

Modèles Linéaires Appliqués

Arthur Charpentier

Automne 2020

Intro #1 (plan de cours)

Modèles Linéaires Appliqués (STT5100)

“Méthode d'estimation par moindres carrés, Régression linéaire simple et multiple, Tests d'hypothèses et intervalles de confiance, tests d'ajustement, introduction aux modèles linéaires généralisés (GLM): régression logistique, régression Poisson, régression Gamma. Applications numériques à l'aide de R”

<https://etudier.uqam.ca/cours?sigle=STT5100>

Instructeur: **Arthur Charpentier**

✉ charpentier.arthur@uqam.ca

🐦 [@freakonometrics](https://twitter.com/freakonometrics)

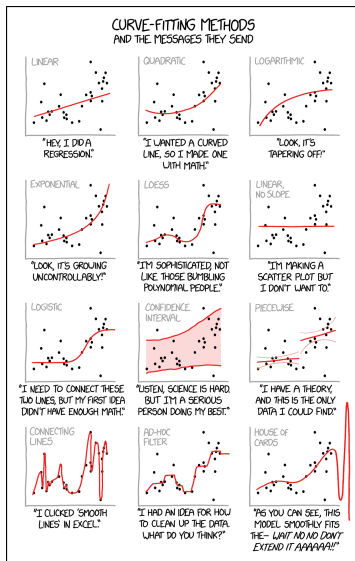
🐙 [freakonometrics](https://github.com/freakonometrics)

🌐 freakonometrics.hypotheses.org

→ [plan de cours.pdf](#)



Modèles Linéaires Appliqués (STT5100)



- R & RStudio
- probas $Y \sim F$, $\mathbb{E}[Y]$, etc
- stats $\{y_1, \dots, y_n\} \sim F_\theta$, estimateur $\hat{\theta}$, $\mathbb{E}[\hat{\theta}]$, etc
- algèbre linéaire $\langle \vec{x}, \vec{e} \rangle = 0$
matrices, projection orthogonales, etc

xkcd.com/2048



Modèles Linéaires Appliqués (STT5100)

① **Rappels**

- R & Markdown
- Probabilités & Algèbre Linéaire
- Statistiques, inférence & tests
- Simulations & Optimisation

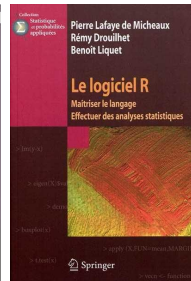
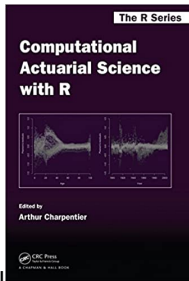
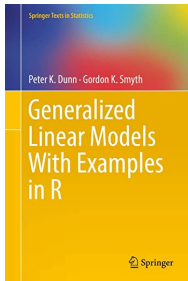
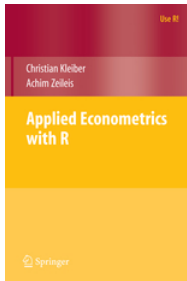
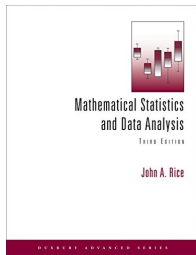
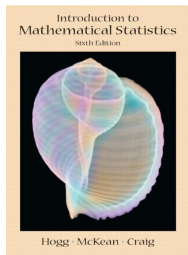
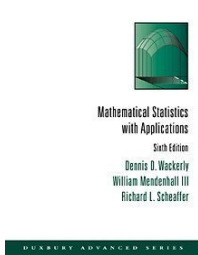
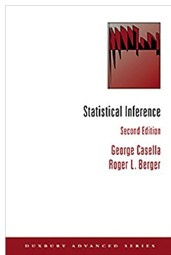
② **Modèles Linéaires (OLS)**

- Moindres Carrés & Modèle Gaussien
- Inférence & Tests
- Incertitude & Prévision

