

Regresión logística binomial

Contents

| | | |
|-----|--|---|
| 1 | Regresión logística binaria y regresión logística binomial | 1 |
| 2 | Modelo | 2 |
| 3 | Estimación de los parámetros | 3 |
| 3.1 | La función de verosimilitud | 3 |
| 3.2 | El máximo de la función de verosimilitud | 4 |
| 4 | El máximo de la función de verosimilitud | 6 |
| 4.1 | Estimacion con R | 6 |
| 5 | Interpretación de π_i | 7 |

1 Regresión logística binaria y regresión logística binomial

```
d = read.csv("datos/MichelinNY.csv")
```

Los datos que analizamos con el modelo logit pueden estar codificados en dos maneras diferentes:

- Con ceros y unos. Este es el caso de los datos del archivo *MichelinNY.csv*, donde la variable respuesta tiene un 0 si el restaurante no está en la Guía Michelin y un 1 si está dentro de la Guía.

```
head(d)
```

```
##      InMichelin Restaurant.Name Food Decor Service Price
## 1           0  14 Wall Street   19   20      19    50
## 2           0           212    17   17      16    43
## 3           0       26 Seats   23   17      21    35
## 4           1           44    19   23      16    52
## 5           0           A    23   12      19    24
## 6           0       A.O.C.   18   17      17    36
```

Como la variable analizada, InMichelin, está codificada como 0 - 1, el modelo se denomina **regresión logística binaria**. Es el modelo que se ha estimado en las secciones precedentes.

- Con datos agrupados. En lugar de ceros y unos podemos indicar el numero de restaurantes que pertenecen a la Guía Michelin y que tienen un valor de la variable Food determinado. Por ejemplo:

```
(d1 = table(d$Food, d$InMichelin))
```

```
##
##      0  1
## 15  1  0
## 16  1  0
## 17  8  0
## 18 13  2
## 19 13  5
```

| | | | |
|----|----|----|----|
| ## | 20 | 25 | 8 |
| ## | 21 | 11 | 15 |
| ## | 22 | 8 | 4 |
| ## | 23 | 6 | 12 |
| ## | 24 | 1 | 6 |
| ## | 25 | 1 | 11 |
| ## | 26 | 1 | 1 |
| ## | 27 | 1 | 6 |
| ## | 28 | 0 | 4 |

Es decir, para Food = 20 tenemos $25 + 8 = 33$ restaurantes con esa puntuación, de los cuales 8 están en la Guía Michelin.

La probabilidad de que 8 de 33 restaurantes estén en la Guía se calcula de la siguiente manera. Definimos la variable aleatoria y_i : “número de restaurantes incluidos en la Guía para $x_i = 20$ ”. Por tanto

$$P(y_i = 8) = \binom{33}{8} \pi_i^8 (1 - \pi_i)^{33-8}$$

donde π_i es la probabilidad de que un restaurante con puntuación 20 esté en la Guía. De manera general, si Y_i : “número de restaurantes incluidos en la Guía para un x_i dado” se tiene que:

$$P(Y_i = y_i) = \binom{m_i}{y_i} \pi_i^{y_i} (1 - \pi_i)^{m_i - y_i}$$

donde m_i es el número total de restaurantes para x_i . De la variable Y_i se dice que tiene distribución binomial (de ahí que se utilice la familia binomial en glm). Algunas propiedades de la distribución binomial son:

- Los valores que puede tomar la variable son $Y_i = 0, 1, \dots, m_i$.
- La esperanza es: $E[Y_i] = m_i \cdot p_i$.
- El caso binario es un caso particular del caso binomial: $Y_i = 0, 1$, $m_i = 1$, $E[Y_i] = 1 \cdot p_i = p_i$.

2 Modelo

Los datos disponibles son

| | | |
|---------|---------|---------|
| y_1 | x_1 | m_1 |
| y_2 | x_2 | m_2 |
| \dots | \dots | \dots |
| y_n | x_n | m_n |

Al igual que el modelo binario se trabaja con probabilidades:

$$P(Y_i = y_i) = \binom{m_i}{y_i} \pi_i^{y_i} (1 - \pi_i)^{m_i - y_i}, \quad y_i = 0, 1, \dots, m_i$$

donde se adopta que:

$$\pi_i = \frac{\exp(\beta_0 + \beta_1 x_i)}{1 + \exp(\beta_0 + \beta_1 x_i)}$$

Ambas ecuaciones forman el modelo que vamos a utilizar para analizar los datos incluidos en la variable d1.

