :

- Nommer un fichier à partir duquel les valeurs initiales pour les estimations sont lues.
- Spécifier plusieurs instructions de modèle et fonctions de perte. Cela facilite la spécification d'un modèle segmenté.
- Employer vos propres dérivées plutôt que celles calculées par le programme.
- Spécifier le nombre d'échantillons de départ à générer.
- Indiquer les critères d'itération supplémentaires, notamment la définition d'une valeur critique pour le contrôle de la dérivée et la définition d'un critère de convergence pour la corrélation entre les résidus et les dérivées.

Les critères supplémentaires de la commande CNLR (régression non linéaire restreinte) vous permettent d'effectuer les opérations suivantes :

- Indiquer le nombre maximal d'itérations mineures permises dans une itération majeure.
- Fixer une valeur critique pour le contrôle de dérivée (calculée).
- Fixer la stabilité des coefficients.
- Indiquer une tolérance pour établir si les valeurs initiales se situent dans les limites déterminées.

Reportez-vous au manuel *Command Syntax Reference* pour plus d'informations sur la syntaxe.

Pondération estimée

Les modèles de régression linéaire standard partent du principe que la variance est constante au sein de la population étudiée. En cas contraire (par exemple, lorsque les observations élevées sur un certain attribut montrent plus de variabilité que les observations faibles sur cet attribut), la régression linéaire par la méthode des moindres carrés ordinaires ne fournit plus des estimations optimales. Si les différences de variabilité peuvent être prévues à partir d'une autre variable, la procédure de pondération estimée peut calculer les coefficients d'un modèle de régression linéaire par la méthode des moindres carrés pondérés, de sorte que les observations les plus précises (c'est-à-dire celles offrant le moins de variabilité) ont plus de pondération dans la détermination des coefficients de régression. La procédure de pondération estimée teste une fourchette de transformations de la pondération et indique celle qui correspond le mieux aux données.

Exemple : Quels sont les effets de l'inflation et du chômage sur les fluctuations des cours de la bourse ? Les actions à forte valeur montrant plus de variabilité que celles de faible valeur, les moindres carrés ordinaires ne fournissent pas d'estimations optimales. La pondération estimée vous permet de prendre en compte les effets du prix de l'action sur la variabilité des fluctuations de prix dans le calcul du modèle linéaire.

Statistiques : Valeurs de log de vraisemblance de la variable source pondérée testée, R multiple, R carré, R carré ajusté, tableau d'ANOVA pour le modèle WLS, estimations standardisées et non standardisées et log de vraisemblance pour le modèle WLS.

Remarques sur les données de pondération estimée

Données : Les variables dépendantes et indépendantes doivent être quantitatives. Les variables catégorielles, comme la religion, la qualification, la zone de résidence, doivent être enregistrées sous forme de variables binaires (factices) ou sous de tout autre type de variables de contraste. La variable de pondération doit être quantitative et doit être associée à la variabilité de la variable dépendante.

Hypothèses : Pour chaque valeur de la variable indépendante, la distribution de la variable dépendante doit être normale. La relation entre la variable dépendante et chaque variable indépendante doit être linéaire et toutes les observations doivent être indépendantes. La variance de la variable dépendante peut varier selon les niveaux de la ou des variables indépendantes mais les différences doivent être prévisibles en fonction de la variable de pondération.

Procédures apparentées : La procédure d'exploration peut être utilisée pour analyser vos données. L'exploration vous propose des tests de normalité et d'homogénéité de la variance, ainsi que des illustrations graphiques. Si votre variable dépendante semble avoir la même variance sur tous les niveaux des variables indépendantes, utilisez la procédure de régression linéaire. Si vos données apparaissent ne pas satisfaire une hypothèse (telle que la normalité), essayez de les modifier. Si vos données ne sont pas liées linéairement et qu'une modification ne change rien, utilisez un autre modèle dans la procédure d'estimation de courbe. Si votre variable dépendante est dichotomique, telle que Utilisable ou Défectueux, utilisez la procédure de régression logistique. Si votre variable dépendante est censurée (par exemple, la durée de survie après opération), utilisez les procédures Tables de survie, Kaplan-Meier ou Régression de Cox, disponibles dans Tableaux personnalisés et statistiques avancées. Si vos données ne sont pas indépendantes (par exemple, si vous observez le même individu sous différentes conditions), utilisez la procédure de mesures répétées, dans Tableaux personnalisés et statistiques avancées.

Obtenir une analyse de pondération estimée

1. A partir des menus, sélectionnez :

Analyse > Régression > Pondération estimée...

2. Sélectionnez une variable dépendante.

3. Sélectionnez une ou plusieurs variables indépendantes.

4. Sélectionnez la variable qui est la source de l'hétéroscédasticité comme variable de pondération.

Variable de pondération

Les données sont pondérées par l'inverse de cette variable élevée à une puissance. L'équation de régression est calculée pour chacune des valeurs d'une plage spécifiée d'exposants et indique l'exposant qui maximise la fonction log de vraisemblance.

