# Longitudinal data analysis (modern methods) Advanced modelling with R

Juan R Gonzalez juanr.gonzalez@isglobal.org

BRGE -Bioinformatics Research Group in Epidemiology ISGlobal -Barcelona Institute for Global Health http://brge.isglobal.org

## Modelos modernos para datos longitudinales

- ▶ Datos longitudinales recogen observaciones repetidas de la variable respuest a lo largo del tiempo, en un mismo individuo
- ► El análisis correcto de estos datos contempla que la correlación entre las medidas de cada sujeto es tenida en cuenta
- ► A parte de las aproximaciones tradicionales (vistas en la clase anterior), también se puede:
  - Utilizar Ecuaciones de Estimación Generalizadas: GEE
  - Modelos lineales mixtos

### Modelos GEE

- Modelan la esperanza marginal o poblacional incorporando la correlación entre las observaciones correspondientes a un mismo individuo, y se asume independencia de los individuos
- Admiten que la variable respuesta siga una distribución distinta a la Gausiana
- Consideran una ecuación de estimación que se escribe en dos partes: una para modelar los parametros de regresión y la segunda para modelar la correlación
- Son bastante flexibles ya que el modelo sólo necesita explicitar una función "link", una función de varianza y una estructura de correlación

### Modelos GEE

- Funcionan bien cuando:
  - el número de observaciones por sujeto es pequeño y el número de sujetos es grande
  - se tratan estudios longitudinales donde las medidas siempre se toman en el mismo instante de tiempo para todos los sujetos

#### Modelos GEE: Formulación

Parte sistemática [lo mismo que un GLM]

$$g(E(Y_{ij})) = g(\mu_{ij}) = \beta' X_{ij}$$

donde  $i=1,\ldots,n$  y  $j=1,\ldots,n_i$ , y n denota el número de individuos, y  $n_i$  el número de medidas repetidas para el individuo i-ésimo

Parte aleatoria

$$V(Y_{ij}) = \nu(\mu_{ij})\phi$$

donde  $\nu$  es la función de la varianza y  $\phi$  el parámetro de escala

Además se tiene que explicitar la estructura de la correlación mediante la working correlation matrix,  $R(\alpha)$ 

### Modelos GEE

Independence, 
$$\begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$
Exchangeable, 
$$\begin{pmatrix} 1 & \rho & \rho \\ \rho & 1 & \rho \\ \rho & \rho & 1 \end{pmatrix}$$
Autoregressive order 1, 
$$\begin{pmatrix} 1 & \rho & \rho^2 \\ \rho & 1 & \rho \\ \rho^2 & \rho & 1 \end{pmatrix}$$
Unstructured, 
$$\begin{pmatrix} 1 & \rho_{12} & \rho_{13} \\ \rho_{12} & 1 & \rho_{23} \\ \rho_{12} & \rho_{23} & 1 \end{pmatrix}$$

Figure 1: GEE correlation structures

#### Modelos GEE

- No es necesaria la especificación de un modelo estadístico. Es decir, no es necesario conocer f(y|parámetros). Así, son flexibles, pero:
  - la estimación de las  $\beta$ 's no tiene porqué se la mejor posible
  - la inferencia está basada en resultados asintóticos
  - los métodos de validación son complicados
- ► La estimación de los parámetros se puede encontrar en muchos sitios (ver por ejemplo Liang y Zeger, Biometrika, 1986 o Zeger et al, Biometrics, 1988)
- ➤ Si hay datos faltantes (missing) la estimación sólo es correcta si los missing son MCAR (missing completely at Random)

## Modelos GEE: estimación de parámetros

La función geeglm from the geepack es muy similar a la glm

formula Symbolic description of the model to be fitted
family Description of the error distribution and link function
data Optional dataframe
id Vector that identifies the clusters
zcor Enter a user defined correlation structure
constr Working correlation structure:
 "independence", "exchangeable", "ar1", "unstructured",
 "userdefined"

std.err Type of standard error to be calculated.
Default "san.se" is the robust (sandwich) estimate;