Otra forma de ver el modelo es:

$$Y_i = f(x_i) + u_i, \quad E[u_i] = 0,$$

Por tanto:

$$E[Y_i] = f(x_i)$$

Com Y_i tiene distribución binomial, su esperanza es

$$E[Y_i] = m_i \cdot \pi_i$$

lo que implica que

$$Y_i = \frac{m_i \cdot \exp(\beta_0 + \beta_1 x_i)}{1 + \exp(\beta_0 + \beta_1 x_i)} + u_i, \quad E[u_i] = 0$$

3 Estimación de los parámetros

3.1 La función de verosimilitud

Dada la muestra $\{Y_1 = y_1, Y_2 = y_2, \dots, Y_n = y_n\}$, la probabilidad de obtener dicha muestra es:

$$P(Y_1 = y_1, Y_2 = y_2, \dots, Y_n = y_n) = \prod_{i=1}^n P(Y_i = y_i) = \prod_{i=1}^n \binom{m_i}{y_i} \pi_i^{y_i} (1 - \pi_i)^{m_i - y_i}$$

Se denomina función de verosimilitud a la probabilidad de obtener la muestra:

$$L(\beta) = \prod_{i=1}^n \binom{m_i}{y_i} \pi_i^{y_i} (1 - \pi_i)^{m_i - y_i}$$

donde $\beta = [\beta_0 \quad \beta_1]^T$. El logaritmo de la verosimilitud es:

$$\begin{aligned} \log L(\beta) &= \log \prod_{i=1}^n \binom{m_i}{y_i} \pi_i^{y_i} (1 - \pi_i)^{m_i - y_i} = \sum_{i=1}^n \left(\log \binom{m_i}{y_i} + y_i \log(\pi_i) + (m_i - y_i) \log(1 - \pi_i) \right) \\ &= \sum_{i=1}^n \left(y_i \log \left(\frac{\exp(\beta_0 + \beta_1 x_i)}{1 + \exp(\beta_0 + \beta_1 x_i)} \right) + (m_i - y_i) \log \left(1 - \frac{\exp(\beta_0 + \beta_1 x_i)}{1 + \exp(\beta_0 + \beta_1 x_i)} \right) + \log \binom{m_i}{y_i} \right) \\ &= \sum_{i=1}^n \left(y_i \log \left(\frac{\exp(x_i^T \beta)}{1 + \exp(x_i^T \beta)} \right) + (m_i - y_i) \log \left(\frac{1}{1 + \exp(x_i^T \beta)} \right) + \log \binom{m_i}{y_i} \right) \\ &= \sum_{i=1}^n \left(y_i \log(\exp(\beta_0 + \beta_1 x_i)) - y_i \log(1 + \exp(\beta_0 + \beta_1 x_i)) - (m_i - y_i) \log(1 + \exp(\beta_0 + \beta_1 x_i)) + \log \binom{m_i}{y_i} \right) \\ &= \sum_{i=1}^n \left(y_i (\beta_0 + \beta_1 x_i) - m_i \log(1 + \exp(\beta_0 + \beta_1 x_i)) + \log \binom{m_i}{y_i} \right) \end{aligned}$$

En R:

```
logLb = function(beta,y,x,m){
  # beta = [beta0 beta1]
  n = length(y)
  suma = 0
  for (i in 1:n){
    suma = suma + y[i]*(beta[1] + beta[2]*x[i]) -
      m[i]*log(1 + exp(beta[1] + beta[2]*x[i])) +
      log(choose(m[i],y[i]))
  }
  return(suma)
}
```

Por ejemplo, para $\beta_0 = -12$ y $\beta_1 = 1$, la función de verosimilitud vale:

```
y = d1[,2]
x = as.integer(row.names(d1))
m = d1[,1] + d1[,2]
```

```
beta = c(-12,1)
logLb(beta,y,x,m)
```

```
##          15
## -646.0697
```

3.2 El máximo de la función de verosimilitud

Tenemos que derivar e igualar a cero:

$$\frac{\partial \log L(\beta)}{\partial \beta_0} = \sum_{i=1}^n \left(y_i - \frac{m_i \exp(\beta_0 + \beta_1 x_i)}{1 + \exp(\beta_0 + \beta_1 x_i)} \right) = \sum_{i=1}^n (y_i - m_i \pi_i)$$

$$\frac{\partial \log L(\beta)}{\partial \beta_1} = \sum_{i=1}^n \left(y_i x_i - \frac{m_i x_i \exp(\beta_0 + \beta_1 x_i)}{1 + \exp(\beta_0 + \beta_1 x_i)} \right) = \sum_{i=1}^n x_i (y_i - m_i \pi_i)$$

En forma matricial tenemos el vector gradiente:

$$\frac{\partial \log L(\beta)}{\partial \beta} = \begin{bmatrix} \frac{\partial \log L(\beta)}{\partial \beta_0} \\ \frac{\partial \log L(\beta)}{\partial \beta_1} \end{bmatrix} = \sum_{i=1}^n \begin{bmatrix} 1 \\ x_{1i} \end{bmatrix} (y_i - m_i \pi_i) = X^T (y - \pi) = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix}$$

donde X es la matriz de regresores:

$$X = \begin{bmatrix} 1 & x_1 \\ 1 & x_2 \\ \dots & \dots \\ 1 & x_n \end{bmatrix}, \quad y = \begin{bmatrix} y_1 \\ y_2 \\ \dots \\ y_n \end{bmatrix}, \quad \pi = \begin{bmatrix} m_1 \pi_1 \\ m_2 \pi_2 \\ \dots \\ m_n \pi_n \end{bmatrix}$$

