

Analisi Colonial Broadcasting - Tesina

Luca Bajardi e Francesca Collini

31/07/2020

Introduzione

Il dataset che utilizziamo in questa tesina è relativo ai film mandati in onda in America nel 1992 da tre delle principali reti televisive. In particolare nel business case fornito dall'Harvard Business School, facciamo riferimento ad una di queste: la "Colonial Broadcasting Company". L'obiettivo è quello di capire quali sono le variabili e come queste interagiscono, nell'influencare gli ascolti per un determinato programma. Gli ascolti vengono espressi attraverso un valore di rating, nello specifico, ogni punto di rating rappresenta 921000 famiglie americane che stanno guardando il nostro programma. Formuliamo diversi modelli di regressione per capire quali sono le variabili migliori da utilizzare per prevedere quale sarà il rating del film al quale siamo interessati. Il problema principale legato a questo dataset, è che questo è costituito da poche osservazioni, quindi per riuscire a formulare dei modelli più accurati, è necessario ricorrere alla cross-validation.

Inizialmente proviamo a formulare dei modelli con un'unica variabile, quella del rating del programma precedente (è infatti l'unica variabile continua), anche se ovviamente non ci permette di avere una spiegazione completa. Per questo vorremmo introdurre nei modelli, altre variabili. Per capire quante e quali variabili andare ad utilizzare, applichiamo il metodo esaustivo, il metodo backward e quello forward, in modo da stabilire qual sia il modello migliore. Infine proviamo a formulare dei modelli alternativi andando ad utilizzare le regressioni ridge e lasso, per penalizzare in maniera differente i vari coefficienti delle variabili indipendenti.

Esplorazione dei dati

Carichiamo i dati leggendo il file csv e settiamo il seme del generatore pseudo-casuale così da avere i risultati sempre uguali.

```
rm(list = ls())
set.seed(1)
CBC = read.csv(file = "Dati per caso Colonial Broadcasting.csv", header=T)
attach(CBC)
```

Il dataset che stiamo analizzando ha 88 osservazioni e 16 variabili:

```
dim(CBC)
```

```
## [1] 88 16
```

Le variabili si chiamano:

```
names(CBC)
```

```
## [1] "network"      "fact"         "stars"        "month"        "day"
## [6] "rating"       "prevratings" "competition"  "bbs"          "abn"
## [11] "oct"          "dec"          "aprmay"       "mon"          "sun"
## [16] "march"
```

Vediamo l'inizio del dataset per vedere com'è fatto:

```
head(CBC)
```

```
##   network fact stars month day rating prevratings competition bbs abn oct
## 1   BBS     0     1     1   1  15.6         14.2          14.5    1  0  0
## 2   BBS     1     0     1   7  10.8         15.3          17.2    1  0  0
## 3   BBS     0     1     1   7  14.1         13.8          14.4    1  0  0
## 4   BBS     1     1     1   1  16.8         12.8          15.3    1  0  0
## 5   BBS     1     1     2   1  14.3         12.4          13.3    1  0  0
## 6   BBS     1     1     2   1  17.1         12.9          15.1    1  0  0
##   dec aprmay mon sun march
## 1   0     0   1  0     0
## 2   0     0   0  1     0
## 3   0     0   0  1     0
## 4   0     0   1  0     0
## 5   0     0   1  0     0
## 6   0     0   1  0     0
```

La variabile “network” è categorica e può assumere tre diversi valori a seconda della rete sulla quale viene trasmesso il programma. Le variabili “month” e “day” indicano rispettivamente il mese ed il giorno della settimana in cui avviene la trasmissione e quindi sono entrambe categoriche. La variabile “fact” è binaria e caratterizza i film, distinguendo quelli che sono basati su fatti reali da quelli di pura fantasia, mentre la variabile “stars” è un valore quantitativo discreto che rappresenta il numero di attori che hanno ricevuto un ingaggio superiore a \$300,000. Infine le informazioni “prevratings” e “competition” sono variabili quantitative continue che si riferiscono il primo al valore di rating del programma immediatamente precedente mandato in onda sulla stessa rete, e l’altro è una media dei valori dei rating degli altri programmi mandati in onda contemporaneamente dalle altre due reti. Utilizzando questi valori vorremo prevedere il quello del rating del film che stiamo considerando, che è espresso appunto dal valore della variabile “rating”.