Variation de l'exposant

S'utilise de pair avec la variable de pondération pour calculer les pondérations. Plusieurs équations de régression seront acceptables, une par valeur de la plage d'exposants. Les valeurs indiquées dans la case de test de variation d'exposant et dans la zone de texte doivent être comprises entre 6,5 et 7,5 (limites incluses). Les valeurs d'exposant varient de la plus faible à la plus élevée, l'incrément étant déterminé par la valeur spécifiée. Le nombre total de valeurs dans la variation de l'exposant est limité à 150.

Options de la pondération estimée

Vous pouvez sélectionner les options de votre analyse de pondération estimée :

Enregistrer la meilleure pondération en tant que nouvelle variable : Ajoute la variable de pondération au fichier actif. Cette variable s'appelle *WGT_n*, *n* étant le nombre attribué à la variable pour qu'elle ait un nom univoque.

Afficher ANOVA et les estimations : Vous permet de contrôler le mode d'affichage des statistiques dans la sortie. Vous pouvez choisir entre Pour le meilleur exposant et Pour chaque valeur de l'exposant.

Fonctions supplémentaires de la commande WLS

Le langage de syntaxe de commande vous permet également d'effectuer les actions suivantes :

- Fournir une valeur unique à l'exposant.
- Spécifier la liste des valeurs d'exposant ou combiner une plage de valeurs avec une liste de valeurs pour cet exposant.

Reportez-vous au manuel *Command Syntax Reference* pour plus d'informations sur la syntaxe.

Régression par les doubles moindres carrés

Les modèles de régression linéaire standard partent du principe que les erreurs au niveau de la variable dépendante ne sont pas corrélées à la ou les variables indépendantes. En cas contraire (par exemple, lorsque les relations entre les variables sont bidirectionnelles), la régression linéaire par la méthode des moindres carrés ne constitue plus un modèle de prévision optimal. La régression par les doubles moindres carrés emploie des variables instrumentales non corrélées aux termes d'erreurs pour calculer les valeurs prévisionnelles du prédicteur problématique (première étape) puis utilise ces valeurs calculées pour évaluer le modèle de régression linéaire de la variable dépendante (seconde étape). Les valeurs calculées étant fondées sur des variables non corrélées aux erreurs, les résultats du modèle double sont optimaux.

Exemple : La demande pour un article est-elle liée au prix et au revenu du consommateur ? La difficulté ici réside dans le fait que le prix et la demande agissent mutuellement l'un sur l'autre. En effet, le prix influence la demande mais la demande influence également le prix. Un modèle de régression par les doubles moindres carrés peut utiliser le revenu du consommateur comme un représentant du prix qui n'est pas corrélé avec les erreurs de mesure de la demande. Ce représentant joue le rôle du prix lui-même dans le modèle originalement spécifié, celui-ci est alors évalué.

Statistiques : Pour chaque modèle : coefficients de régression standardisés et non standardisés, R multiple, R^2 , R^2 ajusté, erreur standard de l'estimation, tableau d'analyse de variance, prévisions et résidus. Également, intervalles de confiance de 95 % pour chaque coefficient de régression, matrices de corrélation et de covariance des estimations des paramètres.

Remarques sur les données de régression par les doubles moindres carrés

Données : Les variables dépendantes et indépendantes doivent être quantitatives. Les variables catégorielles, comme la religion, la qualification, la zone de résidence, doivent être enregistrées sous forme de variables binaires (factices) ou sous de tout autre type de variables de contraste. Les variables explicatives *endogènes* doivent également être quantitatives (pas catégorielles).

Hypothèses : Pour chaque valeur de la variable indépendante, la distribution de la variable dépendante doit être normale. La variance de la distribution de la variable dépendante doit être constante pour toutes les valeurs de la variable indépendante. La relation entre la variable dépendante et chaque variable indépendante doit être linéaire.

Procédures apparentées : Si vous estimez qu'aucune de vos variables de prédicteur n'est corrélée avec les erreurs de la variable dépendante, vous pouvez employer une procédure de régression linéaire. Si vos données ne semblent pas répondre aux hypothèses formulées (telles que la normalité et la constance de la variance), essayez de les modifier. Si vos données ne sont pas liées linéairement et qu'une modification ne change rien, utilisez un autre modèle dans la procédure d'estimation de courbe. Si votre variable dépendante est dichotomique, telle que Vendue ou Non vendue, utilisez la procédure de régression logistique. Si vos données ne sont pas indépendantes (par exemple, si vous observez le même individu sous différentes conditions), utilisez la procédure de mesures répétées.

Obtenir une analyse de la régression par les doubles moindres carrés

1. A partir des menus, sélectionnez :

Analyze > Régression > Doubles moindres carrés...