Figure 2: geeglm arguments

use "jack" for approximate jackknife variance estimate

## Modelos GEE: estimación de parámetros

- For a geeglm object returned by geeglm(), the functions drop1(), confint() and step() do not apply; however anova() does apply.
- The function esticon() in the doBy package computes and test linear functions of the regression parameters for lm, glm and geeglm objects
- Basic syntax,

esticon(obj, cm, beta0, joint.test=FALSE)

obj Model object

cm Matrix specifying linear functions of the regression parameters

(one linear function per row and one column for each parameter)

beta0 Vector of numbers

joint.test If TRUE joint Wald test of the hypothesis Lbeta=beta0 is made,

default is one test for each row, (Lbeta).i=beta0.i

Figure 3:

## esticon()

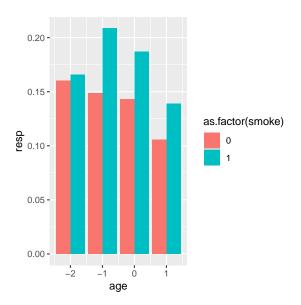
- Let  $\hat{\beta} = (\hat{\beta}_1, \dots, \hat{\beta}_p)$  denote the estimated parameters. Also let  $k = (k_1, \dots, k_p)$  denote a vector of constants; one row of the matrix for the cm argument. Then  $c = k^T \beta = k_1 \beta_1 + \dots + k_p \beta_p$ .
- esticon() calculates the linear combinations of the parameter estimates
   c, the standard error and the confidence interval
- Specify a value for beta0 to test H<sub>0</sub>: c = beta0
- If joint.test=TRUE then all of the linear combinations are tested jointly

Figure 4: esticon function

ohio dataset: Health effect of air pollution. Children followed for four years, wheeze status (resp: 0-no, 1-yes) recorded annually as well as maternal smoking and age (0 is 9 years old) [datos en formato largo]

```
library(geepack)
data(ohio)
head(ohio)
```

```
resp id age smoke
1 0 0 -2 0
2 0 0 -1 0
3 0 0 0 0
4 0 0 1 0
5 0 1 -2 0
6 0 1 -1 0
```



El outcome es binario -> binomial

```
fit.exch <- geeglm(resp~age*smoke,
                   family=binomial(link="logit"),
                   data=ohio, id=id,
                   corstr = "exchangeable",
                   std.err="san.se")
fit.unstr <- geeglm(resp~age*smoke,
                    family=binomial(link="logit"),
                    data=ohio, id=id,
                    corstr = "unstructured",
                    std.err="san.se")
```

summary(fit.exch)

Call: geeglm(formula = resp ~ age + smoke, family = binomial(link = "logit"), data = ohio, id = id, corstr = "exchangeable", std.err = "san.se") Coefficients: Estimate Std.err Wald Pr(>|W|) (Intercept) -1.88043 0.11389 272.597 < 2e-16 \*\*\* age -0.11338 0.04386 6.684 0.00973 \*\* smoke 0.26508 0.17775 2.224 0.13588 ---Signif. codes: 0 '\*\*\*' 0.001 '\*\*' 0.01 '\*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1 Estimated Scale Parameters: Estimate Std.err (Intercept) 0.9985 0.1116 Correlation: Structure = exchangeable Link = identity Estimated Correlation Parameters: Estimate Std.err alpha 0.3543 0.06244 Number of clusters: 537 Maximum cluster size: 4

summary(fit.unstr)

```
Call:
geeglm(formula = resp ~ age + smoke, family = binomial(link = "logit"),
   data = ohio, id = id, corstr = "unstructured", std.err = "san.se")
Coefficients:
           Estimate Std.err Wald Pr(>|W|)
(Intercept) -1.8886 0.1140 274.64 <2e-16 ***
        -0.1149 0.0442 6.75 0.0094 **
age
smoke 0.2535 0.1782 2.02 0.1548
Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
Estimated Scale Parameters:
           Estimate Std.err
(Intercept)
             1.01 0.115
Correlation: Structure = unstructured Link = identity
Estimated Correlation Parameters:
         Estimate Std.err
alpha.1:2 0.350 0.0732
alpha.1:3 0.308 0.0711
alpha.1:4 0.303 0.0710
alpha.2:3 0.470 0.0864
alpha.2:4 0.319 0.0736
alpha.3:4 0.376 0.0788
Number of clusters: 537
                          Maximum cluster size: 4
```

