

Analyse de la Survie Nette et de la Mortalité en Excès Des concepts et des méthodes

Roch Giorgi, Nathalie Grafféo















SESSTIM, Faculté des Sciences Médicales et Paramédicales, Aix-Marseille Université, Marseille, France http://sesstim.univ-amu.fr/

Plan

- Partie I
 - Contexte
 - Concepts : quelle mesure pour répondre à quelle question ?
 - Méthode d'estimation non-paramétrique de la survie nette
 - Application
- Partie II
 - Méthodes d'estimation paramétrique de la mortalité en excès
 - Application

Partie I



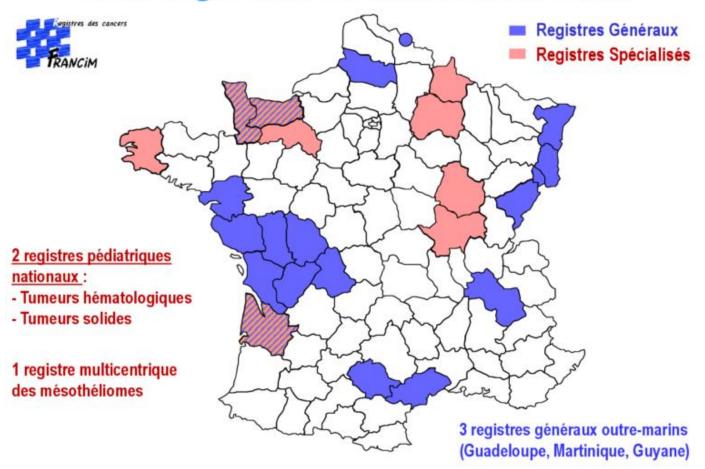
Contexte



Francim: France-Cancer-Incidence et Mortalité

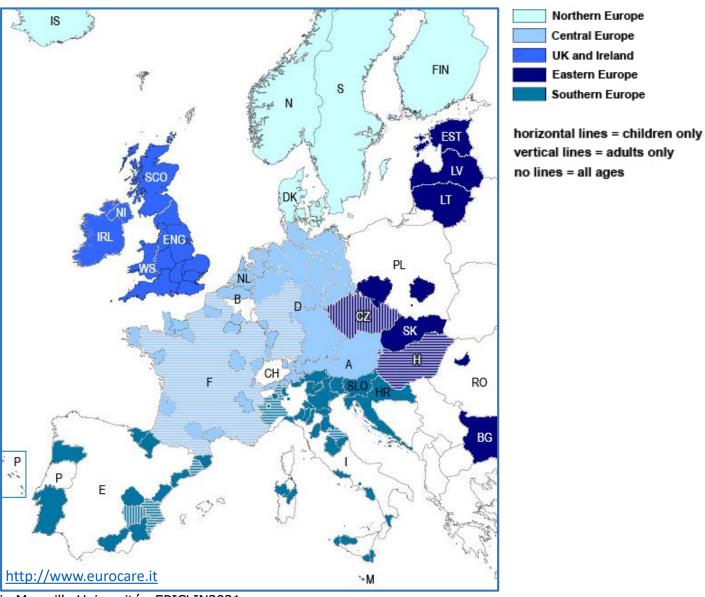
D'après : <u>Accueil - Registre des cancers | Loire-Atlantique et Vendée - Association EPIC-PL</u> (registre-cancers-44-85.fr)

Les Registres de cancers en 2019



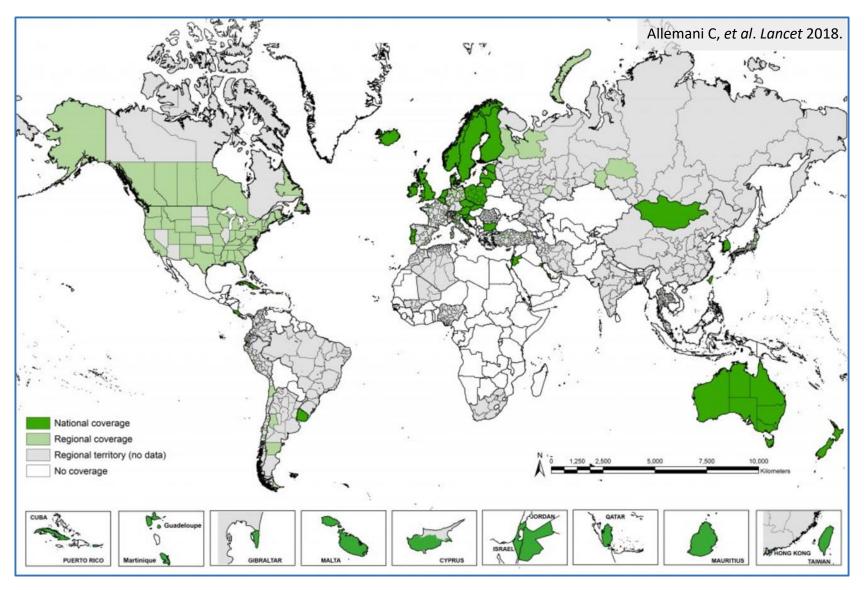


EUROCARE-5: EUROpean CAncer REgistry





CONCORD-3





Données recueillies

- Collectées en routine (la plupart du temps)
 - Date de diagnostic
 - Date de naissance
 - Date de décès (suivi actif)
 - de La cause de décès est souvent inconnue ou peu fiable
 - L'attribution de cette cause peut être subjective, avec peu de possibilités d'être comparable entre régions ou pays
 - Sexe
 - Localisation de la tumeur
 - -TNM: Taille de la tumeur, invasion ganglionnaire, métastase (pas toujours)
- Collectées pour des études spécifiques (études haute résolution)
 - récepteur d'œstrogène, catégorie socio-professionnelle, ...

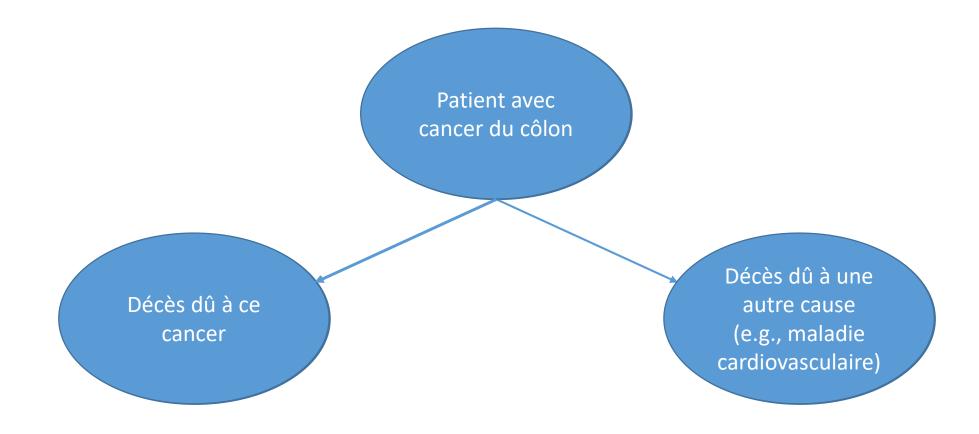


Exemple de données (minimales) disponibles

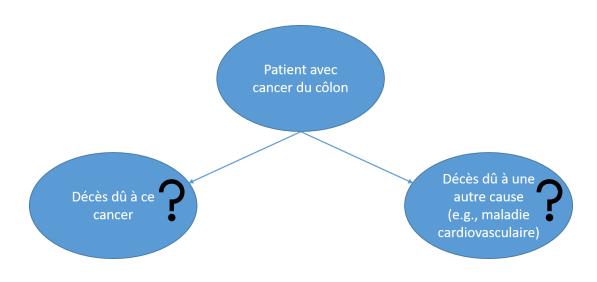
id	Temps	Statut	Age	Sexe	Année diag.
1	1645	0	65	F	2015
2	543	1	76	М	2016
3	2876	0	71	F	2015

- Id: identifiant du patient
- Temps : temps de suivi (ici, en jours)
- Statut: 1 si décédé, 0 sinon
- Age : âge au diagnostic
- Sexe: sexe (ici, F ou M. D'autres codages sont possibles)
- Année diag. : date de diagnostic (ici, année seulement. Précision et codage peuvent différer)

Des risques concurrents

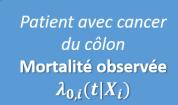


Le cadre de la survie relative : définition



- Cause de décès peu fiable ou inconnue
- Décès dû au cancer étudié ou à une autre cause
- Le cadre de la survier relative est basé sur les risques concurrents mais est appliqué dans des études de population où la cause de décès est inconnue