2. Sélectionnez une variable dépendante.
3. Sélectionnez une ou plusieurs Variables explicatives (prédicteur).
4. Sélectionnez une ou plusieurs Variables instrumentales.

- *Variables instrumentales.* Variables utilisées pour calculer les prévisions des variables endogènes dans la première phase de l'analyse des doubles moindres carrés. Les mêmes variables peuvent apparaître à la fois dans les zones de liste Variables explicatives et Variables instrumentales. Le nombre de variables instrumentales doit être au moins aussi élevé que celui des variables explicatives. Si toutes les variables explicatives et instrumentales répertoriées sont identiques, les résultats sont les mêmes que ceux obtenus par la procédure de régression linéaire.

Les variables explicatives non spécifiées comme instrumentales sont considérées comme étant endogènes. En principe, toutes les variables exogènes de la liste Explicatif sont également spécifiées en tant que variables instrumentales.

Options de régression par les doubles moindres carrés

Vous pouvez sélectionner les options suivantes pour votre analyse :

Enregistrer les nouvelles variables : Permet d'ajouter de nouvelles variables au fichier actif. Les options disponibles sont Prévisions et Résidus.

Afficher la covariance des paramètres : Permet d'imprimer la matrice de covariance des estimations des paramètres.

Fonctions supplémentaires de la commande 2SLS

Le langage de syntaxe de commande vous permet également d'estimer plusieurs équations en même temps. Reportez-vous au manuel *Command Syntax Reference* pour plus d'informations sur la syntaxe.

Méthodes de codification des variables qualitatives

Dans de nombreuses procédures, vous pouvez demander le remplacement automatique d'une variable indépendante catégorielle par un ensemble de variables de contraste, qui seront ensuite introduites dans une équation, ou en seront supprimées, en tant que bloc. Vous pouvez indiquer comment le groupe de variables de contraste doit être codé, généralement à l'aide de la sous-commande CONTRAST. Cette annexe explique et illustre le fonctionnement des différents types de contraste que vous pouvez appeler via la sous-commande CONTRAST.

Déviations

Déviations par rapport à la moyenne générale : Dans les matrices, ces contrastes ont la forme suivante :

```
mean (1/k 1/k ... 1/k 1/k)
df(1) (1-1/k -1/k ... -1/k -1/k)
df(2) (-1/k 1-1/k ... -1/k -1/k)
.
.
df(k-1) (-1/k -1/k ... 1-1/k -1/k)
```

où k est le nombre de catégories de la variable indépendante, la dernière catégorie étant omise par défaut. Par exemple, les contrastes de déviation d'une variable indépendante comportant trois catégories sont les suivants :

```
( 1/3 1/3 1/3)
( 2/3 -1/3 -1/3)
(-1/3 2/3 -1/3)
```


Pour omettre une catégorie autre que la dernière, indiquez son numéro entre parenthèses après le mot-clé `DEVIATION`. Par exemple, la sous-commande suivante permet d'obtenir les déviations de la première et de la troisième catégorie, et d'omettre la deuxième :

```
/CONTRAST (FACTOR)=DEVIATION(2)
```

Supposons que le facteur (*FACTOR*) comporte trois catégories. La matrice de contraste obtenue est la suivante :

```
( 1/3  1/3  1/3)
( 2/3 -1/3 -1/3)
(-1/3 -1/3  2/3)
```

Simple

Contrastes simples : Compare chaque niveau d'un facteur au dernier. La forme de la matrice générale est la suivante :

```
mean (1/k  1/k  ...  1/k  1/k)
df(1) ( 1  0  ...  0  -1)
df(2) ( 0  1  ...  0  -1)
      .
      .
df(k-1) ( 0  .  0  ...  1  -1)
```

où k est le nombre de catégories de la variable indépendante. Par exemple, les contrastes simples d'une variable indépendante comportant quatre catégories sont les suivants :

```
(1/4  1/4  1/4  1/4)
( 1  0  0  -1)
( 0  1  0  -1)
( 0  0  1  -1)
```

Pour utiliser comme catégorie de référence une autre catégorie que la dernière, indiquez entre parenthèses, après le mot-clé `SIMPLE`, le numéro de séquence de la catégorie de référence ; il ne s'agit pas nécessairement de la valeur associée à la catégorie. Par exemple, la sous-commande `CONTRAST` suivante permet d'obtenir une matrice de contraste qui omet la deuxième catégorie :

```
/CONTRAST (FACTOR) = SIMPLE(2)
```

Supposons que le facteur (*FACTOR*) comporte quatre catégories. La matrice de contraste obtenue est la suivante :

```
(1/4  1/4  1/4  1/4)
( 1  -1  0  0)
( 0  -1  1  0)
( 0  -1  0  1)
```