#### Edad como categórica

```
fit <- geeglm(resp~factor(age)+smoke, family=binomial(link="logit"),
             data=ohio, id=id, corstr = "exchangeable",
             std.err="san.se")
summary(fit)
Call:
geeglm(formula = resp ~ factor(age) + smoke, family = binomial(link = "logit"),
   data = ohio, id = id, corstr = "exchangeable", std.err = "san.se")
 Coefficients:
             Estimate Std.err Wald Pr(>|W|)
(Intercept)
           -1.7434 0.1374 161.00 <2e-16 ***
factor(age)-1 0.0540 0.1323 0.17 0.68
factor(age)0 -0.0278 0.1388 0.04 0.84
factor(age)1 -0.3755 0.1467 6.55 0.01 *
             0.2712 0.1781 2.32 0.13
smoke
Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
Estimated Scale Parameters:
           Estimate Std.err
(Intercept)
                  1 0.115
Correlation: Structure = exchangeable Link = identity
Estimated Correlation Parameters:
     Estimate Std.err
alpha 0.354 0.0636
Number of clusters:
                    537
                          Maximum cluster size: 4
```

Podemos testar el efecto de una covariable usando un test de razón de verosimilitud

anova(fit1, fit2)

```
Analysis of 'Wald statistic' Table

Model 1 resp ~ factor(age) + smoke

Model 2 resp ~ factor(age)

Df X2 P(>|Chi|)

1 1 2.32 0.13
```

#### Podemos hacer un test para un parámetro en particular

```
library(doBy)
est <- esticon(fit, diag(5))
est</pre>
```

```
beta0 Estimate Std.Error X2.value
                                          DF Pr(>|X^2|)
                                                        Lower
[1,]
     0.0000 -1.7434
                      0.1374 160.9952
                                     1.0000
                                                0.0000 -2.0127
[2,]
     0.0000 0.0540
                      0.1323 0.1667
                                      1.0000
                                                0.6831 -0.2053
[3,]
     0.0000 -0.0278
                    0.1388 0.0400
                                     1.0000
                                                0.8415 -0.2998
                                     1.0000
[4,]
    0.0000 -0.3755 0.1467 6.5521
                                                0.0105 -0.6631
ſ5.l
     0.0000
             0.2712
                      0.1781 2.3191
                                     1.0000
                                                0.1278 -0.0778
    Upper
[1,] -1.47
[2,] 0.31
[3,1 0.24
[4,] -0.09
[5.] 0.62
```

ORs e IC95%

```
OR.CI <- exp(cbind(est$Estimate, est$Lower, est$Upper))
rownames(OR.CI) <- names(coef(fit))
colnames(OR.CI) <- c("OR", "Lower OR", "Upper OR")
OR.CI</pre>
```

```
OR Lower OR Upper OR (Intercept) 0.175 0.134 0.229 factor(age)-1 1.055 0.814 1.368 factor(age)0 0.973 0.741 1.277 factor(age)1 0.687 0.515 0.916 smoke 1.312 0.925 1.859
```

- ▶ Podemos preguntarnos . . . ¿cuál es el riesgo de 'wheezing' a los 9 años para un niño cuya madre ha fumado?
- Es decir, estima [smoke+factor(age)0] [factor(age)-1]

```
val <- esticon(fit, c(0,-1,1,0,1))
exp(val$Estimate)</pre>
```

```
[1] 1.21
```

val

```
beta0 Estimate Std.Error X2.value DF Pr(>|X^2|)
[1,] 0.000 0.189 0.215 0.773 1.000 0.379
```

- Como vimos en la sesión anterior, se podría usar un modelo lineal, pero:
  - Las observaciones repetidas en cada grupo o cluster, no son necesariamente independientes.
  - Con frecuencia, no solo se quieren tomar decisiones respecto de los grupos o cluster observados, sino que se quiere valorar el efecto de las variables explicativas en una población de la que los grupos son una muestra.
  - ▶ Puede ser de interés valorar la variación del efecto de x de un grupo a otro.
  - La estimación del efecto medio de las variables explicativas en cada grupo puede ser muy deficiente si no se recoge la posible variabilidad entre los grupos.

