

Application du shrinkage aux modèles de Cox

Présentation des enjeux et de la théorie

Corentin Choisy (Inserm UMR 1246 SPHERE)

April 21, 2023

Table des matières

1 Le problème

► Le problème

► Shrinkage: principe

Shrinkage global

Shrinkage par paramètre

Shrinkage conjoint

► Proposition

Contexte

1 Le problème

- Deux étapes majeures dans la construction de notre modèle prédictif:
 - Sélection des variables X_1, \dots, X_K à inclure dans le modèle final
 - Estimation des paramètres correspondants β_1, \dots, β_K
- Modèle final estimé sur les données ayant servi à la sélection des variables
 $\Rightarrow X_j$ a + de chances d'être retenu si β_j est surestimé sur les données que sous-estimé

Biais

1 Le problème

- Deux biais introduits:
 - **Biais de compétition des variables:** β_1, \dots, β_K tendent à être surestimés
 - **Biais de règle d'arrêt:** Des variables sont exclues à tort car leur coefficient est sous-estimé sur les données

Des solutions ?

1 Le problème

- Corriger les valeurs de $\beta_1, \dots, \beta_K \Rightarrow$ shrinkage
- Estimer le modèle sur d'autres données (par exemple échantillon de validation)
 - **Problème:** Si l'échantillon sur lequel on estime le modèle est un échantillon représentatif de la même population source que l'échantillon ayant servi à la sélection, les coefficients peuvent toujours être surestimés
 - \Rightarrow Les coefficients doivent être corrigés \Rightarrow shrinkage

Table des matières

2 Shrinkage: principe

► Le problème

► Shrinkage: principe

Shrinkage global

Shrinkage par paramètre

Shrinkage conjoint

► Proposition

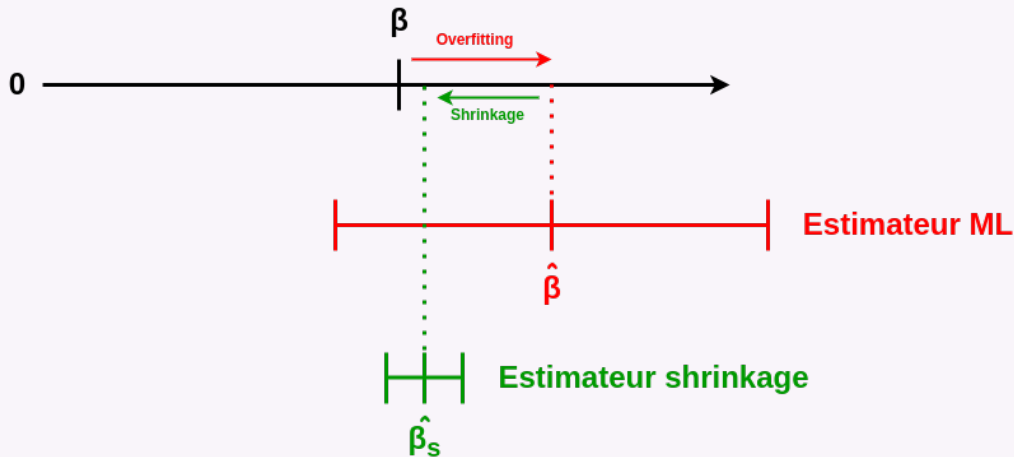
Principe général

2 Shrinkage: principe

- L'estimation des paramètres d'un modèle par maximum de vraisemblance se fait toujours en acceptant un compromis biais-variance.
 - Généralement, on choisit l'estimateur **sans biais à variance minimale**
- Le shrinkage consiste en un choix de compromis différent acceptant un **biais vers 0** de l'estimateur contre une **réduction de la variance**.
- Ici, ce biais est avantageux car nos estimateurs sont enflés du fait du biais de compétition des variables.

Illustration

2 Shrinkage: principe



Shrinkage global

2 Shrinkage: principe

- Le shrinkage global calcule un facteur de réduction des coefficients commun à tous les estimateurs du modèle.
- **Inconvénient:** Ce facteur "moyen" peut sur-corriger certains coefficients et en sous-corriger d'autres.
- Calculé par cross-validation (voir diapo suivante)

Shrinkage global

2 Shrinkage: principe

Notons $X = (X_1, \dots, X_K)$ le vecteur des K variables incluses dans le modèle. On peut écrire le modèle de Cox ainsi, pour chaque individu i :

$$h_i(t) = \lambda_0(t)w_i = \lambda_0(t)e^{X_i\beta}$$

où β est obtenu en maximisant la vraisemblance partielle:

$$\mathcal{L}(\beta) = \prod_{i=1}^N \left(\frac{w_i}{\sum_{R_i} w_j} \right)^{d_i}$$

Avec d_i l'indicatrice d'évènement et R_i l'ensemble des individus à risque au temps t_i .
Notons $\ell_i(\beta)$ la contribution individuelle de l'individu i à la log-vraisemblance correspondante.