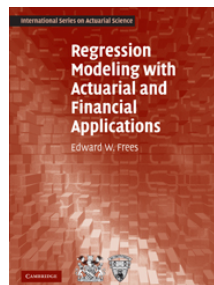
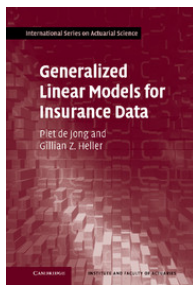
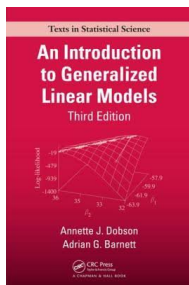
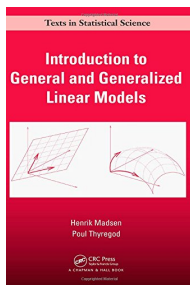
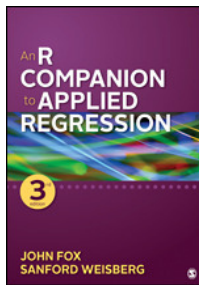
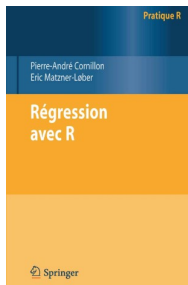
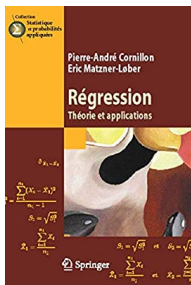
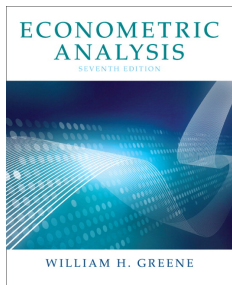
③ **Modèles Linéaires Généralisés (GLM)**

- Logistique, binomiale ($y \in \{0, 1\}$) & multinomiale
- Comptage, Poisson ($y \in \{0, 1, 2, \dots\}$)
- Famille exponentielle & GLM

Statistique Inférentielle & R



Modèles Linéaires (OLS & GLM)



Modèles Linéaires Appliqués (STT5100)

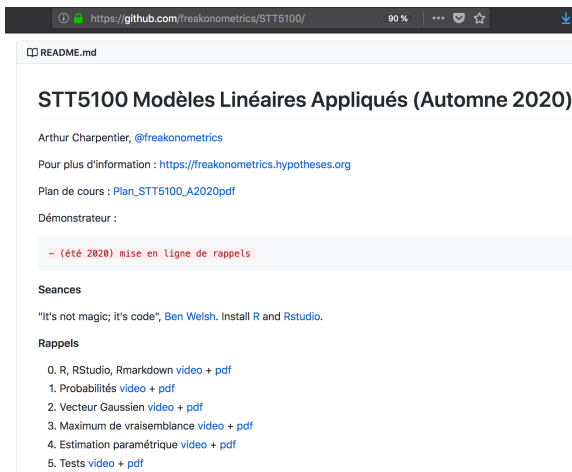
“when a measure becomes a target, it ceases to be a good measure”, Charles Goodhart, membre du Comité de politique monétaire de la Banque d'Angleterre

Autrement dit, les examens ne sont pas l'objectif du cours

- Quizz hebdomadaire ($\times 10$) = 20%
- Examen 1 = 20% (OLS)
- Examen 2 = 20% (GLM)
- Projet 1 = 18% (OLS)
- Projet 2 = 18% (GLM)
- Participation = 4%

Modèles Linéaires Appliqués (STT5100)

Dépôt des documents (slides + devoirs): [github](#) + moodle



https://github.com/freakonometrics/STT5100/ 90 %

README.md

STT5100 Modèles Linéaires Appliqués (Automne 2020)

Arthur Charpentier, [@freakonometrics](#)

Pour plus d'information : <https://freakonometrics.hypotheses.org>

Plan de cours : [Plan_STT5100_A2020pdf](#)

Démonstrateur :

- (été 2020) mise en ligne de rappels

Seances

"It's not magic; it's code", [Ben Welsh](#). Install [R](#) and [Rstudio](#).

Rappels

0. R, RStudio, Rmarkdown [video](#) + [pdf](#)
1. Probabilités [video](#) + [pdf](#)
2. Vecteur Gaussien [video](#) + [pdf](#)
3. Maximum de vraisemblance [video](#) + [pdf](#)
4. Estimation paramétrique [video](#) + [pdf](#)
5. Tests [video](#) + [pdf](#)

Modèles Linéaires Appliqués (STT5100)

Dépôt des documents (slides + devoirs): github + moodle



Université du Québec à Montréal
STT5100 - Modèles linéaires appliqués | Groupe 050 Automne 2020

Arthur
Charpentier



Moodle

Soutien

Français (fr) ▼

Rechercher des cours



Les travaux seront à rendre sur moodle !