Helmert

Contrastes de Helmert : Compare les catégories d'une variable indépendante avec la moyenne des catégories suivantes. La forme de la matrice générale est la suivante :

```
mean (1/k  1/k  ...  1/k  1/k  1/k)
df(1) ( 1  -1/(k-1)  ...  -1/(k-1)  -1/(k-1)  -1/(k-1))
df(2) ( 0  1  ...  -1/(k-2)  -1/(k-2)  -1/(k-2))
      .
      .
df(k-2) ( 0  0  ...  1  -1/2  -1/2)
df(k-1) ( 0  0  ...  0  1  -1)
```

où k est le nombre de catégories de la variable indépendante. Par exemple, une variable indépendante comportant quatre catégories présente une matrice de contraste de Helmert ayant la forme suivante :

```
(1/4  1/4  1/4  1/4)
( 1  -1/3  -1/3  -1/3)
( 0  1  -1/2  -1/2)
( 0  0  1  -1)
```

Différence

Contrastes de différence ou contrastes inversés de Helmert : Compare les catégories d'une variable indépendante avec la moyenne des catégories précédentes de la variable. La forme de la matrice générale est la suivante :

```
mean (1/k 1/k 1/k ... 1/k)
df(1) ( -1 1/k ... 1/k)
df(2) ( -1/2 -1/2 ... 1/k)
.
.
df(k-1) (-1/(k-1) -1/(k-1) ... 1)
```

où k est le nombre de catégories de la variable indépendante. Par exemple, les contrastes de différence d'une variable indépendante comportant quatre catégories sont les suivants :

```
( 1/4 1/4 1/4 1/4)
( -1 1 0 0)
(-1/2 -1/2 1 0)
(-1/3 -1/3 -1/3 1)
```

Polynomial

Contraste polynomial orthogonal : Le premier degré de liberté contient l'effet linéaire sur toutes les catégories, le second degré l'effet quadratique, le troisième degré l'effet cubique, et ainsi de suite pour les effets d'ordre supérieur.

Vous pouvez définir l'espacement entre les niveaux du traitement mesuré par la variable qualitative donnée. Vous pouvez indiquer l'espacement égal (espacement par défaut en cas d'omission de la mesure), sous la forme d'une suite d'entiers allant de 1 à k , où k est le nombre de catégories. Si la variable *médicament* comporte trois catégories, la sous-commande

```
/CONTRAST(DRUG)=POLYNOMIAL
```

est identique à

```
/CONTRAST(DRUG)=POLYNOMIAL(1,20,3)
```

Toutefois, l'espacement égal n'est pas systématiquement nécessaire. Par exemple, supposons que la variable *médicament* représente différents dosages d'un médicament administré à trois groupes. Si le dosage administré au deuxième groupe est le double de celui administré au premier groupe, et si celui administré au troisième groupe est le triple de celui administré au premier groupe, les catégories de traitement sont espacées de manière égale et, dans cette situation, une mesure appropriée se compose d'une suite d'entiers :

```
/CONTRAST(DRUG)=POLYNOMIAL(1,20,3)
```

Toutefois, si le dosage administré au deuxième groupe est le quadruple de celui administré au premier groupe, et si celui administré au troisième groupe est le septuple de celui administré au premier groupe, une mesure appropriée se présente sous la forme suivante :

```
/CONTRAST(DRUG)=POLYNOMIAL(1,4,7)
```

Dans les deux cas, une fois le contraste défini, le premier degré de liberté de la variable *médicament* contient l'effet linéaire des niveaux de dosage, tandis que le deuxième degré contient l'effet quadratique.

Les contrastes polynomiaux sont particulièrement utiles pour réaliser des tests de tendances et analyser la nature des surfaces de réponses. Vous pouvez également utiliser les contrastes polynomiaux pour effectuer un ajustement de courbe non linéaire, comme une régression curviligne.

Répété

Compare les niveaux adjacents d'une variable indépendante : La forme de la matrice générale est la suivante :

```
mean (1/k 1/k 1/k ... 1/k 1/k)
df(1) ( 1 -1 0 ... 0 0)
df(2) ( 0 1 -1 ... 0 0)
.
.
df(k-1) ( 0 0 0 ... 1 -1)
```

où k est le nombre de catégories de la variable indépendante. Par exemple, les contrastes répétés d'une variable indépendante comportant quatre catégories sont les suivants :

```
(1/4 1/4 1/4 1/4)
( 1 -1 0 0)
( 0 1 -1 0)
( 0 0 1 -1)
```

Ces contrastes sont utiles dans l'analyse des profils et lorsque des statistiques de différence sont nécessaires.

Spécial

Contraste défini par l'utilisateur : Permet la saisie de contrastes spéciaux sous la forme de matrices carrées comportant autant de lignes et de colonnes que le nombre de catégories de la variable indépendante spécifiée. Pour MANOVA et LOGLINEAR, la première ligne saisie est toujours l'effet de moyenne ou de constante, et représente le groupe de pondérations indiquant comment déterminer, par rapport à la variable spécifiée, la moyenne des autres variables indépendantes (le cas échéant). Généralement, ce contraste est un vecteur.