Vediamo inoltre che non ci sono elementi NA (Not Available), quindi possiamo usare tutte le osservazioni nel dataset:

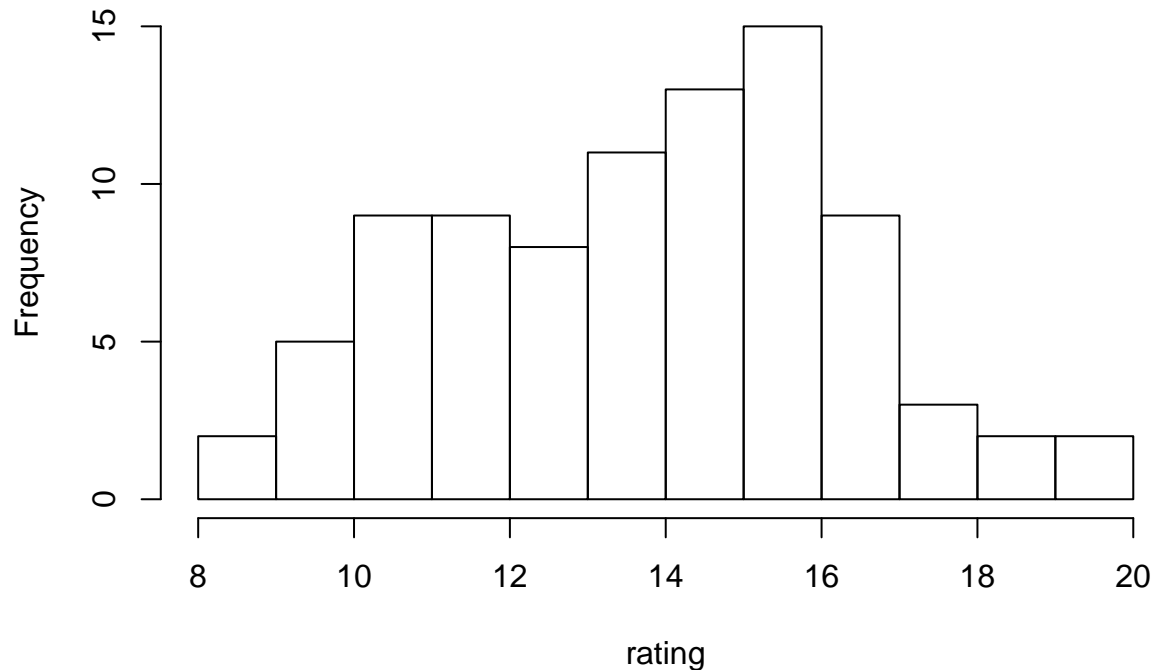
```
sum(is.na(rating))
```

```
## [1] 0
```

Possiamo anche osservare la distribuzione dei rating dei diversi film e calcolare il valore medio.

```
hist(rating)
```

Histogram of rating



```
mean(rating)
```

```
## [1] 13.81932
```

Abbiamo a disposizione un dataset piccolo, che contiene solamente 88 osservazioni che vorremmo utilizzare sia per formulare il nostro modello di previsione (training set), sia per testarlo per capire quanto siano accurate le nostre previsioni. Per questo motivo, scegliamo arbitrariamente di considerare come test set il 30% del dataset totale e come training la parte rimanente.

```
train=sample(88,88*0.7)
test=(-train)
```

Regressione su prevratings

Consideriamo il dataset CBC, ma per la formulazione del modello di regressione prendiamo solo il sottoinsieme train:

```
lm.fit=lm(rating~prevratings,data=CBC,subset=train)
```

Dal summary vediamo che “prevratings” ha un coefficiente di regressione positivo. Questo ha un senso logico, perché possiamo supporre che quando il programma precedente ha un rating più alto, le persone rimangono sul quel canale e non lo cambiano dopo la fine di quest’ultimo. Inoltre la variabile “prevratings”, avendo un p-value sufficientemente piccolo, risulta significativa.

