

Atelier de Modélisation et Méthodes Statistiques en Sciences Sociales du 19 mai 2009 10h à 12h –48 Bd Jourdan

Campus Jourdan, grande salle (10h00-12h00)

Gilbert Saporta (CNAM)

Diagnostic et traitement de la multicolinéarité en régression linéaire

La multicolinéarité conduit à des estimations instables des coefficients d'un modèle de régression linéaire multiple. La solution brutale qui consiste à éliminer des prédictors peut ne pas être acceptable pour le chercheur qui a un modèle issu d'une théorie. Le problème est devenu crucial dans de nombreuses applications où on dispose de plus de variables que d'unités observées. On présentera un panorama des solutions les plus efficaces permettant de conserver toutes les variables : régression sur composantes principales, régression ridge et régression PLS. On donnera également des indications sur le LASSO qui aboutit à une sélection de variables via une pénalité L1 .

Les Ateliers de Modélisation et Méthodes Statistiques en Sciences Sociales (M2S3)

Créés à l'initiative de membres du Centre Maurice Halbwachs (ancien LASMAS-IdL), ils s'adressent aux personnes travaillant sur des données quantitatives en sciences sociales. Ils ont pour objectif de leur permettre d'exposer leurs difficultés, de rencontrer des interlocuteurs, d'échanger sur des méthodes et de confronter différents points de vue afin de développer - indépendamment de l'utilisation d'un logiciel particulier - les recherches sur des modèles pour traiter des données en sciences sociales, les comparaisons de méthodes statistiques et l'aide à l'interprétation des résultats.

Les réunions sont ouvertes à toutes les personnes qui le souhaitent (sans inscription préalable et sans frais), utilisateurs de données, chercheurs, ingénieurs ou étudiants à partir du MASTER.

Le cadre de ces réunions est plutôt informel et les participants doivent se sentir libres d'y exprimer leurs difficultés et/ou d'y avancer des solutions même incertaines.

Les séances ont lieu le dernier mardi de chaque mois, en dehors des vacances universitaires, de 10h à 12h , à L'École normale supérieure, 48 Boulevard Jourdan 75014 Paris