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 ν es la función de la varianza y ϕ el parámetro de escala

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

Modelos GEE

$$\left(\begin{array}{ccc} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{array}\right)$$

$$\begin{pmatrix} 1 & \rho & \rho \\ \rho & 1 & \rho \\ \rho & \rho & 1 \end{pmatrix}$$
 order 1,
$$\begin{pmatrix} 1 & \rho & \rho^2 \\ \rho & 1 & \rho \\ \rho^2 & \rho & 1 \end{pmatrix}$$

 $\left(\begin{array}{cccc}
1 & \rho_{12} & \rho_{13} \\
\rho_{12} & 1 & \rho_{23}
\end{array}\right)$

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 β '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

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

Default "san.se" is the robust (sandwich) estimate; use "jack" for approximate jackknife variance estimate

Figure 2: geeglm arguments

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

esticon()

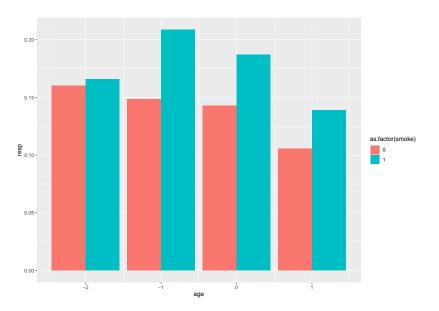
- Let $\hat{\beta} = (\hat{\beta}_1, \dots, \hat{\beta}_p)$ denote the estimated parameters. Also let $k = (k_1, \dots, k_p)$ denote a vector of constants; one row of the matrix for the cm argument. Then $c = k^T \beta = k_1 \beta_1 + \dots + k_p \beta_p$.
- esticon() calculates the linear combinations of the parameter estimates
 c, the standard error and the confidence interval
- Specify a value for beta0 to test H₀: c = beta0
- If joint.test=TRUE then all of the linear combinations are tested jointly

Figure 3: 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	${\tt id}$	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) -1.9005 0.1191 254.69 <2e-16 ***
          -0.1412 0.0582 5.89 0.015 *
age
smoke 0.3138 0.1878 2.79 0.095 .
age:smoke 0.0708 0.0883 0.64 0.422
---
Signif. codes: 0 '*** 0.001 '** 0.01 '* 0.05 '.' 0.1 ' 1
Correlation structure = exchangeable
Estimated Scale Parameters:
           Estimate Std.err
(Intercept)
            0.999 0.114
 Link = identity
Estimated Correlation Parameters:
     Estimate Std.err
alpha
        0.355 0.063
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) -1.9084 0.1191 256.61 <2e-16 ***
           -0.1418 0.0585 5.88 0.015 *
age
          0.3016 0.1885 2.56 0.110
smoke
age:smoke 0.0685 0.0892 0.59 0.443
Signif. codes: 0 '*** 0.001 '** 0.01 '* 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
Correlation structure = unstructured
Estimated Scale Parameters:
           Estimate Std.err
(Intercept)
              1.01 0.117
 Link = identity
Estimated Correlation Parameters:
         Estimate Std.err
alpha.1:2 0.350 0.0737
alpha.1:3 0.308 0.0715
alpha.1:4 0.304 0.0714
alpha.2:3 0.469 0.0869
alpha.2:4 0.319 0.0741
alpha.3:4 0.378 0.0796
Number of clusters: 537 Maximum cluster size: 4
```

Edad como categórica

```
fit <- geeglm(resp~factor(age)+smoke, family=binomial(link="logit"),</pre>
             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 *
smoke
            0.2712 0.1781 2.32 0.13
Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
Correlation structure = exchangeable
Estimated Scale Parameters:
           Estimate Std.err
(Intercept)
                  1 0.115
 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
```

O el test de Wald

```
summary(fit1)
```

```
Call:
  geeglm(formula = resp ~ factor(age) + smoke, family = binor
```

```
Coefficients:
```

Signif. codes:

```
(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 *
smoke 0.2712 0.1781 2.32 0.13
```

data = ohio, id = id, corstr = "exchangeable", std.err

Estimate Std.err Wald Pr(>|W|)

Correlation structure = exchangeable

0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 '

Podemos hacer un test para un parámetro en particular. En este caso lo haremos para cada parámetro

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

