# Atelier prédiction génomique : premiers pas

Vincent Segura (INRAE)

d'après 'premiers-pas.Rmd' de Timothée Flutre (INRAE)

Lundi 17 février 2020

# Introduction

#### R, rmarkdown, RStudio

- Cette présentation a été générée à partir d'un fichier texte au format Rmd utilisé par le logiciel libre R
- La fonction render du package <u>rmarkdown</u> permet de générer le fichier html à partir du fichier Rmd

```
library(rmarkdown)
render("premiers-pas-slides.Rmd")
```

- · Il est généralement plus simple pour faire ça d'utiliser le logiciel RStudio
- Le format Rmd permet également d'utiliser le language LaTeX pour écrire des équations

#### **Packages**

· Cette présentation nécessite par ailleurs le chargement des packages MASS et stats4 qui sont généralement inclus par defaut dans R

library(MASS)
library(stats4)

#### Notation et vocabulaire

- · L'inférence avec un modèle statistique consiste généralement à **estimer les paramètres**, puis à s'en servir pour **prédire de nouvelles données**
- · Lorsqu'on propose un modèle, on commence par expliquer les notations
- · Conventions:
  - lettres grecques pour les paramètres (non-observés), par exemple heta
  - lettres romaines pour les données observées, y
  - lettres romaines surmontées d'un tilde pour les données prédites,  $ilde{y}$
  - les ensembles de données ou de paramètres sont généralement notés en majuscule,  $\mathcal{D}=\{y_1,y_2,y_3\}$  ou  $\Theta=\{\theta_1,\theta_2\}$
  - s'il y a plusieurs paramètres ou données, ils se retrouvent mathématiquement dans des vecteurs, en gras,  $m{ heta}$  et  $m{y}$
  - les vecteurs sont en colonne

#### La notion de vraisemblance

- · Une fois les notations établies, on écrit la **vraisemblance** (*likelihood*), souvent présentée comme étant la "probabilité des données sachant les paramètres"
- · Si les données sont des **variables continues**, c'est la densité de probabilité des données sachant les paramètres, notée  $p(y|\theta)$ , si les données sont des **variables discrètes**, c'est la fonction de masse, notée  $P(y|\theta)$
- · La vraisemblance est une fonction des **paramètres**, d'où le fait qu'on la note  $\mathcal{L}(\theta)$  ou  $\mathcal{L}(\theta|y)$
- · la méthode du **maximum de vraisemblance** cherche à identifier la valeur du paramètre, notée  $\hat{\theta}$  par convention, qui maximise la vraisemblance

$$\hat{\theta} = \operatorname{argmax}_{\theta} \mathcal{L} \iff \frac{\partial \mathcal{L}}{\partial \theta}(\hat{\theta}) = 0$$

#### L'incertitude

- Certains décrivent les statistiques comme étant la "science de l'incertitude" (Lindley, 2000)
- Pour l'instant, nous n'avons parlé que de la façon d'obtenir *une* valeur par paramètre, celle qui maximise la vraisemblance.
- Il est donc primordial ensuite de quantifier l'incertitude que nous avons quant à cette valeur
- C'est sur ce point que différentes approches sont possibles (fréquentiste, bayésienne).

#### Comprendre la vraisemblance

- Supposons que l'on étudie une quantité physique dont la valeur résulte de la somme d'une très grande quantité de facteurs indépendants, chacun ayant un faible impact sur la valeur finale
- · On prend trois mesures de cette quantité d'intérêt
- Comme il y a de la variation, on choisit d'introduire une variable aléatoire Y correspondant à la quantité d'intérêt, et on dénote par  $y_1$ ,  $y_2$  et  $y_3$  les trois observations, vues comme des réalisations de cette variable aléatoire :