Devoir 1

Ajouter un travail

Remises de fichiers

Taille maximale des nouveaux fichiers : 2Go, Nombre maximal d'annexes : 20

Modèles Linéaires Appliqués (STT5100)

Vidéos du cours: [youtube](#) (+ github + moodle)

The screenshot shows a video player interface. The main content area displays a slide titled "Fonctions Liens : Canonique". The slide text includes:

- Cas particulier : lien canonique $g = b'^{-1}$ i.e. $\eta_i = \theta_i$
- $$\mu(\mathbf{x}) = b'(\mathbf{x}^\top \beta)$$
- Exemple** Pour la loi normale, $\mu(\mathbf{x}) = \mathbf{x}^\top \beta$ (identité)
- Exemple** Pour la loi de Poisson, $\mu(\mathbf{x}) = \exp(\mathbf{x}^\top \beta)$ (logarithmique)
- Exemple** Pour la loi de Bernoulli, $\mu(\mathbf{x}) = \frac{\exp(\mathbf{x}^\top \beta)}{1 + \exp(\mathbf{x}^\top \beta)}$ (logit)
- Exemple** Pour la loi Tweedie $V(\mu) = \mu^\gamma$, $\mathbf{x}^\top \beta = \frac{\mu(\mathbf{x})^{1-\gamma}}{1-\gamma}$ (power)

The video player controls at the bottom show a progress bar at 8:17 / 41:01 and the URL [nonometrics_hypotheses.org](https://www.youtube.com/watch?v=nonometrics_hypotheses.org).

To the right of the video player is a table of contents for the STT5100 course, listing slides 12 through 17 with their respective durations and the presenter's name, arthur charpentier.

Slide	Duration	Presenter
12	36:23	arthur charpentier
13	30:01	arthur charpentier
14	41:02	arthur charpentier
15	36:05	arthur charpentier
16	15:10	arthur charpentier
17	29:33	arthur charpentier

Modèles Linéaires Appliqués (STT5100)

Quizz: moodle



Université du Québec à Montréal
STT5100 - Modèles linéaires appliqués | Groupe 050 Automne 2020

Arthur
Charpentier



Moodle

Soutien

Français (fr) ▼

Rechercher des cours



par exemple

On dispose de 119 observations, dans le fichier [echantillon.csv](#).

Supposons que les observations sont des réalisations d'une loi normale, au sens où les x sont supposés tirés des X , de densité

$$x \mapsto f(x) = \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} \exp\left[-\frac{1}{2}\left(\frac{x-\mu}{\sigma}\right)^2\right]$$

pour $x \geq 0$. On veut l'intervalle de confiance à 95% du paramètre μ , centré sur \bar{x} . Quelle est la borne inférieure de l'intervalle de confiance (symétrique), au seuil de 95%? (une tolérance de 0,02 est accordée)

Réponse :

on sauve le fichier [echantillon.csv](#) puis on ouvre R

Modèles Linéaires Appliqués (STT5100)

```
1 > b = read.csv("echantillon.csv")
2 > n = nrow(b)
3 > m = mean(b$x)
4 > s = sd(b$x)
5 > interval = m + 1.96*c(-1,+1)*s/sqrt(n)
6 > interval
7 [1] 370.0794 407.7525
```

puisque l'intervalle de confiance pour μ , avec un niveau de confiance $1 - \alpha$, est de la forme

$$\left[\bar{x}_n + \Phi^{-1}(\alpha/2) \frac{\hat{s}_n}{\sqrt{n}}; \bar{x}_n + \Phi^{-1}(1 - \alpha/2) \frac{\hat{s}_n}{\sqrt{n}} \right]$$

avec les constantes usuelles ± 1.96 puisque

```
1 > qnorm(c(.025,.975))
2 [1] -1.959964 1.959964
```

Modèles Linéaires Appliqués (STT5100)

Une fois la tentative envoyée, vous n'aurez plus la possibilité de modifier vos réponses pour cette tentative.

Tout envoyer et terminer

Annuler

On peut alors soumettre la réponse (définitivement)

On dispose de 119 observations, dans le fichier [echantillon.csv](#).