```
estimate std.error statistic p.value
                                        beta0 df
(Intercept)
           -1.7434
                   0.1374 160.9952
                                 0.0000 0.0000 1
factor(age)-1
           0.0540
                   0.1323
                        0.1667 0.6831 0.0000 1
factor(age)0
          factor(age)1
          -0.3755
                   0.1467 6.5521 0.0105 0.0000 1
smoke
           0.2712
                   0.1781 2.3191 0.1278
                                        0.0000 1
```

ORs e IC95%

```
OR.CI <- exp(cbind(est$estimate, est$lwr, est$upr))
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)
```

```
[1] 1.21
```

val

```
estimate std.error statistic p.value beta0 df [1,] 0.189 0.215 0.773 0.379 0.000 1
```

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

- ▶ [y] son las observaciones, con media $E(y) = X\beta$
- \triangleright [β] 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
- ▶ [ϵ] 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 $y \text{ con } \beta \text{ y } u$

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

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

- ► 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

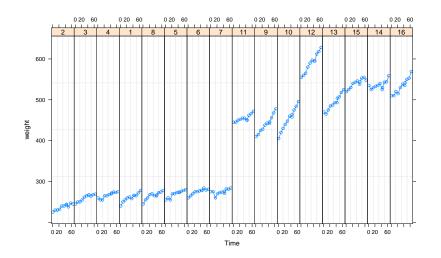
```
datos.s <-groupedData(weight ~ Time | Rat, BodyWeight)
head(datos.s)</pre>
```

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

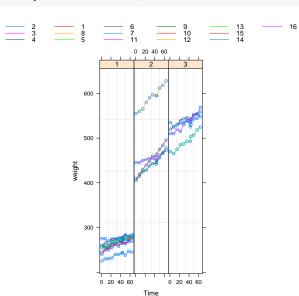
1 240 1 1 1
2 250 8 1 1
3 255 15 1 1
4 260 22 1 1
5 262 29 1 1
6 258 36 1 1
```

Usa la librería trellis para graficar (muy potente)

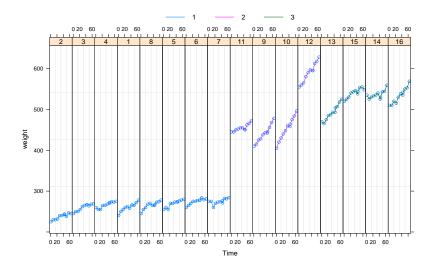
plot(datos.s)



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



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

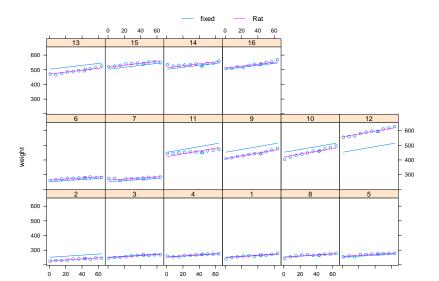


El modelo de intercept aleatorio puede estimarse con:

```
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
                         6.4
StdDev:
               36.6
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
              36.6
                        6.4
StdDev:
Fixed effects: weight ~ Time * Diet
           Value Std.Error DF t-value p-value
(Intercept) 251.7
                 13.01 157 19.34
           0.4
                   0.04 157 10.25
Time
Diet2
           200.7 22.54 13 8.90
Diet3 252.1 22.54 13 11.18
Time:Diet2 0.6 0.06 157 9.97
                                            0
Time:Diet3 0.3
                 0.06 157 4.91
 Correlation:
          (Intr) Time Diet2 Diet3 Tm:Dt2
Time
     -0.090
Diet2 -0.577 0.052
Diet3 -0.577 0.052 0.333
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
```