$$y_1$$
 = 4.374,  $y_2$  = 5.184,  $y_3$  = 4.164

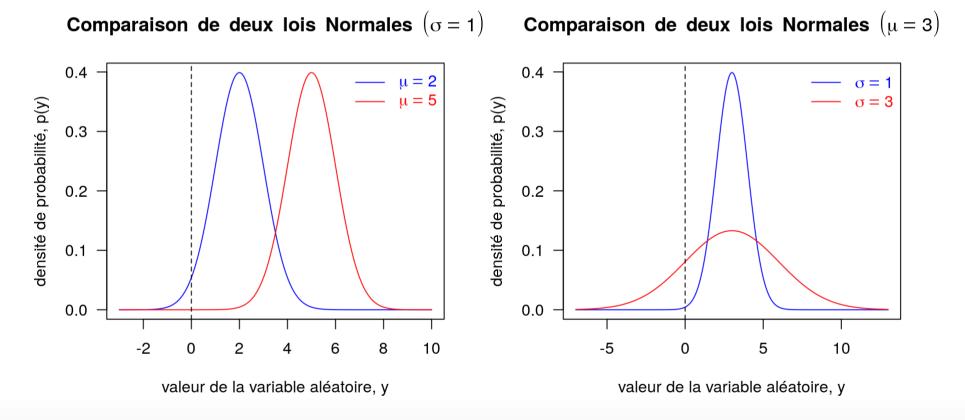
 $\cdot$  Etant donné les caractéristiques du phénomène, il est raisonnable de supposer que la variable Y suit une loi Normale (c.f. le théorème central limite)

- · Cette distribution de probabilité est caractérisée par deux paramètres, sa **moyenne** que l'on note généralement  $\mu$ , et sa **variance** que l'on note généralement  $\sigma^2$  ( $\sigma$  étant l'écart-type)
- · En terme de notation, on écrit  $Y\sim \mathcal{N}(\mu,\sigma^2)$ , et la densité de probabilité de la réalisation y de Y s'écrit :

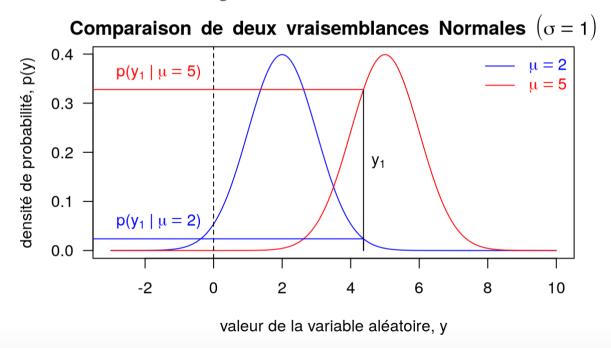
$$Y \sim \mathcal{N}(\mu, \sigma^2) \;\; \Leftrightarrow \;\; p(Y = y \,|\, \mu, \sigma) = rac{1}{\sigma \sqrt{2\pi}} \mathrm{exp}igg(-rac{(y - \mu)^2}{2\sigma^2}igg)$$

· L'intérêt de ce modèle paramétrique est de pouvoir "résumer" les données, par exemple un million de mesures, par seulement deux valeurs, les paramètres

- · Mais bien entendu, nous ne connaissons pas les valeurs de paramètres!
- · La moyenne  $\mu$  peut prendre toutes les valeurs entre  $-\infty$  et  $+\infty$ , et la variance  $\sigma^2$  n'a pour seule restriction que d'être positive
- · La loi Normale peut être assez différente selon les valeurs de ces paramètres



- Revenons à nos trois mesures : 4.374, 5.184, 4.164
- Parmi toutes les valeurs possibles des paramètres, quelles sont celles pour lesquelles la loi Normale est une bonne description du mécanisme qui a généré ces données ?
- · Pour simplifier, supposons que l'on connaisse déjà la variance :  $\sigma^2=1$ , il ne nous reste plus qu'à trouver la moyenne :  $\mu$ .
- · Pour la première observation,  $y_1$  = 4.374 :



· D'après le graphique précédent :  $p(y_1 \, | \, \mu=5, \sigma=1) > p(y_1 \, | \, \mu=2, \sigma=1)$ 

- · Cela se vérifie si l'on fait le calcul avec la formule :
  - $p(y_1 \mid \mu = 5, \sigma = 1)$  = 0.328
  - $p(y_1 \mid \mu = 2, \sigma = 1)$  = 0.024
- · Comme les deux densités ont la même valeur pour  $\sigma$ , la différence vient bien du terme  $(y-\mu)^2$  dans l'exponentielle, terme qui représente l'écart à la moyenne
- · Au final, nous pouvons conclure pour la première observation, que la vraisemblance  $\mathcal{L}(\mu=5,\sigma=1)$  est plus grande que  $\mathcal{L}(\mu=2,\sigma=1)$