Les autres lignes de la matrice contiennent les contrastes spéciaux indiquant les comparaisons entre les catégories de la variable. Généralement, les contrastes orthogonaux sont les plus utiles. Ils ne sont pas redondants et sont statistiquement indépendants. Les contrastes sont orthogonaux si :

- Pour chaque ligne, la somme des coefficients de contraste est égale à 0.
- La somme des produits des coefficients correspondant à toutes les paires de lignes disjointes est aussi égale à 0.

Par exemple, supposons que la variable traitement comporte quatre niveaux et que vous souhaitez comparer les différents niveaux de traitement. Un contraste spécial approprié peut avoir la forme suivante :

```
(1 1 1 1) weights for mean calculation
(3 -1 -1 -1) compare 1st with 2nd through 4th
(0 2 -1 -1) compare 2nd with 3rd and 4th
(0 0 1 -1) compare 3rd with 4th
```

que vous définissez à l'aide de la sous-commande CONTRAST suivante pour MANOVA, LOGISTIC REGRESSION et COXREG :

```
/CONTRAST(TREATMNT)=SPECIAL( 1 1 1 1
                             3 -1 -1 -1
                             0 2 -1 -1
                             0 0 1 -1 )
```

Pour LOGLINEAR, vous devez indiquer :

```
/CONTRAST(TREATMNT)=BASIS SPECIAL( 1 1 1 1
                                    3 -1 -1 -1
                                    0 2 -1 -1
                                    0 0 1 -1 )
```

La somme de chaque ligne, à l'exception de la ligne des moyennes, est égale à 0, de même que celle des produits de chaque paire de lignes disjointes :

```
Rows 2 and 3: (3)(0) + (-1)(2) + (-1)(-1) + (-1)(-1) = 0
Rows 2 and 4: (3)(0) + (-1)(0) + (-1)(1) + (-1)(-1) = 0
Rows 3 and 4: (0)(0) + (2)(0) + (-1)(1) + (-1)(-1) = 0
```

Il n'est pas nécessaire que les contrastes spéciaux soient orthogonaux. Toutefois, ils ne doivent pas constituer des combinaisons linéaires les uns avec les autres. Si tel est le cas, la procédure signale la dépendance linéaire et interrompt le traitement. Les contrastes polynomiaux, de différence et de Helmert sont tous des contrastes orthogonaux.

Indicateur

Codification des variables indicateur : Egalement appelé codification factice, ce type de codification n'est pas disponible dans LOGLINEAR ni MANOVA. Le numéro des nouvelles variables codées est $k-1$. Les observations de la catégorie de référence sont codées 0 pour toutes les variables $k-1$. Une observation dans la $n^{\text{ième}}$ catégorie est codée 0 pour toutes les variables indicateur, sauf la $n^{\text{ième}}$, codée 1.

Remarques

Le présent document a été développé pour des produits et des services proposés aux Etats-Unis et peut être mis à disposition par IBM dans d'autres langues. Toutefois, il peut être nécessaire de posséder une copie du produit ou de la version du produit dans cette langue pour pouvoir y accéder.

Le présent document peut contenir des informations ou des références concernant certains produits, logiciels ou services IBM non annoncés dans ce pays. Pour plus de détails, référez-vous aux documents d'annonce disponibles dans votre pays, ou adressez-vous à votre partenaire commercial IBM. Toute référence à un produit, programme ou service IBM n'implique pas que seul ce produit, programme ou service IBM puisse être utilisé. Tout autre élément fonctionnellement équivalent peut être utilisé, s'il n'enfreint aucun droit d'IBM. Il est de la responsabilité de l'utilisateur d'évaluer et de vérifier lui-même les installations et applications réalisées avec des produits, logiciels ou services non expressément référencés par IBM.

IBM peut détenir des brevets ou des demandes de brevet couvrant les produits mentionnés dans le présent document. La remise de ce document ne vous donne aucun droit de licence sur ces brevets ou demandes de brevet. Si vous désirez recevoir des informations concernant l'acquisition de licences, veuillez en faire la demande par écrit à l'adresse suivante :

*IBM Director of Licensing
IBM Corporation
North Castle Drive, MD-NC119
Armonk, NY 10504-1785
U.S.A.*

Pour toute demande d'informations relatives au jeu de caractères codé sur deux octets, contactez le service de propriété intellectuelle IBM ou envoyez vos questions par courrier à l'adresse suivante :

*Intellectual Property Licensing
Legal and Intellectual Property Law
IBM Japan Ltd.
19-21, Nihonbashi-Hakozakicho, Chuo-ku
Tokyo 103-8510, Japan*

LE PRESENT DOCUMENT EST LIVRE EN L'ETAT SANS AUCUNE GARANTIE EXPLICITE OU IMPLICITE. IBM DECLINE NOTAMMENT TOUTE RESPONSABILITE RELATIVE A CES INFORMATIONS EN CAS DE CONTREFAÇON AINSI QU'EN CAS DE DEFAUT D'APTITUDE A L'EXECUTION D'UN TRAVAIL DONNE. Certaines juridictions n'autorisent pas l'exclusion des garanties implicites, auquel cas l'exclusion ci-dessus ne vous sera pas applicable.