Le cadre de la survie relative : hypothèse 1



$$\lambda_{0,i}(t|X_i) = \lambda_{E,i}(t|X_i) + \lambda_{P,i}(t|X_{D,i})$$

Décès dû à ce cancer Mortalité en excès $\lambda_{E,i}(t|X_i)$

Décès dû à une autre cause Mortalité « autres causes » $\lambda_{P,i}(t|X_{Di})$

Le cadre de la survie relative : hypothèse 2

- Mortalité attendue dans la population générale
- Obtenue à partir des tables de mortalité
- Tables de mortalité
 appropriées : on fait
 l'hypothèse que ces tables de
 mortalité reflètent la mortalité
 due aux autres causes de
 décès que la maladie étudiée

Décès dû à une autre cause

Mortalité « autres causes »

 $\lambda_{P,i}(t|X_{D,i})$

Les tables de mortalité (1/3)

- Issues des statistiques officielles nationales
- Stratifiées par des variables démographiques
 - -Âge, sexe, année, région, département
 - Ethnie (USA, Nouvelle-Zélande)
 - Indicateur de déprivation (Royaume-Uni)

Les tables de mortalité (2/3)

• Exemple issu du package survival dans R

```
survexp.usr[78:82,,,'2004']
Rate table with dimension(s): age sex race
, , race = white
    sex
         male
                 female
age
  77 0.0001476044 0.0001010906
  78 0.0001631797 0.0001127686
  79 0.0001803468 0.0001257690
  80 0.0001992560 0.0001402259
  81 0.0002200673 0.0001563012
```

```
, , race = black
    sex
            male female
age
  77 0.0001913084 0.0001253706
  78 0.0002061135 0.0001368304
  79 0.0002220203 0.0001493098
  80 0.0002391014 0.0001628950
  81 0.0002574355 0.0001776724
```



Les tables de mortalité (3/3)

- Exemple issu du package survival dans R
- Probabilité de survie de 77 à 78 ans pour un homme blanc ayant 77 ans en 2004 ?

```
dhr <- survexp.usr[78,'male','white','2004']
exp(-dhr*365.25)
0.947515</pre>
```

Concepts : quelle mesure pour répondre à quelle question ?

Quelle est la probabilité de survivre un temps *t* après le diagnostic ?



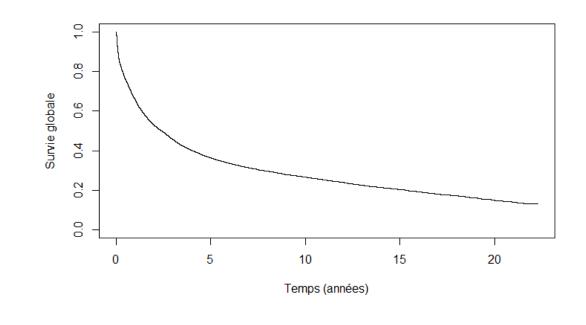
Quelle est la probabilité de survivre un temps *t* après le diagnostic ?

- Survie observée/globale (S_o)
- Notation : *T* v.a. mesurant le délai du diagnostic au décès

•
$$S_{O,i}(t) = P(T_i \ge t)$$

•
$$S_{O,i}(t) = \exp\left(-\Lambda_{O,i}(t)\right)$$

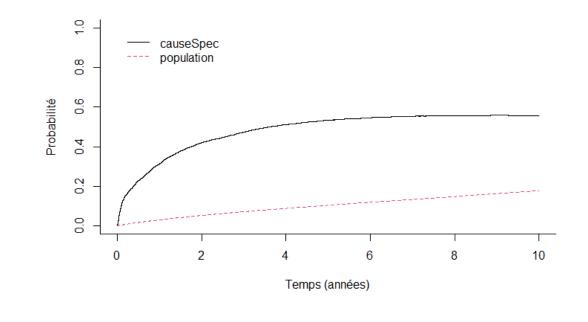
= $\exp\left(-\int_0^t \lambda_{O,i}(u)du\right)$



Quelle est la probabilité de décéder du cancer étudié au t après le diagnostic ?

Quelle est la probabilité de décéder du cancer étudié au *t* après le diagnostic ?

- Fonction d'incidence cumulée (ou probabilité brute)
- $F_K(t) = P(T \le t, cause = K)$
- $\bullet \ 1 S_O(t) = F_K(t) + F_{\overline{K}}(t)$
- $F_K(t) = \int_0^t S_O(u \lambda_E(u)) du$
 - $1 F_K$ n'est pas une proba. de survie $(\lim_{t \to \infty} F_K(t) \neq 0)$
 - F_K dépend de Λ_E et Λ_P



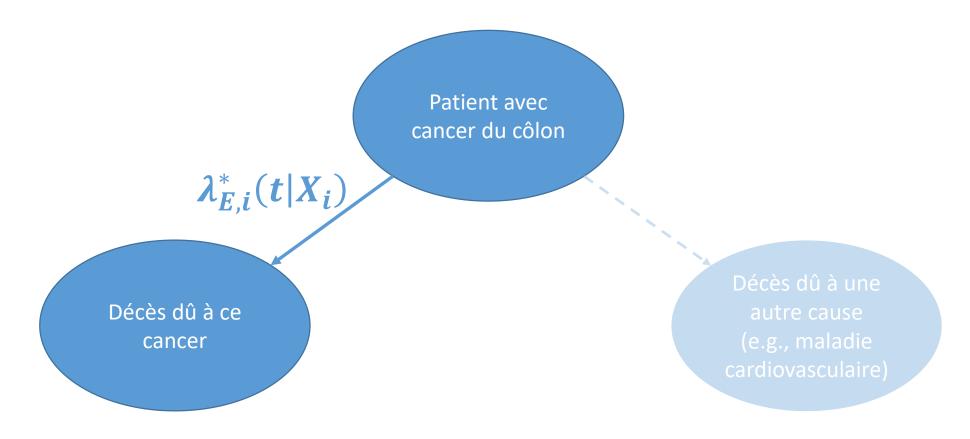


- Survie nette individuelle : $S_{N,i}(t) = \exp\left(-\int_0^t \lambda_{E,i}(u)du\right)$
- Ne dépend que de $\lambda_{E,i}$ (et pas de $\lambda_{P,i}$)

•
$$S_{N,i}(t) = \exp\left(-\int_0^t \left(\lambda_{O,i}(u) - \lambda_{P,i}(u)\right) du\right) = \frac{S_{O,i}(t)}{S_{P,i}(t)}$$

• Survie nette populationnelle (échantillon) : $S_N(t) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \frac{S_{O,i}(t)}{S_{P,i}(t)}$

• Interprétation 1 : la survie nette populationnelle est la *moyenne des* ratios individuels de la survie observée du patient sur la survie issue des tables de mortalité d'un individu avec les mêmes caractéristiques démographiques



• Interprétation 1 : la survie nette populationnelle est la *moyenne des* ratios individuels de la survie du patient sur la survie issue des tables de mortalité d'un individu avec les mêmes caractéristiques démographiques

• Interprétation 2 : la survie nette est la survie que l'on observerait, dans un monde hypothétique, où la seule cause possible de décès serait le cancer étudié

Comment comparer la survie observée des patients à celle d'un groupe sans ce cancer ayant la même structure démographique ?

Comment comparer la survie observée des patients à celle d'un groupe sans ce cancer ayant la même structure démographique ?

- Ratio de survie relative (S_R)
- $S_R(t) = \frac{S_O(t)}{S_P(t)}$ défini au niveau populationnel (échantillon)
- On compare la survie globale à la survie de la population générale pour une population ayant les mêmes caractéristiques démographiques

$$S_R(t) = \frac{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n S_{O,i}(t)}{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n S_{P,i}(t)} \neq \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \frac{S_{O,i}(t)}{S_{P,i}(t)} = S_N(t)$$





Extrait de Perme, Maja Pohar, Jacques Estève, and Bernard Rachet. "Analysing population-based cancer survival—settling the controversies." *BMC cancer* 16.1 (2016): 1-8.

"We mimic real data to create two data sets A and B with same demographic distributions, and assume that

- (i) the cohorts were diagnosed in two different calendar years (1990 and 2000) and thus had a different general population mortality rate λ_{Pi} ;
- (ii) but the true, underlying cancer prognosis did not improve between periods A and B, i.e. the cancer-specific hazards λ_{Ci} are the same. The data sets are large (20000 patients each) to enable clear distinction between the random variation and true differences."

Extrait de Perme, Maja Pohar, Jacques Estève, and Bernard Rachet. "Analysing population-based cancer survival—settling the controversies." *BMC cancer* 16.1 (2016): 1-8.