Comme on dispose de plusieurs observations,  $\{y_1,y_2,y_3\}$ , et qu'on suppose qu'elles sont toutes des réalisations de la même variable aléatoire, Y, il est pertinent de calculer la vraisemblance de toutes ces observations conjointement plutôt que séparément :

$$\mathcal{L}(\mu,\sigma) = p(y_1,y_2,y_3 \,|\, \mu,\sigma)$$

· Si l'on fait aussi l'hypothèse que ces observations sont indépendantes, cela se simplifie en :

$$egin{aligned} \mathcal{L}(\mu,\sigma) &= p(y_1 \,|\, \mu,\sigma) imes p(y_2 \,|\, \mu,\sigma) imes p(y_3 \,|\, \mu,\sigma) \ &= \prod_{i=1}^3 p(y_i \,|\, \mu,\sigma) \end{aligned}$$

 Il n'est pas très pratique de maximiser la vraisemblance directement, on préfère passer au log (qui est monotone, donc le maximum de l'un est aussi le maximum de l'autre):

$$egin{aligned} l(\mu,\sigma) &= \log \mathcal{L}(\mu,\sigma) \ &= \sum_{i=1}^3 \log p(y_i \,|\, \mu,\sigma) \ &= \sum_{i=1}^3 \log \left[ rac{1}{\sigma \sqrt{2\pi}} \exp\left(-rac{(y_i - \mu)^2}{2\sigma^2}
ight) 
ight] \ &= -3 \log \sigma \, - rac{3}{2} \log(2\pi) \, - rac{1}{2\sigma^2} \sum_{i=1}^3 (y_i - \mu)^2 \end{aligned}$$

• En pratique, (i) on écrit une fonction qui calcule la log-vraisemblance, et (ii) on cherche le maximum de cette fonction

```
compute.log.likelihood <- function(parameters, data){</pre>
  mu <- parameters[1]</pre>
  sigma <- parameters[2]</pre>
  y <- data
  n <- length(y)</pre>
  \log.lik < - - n * \log(sigma) - (n/2) * \log(2 * pi) - sum(((y - mu)^2) / (2 * sigma^2))
  return(log.lik)
compute.log.likelihood(c(5,1), y)
## [1] -3.32
compute.log.likelihood(c(2,1), y)
## [1] -13
```

 Dans le cas de la loi Normale, il existe déjà dans R des fonctions implémentant la densité de probabilité, ce qui nous permet de vérifier que nous n'avons pas fait d'erreur

```
sum(dnorm(x=y, mean=5, sd=1, log=TRUE))

## [1] -3.32

sum(dnorm(x=y, mean=2, sd=1, log=TRUE))

## [1] -13
```

## Ecrire le modèle

#### **Notations**

- $\cdot n$ : nombre d'individus (diploïdes, supposés non-apparentés)
- i : indice indiquant le i-ème individu,  $i \in \{1, \dots, n\}$
- $\cdot y_i$  : phénotype de l'individu i pour la caractère d'intérêt
- ·  $\mu$  : moyenne globale du phénotype des n individus
- $\cdot f$  : fréquence de l'allèle minoritaire au marqueur SNP d'intérêt
- ·  $x_i$  : génotype de l'individu i à ce SNP, codé comme le nombre de copie(s) de l'allèle minoritaire, orall i  $x_i \in \{0,1,2\}$
- $\cdot$   $\beta$  : effet additif de chaque copie de l'allèle minoritaire en unité du phénotype
- ·  $\epsilon_i$  : erreur pour l'individu i
- $\sigma^2$  : variance des erreurs

#### **Notations** (suite)

- · Données :  $\mathcal{D} = \{(y_1 \mid x_1), \ldots, (y_n \mid x_n)\}$
- · Paramètres :  $\Theta = \{\mu, \beta, \sigma\}$

#### Vraisemblance

 On suppose que le génotype au SNP d'intérêt a un effet additif sur la moyenne du phénotype, ce qui s'écrit généralement :

$$orall i \;\; y_i = \mu + eta x_i + \epsilon_i \; ext{avec} \; \epsilon_i \overset{ ext{i.i.d}}{\sim} \mathcal{N}(0,\sigma^2)$$

· Une autre façon équivalente de l'écrire :

$$orall i \;\; y_i \,|\, x_i, \mu, eta, \sigma \; \stackrel{ ext{i.i.d}}{\sim} \mathcal{N}(\mu + eta x_i, \sigma^2)$$

## Simuler des données

· Initialisation:

On utilise un générateur de nombres pseudo-aléatoires qui peut être initialisé avec une graine (seed), ce qui est très utile pour la reproductibilité des analyses

set.seed(1866) # année de parution de l'article de Mendel fondant la génétique

· Nombre d'individus :

n <- 200

· Moyenne générale :

mu <- 50

· Génotypes (on suppose que la population est à l'équilibre d'Hardy-Weinberg) :

```
##' Genotype frequencies
## 1
    Calculate the genotype frequencies at a locus assuming the Hardy-Weinberg equilibrium
## 1
    (https://en.wikipedia.org/wiki/Hardy%E2%80%93Weinberg principle).
    Oparam maf frequency of the minor allele, a
   @return vector of genotype frequencies
##' @author Timothee Flutre
calcGenoFreq <- function(maf){</pre>
  stopifnot(is.numeric(maf), length(maf) == 1, maf >= 0, maf \leq 0.5)
  geno.freg <- c((1 - maf)^2)
                2 * (1 - maf) * maf.
                maf^2)
  names(geno.freq) <- c("AA", "Aa", "aa")</pre>
  return(geno.freg)
f < -0.3
genotypes <- sample(x=c(0,1,2), size=n, replace=TRUE, prob=calcGenoFreq(f))
```

```
head(genotypes)
## [1] 2 0 1 0 1 1
table(genotypes)
## genotypes
## 102 80 18
sum(genotypes) / (2 * n) # estimate of the MAF
## [1] 0.29
var(genotypes) # important for the estimate of beta
## [1] 0.426
```

• Effet du génotype sur le phénotype,  $\beta$  :

```
(beta <- rnorm(n=1, mean=2, sd=1))
## [1] 2.45</pre>
```

• Erreurs,  $\epsilon$  (par simplicité, on fixe  $\sigma$  à 1):

```
sigma <- 1
errors <- rnorm(n=n, mean=0, sd=sigma)</pre>
```

· Nous avons maintenant tout ce qu'il faut pour simuler les phénotypes,  $m{y}$ , via l'équation précédente :  $y_i=\mu+\beta x_i+\epsilon_i$ 

```
phenotypes <- mu + beta * genotypes + errors</pre>
```

· Il est habituel dans R d'organiser les données dans un tableau

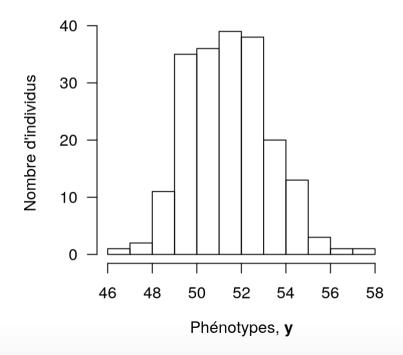
```
dat <- data.frame(x=genotypes, y=phenotypes)
head(dat)</pre>
```

```
## X y
## 1 2 52.7
## 2 0 50.2
## 3 1 53.6
## 4 0 49.1
## 5 1 51.7
## 6 1 52.9
```