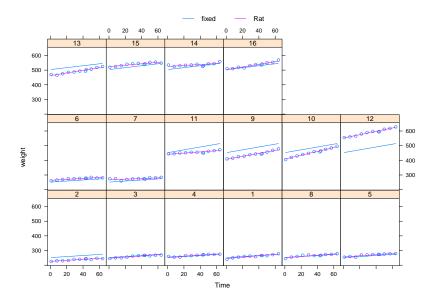
Comparamos con un modelo lineal

```
mod.lm <-lm(weight ~ Time * Diet, BodyWeight)
summary(mod.lm)
Call:
lm(formula = weight ~ Time * Diet, data = BodyWeight)
Residuals:
        1Q Median 3Q
                          Max
  Min
-51.83 -24.22 0.66 10.44 113.89
Coefficients:
          Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
                    7.263 34.65 <2e-16 ***
(Intercept) 251.652
          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
  AIC BIC logLik
 1172 1203 -576
Random effects:
Formula: ~Time | Rat
Structure: General positive-definite, Log-Cholesky parametrization
          StdDev Corr
(Intercept) 36.939 (Intr)
Time
        0.248 -0.149
Residual 4.444
Fixed effects: weight ~ Time * Diet
          Value Std.Error DF t-value p-value
(Intercept) 251.7 13.09 157 19.22 0.0000
         0.4 0.09 157 3.95 0.0001
Time
Diet2 200.7 22.68 13 8.85 0.0000
Diet3 252.1 22.68 13 11.11 0.0000
Time:Diet2 0.6 0.16 157 3.84 0.0002
Time:Diet3 0.3 0.16.157 1.89 0.0606
Correlation:
         (Intr) Time Diet2 Diet3 Tm:Dt2
Time
        -0.160
Diet2
     -0.577 0.092
     -0.577 0.092 0.333
Diet3
Time:Diet2 0.092 -0.577 -0.160 -0.053
Time:Diet3 0.092 -0.577 -0.053 -0.160 0.333
```

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



¿cuál es necesario?

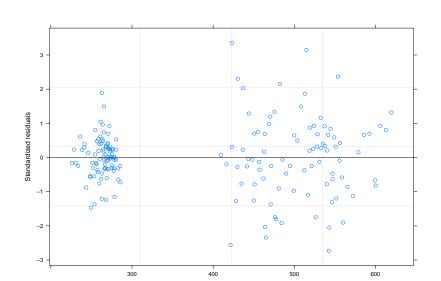
anova(mod.lme, mod.lme2)

```
        Model df
        AIC
        BIC logLik
        Test
        L.Ratio
        p-value

        mod.lme
        1
        8
        1248
        1273
        -616
        -616
        -576
        1
        vs 2
        80.5
        <.0001</td>
```

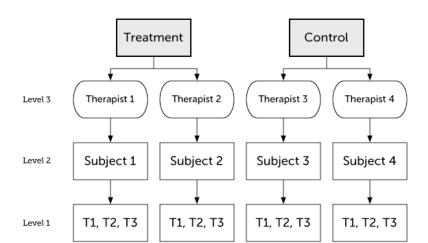
Model checking

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]

summary(mod.bin)

```
Generalized linear mixed model fit by maximum likelihood (Laplace Approximation) ['glmerMod']
Family: binomial (logit)
Formula: resp ~ age * smoke + (1 | id)
  Data: ohio
    ATC
            BIC
                 logLik deviance df.resid
           1628
                    -795
   1599
                            1589
                                     2143
Scaled residuals:
         10 Median
  Min
                       30
                            Max
-1.399 -0.178 -0.159 -0.128 2.602
Random effects:
Groups Name
                 Variance Std.Dev.
 id
      (Intercept) 5.5 2.35
Number of obs: 2148, groups: id, 537
Fixed effects:
           Estimate Std. Error z value Pr(>|z|)
(Intercept) -3.4017 0.2788 -12.20 <2e-16 ***
           -0.2170 0.0868 -2.50 0.012 *
age
           0.4782
                   0.2992 1.60 0.110
smoke
age:smoke 0.1046 0.1391 0.75 0.452
---
Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
Correlation of Fixed Effects:
        (Intr) age
                      smoke
        0.272
age
smoke -0.442 -0.193
age:smoke -0.146 -0.621 0.280
```

Estimates with 95% CI

tab

```
Est Lower Upper (Intercept) -3.402 -3.948 -2.8552 age -0.217 -0.387 -0.0469 smoke 0.478 -0.108 1.0648 age:smoke 0.105 -0.168 0.3773
```

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")