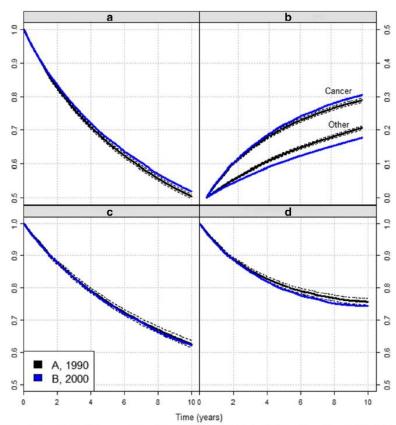


Fig. 2 Comparing two cohorts with the different measures. Colon cancer survival (simulated data): a) Overall survival, b) Crude mortality, c) Net survival, d) Relative survival ratio. Black curves: cohort A, diagnosed 1990; blue curves: cohort B, diagnosed 2000. Dashed lines denote the 95% confidence intervals for cohort A

- Données générées de sorte que
 - $\lambda_{E,1990} = \lambda_{E,2000}$
 - Diminution de la mortalité « autres causes » entre 1990 et 2000

- Interprétation du cadran a ?
- Interprétation du cadran b ?
- Interprétation du cadran d?

Méthodes d'estimation nonparamétriques de la survie nette

Notions de processus

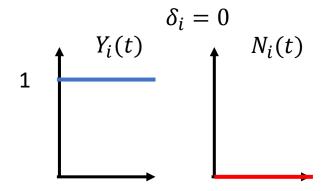
Nombre à risque (« risk set ») :

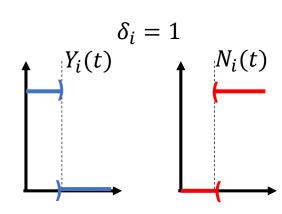
$$Y(t) = \sum_{i=1}^{n} Y_i(t)$$
, où $Y_i(t) = \mathbb{1}(T_i \ge t, C_i \ge t)$

Nombre de décès :

$$N(t) = \sum_{i=1}^{n} N_i(t)$$
, où $N_i(t) = \mathbb{1}(T_i \le t, T_i \le C_i)$

• Indicatrice de décès : $\delta_i = \mathbb{1}(T_i \leq C_i)$







Survie observée

•
$$S_O(t) = P(T > t) = \exp\left(-\int_0^t \lambda_O(u)du\right)$$

• Estimateur de Kaplan-Meier :

$$\widehat{S_O}(t) = \prod_{u \le t} \left(1 - \frac{dN(u)}{Y(u)} \right)$$

• Dans R, package survival

 $survfit(Surv(time, status) \sim 1, data = mydata)$

Estimateur de Nelson-Aalen :

$$\widehat{\Lambda_O}(t) = \int_0^t \frac{dN(u)}{Y(u)}$$



Estimateur Pohar-Perme de la survie nette (1/4)

•
$$S_N(t) = exp\left(-\int_0^t \lambda_E(u)du\right)$$

Analogie avec Nelson-Aalen ?

$$\widehat{\Lambda_E}(t) = \int_0^t \frac{dN_E(u)}{Y(u)}$$

- Problèmes :
 - Calcul de dN_E en l'absence de la cause de décès ?
 - Comment corriger le problème de censure informative ?

Estimateur Pohar-Perme de la survie nette (2/4)

• Estimation de dN_E en l'absence de la cause de décès ?

 Intuitivement, différence entre le nombre de décès observés et le nombre de décès que l'on attendrait due à la mortalité populationnelle

•
$$E(dN_{P,i}(t)|Y_i(t)) = Y_i(t)\lambda_{P,i}(t)dt$$

•
$$d\widehat{N}_E(t) = \sum_{i=1}^n Y_i(t) dN_i(t) - \sum_{i=1}^n Y_i(t) \lambda_{P,i}(t) dt$$

Estimateur Pohar-Perme de la survie nette (3/4)

Comment corriger le problème de censure informative ?

- La mortalité due au cancer étudié et la mortalité « autres causes » partagent l'influence des mêmes variables démographiques (e.g. âge)
- Procédé de pondération IPW (Inverse Probability Weighting) pour corriger ceux qui sortent « prématurément » de l'étude du fait d'un décès « autres causes »

$$-N^w(u) = \sum_{i=1}^n N_i^w$$

$$-Y^{w}(u) = \sum_{i=1}^{n} Y_{i}^{w}$$

-Avec
$$dN_i^w(u) = \frac{dN_i(u)}{S_{P,i}(u)}$$
 et $Y_i^w = \frac{Y_i(u)}{S_{P,i}(u)}$

Estimateur Pohar-Perme de la survie nette (4/4)

 L'estimateur Pohar-Perme est un estimateur consistant de la survie nette

$$\widehat{\Lambda_E}(t) = \int_0^t \frac{dN^w(u)}{Y^w(u)} - \int_0^t \frac{\sum_{i=1}^n Y_i^w(u) \lambda_{P,i}(u) du}{Y^w(u)}$$

• Dans R, package relsurv

```
rs.surv(Surv(time, status)~1, data = mydata,
    ratetable = slopop, method = ''pohar-perme'')
```

Comparaison de courbes de survie globale entre $K \ge 2$ groupes sur [0, T]

- (H_0) : $\forall t \in [0, T]$, $\Lambda_1(t) = \Lambda_2(t) = ... = \Lambda_K(t)$
- Distribution asymptotique sous (H_0) : $\chi^2(K-1)$
- Test stratifié en cas d'hétérogénéité

• Dans R, package survival

```
survdiff(Surv(time, status)~X1, data = mydata)
# si besoin d'un test stratifié sur sur une variable X2
survdiff(Surv(time, status)~X1 + strata(X2), data = mydata)
```

Comparaison de courbes de survie nette entre $K \ge 2$ groupes sur [0, T]

- (H_0) : $\forall t \in [0, T]$, $\Lambda_{E1}(t) = \Lambda_{E2}(t) = ... = \Lambda_{EK}(t)$
- Distribution asymptotique sous (H_0) : $\chi^2(K-1)$
- Test stratifié en cas d'hétérogénéité
- Dans R, package relsurv

Application : jeu de données colrec

Exemple adapté à partir de Perme, Maja Pohar, and Klemen Pavlic. "Nonparametric relative survival analysis with the R package relsurv." *Journal of Statistical Software* 87.1 (2018): 1-27.



Jeu de données (1/3)

```
# Chargement du package utilisé
library (relsurv)
 Données colrec incluses dans le package relsurv
str(colrec)
'data.frame': 5971 obs. of 7 variables:
  sex : int 1 2 1 2 2 1
  age : num 23004
                    12082 24277 29256 30416
  diag: 'date' num 12656 13388 12711 13971 12997
  time: num 16 504 22 3998 9 ...
  stat : int 0 0 0
  stage: Factor w/ 4 levels "1", "2", "3", "99": 1 3 3
 $ site: Factor w/ 2 levels "colon", "rectum": 2 2 1
  1 1 2 2 2 2 ...
```



Jeu de données (2/3)

```
colrec[1:3, ]
 sex age diag time stat stage site
   1 23004 12656 16 0
                             1 rectum
 2 12082 13388 504 0
                             3 rectum
   1 24277 12711 22 0
3
                             3 colon
as.Date(colrec[1,"diag"]) # pour retrouver la date de
diagnostic
"1994-08-26"
```

Jeu de données (3/3)

```
mydata <- colrec
# pour enlever les patients avec date de diag au 29/02
mydata$diag2 <- as.Date(mydata$diag)</pre>
id <- which (format (mydata$diag2, '%m') == "02" &
             format (mydata$diaq2, '%d') == "29")
mydata <- mydata[-id, ]</pre>
# pour enlever les patients pour lesquels le stade est
manquant
mydata <- mydata[mydata$stage != 99, ]</pre>
dim (mydata)
[1] 5575
```



Avant de commencer : utilisation de la table de mortalité dans relsury

 Utilisation de la table de mortalité slovène slopop (incluse dans le package relsury)

• Examiner cette table (str, head, ...)

• Que fait l'option rmap dans rs.surv (?rs.surv)

The slopop: a ratetable object

```
head(slopop[,c("1998", "1999", "2000"),])
Rate table with dimension(s): age year sex
, , sex = male
   year
                                      2000
            1998
                        1999
age
  0 1.702793e-05 1.394407e-05 1.664226e-05
  1 1.396694e-06 2.054209e-06 8.762741e-07
  2 1.122777e-06 8.488862e-07 0.000000e+00
  3 8.214987e-07 0.000000e+00 2.738055e-07
  4 1.615848e-06 1.095386e-06 0.000000e+00
  5 5.202539e-07 2.738055e-07 2.738055e-07
```

```
, , sex = female
   vear
                         1999
                                       2000
age
            1998
  0 1.111108e-05 1.179843e-05 1.229343e-05
  1 1.807623e-06 3.011876e-07 3.011876e-07
  2 8.762741e-07 3.011876e-07 6.024083e-07
  3 2.738055e-07 6.024083e-07 3.011876e-07
  4 0.000000e+00 2.738055e-07 0.000000e+00
  5 5.750232e-07 2.738055e-07 1.698036e-06
```



The ratetable format and the rmap option

• 3 dimensions dans slopop: age, sex et year

rmap: an optional list to be used if the variables are not organized and named in the same way as in the ratetable object. See details below.