- Modeliza la realación entre la variable dependiente y las covariables
- Estima la correlación intra-individuo (se puede especificar una estructura)
- Se pueden aplicar a muchas situaciones (datos multinivel, ANOVA, datos longitudinales)
- No requieren puntos equidistantes (son covariables -se modeliza el efecto)
- Son robustos ante los missing

Un modelo mixto se puede representar como:

$$y = X\beta + Zu + \epsilon$$

#### donde

- ightharpoonup [y] son las observaciones, con media  $E(y) = X\beta$
- ightharpoonup [eta] es un vector de efectos fijos
- ▶ [u] is un vector i.i.d de variables aleatorias con media E(u) = 0 y matriz de varianza-covarianza var(u) = G
- ▶ [ $\epsilon$ ] es un vector de términos i.i.d. correspondientes al error aleatorio con media  $E(\epsilon) = 0$  y varianza  $var(\epsilon) = R$
- ▶ [X and Z] son matrices de regresores que relacionan las observaciones y con  $\beta$  y u

 Modelo sencillo para interpretar (modelo lineal mixto con intercept aleatorio)

$$\begin{aligned} y_{ij} &= \beta_0 + \beta_1 X_{ij} + a_{ij} + \epsilon_{ij} \\ a_i \ N(0, \tau_a^2) \ , \tau_a^2 &\geq 0 \\ \epsilon_{ij} \ N(0, \tau^2) \ , \tau^2 &> 0 \end{aligned}$$

- ► El modelo presenta ahora un intercept aleatorio (centrado en 0) que depende del individuo *i*-ésimo
- ► La varianza del efecto aleatorio recoge la variabilidad entre los diferentes individuos
- La varianza del error recoge la variabilidad dentro de cada individuo no explicada por el modelo. NOTA: si la varianza del efecto aleatorio fuese nula, el modelo coincidiría con el modelo de efectos fijos o de regresión lineal.

- librería nlme o lme4
- BodyWeight: Rat weight over time for different diets

```
library(nlme)
data("BodyWeight" , package="nlme")
head(BodyWeight)
```

```
Grouped Data: weight ~ Time | Rat
weight Time Rat Diet

1 240 1 1 1
2 250 8 1 1
3 255 15 1 1
4 260 22 1 1
5 262 29 1 1
6 258 36 1 1
```

Debemos especificar la estructura de los datos mediante la función groupedData

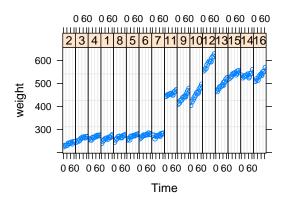
```
datos.s <-groupedData(weight ~ Time | Rat, BodyWeight)
head(datos.s)</pre>
```

```
Grouped Data: weight ~ Time | Rat
weight Time Rat Diet

1 240 1 1 1
2 250 8 1 1
3 255 15 1 1
4 260 22 1 1
5 262 29 1 1
6 258 36 1 1
```

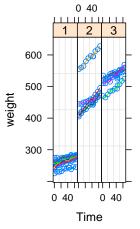
Usa la librería trellis para graficar (muy potente)

```
plot(datos.s)
```