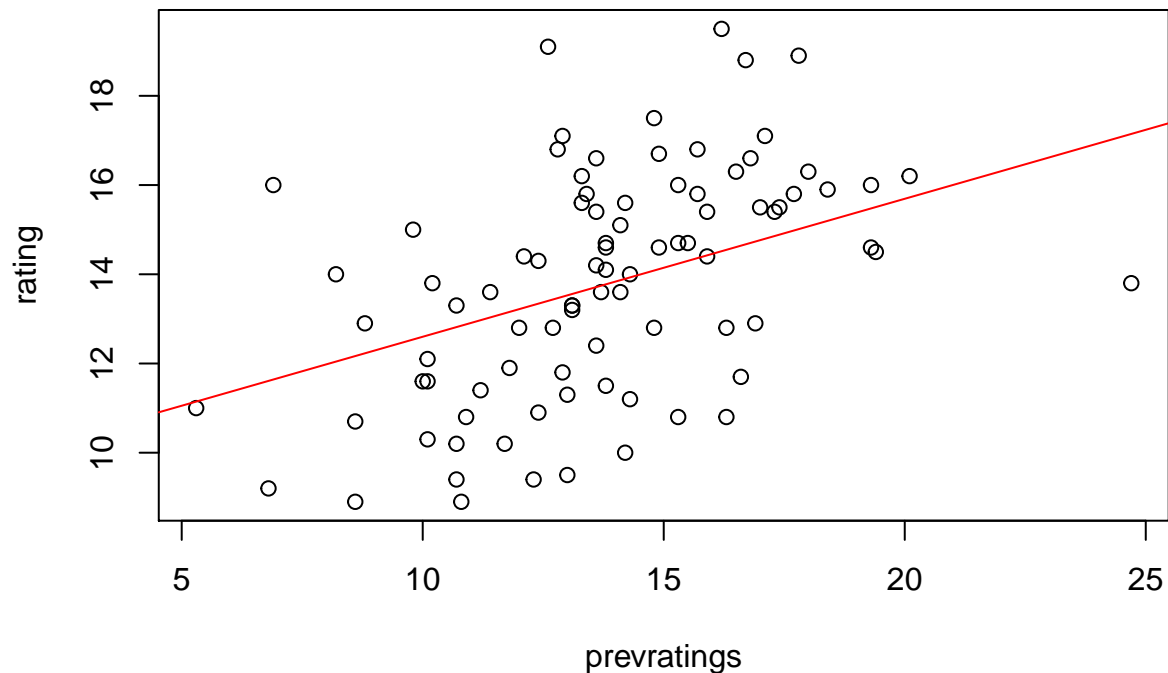
```
summary(lm.fit)
```

```
##
## Call:
## lm(formula = rating ~ prevratings, data = CBC, subset = train)
##
## Residuals:
##      Min       1Q   Median       3Q      Max
```

```
## -4.0270 -1.8332 -0.0239 1.7018 5.6967
##
## Coefficients:
##             Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
## (Intercept)  9.50644    1.26880   7.492 3.96e-10 ***
## prevratings  0.30928    0.08843   3.498 0.000899 ***
## ---
## Signif. codes:  0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
##
## Residual standard error: 2.405 on 59 degrees of freedom
## Multiple R-squared:  0.1717, Adjusted R-squared:  0.1577
## F-statistic: 12.23 on 1 and 59 DF, p-value: 0.0008991
```