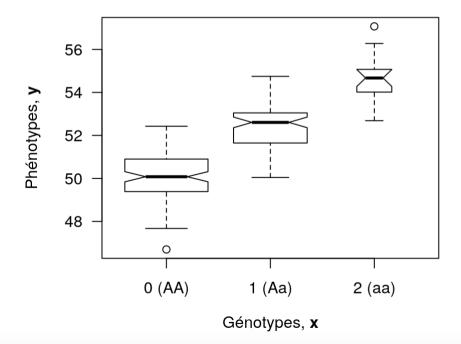
## Réaliser l'inférence

## Visualisation graphique

Distribution du phénotype



· Relation génotypes - phénotypes



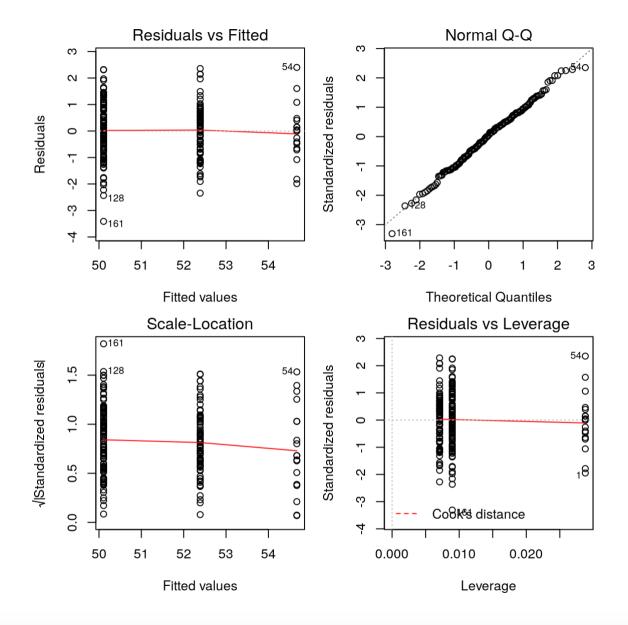
### Implémentation (facile)

 Sous R, la fonction lm implémente l'estimation par maximum de vraisemblance

```
fit <- lm(y \sim x, data=dat)
```

· Vérification des hypothèses du modèle (homoscédasticité, normalité, indépendance)

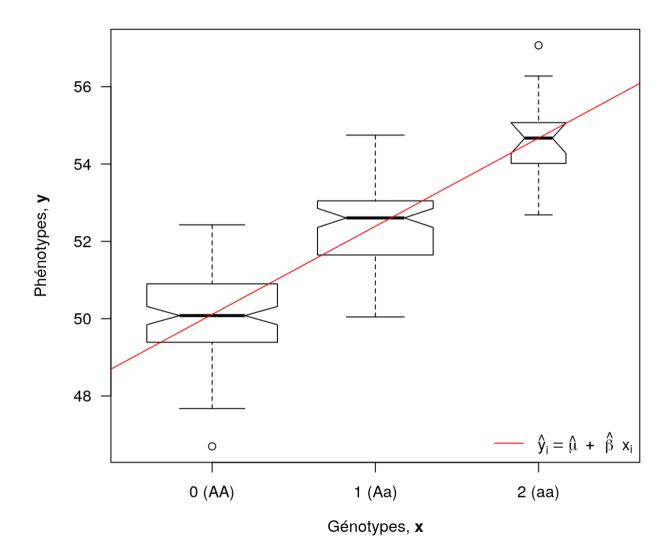
```
par(mfrow=c(2, 2), mar = c(4, 4, 2, 1))
plot(fit)
```



#### summary(fit)

```
##
## Call:
## lm(formula = y \sim x, data = dat)
##
## Residuals:
## Min 10 Median 30 Max
## -3.411 -0.701 0.055 0.688 2.399
##
## Coefficients:
##
             Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
## (Intercept) 50.1085 0.0981 511.0 <2e-16 ***
## x 2.2814 0.1125 20.3 <2e-16 ***
## ---
## Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
##
## Residual standard error: 1.04 on 198 degrees of freedom
## Multiple R-squared: 0.675, Adjusted R-squared: 0.673
## F-statistic: 411 on 1 and 198 DF, p-value: <2e-16
```

· Représentation graphique du modèle



#### Implémentation (plus difficile)

· Il faut d'abord écrire une fonction calculant l'opposé de la log-vraisemblance

```
negLogLik <- function(mu, beta, sigma){
  - sum(dnorm(x=dat$y, mean=mu + beta * dat$x, sd=sigma, log=TRUE))
}</pre>
```

• Puis demander à la fonction mle de la maximiser (en spécifiant que le paramètre  $\sigma$  ne peut pas être négatif ou nul)

#### summary(fit2)

```
## Maximum likelihood estimation
##
## Call:
## mle(minuslogl = negLogLik, start = list(mu = mean(dat$y), beta = 0,
##
      sigma = 1), method = "L-BFGS-B", nobs = nrow(dat), lower = c(-Inf,
##
      -Inf, 10^{(-6)}, upper = c(+Inf, +Inf, +Inf))
##
## Coefficients:
## Estimate Std. Error
## mu 50.11 0.0976
## beta 2.28 0.1119
## sigma 1.03 0.0515
##
## -2 log L: 579
```

# Evaluer les résultats

### Sélection de modèles

- · Evaluation de l'ajustement du modèle aux données
- · Dans notre cas de régression linéaire simple, on peut utiliser le coefficient de détermination  $\mathbb{R}^2$

summary(fit)\$r.squared

## [1] 0.675

 On peut facilement vérifier que cette valeur renvoyée par la fonction lm correspond à la formule :

$$R^2 = rac{\hat{eta}^2 \, Var(oldsymbol{x})}{\hat{eta}^2 \, Var(oldsymbol{x}) + \hat{\sigma}^2}$$
 '

```
(coefficients(fit)[2]^2 * var(dat$x)) /
  (coefficients(fit)[2]^2 * var(dat$x) + summary(fit)$sigma^2)
```