Details

NOTE: The follow-up time must be specified in days. The ratetable being used may have different variable names and formats than the user's data set, this is dealt with by the rmap argument. For example, if age is in years in the data set but in days in the ratetable object, age=age*365.241 should be used. The calendar year can be in any date format (date, Date and POSIXt are allowed), the date formats in the ratetable and in the data may differ.

Créer une variable groupe selon que l'âge soit inférieur à 70 ans (ou supérieur)

```
2 groupes de patients suivant l'âge
d1 <- subset (mydata, mydata$age < 70 * 365.241)
d1$qp <- 1
d2 < - subset (mydata, mydata$site >= 70 * 365.241)
d2$qp <- 2
mydata <- rbind(d1, d2)</pre>
```

Censure administrative à 5 ans

```
ind <- which(mydata$time > 365.241 * 5)
mydata$time[ind] <- 365.241 * 5
mydata$stat[ind] <- 0</pre>
```

Est-il raisonnable d'estimer la survie nette à 5 ans ?

Etude de la décroissance dans le temps de la taille de l'échantillon due à la mortalité populationnelle (?nessie)

```
breaks <-c(0, seq(from = 45, to = 90, by = 5), Inf)
mydata$agegr <- cut(mydata$age / 365.241, breaks)</pre>
nessie (Surv (time, stat) ~ gp + agegr,
    data = mydata[mydata$age / 365.241 > 50,],
    ratetable = slopop,
    times = seq(0, 5, 1),
    rmap = list(age = age, sex = sex, year = diag))
```

Etude de la décroissance dans le temps de la taille de l'échantillon due à la mortalité populationnelle (?nessie)

	0	1	2	3	4	5	c.exp.surv
gp=1,agegr(50,55]	383	380.0	376.9	373.6	370.2	366.5	28.0
gp=1,agegr(55,60]	576	569.3	562.2	554.7	546.9	538.8	23.5
gp=1,agegr(60,65]	848	831.9	815.2	798.1	780.3	761.9	18.8
gp=1,agegr(65,70]	1026	997.2	967.2	936.2	904.2	871.5	14.8
gp=2,agegr(70,75]	955	915.5	875.0	833.5	791.2	747.9	11.3
gp=2,agegr(75,80]	672	630.3	588.2	545.6	502.5	459.0	8.3
gp=2,agegr(80,85]	411	366.8	324.5	284.1	245.6	209.8	6.0
gp=2,agegr(85,90]	198	165.4	136.1	110.2	87.7	68.9	4.2
gp=2,agegr(90,Inf]	33	24.9	18.4	13.3	9.3	6.3	2.9



Sélection des patients de moins de 80 ans

```
mydata <- mydata[mydata$age <= 80 * 365.241, ]</pre>
summary (mydata[c(4,6,7,10)])
     time
                     site
              stage
                                        agegr
Min.: 1 1:781 colon:2912 (65,70]:1026
1st Qu.: 281 2 :2953 rectum:2021
                                    (70,75]: 955
Median :1112 3 :1199
                                     (60,651:848)
Mean :1053
            99: 0
                                     (75,801:672)
3rd Qu.:1826
                                     (55,601:576)
Max. :1826
                                     (50,551:383)
                                     (Other): 473
```

1/ Survie globale à 5 ans ? 2/ Probas. brutes de décéder à 5 ans (Ket \overline{K}) 3/ Lien ?

```
so fit <- survfit(Surv(time, stat)~gp, data = mydata)
crudep fit <- cmp.rel( Surv(time, stat) ~ gp,</pre>
                 data = mydata, ratetable = slopop,
                 rmap = list(age = age, sex = sex, year = diag))
crd.K <- summary(crudep fit, times=5, scale = 365.241)$est[c(1,3)]</pre>
crd.other <- summary(crudep fit, times=5)$est[c(2,4)]</pre>
(total <- crd.K + crd.other)</pre>
[1] 0.5498830 0.6871543
1-summary(so fit, times=3652.41)$surv
   0.5498830 0.6871543
```



Survie nette à 1, 2 et 5 ans ?

```
sn fit <- rs.surv(Surv(time, stat) ~ gp,</pre>
                      data = mydata,
                      ratetable = slopop,
                     method = "pohar-perme",
                      add.times = c(1, 2, 5) * 365.241,
                      rmap = list(age = age, sex = sex, year = diag))
summary(sn fit, times = c(1, 2, 5) * 365.241)
```

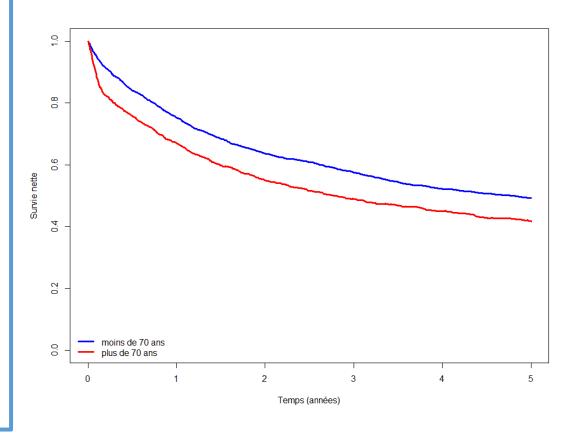
Survie nette à 1, 2 et 5 ans ?

```
summary(sn fit, times = c(1, 2, 5) * 365.241)
            qp=1
time n.risk n.event survival std.err lower 95% CI upper 95% CI
                  0.753 0.00776
      2445 858
 365
                              0.738
                                          0.768
 730 2029 415 (0.636)0.00877 0.619 0.653
1826 1486 543
                  0.493/0.00954 0.475 0.512
            gp=2
time n.risk n.event survival std.err lower 95% CI upper 95% CI
            589
                   0.671
                        0.0125
                                   0.647
                                          0.696
 365
      1038
 730 806 232
                  0.549
                        0.0138 0.523 0.577
1826 509 297
                   0.417
                        0.0155 0.387
                                             0.448
```



Survie nette : évolution

```
plot(sn fit,
col=c("blue", "red"),
1wd=3
xscale = 365.241,
xlab = "Temps
(années)",
ylab = "Survie nette")
```





Comparaison des distributions de survie nette : le test de type log-rank

```
lrn <- rs.diff(Surv(time, stat) ~ qp,</pre>
          data = mydata, ratetable = slopop,
          rmap = list(age = age, sex = sex, year = diag))
1 rn
Value of test statistic: 26.66999
Degrees of freedom: 1
P value: 2.413411e-07
```

Comparaison des distributions de survie nette : le test de type log-rank stratifié sur le stade

```
lrn.strt <- rs.diff(Surv(time, stat) ~ gp + strata(stage),</pre>
               data = mydata, ratetable = slopop,
               rmap = list(age = age, sex = sex, year = diag))
lrn.strt
Value of test statistic: 51.58615
Degrees of freedom: 1
P value: 6.852297e-13
```

Partie II

Méthodes d'estimation paramétrique de la mortalité en excès

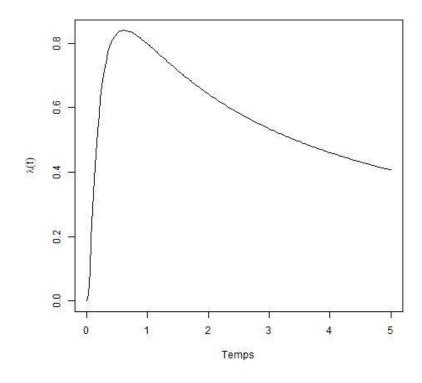
Des Méthodes Non-Paramétriques aux Modèles Paramétriques

- Intérêt pour estimer l'effet de covariables sur la mortalité en excès
 - Démographiques, cliniques,...
- Intérêt (plus tardivement) pour estimer la dynamique de la mortalité en excès
- Modèles de régression de « type » modèle de Cox (survie globale)

 Repose sur la modélisation du taux auquel les individus présentent l'événement d'intérêt

$$\lambda(t) = \lim_{h \to 0} \frac{P(t \le T < t + h | T \ge t)}{h}$$

Taux instantané



Modèle de Régression de Cox

(2)