Le présent document peut contenir des inexactitudes ou des coquilles. Ce document est mis à jour périodiquement. Chaque nouvelle édition inclut les mises à jour. IBM peut, à tout moment et sans préavis, modifier les produits et logiciels décrits dans ce document.

Les références à des sites Web non IBM sont fournies à titre d'information uniquement et n'impliquent en aucun cas une adhésion aux données qu'ils contiennent. Les éléments figurant sur ces sites Web ne font pas partie des éléments du présent produit IBM et l'utilisation de ces sites relève de votre seule responsabilité.

IBM pourra utiliser ou diffuser, de toute manière qu'elle jugera appropriée et sans aucune obligation de sa part, tout ou partie des informations qui lui seront fournies.

Les licenciés souhaitant obtenir des informations permettant : (i) l'échange des données entre des logiciels créés de façon indépendante et d'autres logiciels (dont celui-ci), et (ii) l'utilisation mutuelle des données ainsi échangées, doivent adresser leur demande à :

*IBM Director of Licensing
IBM Corporation*

North Castle Drive, MD-NC119
Armonk, NY 10504-1785
U.S.A.

Ces informations peuvent être soumises à des conditions particulières, prévoyant notamment le paiement d'une redevance.

Le logiciel sous licence décrit dans ce document et tous les éléments sous licence disponibles s'y rapportant sont fournis par IBM conformément aux dispositions du Livret Contractuel IBM, des Conditions Internationales d'Utilisation de Logiciels IBM, des Conditions d'Utilisation du Code Machine ou de tout autre contrat équivalent.

Les données de performances et les exemples de clients sont fournis à titre d'exemple uniquement. Les performances réelles peuvent varier en fonction des configurations et des conditions d'exploitation spécifiques.

Les informations concernant des produits non IBM ont été obtenues auprès des fournisseurs de ces produits, par l'intermédiaire d'annonces publiques ou via d'autres sources disponibles. IBM n'a pas testé ces produits et ne peut confirmer l'exactitude de leurs performances ni leur compatibilité. Elle ne peut recevoir aucune réclamation concernant des produits non IBM. Toute question concernant les performances de produits non IBM doit être adressée aux fournisseurs de ces produits.

Toute instruction relative aux intentions d'IBM pour ses opérations à venir est susceptible d'être modifiée ou annulée sans préavis, et doit être considérée uniquement comme un objectif.

Le présent document peut contenir des exemples de données et de rapports utilisés couramment dans l'environnement professionnel. Ces exemples mentionnent des noms fictifs de personnes, de sociétés, de marques ou de produits à des fins illustratives ou explicatives uniquement. Toute ressemblance avec des noms de personnes, de sociétés ou des données réelles serait purement fortuite.

LICENCE DE COPYRIGHT :

Le présent logiciel contient des exemples de programmes d'application en langage source destinés à illustrer les techniques de programmation sur différentes plateformes d'exploitation. Vous avez le droit de copier, de modifier et de distribuer ces programmes exemples sous quelque forme que ce soit et sans paiement d'aucune redevance à IBM, à des fins de développement, d'utilisation, de vente ou de distribution de programmes d'application conformes aux interfaces de programmation des plateformes pour lesquels ils ont été écrits ou aux interfaces de programmation IBM. Ces programmes exemples n'ont pas été rigoureusement testés dans toutes les conditions. Par conséquent, IBM ne peut garantir expressément ou implicitement la fiabilité, la maintenabilité ou le fonctionnement de ces programmes. Les programmes exemples sont fournis "EN L'ETAT", sans garantie d'aucune sorte. IBM ne sera en aucun cas responsable des dommages liés à l'utilisation des programmes exemples.

Toute copie totale ou partielle de ces programmes exemples et des oeuvres qui en sont dérivées doit comprendre une notice de copyright, libellée comme suit :

© Copyright IBM Corp. 2020. Des segments de code sont dérivés des Programmes exemples d'IBM Corp.

© Copyright IBM Corp. 1989 - 2020. All rights reserved.

Marques

IBM, le logo IBM et ibm.com sont des marques d'International Business Machines Corp. dans de nombreux pays. Les autres noms de produits et de services peuvent être des marques d'IBM ou d'autres sociétés. La liste actualisée de toutes les marques d'IBM est disponible sur la page Web "Copyright and trademark information" à l'adresse www.ibm.com/legal/copytrade.shtml.