Shrinkage global

2 Shrinkage: principe

On a, avec $\ell_{(-i)}(\beta)$ la log-vraisemblance, maximisée par $\hat{\beta}_{(-i)}$, du modèle avec l'individu i supprimé:

$$\ell_i(\beta) = \ell(\beta) - \ell_{(-i)}(\beta)$$

Avec $\sum_{i=1}^N \ell_i(\beta) = \ell(\beta)$, il vient que:

$$cvl = \sum_{i=1}^N \ell_i(\hat{\beta}_{(-i)})$$

est une mesure de la capacité prédictive du modèle.

Shrinkage global

2 Shrinkage: principe

Supposons maintenant que l'on calcule un modèle de Cox sur les mêmes données avec pour seule variable dépendante l'indice pronostique $X_i \hat{\beta}_{(-i)}$ pour chaque individu i . En notant $\ell^*(c)$ la log-vraisemblance de ce modèle avec c le coefficient de sa seule variable et $\ell(c)$ la log-vraisemblance du modèle avec pour seule covariable $X_i \hat{\beta}$, on remarque:

- $\ell^*(c) < \ell(c), \forall c$, indiquant que le fit à de nouvelles données est toujours moins bon que celui aux données utilisées pour calculer le modèle
- Par définition de $\hat{\beta}$, $\ell(c)$ est maximisée par $c = 1$ et $\ell(1)$ est une mesure du fit du modèle aux données, tandis que $\ell^*(1)$ mesure la capacité prédictive du modèle.
- La maximisation de $\ell^*(c)$ par \hat{c} permet donc d'obtenir un coefficient c généralement inférieur à 1 permettant de ramener les β à des valeurs reflétant la capacité prédictive du modèle.

Shrinkage global - Résumé

2 Shrinkage: principe

1. Calcul du modèle N fois en retirant un sujet à chaque fois (jackknife), afin de calculer les $\hat{\beta}_{(-i)}$
2. Calcul du modèle de Cox avec pour variable $X_i \hat{\beta}_{(-i)}$. Le coefficient c de ce modèle donne le facteur de shrinkage.
3. On retient comme coefficients les $c\beta_j; j = 1, \dots, K$

Shrinkage par paramètre

2 Shrinkage: principe

De façon à éviter la sur-correction de certains paramètres, on propose de calculer un facteur de shrinkage par variable en modifiant les étapes 2 et 3.

2. Calcul du modèle de Cox avec K variables $X_{ij}\hat{\beta}_j^{(-i)}; j = 1, \dots, K$. Les coefficients c_1, \dots, c_K de ce modèle donnent les facteurs de shrinkage.
3. On retient comme coefficients les $\gamma_j = c_j\beta_j; j = 1, \dots, K$

Problème: Si des variables très corrélées (y compris des termes d'interaction) sont présentes dans le modèle, les coefficients corrigés pour ces variables ne sont pas interprétables.

Shrinkage conjoint

2 Shrinkage: principe

Le shrinkage conjoint est un compromis entre le shrinkage global et par paramètres. Il propose de donner un facteur de shrinkage commun pour chaque sous-groupe de variables corrélées entre elles J_1, \dots, J_h , mutuellement exclusifs et collectivement exhaustifs. On modifie la procédure ainsi:

2. Calcul du modèle de Cox à h covariables définies par $\eta_{ig} = \sum_{j \in J_g} x_{ij} \hat{\beta}_j^{(-i)}$ permettant d'obtenir les facteurs de shrinkage c_1, \dots, c_h
3. Pour chaque $J_g; g = 1, \dots, h$, le coefficient retenu pour les variables appartenant au groupe g sont les $\gamma_j = c_g \beta_j$

Table des matières

3 Proposition

- ▶ Le problème
- ▶ Shrinkage: principe
 - Shrinkage global
 - Shrinkage par paramètre
 - Shrinkage conjoint
- ▶ Proposition

Appliquer le shrinkage ?

3 Proposition

- Dans le cadre de notre projet, il semble donc intéressant d'appliquer un shrinkage conjoint qui permettra une évaluation du modèle plus réaliste dans la validation interne.
- Cette démarche peut sembler dispensable si nous pouvons bénéficier d'une validation externe, bien qu'elle permette également, en théorie, une réduction de la variance des coefficients.

Application du shrinkage aux modèles de Cox