De igual manera se obtiene la matriz hessiana:

$$\frac{\partial^2 \log L(\beta)}{\partial \beta \partial \beta^T} = \begin{bmatrix} \frac{\partial^2 \log L(\beta)}{\partial \beta_0^2} & \frac{\partial^2 \log L(\beta)}{\partial \beta_0 \partial \beta_1} \\ \frac{\partial^2 \log L(\beta)}{\partial \beta_0 \partial \beta_1} & \frac{\partial^2 \log L(\beta)}{\partial \beta_1^2} \end{bmatrix} = - \sum_{i=1}^n \begin{bmatrix} 1 \\ x_i \end{bmatrix} m_i \pi_i (1 - \pi_i) \begin{bmatrix} 1 & x_i \end{bmatrix} = -X^T W X$$

donde W es una matriz diagonal con

$$W_{ii} = m_i \pi_i (1 - \pi_i)$$

En R:

```
grad_logLb = function(beta,y,x,m){
  n = length(y)
  X = cbind(rep(1,n),x)
  y = matrix(y, nrow = n, ncol = 1)
  pi = matrix(0, nrow = n, ncol = 1)
  for (i in 1:n){
    pi[i,1] = m[i]*exp(beta[1] + beta[2]*x[i])/(1 + exp(beta[1] + beta[2]*x[i]))
  }
  grad = t(X) %*% (y - pi)
  return(grad)
}
```

Comprobacion:

```
beta = c(-12,1)
grad_logLb(beta, y, x, m)
```

```
##           [,1]
##      -89.81236
## x -1791.80199
```

```
hess_logLb = function(beta,x,m){
  n = length(x)
  X = cbind(rep(1,n),x)
  W = matrix(0, nrow = n, ncol = n)
  for (i in 1:n){
    pi = exp(beta[1] + beta[2]*x[i])/(1 + exp(beta[1] + beta[2]*x[i]))
    W[i,i] = m[i]*pi*(1-pi)
  }
  hess = -t(X) %*% W %*% X
  return(hess)
}
```

```
beta = c(-12,1)
hess_logLb(beta, x, m)
```

```
##           x
##      -0.1845959 -3.150987
## x -3.1509868 -54.265816
```

```
# fdHess calcula el gradiente y el hessiano numéricamente,
# mediante diferencias finitas (para comprobar)
nlme::fdHess(beta,logLb, y, x , m)
```

```
## $mean
## [1] -646.0697
##
## $gradient
## [1] -89.81236 -1791.80199
##
## $Hessian
##           [,1]      [,2]
## [1,] -0.1846241 -3.150774
```

```
## [2,] -3.1507741 -54.263073
```

4 El máximo de la función de verosimilitud

Lo vamos a calcular con `optim()`:

```
logLb_optim = function(beta,y,x,m){  
  logL = logLb(beta,y,x,m)  
  return(-logL)  
}
```

```
m1 = lm(y/m ~ x)  
beta_i = coef(m1)
```

```
mle = optim(par = beta_i, fn = logLb_optim, y, x, m, gr = NULL, method = "BFGS", hessian = TRUE, control = list("trace" = 1))
```

```
## initial value 43.461359  
## iter 2 value 38.182346  
## iter 3 value 22.941678  
## iter 4 value 19.215416  
## iter 5 value 18.773934  
## iter 6 value 18.745943  
## iter 7 value 18.745823  
## iter 8 value 18.745691  
## iter 9 value 18.745560  
## iter 9 value 18.745560  
## iter 9 value 18.745560  
## final value 18.745560  
## converged
```

```
mle$par
```

```
## (Intercept)          x  
## -10.8416674    0.5012424
```

4.1 Estimacion con R

```
y = cbind(d1[,2], d1[,1]) # la primera columna tiene que ser la de 1  
x = as.integer(row.names(d1))  
m2 = glm(y ~ x, family = binomial)  
summary(m2)
```

```
##  
## Call:  
## glm(formula = y ~ x, family = binomial)  
##  
## Deviance Residuals:  
##      Min       1Q   Median       3Q      Max   
## -1.4850  -0.7987  -0.1679   0.5913   1.5889   
##  
## Coefficients:  
##              Estimate Std. Error z value Pr(>|z|)      
## (Intercept) -10.84154    1.86236  -5.821 5.84e-09 ***  
## x           0.50124     0.08768   5.717 1.08e-08 ***  
## ---  
## Signif. codes:  0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
```

```
##
## (Dispersion parameter for binomial family taken to be 1)
##
## Null deviance: 61.427 on 13 degrees of freedom
## Residual deviance: 11.368 on 12 degrees of freedom
## AIC: 41.491
##
## Number of Fisher Scoring iterations: 4
```

5 Interpretación de π_i

En el caso de datos agrupados, π_i es el valor de la probabilidad de que un restaurante esté en la Guía Michelin dada su puntuación. Podemos representar los valores obtenidos de los datos junto a los valores estimados por el modelo para estas probabilidades:

```
prob_observada = d1[,2]/m
prob_estimada = exp(coef(m2)[1] + coef(m2)[2]*x)/(1+exp(coef(m2)[1] + coef(m2)[2]*x))
plot(x,prob_observada)
lines(x,prob_estimada, col = "red", lty = 2)
```