- Repose sur la modélisation du taux auquel les individus présentent l'événement d'intérêt
- Conditionnellement à leurs covariables z_i , $\lambda(t|z_i)$
- Modèle semi-paramétrique
 - Effet multiplicatif de covariables (exponentiel) sur un taux de mortalité de base

$$\lambda(t|z_i) = \lambda_0(t) exp(\beta z_i)$$

- $-\beta$ vecteur des paramètres associés au vecteur de covariables z
- $-\lambda_0(t)$ taux de mortalité de base

Modèle de Régression de Mortalité en Excès

Repose sur la décomposition du taux de mortalité observé

$$\lambda_O(t|z_i) = \lambda_E(t|z_i) + \lambda_P(t|z_{D_i})$$

- Patient i ayant un vecteur de covariables z_i
- $-\lambda_E$: mortalité en excès
- $-\lambda_P$: pour un patient i diagnostiqué à l'âge a_i en l'année y_i , $\lambda_P(t|z_{D_i})$ est obtenu en prenant dans la table de mortalité du même pays (ou à un niveau géographique plus fin, si disponible) le taux pour un individu d'âge a_i+t et à l'année y_i+t

Vraisemblance

(1)

- Contribution d'un patient qui décède en t_i ($\delta_i = 1$)
 - $-L_i(\beta|t_i,\delta_i) = \lambda_O(t_i)S_O(t_i)$
 - $-\log L_i(\beta|t_i,\delta_i) = \log(\lambda_O(t_i)) \Lambda_O(t_i)$
- Contribution d'un patient censuré en t_i ($\delta_i = 0$)
 - $-L_i(\beta|t_i,\delta_i) = S_O(t_i)$
 - $-\log L_i(\beta|t_i,\delta_i) = -\Lambda_O(t_i)$
- Contribution d'un patient qui décède selon δ_i
 - $-L_i(\beta|t_i,\delta_i) = \lambda_O(t_i)^{\delta_i} S_O(t_i)$
 - $-\log L_i(\beta|t_i,\delta_i) = \delta_i \log(\lambda_O(t_i)) \Lambda_O(t_i)$



Vraisemblance

(2)

Vraisemblance : produit des vraisemblances individuelles

$$-L(\beta|\mathbf{z}) = \prod_{i} L_{i}(\beta|t_{i}, \delta_{i}) = \prod_{i} \lambda_{O}(t_{i})^{\delta_{i}} S_{O}(t_{i})$$

$$-\log L(\beta|\mathbf{z}) = \sum_{i} \delta_{i} \log(\lambda_{O}(t_{i})) - \Lambda_{O}(t_{i})$$

• Puisque $\lambda_O(t_i|z_i) = \lambda_E(t_i|z_i) + \lambda_P(t_i|z_{D_i})$

$$-\log L(\beta|\mathbf{z}) = \sum_{i} \left(\delta_{i} \log \left[\lambda_{E}(t_{i}|z_{i}) + \lambda_{P}(t_{i}|z_{D_{i}}) \right] - \Lambda_{E}(t_{i}|z_{i}) + \Lambda_{P}(t_{i}|z_{D_{i}}) \right)$$

• Puisque $\Lambda_P(t_i|z_{D_i})\perp \beta$, on maximise

$$-\sum_{i} \left(\delta_{i} log \left[\lambda_{E}(t_{i}|z_{i}) + \lambda_{P}(t_{i}|z_{D_{i}}) \right] - \Lambda_{E}(t_{i}|z_{i}) \right)$$

Modèle de Mortalité en Excès d'Estève et coll.

(1)

$$\lambda_E(t|z_i) = \lambda_{E,0}(t) exp(\beta z_i)$$

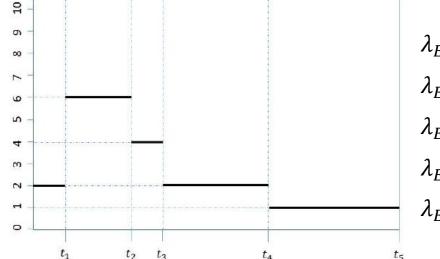
• Avec $\lambda_{E,0}(t)=\sum_{j=1}^J \tau_j I_j(t)$: taux de base en excès où $I_j(t)=1$ si $\tau_{j-1}< t<\tau_j$ (z=0)

Modèle de Mortalité en Excès d'Estève et coll.

$$\lambda_E(t|z_i) = \lambda_{E,0}(t) exp(\beta z_i)$$

• Avec $\lambda_{E,0}(t) = \sum_{j=1}^J \tau_j I_j(t)$: taux de base en excès

où
$$I_j(t) = 1$$
 si $\tau_{j-1} < t < \tau_j$ ($z = 0$)



$$\lambda_{E,0}(t) = 2 \ (\forall t \text{ entre } 0 \text{ et } t_1)$$

$$\lambda_{E,0}(t) = 6 \ (\forall t \text{ entre } t_1 \text{ et } t_2)$$

$$\lambda_{E,0}(t) = 4 \ (\forall t \text{ entre } t_2 \text{ et } t_3)$$

$$\lambda_{E,0}(t) = 2 \ (\forall t \text{ entre } t_3 \text{ et } t_4)$$

$$\lambda_{E,0}(t) = 1 \ (\forall t \text{ entre } t_4 \text{ et } t_5)$$

Fonction constante par morceaux (exemple fictif)



Modèle de Mortalité en Excès d'Estève et coll.

(3)

$$\lambda_E(t|z_i) = \lambda_{E,0}(t) exp(\beta z_i)$$

- Avec $\lambda_{E,0}(t) = \sum_{j=1}^J \tau_j I_j(t)$: taux de base en excès où $I_j(t)=1$ si $\tau_{j-1} < t < \tau_j$ ($\mathbf{z}=0$)
- Et $exp(\beta z_i)$: taux relatif de mortalité en excès
- Estimation des β et des τ ($\lambda_{E,0}$) par maximisation de la vraisemblance totale

Interprétation des Paramètres β

• Pour 2 individus i, j ayant pour covariables z_i et z_j

$$\frac{\lambda_E(t|z_i)}{\lambda_E(t|z_j)} = \frac{\lambda_{E,0}(t)exp(\beta z_i)}{\lambda_{E,0}(t)exp(\beta z_j)} = exp\left(\beta \left(z_i - z_j\right)\right) = TRME(t) = TRME$$
TRME: Taux Relatif de Mortalité en Excès

Interprétation des Paramètres β

• Pour 2 individus i, j ayant pour covariables z_i et z_j

$$\frac{\lambda_E(t|z_i)}{\lambda_E(t|z_j)} = \frac{\lambda_{E,0}(t)exp(\beta z_i)}{\lambda_{E,0}(t)exp(\beta z_j)} = exp\left(\beta \left(z_i - z_j\right)\right) = TRME(t) = TRME$$
TRME : Taux Relatif de Mortalité en Excès

- -z binaire (sexe, codé en 0 si féminin et 1 si masculin)
 - $TRME = exp(\beta(z = 1 z = 0)) = exp(\beta)$
 - Hypothèse des risques proportionnels

Interprétation des Paramètres β

• Pour 2 individus i, j ayant pour covariables z_i et z_j

$$\frac{\lambda_E(t|z_i)}{\lambda_E(t|z_j)} = \frac{\lambda_{E,0}(t)exp(\beta z_i)}{\lambda_{E,0}(t)exp(\beta z_j)} = exp\left(\beta \big(z_i - z_j\big)\right) = TRME(t) = TRME$$
TRME : Taux Relatif de Mortalité en Excès

- -z binaire (sexe, codé en 0 si féminin et 1 si masculin)
 - $TRME = exp(\beta(z = 1 z = 0)) = exp(\beta)$
 - Hypothèse des risques proportionnels
- -z continu (âge, en années en prenant par exemple ces 2 valeurs)
 - $TRME = exp(\beta(z = 25 z = 24)) = exp(\beta)$
 - Hypothèse de log-linéarité
- Interprétation comme n'importe quel « RR » par rapport à 1

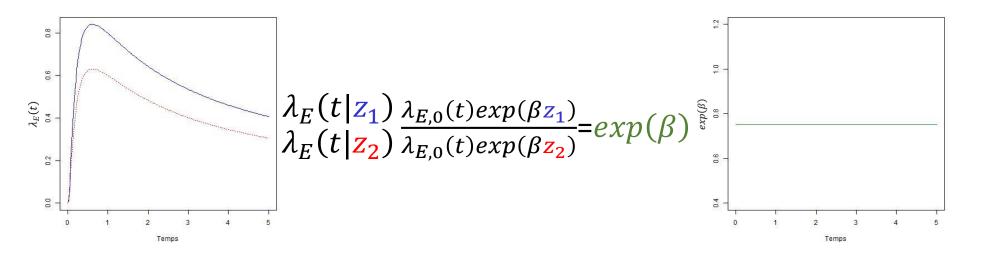
Modèle de Mortalité en Excès d'Estève *et coll. Modèle à Taux de Mortalité en Excès Proportionnels*