## x ## 0.674

### Estimation des paramètres

· Prenons l'exemple de  $\beta$ , comme nous avons simulé les données, nous connaissons sa vraie valeur

```
beta
```

```
## [1] 2.45
```

· Après avoir ajusté le modèle avec la fonction lm, nous pouvons récupérer l'estimation de ce paramètre  $(\hat{\beta})$ 

```
(beta.hat <- coefficients(fit)[2])</pre>
```

```
## x
## 2.28
```

- Pour comparer les deux, on définit une fonction de perte (*loss function*) reliant le paramètre ( $\beta$ ) à son estimation ( $\hat{\beta}$ )
- · On utilise une fonction quadratique, dont on prend l'espérance, ce qui donne l'erreur quadratique moyenne (*mean squared error*)

$$MSE = E\left((\hat{eta} - eta)^2
ight)$$

 On calcule sa racine carrée pour que le résultat soit dans la même unité que le paramètre

```
(rmse.beta <- sqrt((beta.hat - beta)^2))
##  x</pre>
```

## 0.172

### Prédiction de données

· On peut aussi calculer l'erreur quadratique moyenne avec les phénotypes déjà observés (on parle de *in-sample predictions*)

```
y <- phenotypes
y.hat <- (coefficients(fit)[1] + coefficients(fit)[2] * genotypes)
errors <- y - y.hat
(rmse.y <- sqrt(mean(errors^2)))</pre>
```

· On peut aussi utiliser la fonction predict

## [1] 1.03

```
errors <- phenotypes - predict(fit)
(rmse.y <- sqrt(mean(errors^2)))
## [1] 1.03</pre>
```

· Le vecteur errors correspond aux résidus du modèle

```
head(errors)
## 1 2 3 4 5 6
## -1.9859 0.0643 1.2021 -0.9601 -0.6865 0.5462
head(resid(fit))
## 1 2 3 4 5 6
## -1.9859 0.0643 1.2021 -0.9601 -0.6865 0.5462
(rmse.y <- sqrt(mean(resid(fit)^2)))</pre>
## [1] 1.03
```

- · De façon plus intéressante, on souhaiterai évaluer les prédictions phénotypiques sur  $n_{
  m new}$  nouveaux individus
- · Pour cela, on commence par simuler de nouvelles données,  $\mathcal{D}_{\mathrm{new}}=\{(y_{i,\mathrm{new}}\,|\,x_{i,\mathrm{new}})\}$ , toujours avec les *mêmes* "vraies" valeurs des paramètres,  $\Theta=\{\mu,\beta,\sigma\}$

```
set.seed(1944) # année de découverte de l'ADN comme support des gènes
n.new <- 100
x.new <- sample(x=c(0,1,2), size=n.new, replace=TRUE, prob=calcGenoFreq(f))
y.new <- mu + beta * x.new + rnorm(n=n.new, mean=0, sd=sigma)</pre>
```

· Puis on utilise les estimations des paramètres obtenues précédemment pour prédire les nouveaux phénotypes à partir des nouveaux génotypes,

$$ilde{\mathcal{D}}_{ ext{new}} = \{( ilde{y}_{i, ext{new}} = \hat{\mu} + \hat{eta} \, x_{i, ext{new}})\}$$
 (out-of-sample predictions)

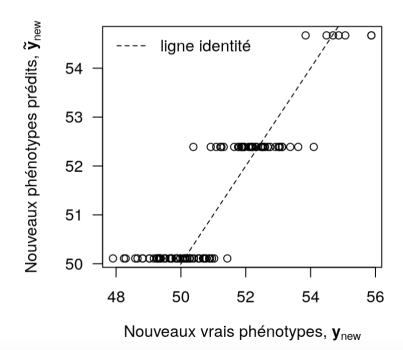
```
y.new.tilde <- (coefficients(fit)[1] + coefficients(fit)[2] * x.new)</pre>
```

· Enfin, on calcule l'erreur quadratique moyenne de prédiction

```
errors.tilde <- y.new - y.new.tilde
(rmspe <- sqrt(mean(errors.tilde^2)))</pre>
```

## [1] 0.8

#### Graphiquement:



# Perspectives

### Explorer les simulations possibles

- La simulation est un outil particulièrement utile pour explorer comment un modèle répond à des changements dans les données et les paramètres
- On pourrait par exemple avoir envie de savoir ce qui se passe si la taille de l'échantillon (n) varie
- · Idem, que se passe-t-il si, à n et  $\sigma$  fixés, on modifie eta ?