Adobe, le logo Adobe, PostScript et le logo PostScript sont des marques d'Adobe Systems Incorporated aux Etats-Unis et/ou dans certains autres pays.

Intel, le logo Intel, Intel Inside, le logo Intel Inside, Intel Centrino, le logo Intel Centrino, Celeron, Intel Xeon, Intel SpeedStep, Itanium et Pentium sont des marques d'Intel Corporation ou de ses filiales aux Etats-Unis et/ou dans certains autres pays.

Linux est une marque de Linus Torvalds aux Etats-Unis et/ou dans certains autres pays.

Microsoft, Windows, Windows NT et le logo Windows sont des marques de Microsoft Corporation aux Etats-Unis et/ou dans certains autres pays.

UNIX est une marque enregistrée de The Open Group aux Etats-Unis et/ou dans certains autres pays.

Java ainsi que toutes les marques et tous les logos incluant Java sont des marques d'Oracle et/ou de ses sociétés affiliées.

Index

A

Analyse de régression logistique [2](#)
Analyse par la méthode des probits
critères [12](#)
Définition d'une plage [12](#)
fonctions supplémentaires de la commande [12](#)
Impact relatif médian [12](#)
Intervalle de confiance de référence [12](#)
Itérations [12](#)
statistiques [12](#)
Taux de réponse naturel [12](#)
Test de parallélisme [12](#)

C

catégorie de référence
Dans la régression logistique multinomiale [8](#)
Cellules contenant 0 observation
Dans la régression logistique multinomiale [9](#)
Classification
Dans la régression logistique multinomiale [6](#)
Constante
dans la régression linéaire [5](#)
Inclusion ou exclusion [7](#)
Contraintes sur les paramètres
Dans la régression non linéaire [21](#)
Contrastes
Dans la régression logistique [4](#)
Covariables
Dans la régression logistique [4](#)
covariables catégorielles [4](#)
covariables de chaîne
Dans la régression logistique [4](#)
Critère de convergence
Dans la régression logistique multinomiale [9](#)

D

Delta
Comme correction pour les cellules contenant 0
observation [9](#)
DfBeta
Dans la régression logistique [4](#)
Distance de Cook
Dans la régression logistique [4](#)

E

élimination descendante
Dans la régression logistique [3](#)
Estimations des paramètres
Dans la régression logistique multinomiale [8](#)

F

Fonction de déviance
Pour l'estimation de la valeur d'échelle de dispersion [9](#)

H

Historique des itérations
Dans la régression logistique multinomiale [9](#)

I

Impact relatif médian
Dans les analyses par la méthode des probits [12](#)
Intervalle de confiance
Dans la régression logistique multinomiale [8](#)
Intervalle de confiance de référence
Dans les analyses par la méthode des probits [12](#)
Itérations
Dans la régression logistique [5](#)
Dans la régression logistique multinomiale [9](#)
Dans les analyses par la méthode des probits [12](#)

K

khi-deux de Pearson
Pour l'estimation de la valeur d'échelle de dispersion [9](#)
Qualité de l'ajustement [8](#)

L

Log de vraisemblance
Dans la pondération estimée [23](#)
Dans la régression logistique multinomiale [8](#)
Loi des réponses décroissantes de Metcherlich
Dans la régression non linéaire [20](#)

M

Matrice de corrélation
Dans la régression logistique multinomiale [8](#)
Matrice de covariance
Dans la régression logistique multinomiale [8](#)
Modèle de densité
Dans la régression non linéaire [20](#)
Modèle de densité de rendement
Dans la régression non linéaire [20](#)
Modèle de Gompertz
Dans la régression non linéaire [20](#)
Modèle de Johnson-Schumacher
Dans la régression non linéaire [20](#)
Modèle de log modifié
Dans la régression non linéaire [20](#)
Modèle de Michaelis Menten
Dans la régression non linéaire [20](#)
Modèle de Morgan-Mercer-Florin

- Modèle de Morgan-Mercer-Florin (*suite*)
 - Dans la régression non linéaire [20](#)
- Modèle de Peal-Reed
 - Dans la régression non linéaire [20](#)
- Modèle de Richards
 - Dans la régression non linéaire [20](#)
- Modèle de Verhulst
 - Dans la régression non linéaire [20](#)
- Modèle de Von Bertalanffy
 - Dans la régression non linéaire [20](#)
- Modèle de Weibull
 - Dans la régression non linéaire [20](#)
- Modèle des rapports cubiques
 - Dans la régression non linéaire [20](#)
- Modèle des rapports quadratiques
 - Dans la régression non linéaire [20](#)
- Modèle gaussien
 - Dans la régression non linéaire [20](#)
- Modèles avec effets principaux
 - Dans la régression logistique multinomiale [7](#)
- Modèles factoriels complets
 - Dans la régression logistique multinomiale [7](#)
- Modèles non linéaires
 - Dans la régression non linéaire [20](#)
- Modèles personnalisés
 - Dans la régression logistique multinomiale [7](#)