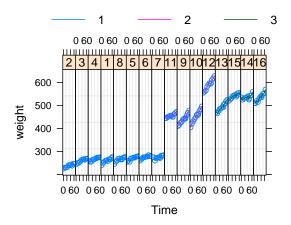


plot(datos.s, outer="Diet")





```
plot(datos.s, inner="Diet")
```

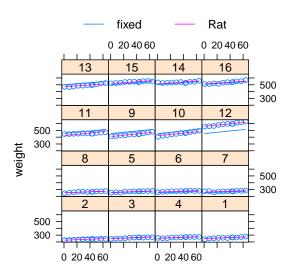


#### El modelo de intercept aleatorio puede estimarse con:

```
mod.lme <-lme(weight ~ Time * Diet, datos.s, random = ~ 1)
mod.lme
Linear mixed-effects model fit by REML
  Data: datos.s
  Log-restricted-likelihood: -616
  Fixed: weight ~ Time * Diet
(Intercept)
                  Time
                             Diet2
                                         Diet3 Time:Diet2 Time:Diet3
    251.652
                 0.360
                            200.665
                                        252.072
                                                     0.606
                                                                 0.298
Random effects:
 Formula: ~1 | Rat
        (Intercept) Residual
StdDev:
               36.6
                        6.4
Number of Observations: 176
Number of Groups: 16
```

Y podemos estimar la parte fija y aleatoria con

```
plot(augPred(mod.lme, level = 0:1, length.out = 2))
```



summary(mod.lme)

```
Linear mixed-effects model fit by REML
Data: datos.s
  AIC BIC logLik
 1248 1273 -616
Random effects:
Formula: ~1 | Rat
       (Intercept) Residual
StdDev:
             36.6
                      6.4
Fixed effects: weight ~ Time * Diet
          Value Std.Error DF t-value p-value
(Intercept) 251.7
                13.01 157
                              19.34
                0.04 157 10.25
          0.4
Time
                22.54 13 8.90
Diet2 200.7
                                         0
Diet3 252.1 22.54 13 11.18
                                         0
                0.06 157 9.97
Time:Diet2 0.6
Time:Diet3 0.3
                0.06 157 4.91
Correlation:
         (Intr) Time Diet2 Diet3 Tm:Dt2
Time
     -0.090
Diet2 -0.577 0.052
     -0.577 0.052 0.333
Diet3
Time:Diet2 0.052 -0.577 -0.090 -0.030
Time:Diet3 0.052 -0.577 -0.030 -0.090 0.333
Standardized Within-Group Residuals:
    Min
             01
                    Med
                             03
                                    Max
-2.72699 -0.46788 0.00709 0.47622 3.36035
Number of Observations: 176
Number of Groups: 16
```

#### Comparamos con un modelo lineal

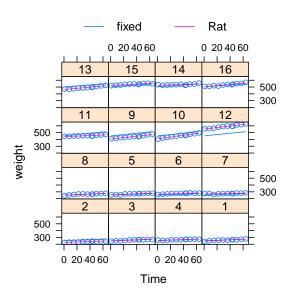
mod.lm <-lm(weight ~ Time \* Diet, BodyWeight)

```
summary(mod.lm)
Call:
lm(formula = weight ~ Time * Diet, data = BodyWeight)
Residuals:
  Min
        10 Median
                     30
                          Max
-51.83 -24.22 0.66 10.44 113.89
Coefficients:
          Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
(Intercept) 251.652
                  7.263 34.65 <2e-16 ***
          0.360 0.187 1.92 0.057 .
Time
Diet2 200.665 12.581 15.95 <2e-16 ***
Diet3 252.072 12.581 20.04 <2e-16 ***
Time:Diet2 0.606 0.324 1.87 0.064.
Time:Diet3 0.298 0.324 0.92 0.359
Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
Residual standard error: 34.2 on 170 degrees of freedom
Multiple R-squared: 0.93, Adjusted R-squared: 0.928
F-statistic: 450 on 5 and 170 DF, p-value: <2e-16
```