### Ré-écrire le modèle

Modèle sous forme multivariée

$$m{y} \, | \, m{x}, \mu, eta, \sigma \, \sim \mathcal{N}_n(\mathbf{1}\mu + m{x}eta, \sigma^2 I_n)$$

- · avec:
  - $oldsymbol{y}$  : vecteur de dimension n contenant les phénotypes,
  - $oldsymbol{x}$  : vecteur de dimension n contenant les génotypes,
  - ${f 1}$  : vecteur de dimension n ne contenant que des 1,
  - $I_n$  : matrice identité de dimension n imes n

· Exemple d'un vecteur aléatoire de longueur 2,  $\theta$ , distribué selon une loi Normale bivariée  $\mathcal{N}_2(\mu, \Sigma)$ :

$$m{ heta} \sim \mathcal{N}_2(m{\mu}, \Sigma) \Leftrightarrow egin{bmatrix} heta_1 \ heta_2 \end{bmatrix} \sim \mathcal{N}_2\left(egin{bmatrix} \mu_1 \ \mu_2 \end{bmatrix}, egin{bmatrix} \sigma_1^2 & \sigma_{12}^2 \ \sigma_{12}^2 & \sigma_2^2 \end{bmatrix}
ight)$$

· On fixe quelques valeurs

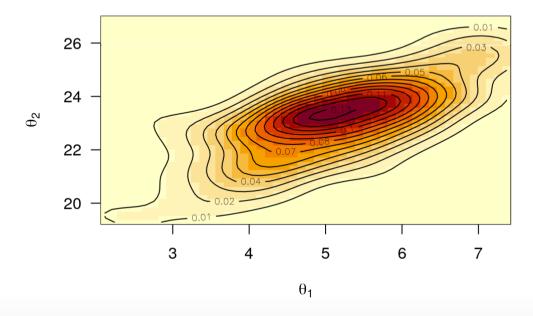
```
mu.1 <- 5
mu.2 <- 23
mu <- c(mu.1, mu.2)
var.1 <- 1
var.2 <- 2
rho <- 0.8
covar.12 <- rho * sqrt(var.1 * var.2)
Sigma <- matrix(c(var.1, covar.12, covar.12, var.2), nrow=2, ncol=2)</pre>
```

· On simule des vecteurs aléatoires avec la fonction mvrnorm du package MASS

```
theta <- mvrnorm(n=100, mu=mu, Sigma=Sigma)</pre>
dim(theta)
## [1] 100
head(theta)
##
        [,1] [,2]
## [1,] 4.00 22.7
## [2,] 6.25 23.0
## [3,] 5.35 23.8
## [4,] 5.67 22.4
## [5,] 6.57 24.1
## [6,] 4.48 23.3
```

#### · Représentation graphique

#### Echantillons d'une Normal bivariée avec $\rho$ = 0.8



## Annexe

#### print(sessionInfo(), locale=FALSE)

```
## R version 3.6.2 (2019-12-12)
## Platform: x86 64-pc-linux-gnu (64-bit)
## Running under: Ubuntu 19.10
##
## Matrix products: default
## BLAS: /usr/lib/x86 64-linux-gnu/blas/libblas.so.3.8.0
## LAPACK: /usr/lib/x86_64-linux-gnu/lapack/liblapack.so.3.8.0
##
## attached base packages:
## [1] stats4 stats graphics grDevices utils datasets methods
## [8] base
##
## other attached packages:
## [1] MASS 7.3-51.5
##
## loaded via a namespace (and not attached):
   [1] compiler 3.6.2 magrittr 1.5 tools 3.6.2 htmltools 0.4.0
   [5] yaml_2.2.1 Rcpp_1.0.3 stringi_1.4.5 rmarkdown_2.1
##
   [9] knitr_1.28 stringr_1.4.0 xfun_0.12
                                                    digest 0.6.24
##
  [13] rlang_0.4.4 evaluate_0.14
```