• Pour 2 individus i, j ayant pour covariables z_i et z_j

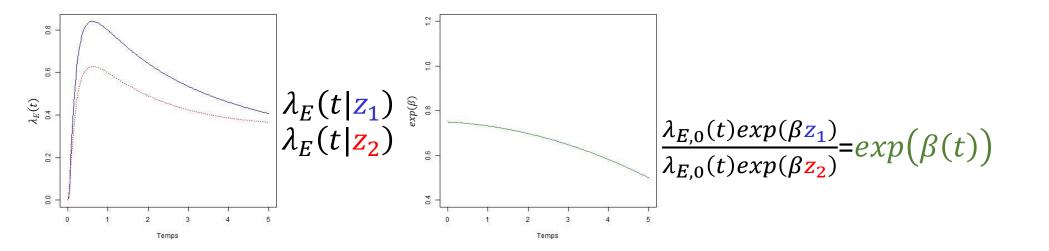
$$\frac{\lambda_E(t|z_i)}{\lambda_E(t|z_j)} = \frac{\lambda_{E,0}(t)exp(\beta z_i)}{\lambda_{E,0}(t)exp(\beta z_j)} = exp\left(\beta \big(z_i - z_j\big)\right) = TRME(t) = TRME$$
TRME : Taux Relatif de Mortalité en Excès

- Par conséquence, les fonctions du taux de mortalité en excès sont proportionnelles, leur rapport est constant et ne dépend pas de t
 - Hypothèse à vérifier au vue des données
- Rapport des fonctions du taux de mortalité en excès est un « risque relatif » en excès à l'instant t des sujets de caractéristique z_i par rapport à ceux de caractéristique z_i

Modèle à Taux de Mortalité en Excès Proportionnels



Modèle à Taux de Mortalité en Excès non Proportionnels



Modèle de Mortalité en Excès d'Estève *et coll.* Modèle log-linéaire sur l'effet des covariables

• Pour 2 individus i, j ayant pour covariables z_i et z_j

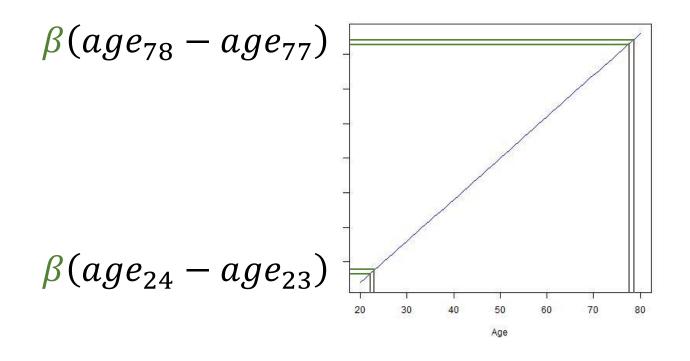
$$\frac{\lambda_E(t|z_i)}{\lambda_E(t|z_j)} = \frac{\lambda_{E,0}(t)exp(\beta z_i)}{\lambda_{E,0}(t)exp(\beta z_j)} = exp\left(\beta \big(z_i - z_j\big)\right) = TRME(t) = TRME$$
TREM : Taux Relatif de Mortalité en Excès

$$\ln\left(\frac{\lambda_{E,0}(t)exp(\beta^t z_i)}{\lambda_{E,0}(t)exp(\beta^t z_i)}\right) = \beta(z_i - z_j)$$

- Par conséquence, le logarithme du rapport des taux de mortalité en excès est une fonction linéaire des covariables
 - Hypothèse à vérifier au vue des données

Effet Log-Linéaire sur une Covariable

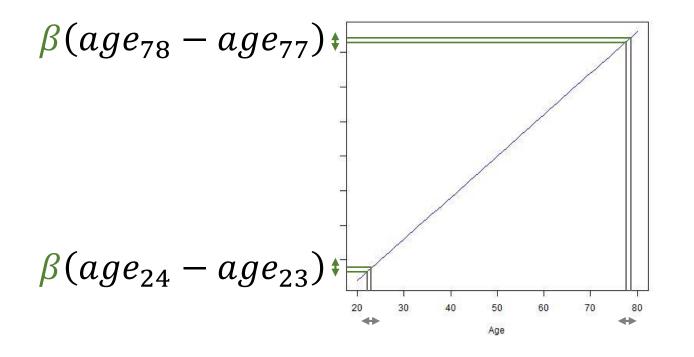
(1)





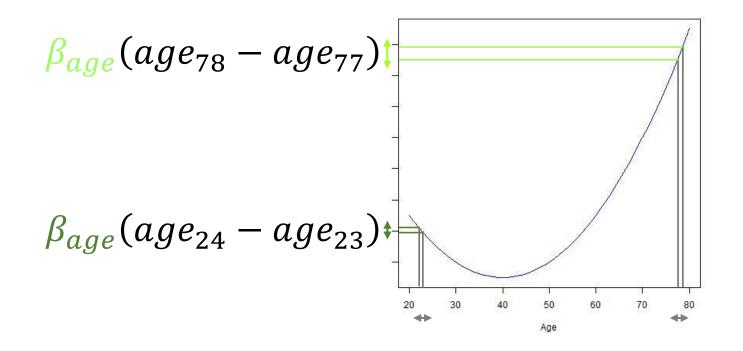
Effet Log-Linéaire sur une Covariable

(2)





Effet Non Log-Linéaire sur une Covariable





Tests des Paramètres β Une seule (nominale), plusieurs variables

- Hypothèse nulle $H_0: \beta = \beta^{(0)}$ (dimension de $\beta = p$)
- Test
 - Rapport de vraisemblance

•
$$2[L(\hat{\beta}) - L(\beta^{(0)})]$$

- Wald

•
$$(\widehat{\beta} - \beta^{(0)})^t I(\widehat{\beta})^{-1} (\widehat{\beta} - \beta^{(0)})$$

Score

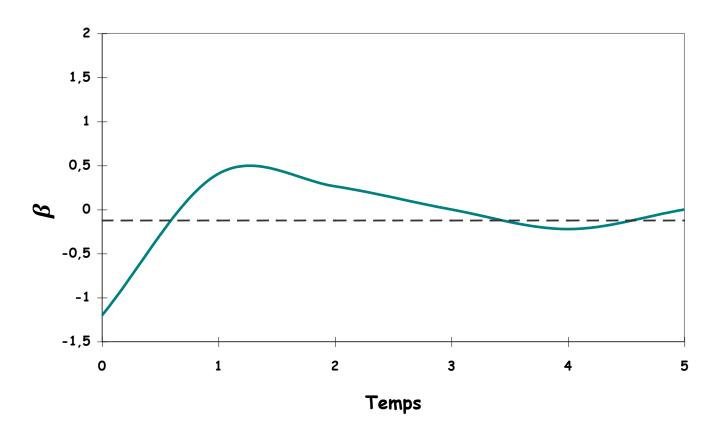
•
$$U^{t}(\beta^{(0)})I(\beta^{(0)})^{-1}U(\beta^{(0)})$$

où I est la matrice d'information de Fisher

$$\stackrel{H_0}{\rightarrow} \chi^2$$
 à *p* degrés de liberté

Estimation avec Hypothèse TME Proportionnels vs non Proportionnels

(1)

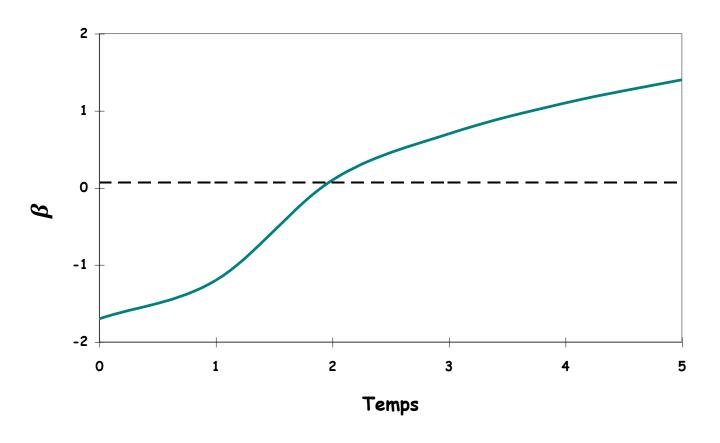


▶ Estimation d'un effet moyen ◀



Estimation avec Hypothèse TME Proportionnels vs non Proportionnels

(2)



▶ Conclusion à tort à l'absence d'effet ◀



Modèle de Mortalité en Excès de Giorgi et coll.

(1)

$$\lambda_E(t|z_i) = \lambda_{E,0}(t) exp(\beta(t)z_i)$$

$$\lambda_E(t|z_i) = \sum_{j=1}^J \tau_j I_j(t) \exp(\beta z_i)$$
Estève et coll.