Però il modello non spiega tutta la variabilità, infatti il valore R^2 è solo 0.1717, questo significa che con questo modello ne spieghiamo solo il 17%. L'obiettivo è quello di massimizzare questo valore, in modo da poter predire il valore del rating con la maggiore accuratezza possibile. Possiamo vedere anche nel `plot`, che non tutta la variabilità è rappresentata, infatti ci sono molti punti abbastanza distanti dalla retta.

```
plot(prevratings, rating)
abline(lm.fit, col="red")
```



Per capire la qualità della nostra previsione e per misurare l'errore, possiamo considerare il valore atteso del quadrato della deviazione, il MSE (Mean Square Error):

$$\mathbf{E}[(y - \hat{y})^2] = \mathbf{E}^2[(f(x_0) - \hat{f}(x_0))] + (\sigma_\epsilon)^2 + \text{Var}[\hat{f}(x_0)]$$

dove $y = f(x_0) + \epsilon$ e $\hat{y} = \hat{f}(x_0)$. Il primo termine del MSE viene chiamato bias, il secondo è l'errore irriducibile dovuto al rumore intrinseco presente nel sistema, mentre l'ultimo termine rappresenta la varianza.

Possiamo calcolare il MSE andando a validare questo modello sul sottoinsieme di test. L'errore viene definito come il rapporto tra la somma, su tutte le osservazioni presenti nel test set, del quadrato dell'errore sulle singole osservazioni, diviso per la cardinalità dell'insieme test.

$$MSE = \frac{\sum_{i \in test} (y_i - \hat{y}_i)^2}{|test|}$$

```
mean((rating~predict(lm.fit,CBC))[test]^2)
```

```
## [1] 3.489889
```

Il MSE di un solo modello non è una misura molto indicativa perchè non abbiamo termini di paragone, quindi dobbiamo calcolarlo anche per altri modelli e valutare quale sia il migliore andando a selezionare quello con l'errore più piccolo.

Regressione su poly(prevratings,pwr)

Creiamo dei modelli utilizzando polinomi di vario grado attraverso la funzione `poly(prevratings,pwr)` (la funzione restituisce una matrice le cui colonne sono a base di polinomi ortogonali, il che significa in sostanza che ogni colonna è una combinazione lineare delle variabili `prevratings`, `prevratings^2`, `prevratings^3`, ...).

```
potenze = c(1,2,3,4,5,6,10,16)
ma<-matrix(nrow=3,ncol=length(potenze)+1)
ma[1,1]="potenze"
ma[2,1]="MSE"
ma[3,1]="R^2"
ma[1,2:(length(potenze)+1)]=potenze
for (i in 2:(length(potenze)+1)){
  pwr = potenze[i-1]
  lm.fit_n= lm(rating~poly(prevratings,pwr),data=CBC,subset=train)
  ma[2,i] = mean((rating~predict(lm.fit_n,CBC))[test]^2)
  ma[3,i] = summary(lm.fit_n)$r.squared
}
ma
```

```
##      [,1]      [,2]      [,3]      [,4]
## [1,] "potenze" "1"      "2"      "3"
## [2,] "MSE"     "3.48988949215875" "3.40803317223908" "3.00023440403935"
## [3,] "R^2"     "0.171735197954496" "0.182204759148948" "0.221588843537537"
##      [,5]      [,6]      [,7]
## [1,] "4"      "5"      "6"
## [2,] "2.98907487503185" "3.04344984117172" "3.04871129507942"
## [3,] "0.221661737092959" "0.234124907653851" "0.24364159603347"
##      [,8]      [,9]
## [1,] "10"     "16"
## [2,] "3.29680579710106" "2.94827384158756"
## [3,] "0.268680720924043" "0.356467229038818"
```

Possiamo vedere che, aumentando il grado dei polinomi in funzione di `prevratings`, non diminuisce di molto il MSE, ma aumenta l' R^2 , questo significa che stiamo facendo overfitting. Infatti con l'aumento della complessità del modello, R^2 nel sample, mal che vada rimane lo stesso perchè sto aggiungendo altri modi per spiegare la variabile che voglio prevedere, quando però andiamo a testare il modello su un insieme esterno, questo non è necessariamente vero perchè, anche se sta diminuendo il bias, contemporaneamente sta aumentando la varianza.