El modelo con intercept y pendiente aleatoria puede estimarse con:

```
mod.lme2 <-lme(weight ~ Time * Diet, random = ~ Time,
              datos.s)
summary(mod.lme2)
Linear mixed-effects model fit by REML
Data: datos.s
     ATC
              BIC
                   logLik
  1171 72 1203 078 -575 8599
Random effects:
Formula: ~Time | Rat
Structure: General positive-definite, Log-Cholesky parametrization
           StdDev
                     Corr
(Intercept) 36.9390723 (Intr)
Time
            0.2484113 -0.149
Residual 4.4436052
Fixed effects: weight ~ Time * Diet
               Value Std.Error DF t-value p-value
(Intercept) 251.65165 13.094025 157 19.218816 0.0000
          0.35964 0.091140 157 3.946019 0.0001
Time
Diet2 200.66549 22.679516 13 8.847873 0.0000
      252.07168 22.679516 13 11.114509 0.0000
Diet3
Time:Diet2 0.60584 0.157859 157 3.837858 0.0002
Time:Diet3 0.29834 0.157859 157 1.889903 0.0606
Correlation:
          (Intr) Time Diet2 Diet3 Tm:Dt2
Time
         -0.160
Diet2
        -0.577 0.092
Diet3
        -0.577 0.092 0.333
Time:Diet2 0.092 -0.577 -0.160 -0.053
Timo: Dio+3 0 000 = 0 577 = 0 053 = 0 160 0 333
```

```
plot(augPred(mod.lme2, level = 0:1, length.out = 2))
```

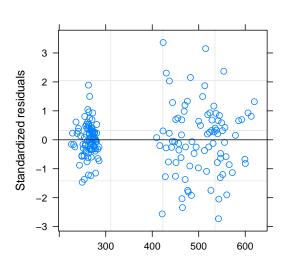


## ¿cuál es necesario?

```
anova(mod.lme, mod.lme2)
```

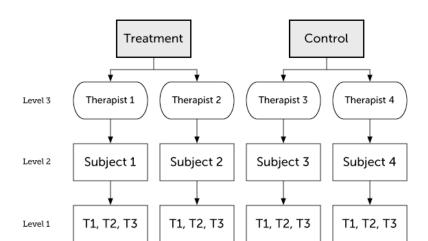
# Modelos mixtos Model checking

plot(mod.lme)



## Modelos anidados

Los **efectos anidados**, el factor aparece SÓLO dentro de un nivel particular de otro factor (cada ojo es de un individuo); para los **efectos cruzados** un factor puede aparecer en más de un nivel de otro factor



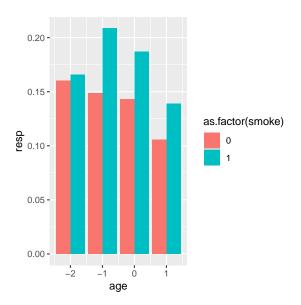
#### Modelos anidados

ohio dataset: Health effect of air pollution. Children followed for four years, wheeze status (resp: 0-no, 1-yes) recorded annually as well as maternal smoking and age (0 is 9 years old) [datos en formato largo

```
library(lme4)
mod.bin <- lmer(resp ~ age*smoke + (1|id),
                data=ohio, family="binomial" )
```

summary(mod.bin) Generalized linear mixed model fit by maximum likelihood () Approximation) [glmerMod] Family: binomial (logit)

Formula: resp ~ age \* smoke + (1 | id) Data: ohio Control: structure(list(optimizer = c("bobyqa", "Nelder\_Mead"), cale use.last.params = FALSE, restart\_edge = FALSE, boundary



#### Fixed effects:

#### Estimates with 95% CI

#### tab

```
Est Lower Upper (Intercept) -3.4017098 -3.9482349 -2.85518472 age -0.2170390 -0.3871280 -0.04694996 smoke 0.4782426 -0.1082864 1.06477149 age:smoke 0.1046484 -0.1680217 0.37731854
```

#### Exercises

- Analiza de nuevo los datos agudezavisual.txt usando un modelo mixto (ojo dentro de individuo) [NOTA: diferente al modelo tradicional que agregaría los datos]. ¿Hay un efecto tiempo?
- 2. El dataset Milk estudia el contenido de proteina en la leche de vaca (variable protein). Se dispone de datos desde el parto (variable Time) para distintas vacas (variable Cow). Estamos interesados en saber qué dieta (variable Diet) produce una leche con un mayor contenido de proeínas. Contesta a esta pregunta analizando los datos que puedes cargar con

data("Milk", package="nlme")

3. Investigadores están interesados en saber si la distancia entre dientes (variable distance) en niños y niñas (variable Sex) que llevan ortodocia evoluciona de la misma manera a lo largo del tiempo (variable age). Contesta a esta pregunta científica analizando los datos que puedes cargar en R con:

data("Orthodont", package="nlme")