Supposons que les observations sont des réalisations d'une loi normale, au sens où les x sont supposés tirés des X , de densité

$$x \mapsto f(x) = \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} \exp\left[-\frac{1}{2}\left(\frac{x-\mu}{\sigma}\right)^2\right]$$

pour $x \geq 0$. On veut l'intervalle de confiance à 95% du paramètre μ , centré sur \bar{x} . Quelle est la borne inférieure de l'intervalle de confiance (symétrique), au seuil de 95%? (une tolérance de 0,02 est accordée)

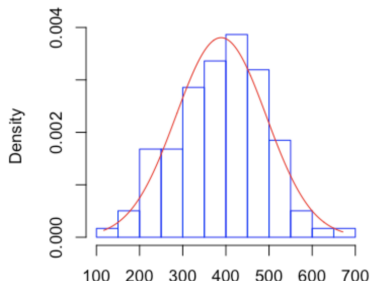
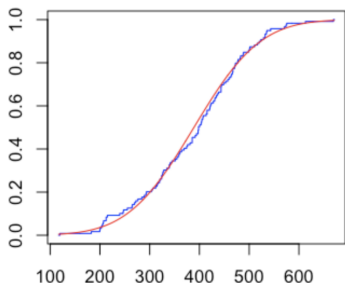
Réponse :

370.0794



Modèles Linéaires Appliqués (STT5100)

Des éléments de réponse (succints) sont alors proposés



Modèles Linéaires Appliqués (STT5100)

Discussion: forum teams

< Toutes les équipes



Groupe UQAM STT5100

Général

Général Publications Fichiers Bloc-notes de classe Devoirs Notes +

- Charpentier, Arthur a ajouté vanier, Ceirick à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Teres, William à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Tauadros, Edward à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Tatonetti, Claudia à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Sylvain, Roxanne à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Silue, Katieebie Fred à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Sharma, Amanjot à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Samaha, Christina à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Sabourin, Michael à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Portelance, Vincent à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Pelletier, Matthieu à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Paul, Christopher-Junior à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Paquet, Anne à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Paiement, William à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Oueini, Christina à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Moussa, Amira à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Morasse, Rachel à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Moradi-Djanatdoust, Maral à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Moreau, Loïc à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Mayaki, Alexandra à l'équipe.
- Charpentier, Arthur a ajouté Mahoro, Liliane à l'équipe.

Démarrer une conversation. Utilisez @ pour mentionner un contact.



Modèles Linéaires Appliqués (STT5100)



Tricherie et intégrité académique

<http://r18.uqam.ca/>

par exemple Comment citer ses sources?

Politique 16, <https://harcelement.uqam.ca/>

Modèles Linéaires Appliqués (STT5100)



Lors d'un cours ou d'une activité d'enseignement en ligne, le personnel enseignant peut décider, selon le cas, de procéder à l'enregistrement audio ou audiovisuel du cours ou de l'activité d'enseignement. Le personnel enseignant peut partager l'enregistrement uniquement à son groupe-cours.



En cas d'enregistrement, l'étudiante, l'étudiant sera informé au début de la séance.



Il est de la responsabilité de l'étudiante, de l'étudiant de désactiver son microphone et/ou sa caméra s'il ne souhaite pas être enregistré.



À défaut de désactiver son microphone et/ou sa caméra, l'étudiante, l'étudiant, consent à l'enregistrement audio ou audiovisuel, à la conservation, à la rediffusion et à l'utilisation de l'enregistrement de son nom, de sa voix et de son image dans le cadre du cours ou de l'activité en ligne. L'étudiante, l'étudiant reconnaît ne détenir aucun droit dans l'enregistrement.



Sauf avec l'autorisation expresse écrite du personnel enseignant, l'étudiante, l'étudiant reconnaît qu'il est interdit de reproduire, d'enregistrer, de publier, de diffuser, de communiquer ou de partager, par quelque moyen que ce soit, tout ou partie de l'enregistrement d'un cours ou d'une activité d'enseignement en ligne de même que tout matériel pédagogique s'y rattachant.

Une étudiante, un étudiant qui contrevient à ce qui précède s'expose aux sanctions prévues dans les règlements et politiques de l'UQAM ou à tout recours légal, notamment en vertu de la Loi sur le droit d'auteur.