P

- Pondération estimée
 - Afficher ANOVA et les estimations [24](#)
 - Enregistrer meilleure pondération dans nouvelle variable [24](#)
 - exemple [23](#)
 - fonctions supplémentaires de la commande [25](#)
 - Historique des itérations [24](#)
 - Log de vraisemblance [23](#)
 - statistiques [23](#)

Q

- Qualité de l'ajustement
 - Dans la régression logistique multinomiale [8](#)

R

- R2 de Cox et Snell
 - Dans la régression logistique multinomiale [8](#)
- R2 de McFadden
 - Dans la régression logistique multinomiale [8](#)
- R2 de Nagelkerke
 - Dans la régression logistique multinomiale [8](#)
- Rapport de vraisemblance
 - Pour l'estimation de la valeur d'échelle de dispersion [9](#)
 - Qualité de l'ajustement [8](#)
- Régression asymptotique
 - Dans la régression non linéaire [20](#)
- Régression linéaire
 - Pondération estimée [23](#)
 - Régression par les doubles moindres carrés [25](#)
- Régression logistique
 - Binaire [1](#)
 - Coefficients [2](#)

- Régression logistique (*suite*)
 - Constante [5](#)
 - Contrastes [4](#)
 - covariables catégorielles [4](#)
 - covariables de chaîne [4](#)
 - Définition de la règle de sélection [3](#)
 - Définition de règle [3](#)
 - Enregistrement de nouvelles variables [4](#)
 - exemple [2](#)
 - fonctions supplémentaires de la commande [6](#)
 - Itérations [5](#)
 - limite du classement [5](#)
 - Mesures d'influence [4](#)
 - méthodes de sélection des variables [3](#)
 - Options d'affichage [5](#)
 - Prévisions [4](#)
 - Probabilité pour méthode pas à pas [5](#)
 - Résidus [4](#)
 - Statistique de qualité d'ajustement de Hosmer-Lemeshow [5](#)
 - statistiques [2](#)
 - Tracés et statistiques [5](#)
- Régression logistique binaire [1, 2](#)
- Régression logistique multinomiale
 - catégorie de référence [8](#)
 - Critères [9](#)
 - enregistrer [10](#)
 - Exportation des informations du modèle [10](#)
 - fonctions supplémentaires de la commande [10](#)
 - Modèles [7](#)
 - statistiques [8](#)
- Régression logistique SPSS [2](#)
- Régression non linéaire
 - Algorithme de Levenberg-Marquardt [22](#)
 - Contraintes sur les paramètres [21](#)
 - Dérivées [22](#)
 - Enregistrement de nouvelles variables [22](#)
 - Erreur standard estimée par le bootstrap [22](#)
 - exemple [19](#)
 - Fonction de perte [21](#)
 - fonctions supplémentaires de la commande [23](#)
 - Interprétation des résultats [22](#)
 - Logique conditionnelle [20](#)
 - Méthode d'estimation [22](#)
 - Modèle segmenté [20](#)
 - Modèles non linéaires communs [20](#)
 - Paramètres [20](#)
 - Prévisions [22](#)
 - Programmation quadratique séquentielle [22](#)
 - Résidus [22](#)
 - statistiques [19](#)
 - Valeurs initiales [20](#)
- Régression par les doubles moindres carrés
 - Covariance des paramètres [26](#)
 - Enregistrement de nouvelles variables [26](#)
 - exemple [25](#)
 - fonctions supplémentaires de la commande [26](#)
 - statistiques [25](#)
 - Variabes instrumentales [25](#)
- Régression probits
 - exemple [10](#)
 - statistiques [10](#)
- Régression quantile
 - Affichage [16](#)

Régression quantile (*suite*)

- critères [14](#)
- enregistrer [17](#)
- exemple [12](#)
- exporter [18](#)
- modèle [15](#)
- statistiques [12](#)

Régression restreinte

- Dans la régression non linéaire [21](#)

S

sélection ascendante

- Dans la régression logistique [3](#)

sélection progressive

- Dans la régression logistique multinomiale [7](#)

Sélection progressive

- Dans la régression logistique [3](#)

Séparation

- Dans la régression logistique multinomiale [9](#)

singularité

- Dans la régression logistique multinomiale [9](#)

Statistique de qualité d'ajustement de Hosmer-Lemeshow

- Dans la régression logistique [5](#)

Step-halving

- Dans la régression logistique multinomiale [9](#)

T

Table de classification

- Dans la régression logistique multinomiale [8](#)

Tableaux de probabilités des cellules

- Dans la régression logistique multinomiale [8](#)

Test de parallélisme

- Dans les analyses par la méthode des probits [12](#)

V

Valeur d'échelle de dispersion

- Dans la régression logistique multinomiale [9](#)

Valeurs influentes

- Dans la régression logistique [4](#)