Regressione con cross-validation

Poichè il nostro dataset è piuttosto piccolo per eseguire un test indipendente, può essere seguita la strategia della cross-validation. La tecnica consiste nel suddividere in K sottoinsiemi disgiunti i nostri dati, per ogni

sottoinsieme k -esimo formulare un modello e calcolare il MSE_k utilizzando i dati di partenza andando però ad escludere il sottoinsieme in questione, testare poi questo modello su quest'ultimo sottoinsieme. Così ogni sottoinsieme svolge $K - 1$ volte il ruolo di training set e esattamente una volta il ruolo di test set. Il MSE complessivo del modello è:

$$CV(K) = \sum_{k=1}^K \frac{n_k}{n} MSE_k.$$

Leave-One-Out Cross Validation

Nel caso limite in cui $K = n$, utilizziamo l'approccio Leave-One-Out Cross Validation. Utilizzando quindi $K = 88$, calcoliamo l'errore di ogni osservazione per la previsione fatta andando ad escludere quel dato e poi facendo semplicemente la media su tutti i valori.

```
sample.size = length(prevratings) #decido la dimensione del campione
cv.errors = numeric(sample.size) #prealloco un vettore di zeri
for (k in 1:sample.size){
  fitCV=lm(rating~prevratings,data=CBC[-k,]) #tolgo un'osservazione
  cv.errors[k]= ((rating-predict(fitCV,CBC))[k])^2
  #vado a prevedere solo per quell'osservazione
}
mean(cv.errors) #calcolo la media
```

```
## [1] 5.169679
```

Un metodo alternativo è quello di utilizzare la funzione `cv.glm` dove nel vettore `delta` troviamo, nella prima posizione, lo stesso risultato precedente e nella seconda un termine che è leggermente migliorato perchè tiene conto dei possibili errori di approssimazione.

```
library(boot)
glm.fit=glm(rating~prevratings,data=CBC)
cv.err=cv.glm(CBC,glm.fit) #passa la struttura dati e il modello
cv.err$K
```

```
## [1] 88
```

```
cv.err$delta
```

```
## [1] 5.169679 5.168069
```

Proviamo con polinomi con grado massimo diverso

```
cv.error=rep(0,8)
j=1
for (i in potenze){ #LOOCV su 8 modelli
  glm.fit=glm(rating~poly(prevratings,i),data=CBC)
  cv.error[j]=cv.glm(CBC,glm.fit)$delta[1]
  j=j+1
}
cv.error
```

```
## [1] 5.169679e+00 5.436229e+00 5.102095e+00 6.600530e+00 1.584170e+01
```

```
## [6] 7.520611e+01 1.080856e+05 2.239373e+11
```

Possiamo concludere quindi che non è detto che nel momento in cui aumentiamo il grado del polinomio, automaticamente diminuisce il valore dell'errore perchè visto che la funzione è molto oscillante stiamo introducendo del rumore.

K-fold Cross Validation

Proviamo inoltre ad utilizzare la K-fold Cross Validation. In questo caso specifico, dividiamo l'intero dataset in $K = 10$ sottogruppi ed ogni volta utilizziamo un sottoinsieme diverso che svolge la funzione di test set. Questo metodo risulta computazionalmente più veloce perchè andiamo a confrontare meno osservazioni, ma le conclusioni che possiamo trarre sono le stesse.

```
set.seed(20)
#divido in 10 gruppi che ovviamente non saranno della stessa cardinalità
cv.error.10=rep(0,8)
j=1
for (i in potenze){
  glm.fit=glm(rating~poly(prevratings,i),data=CBC)
  cv.error.10[j]=cv.glm(CBC,glm.fit,K=10)$delta[1]
  j=j+1
}
cv.error.10

## [1] 5.213349e+00 5.520776e+00 5.404177e+00 1.030911e+01 6.671234e+01
## [6] 6.876285e+02 9.527265e+05 2.486979e+12

detach(CBC)
```