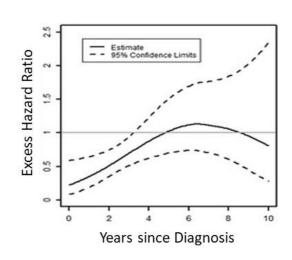
• Avec $\lambda_{E,0}(t)$ et $\beta(t)$ modélisés par des fonction B-Splines

(1)

- Fonctions polynomiales par morceaux d'ordre q (polynôme de degré q-1)
 - Flexibilité augmente avec l'ordre
- Point de jonction de deux polynômes contiguës au niveau de points appelés nœuds
 - Nombre de nœuds contrôle la flexibilité
- Chaque morceau (polynôme) relie le morceau suivant de manière lisse et homogène

(1)

- Fonctions polynomiales par morceaux d'ordre q (polynôme de degré q-1)
 - Flexibilité augmente avec l'ordre
- Point de jonction de deux polynômes contiguës au niveau de points appelés nœuds
 - Nombre de nœuds contrôle la flexibilité
- Chaque morceau (polynôme) relie le morceau suivant de manière lisse et homogène

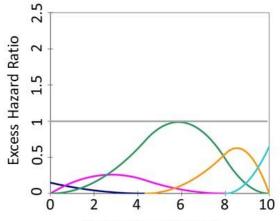




(1)

- Fonctions polynomiales par morceaux d'ordre q (polynôme de degré q-1)
 - Flexibilité augmente avec l'ordre
- Point de jonction de deux polynômes contiguës au niveau de points appelés nœuds
 - Nombre de nœuds contrôle la flexibilité
- Chaque morceau (polynôme) relie le morceau suivant de manière lisse et homogène

B-Splines quadratique, 2 nœuds intérieurs

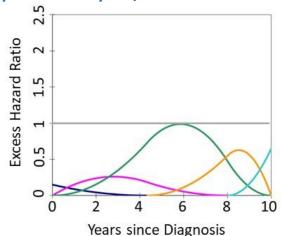


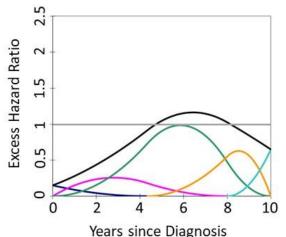


(1)

- Fonctions polynomiales par morceaux d'ordre q (polynôme de degré q-1)
 - Flexibilité augmente avec l'ordre
- Point de jonction de deux polynômes contiguës au niveau de points appelés nœuds
 - Nombre de nœuds contrôle la flexibilité
- Chaque morceau (polynôme) relie le morceau suivant de manière lisse et homogène

B-Splines quadratique, 2 nœuds intérieurs





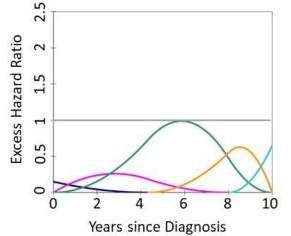


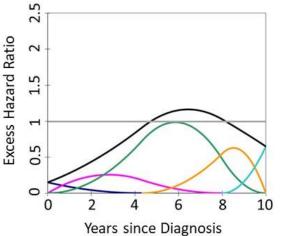
Roch Giorgi, Nathalie Grafféo, Aix-Marseille Université - EPICLIN2021

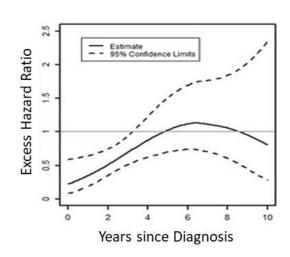
(1)

- Fonctions polynomiales par morceaux d'ordre q (polynôme de degré q-1)
 - Flexibilité augmente avec l'ordre
- Point de jonction de deux polynômes contiguës au niveau de points appelés nœuds
 - Nombre de nœuds contrôle la flexibilité
- Chaque morceau (polynôme) relie le morceau suivant de manière lisse et homogène

B-Splines quadratique, 2 nœuds intérieurs









Roch Giorgi, Nathalie Grafféo, Aix-Marseille Université - EPICLIN2021

(2)

- Modélisation souple et flexible des variations de l'effet au cours du temps
- Estimation non plus basée sur des a priori mais sur la modélisation des données observées
- Avantage
 - Estimation « fine », non biaisée
 - Rend bien compte de l'effet tel qu'il est estimé
- Inconvénient Difficulté relative
 - Interprétation non résumée à l'interprétation d'un seul paramètre



Fonctions B-Splines Quadratique, 2 nœuds intérieurs

$$\beta_i(t) = \sum_{j=-(q-1)}^m \alpha_{i,j} B_{j,q}(t)$$
 $i = 1, ..., P$

- Fonctions B-Splines quadratiques (ordre q=3)
- Deux nœuds intérieurs (m = 2)
 - Localisation basée sur les quantiles de la distribution des temps de décès observés, connaissances épidémiologiques/clinique,...
- 5 fonctions de bases pour l'espace de régression des splines
 - 5P paramètres à estimer par coefficients associés aux covariables

Modèle de Mortalité en Excès de Giorgi et coll.

(2)

$$\lambda_E(t|z_i) = \lambda_{E,0}(t) exp(\beta(t)z_i) \qquad \lambda_E(t|z_i) = \sum_{j=1}^J \tau_j I_j(t) exp(\beta z_i)$$
Estève et coll.

• Avec $\lambda_{E,0,i}(t)$ et $\beta(t)$ modélisés par des fonction B-Splines

$$\lambda_E(t|z_i) = \sum_{j=-2}^2 \nu_j B_{j,3}(t) \exp\left(\sum_{p=1}^P \sum_{j=-2}^2 \alpha_{p,j} B_{j,3}(t) z_i\right)$$

• Estimation des paramètres ν et α par maximisation de la vraisemblance totale

Tests des Paramètres α

- Tests du rapport de vraisemblance (TRV)
 - Pas d'association
 - $\beta_p(t) = 0$: TRV avec (q + m)P degrés de liberté
 - Proportionnalité des taux
 - $\beta_p(t) = C$: TRV avec ((q+m)-1)P degrés de liberté

Modèle de Mortalité en Excès de Giorgi et coll.

(3)

$$\lambda_E(t|z_i) = \lambda_{E,0}(t) exp(\beta(t)z_i)$$

$$\lambda_E(t|z_i) = \sum_{j=1}^J \tau_j I_j(t) \exp(\beta z_i)$$

Estève et coll.

$$\lambda_E(t|z_i) = \sum_{j=-2}^2 \nu_j B_{j,3}(t) \exp\left(\sum_{p=1}^P \sum_{j=-2}^2 \alpha_{p,j} B_{j,3}(t) z_i\right)$$

$$\lambda_{E}(t|z_{i}) = \sum_{j=-2}^{2} \nu_{j} B_{j,3}(t) \exp\left[\left(\sum_{p=1}^{P-l} \sum_{j=-2}^{2} \alpha_{p,j} B_{j,3}(t) z_{i}\right) + \left(\sum_{h=P-l+1}^{P} \beta z_{i}\right)\right]$$

Taux de base en excès :

modélisation souple et flexible de ces variations au cours du temps

Taux relatif de mortalité en excès :

modélisation souple et flexible d'effets au cours du temps

modélisation constante d'effets au cours du temps



Application : jeu de données colrec

Exemples adaptés de ceux donnés dans le package xhaz :

Juste Goungounga, Nathalie Graffeo, Roch Giorgi.

Excess hazard modelling taking into account inappropriate expected mortality rates.



Références

- Cox DR. Regression models and life tables. JRSS B 1972; 34: 187-220.
- Esteve J, Benhamou E, Croasdale M, Raymond L. Relative survival and the estimation of net survival: elements for further discussion. *Stat Med* 1990; 9: 529-538.
- Giorgi R, Abrahamowicz M, Quantin C, Bolard P, Esteve J, Gouvernet J, Faivre J. A relative survival regression model using B-splines functions. Stat Med 2003; 22:2767-84.
- Grafféo N, Castell F, Belot A, Giorgi R. A log-rank-type test to compare net survival distributions.
 Biometrics 2016; 72(3):760-769.
- Perme MP, Stare J, Estève J. On estimation in relative survival. Biometrics 2012; 68(1):113-120.
- Perme MP, Estève J, Rachet B. Analysing population-based cancer survival settling the controversies. *BMC Cancer* 2016; 16(1):1-8.
- Perme MP, Pavlic K. Nonparametric relative survival analysis with the R package relsurv. Journal of Statistical Software 2018; 87(1):1-27.

Pour aller plus loin?

- Modèles paramétriques flexibles
 - Méthodes non pénalisées, pénalisées
- Outils diagnostic
 - Ecart à la proportionnalité, à la log-linéarité
- Gestion des données manquantes
- Gestion des événements multiples
 - Événements répétés, risques semi-compétitifs, modèles multi-états
- Modélisation en présence de tables de mortalité insuffisamment stratifiée
- Extensions des modèles de mortalité en excès en situation non-populationnelle
 - Recherche clinique, santé au travail



En cours de rédaction

15ème Conférence Francophone d'EPIdémiologie CLINique

EPICLIN2021 / JSCLCC28

28èmes Journées des Statisticiens des Centres de Lutte Contre le Cancer















Annexe 1 Ratio de Survie Relative



(1)

•
$$S_R(t) = \frac{S_O(t)}{S_P(t)}$$

Ederer I

$$\int_0^t \frac{dN(u)}{Y(u)} - \int_0^t \frac{\sum_{i=1}^n S_{P,i}(u) \lambda_{P,i}(u)}{\sum_{i=1}^n S_{P,i}(u)} du$$

On peut montrer que

$$\lambda_P(u) = \frac{E(S_{P,1}(u)\lambda_{P,1}(u))}{E(S_{P,1}(u))}$$

• D'où Ederer I estimateur consistant de $\Lambda_0(t) - \Lambda_P(t)$ ($\neq \Lambda_E(t)$)

•
$$S_R(t) = \frac{S_O(t)}{S_P(t)} = \frac{\exp(-\Lambda_O(t))}{\exp(-\Lambda_P(t))} = \exp(\Lambda_P(t) - \Lambda_O(t))$$

- Or Ederer I estimateur consistant de $\Lambda_O(t) \Lambda_P(t)$
- ⇒ Ederer I estimateur consistant du ratio de survie relative

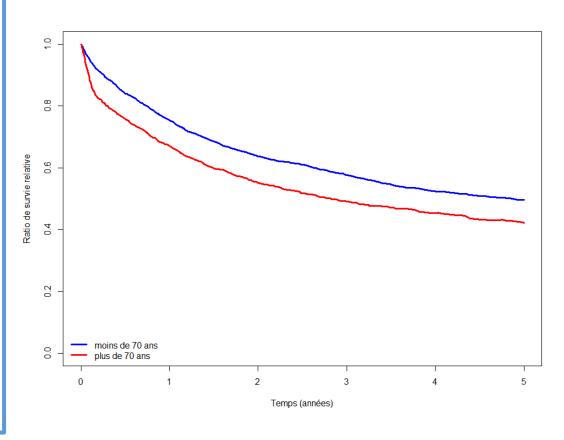
• Dans R, package relsurv

(4)

```
summary(rsr fit, times = c(1, 5, 10) * 365.241)
            qp=1
time n.risk n.event survival std.err lower 95% CI upper 95% CI
     2445 858 0.753 0.00776
                            0.738
                                      0.768
 365
 730 2029 415 0.637 0.00877 0.620 0.654
1826 1486 543 0.496 0.00953 0.477 0.515
            qp=2
time n.risk n.event survival std.err lower 95% CI upper 95% CI
     1038 589 0.671 0.0125 0.647 0.696
 365
 730 806 232 0.551 0.0138 0.524 0.578
1826 509 297 0.422 0.0155 0.392 0.453
```



```
plot(rsr fit,
col=c("blue", "red"),
1wd=3
xscale = 365.241,
xlab = "Temps
(années)",
ylab = "Ratio de
survie relative")
```





Annexe 2 Fonctions B-Splines

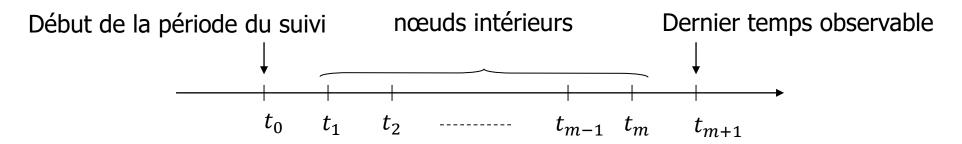


(1)



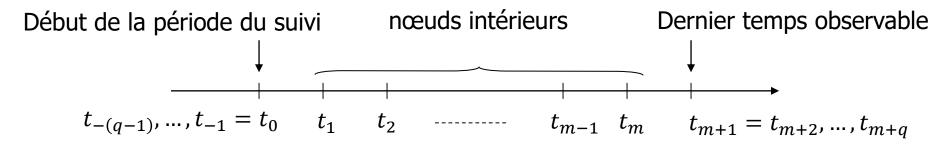


(1)



m : nombre de nœuds intérieurs

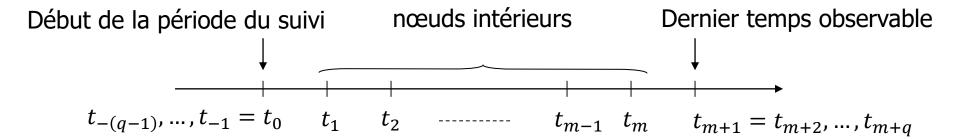
(1)



m : nombre de nœuds intérieurs

q: ordre de la fonction spline

(1)



m : nombre de nœuds intérieurs

q : ordre de la fonction spline

$$B_{j,q}(t) = \frac{t - t_j}{t_{j+q-1} - t_j} B_{j,q-1}(t) + \frac{t_{j+q} - t}{t_{j+q} - t_{j+1}} B_{j+1,q-1}(t)$$

$$j = -(q-1), \dots, m$$

$$B_{j,1}(t) = \begin{cases} 1 \text{ si } t \in [t_j, t_{j+1}] \\ 0 \text{ sinon} \end{cases}$$

Quadratique, 2 nœuds intérieurs

$$B_{j,q}(t) = \frac{t - t_j}{t_{j+q-1} - t_j} B_{j,q-1}(t) + \frac{t_{j+q} - t}{t_{j+q} - t_{j+1}} B_{j+1,q-1}(t)$$

m=2: nombre de nœuds intérieurs q=3: ordre de la fonction spline

Avec
$$j = -2$$
 et $q = 3$:

Avec
$$j = -2$$
 et $q = 3$: $B_{-2,3}(t) = \underbrace{t - t_{-2}}_{t_{-2+3-1}} B_{-2,3-1}(t) + \underbrace{t_{-2+3} - t}_{t_{-2+3}} B_{-2+1,3-1}(t)$

$$B_{-2,2}(t) = \frac{t - t_{-2}}{t_{-1} - t_{-2}} B_{-2,1}(t) + \frac{t_0 - t}{t_0 - t_{-1}} B_{-1,1}(t)$$

$$B_{-1,2}(t) = \frac{t - t_{-1}}{t_0 - t_{-1}} B_{-1,1}(t) + \frac{t_1 - t}{t_1 - t_0} B_{0,1}(t)$$

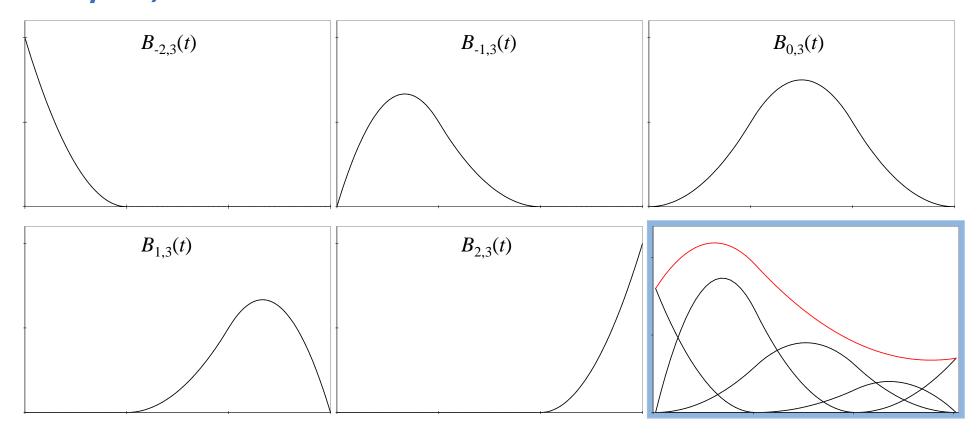
$$B_{-2,3}(t) = \frac{t_1 - t}{t_1 - t_{-1}} \times \frac{t_1 - t}{t_1 - t_0} B_{0,1}(t)$$

$$B_{-2,3}(t) = 1 - \frac{2}{t_1}t + \frac{1}{t_1^2}t^2$$
 si $t \in [t_0, t_1[$, 0 sinon



Fonctions B-Splines Quadratique, 2 nœuds intérieurs





$$\beta(t) = \sum_{j=-(q-1)}^{m} \alpha_j B_{j,q}(t), t \in (t_0, t_{m+1})$$