Regressione con più variabili

Questi diversi esperimenti, probabilmente ci suggeriscono che utilizzare solo la variabile “prevratings” potrebbe non essere sufficiente per prevedere il rating. Con la funzione `regsubsets` possiamo, in modo automatico, selezionare quelle variabili che sono le migliori per predire la variabile risposta, quando viene fissato il numero totale di variabili da utilizzare nel modello. Il termine “migliore” si riferisce alle prestazioni, guardando la RSS. Utilizziamo il dataset eliminando la colonna che contiene la media dei rating di programmi mandati in onda dalle reti concorrenti. Infatti, questo valore è molto difficile da prevedere e potrebbe essere rischioso includerlo nel modello in quanto potrebbe portare a conclusioni sbagliate.

```
library(leaps)
CBC$network=as.factor(CBC$network)
CBC$day=as.factor(CBC$day)
CBC$month=as.factor(CBC$month)
CBCr=CBC[, 1:7]
regfit.full=regsubsets(rating~.,CBCr,nvmax=15)
summary(regfit.full)

## Subset selection object
## Call: regsubsets.formula(rating ~ ., CBCr, nvmax = 15)
## 15 Variables (and intercept)
##               Forced in Forced out
## networkBBS      FALSE      FALSE
## networkCBC       FALSE      FALSE
## fact             FALSE      FALSE
## stars            FALSE      FALSE
## month2           FALSE      FALSE
## month3           FALSE      FALSE
## month4           FALSE      FALSE
## month5           FALSE      FALSE
## month9           FALSE      FALSE
## month10          FALSE      FALSE
## month11          FALSE      FALSE
## month12          FALSE      FALSE
```

```
## day2          FALSE      FALSE
## day7          FALSE      FALSE
## prevratings   FALSE      FALSE
## 1 subsets of each size up to 15
## Selection Algorithm: exhaustive
##              networkBBS networkCBC fact stars month2 month3 month4 month5
## 1 ( 1 ) " "          " "          " " " " " " " " " "
## 2 ( 1 ) " "          " "          "*" " " " " " " " "
## 3 ( 1 ) " "          " "          "*" " " " " " " " "
## 4 ( 1 ) " "          " "          "*" "*" " " " " " "
## 5 ( 1 ) " "          " "          "*" "*" " " " " " "
## 6 ( 1 ) "*"          " "          "*" "*" " " " " " "
## 7 ( 1 ) "*"          " "          "*" "*" " " " " " "
## 8 ( 1 ) "*"          " "          "*" "*" " " " " "*" "
## 9 ( 1 ) "*"          "*"          "*" "*" " " " " "*" "
## 10 ( 1 ) "*"         "*"          "*" "*" "*" " " "*" "
## 11 ( 1 ) "*"         "*"          "*" "*" "*" " " "*" "*"
## 12 ( 1 ) "*"         "*"          "*" "*" "*" " " "*" "*"
## 13 ( 1 ) "*"         "*"          "*" "*" "*" "*" "*" "*"
## 14 ( 1 ) "*"         "*"          "*" "*" "*" "*" "*" "*"
## 15 ( 1 ) "*"         "*"          "*" "*" "*" "*" "*" "*"
##              month9 month10 month11 month12 day2 day7 prevratings
## 1 ( 1 ) " "          " "          " "          " " " " " " "*"
## 2 ( 1 ) " "          " "          " "          " "          " " " " "*"
## 3 ( 1 ) " "          " "          " "          "*"          " " " " "*"
## 4 ( 1 ) " "          " "          " "          "*"          " " " " "*"
## 5 ( 1 ) " "          "*"          " "          "*"          " " " " "*"
## 6 ( 1 ) " "          "*"          " "          "*"          " " " " "*"
## 7 ( 1 ) " "          "*"          " "          "*"          "*" " " " "*"
## 8 ( 1 ) " "          "*"          " "          "*"          "*" " " " "*"
## 9 ( 1 ) " "          "*"          " "          "*"          "*" " " " "*"
## 10 ( 1 ) " "         "*"          " "          "*"          "*" " " " "*"
## 11 ( 1 ) " "         "*"          " "          "*"          "*" " " " "*"
## 12 ( 1 ) " "         "*"          " "          "*"          "*" "*" " " "*"
## 13 ( 1 ) " "         "*"          " "          "*"          "*" "*" " " "*"
## 14 ( 1 ) "*"         "*"          " "          "*"          "*" "*" " " "*"
## 15 ( 1 ) "*"         "*"          "*"          "*"          "*" "*" " " "
```

```
reg.summary=summary(regfit.full)
```

Analizzando il risultato, osserviamo che quando fissiamo ad uno il numero di predittori, la variabile migliore che possiamo utilizzare è appunto “prevratings”, man mano che aumentiamo questo numero a questa si aggiungono tutte le altre, quando raggiungiamo il numero totale dei predittori che è uguale a 15.

```
reg.summary$rsq
```

```
## [1] 0.2343602 0.3151354 0.3720341 0.4084705 0.4308890 0.4482936 0.4677308
## [8] 0.4825366 0.4910659 0.5013114 0.5080425 0.5122618 0.5135400 0.5137033
## [15] 0.5137192
```

Osserviamo che, come ci potremmo aspettare, l’ R^2 aumenta in maniera monotona all’aumentare delle variabili, ma questo non necessariamente ci fa concludere che il modello in cui utilizziamo un maggior numero di variabili è il migliore. Per questo sarebbe opportuno considerare altri indici, al fine di capire qual è il giusto equilibrio tra numero di variabili e proporzione della variabilità spiegata.

Poichè stiamo confrontando modelli con un numero diverso di variabili, guardare solamente l’ R^2 , potrebbe

non fornirci un'informazione utile o quanto meno potremmo avere in mano un'informazione piuttosto distorta. A questo proposito sarebbe utile utilizzare altri indici come l' R_{adj}^2 , il C_p e il BIC :

- R_{adj}^2 è definito dal seguente rapporto dove q rappresenta il numero di variabili ed n il numero di osservazioni:

$$R_{adj}^2 = 1 - \frac{\frac{SSR}{(n-q-1)}}{\frac{TSS}{(n-1)}}.$$

Osserviamo che al crescere di q il denominatore diminuisce e se non scende abbastanza velocemente anche il numeratore, il modello potrebbe essere peggiore quando quelle variabili stanno spiegando del rumore. Quindi mentre quando aggiungiamo delle variabili l' R^2 non può diminuire, può succedere per l' R_{adj}^2 .

- C_p , definendo $p = q + 1$ il numero totale di coefficienti dato dalla somma del numero di variabili e la costante. Definiamo inoltre σ^2 la stima dell'errore della varianza e n sempre il numero di osservazioni, il Mallows's C_p , si calcola come:

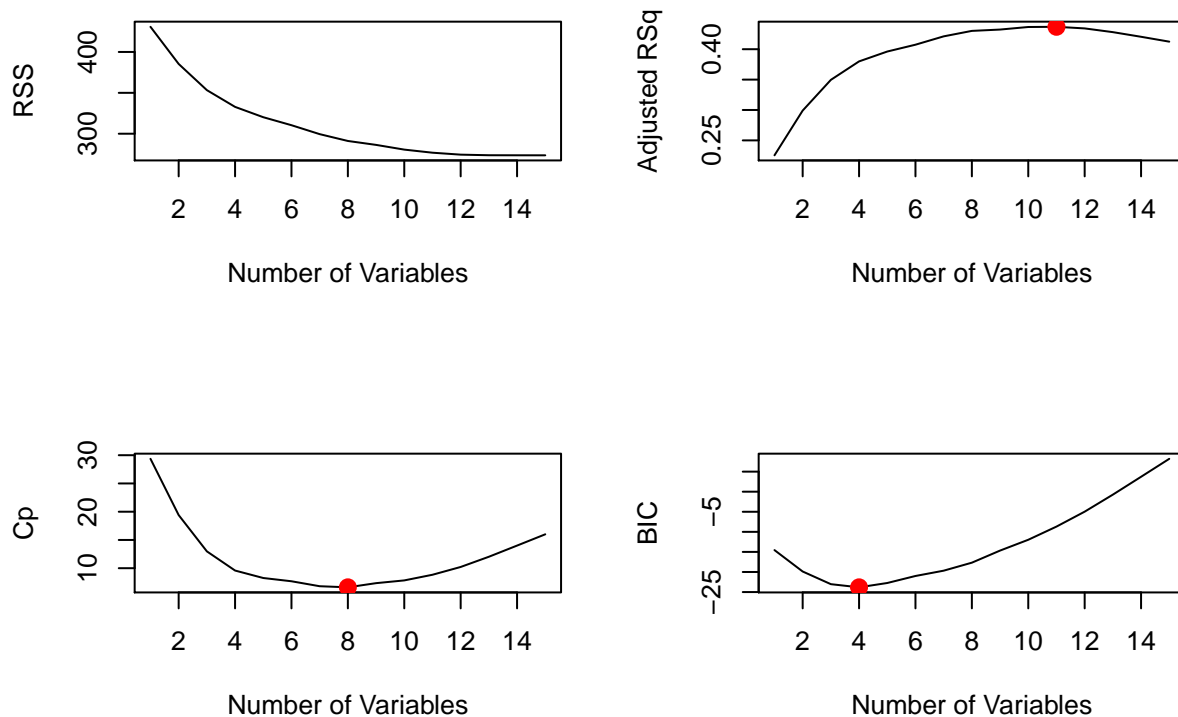
$$C_p = \frac{1}{n}(SSR + 2p\sigma^2)$$

- BIC (Bayesian Information Criterion) è definito da:

$$BIC = \frac{1}{n}(SSR + \log(n)p\sigma^2)$$

In questo caso l'uso di più variabili viene penalizzato maggiormente rispetto all'indice C_p perchè in genere il logaritmo del numero delle variabili tende ad essere più grande di due. Per questo motivo quindi in linea di principio, utilizzando questo parametro, otterremo un modello più conservativo.

```
par(mfrow=c(2,2))
plot(reg.summary$rss,xlab="Number of Variables",ylab="RSS",type="l")
plot(reg.summary$adjr2,xlab="Number of Variables",ylab="Adjusted RSq",type="l")
t=which.max(reg.summary$adjr2)
points(t,reg.summary$adjr2[t], col="red",cex=2,pch=20)
plot(reg.summary$cp,xlab="Number of Variables",ylab="Cp",type='l')
q=which.min(reg.summary$cp)
points(q,reg.summary$cp[q],col="red",cex=2,pch=20)
u=which.min(reg.summary$bic)
plot(reg.summary$bic,xlab="Number of Variables",ylab="BIC",type='l')
points(u,reg.summary$bic[u],col="red",cex=2,pch=20)
```



Analizzando i diversi grafici ed andando ad individuare i punti di ottimo (il massimo per l' R_{adj}^2 e il minimo per gli altri due indici), osserviamo che secondo l' R_{adj}^2 il numero ottimale di variabili da considerare è 11, scegliendo il criterio del C_p , invece questo scende ad 8, ed si riduce infine a 4, andando a guardare il BIC .

Forward/Backward Stepwise Selection

Metodi alternativi per selezionare il miglior sottoinsieme di variabili, sono quelli della selezione greedy. Possiamo procedere o con la selezione “forward”, dove partiamo dal modello nullo ed aggiungiamo una variabile per volta, scegliendo quella che porta al più alto miglioramento, oppure con la selezione “backward”, in cui seguiamo la strada al contrario, quindi partiamo dal modello completo andando ad eliminare una variabile alla volta.

```
regfit.fwd=regsubsets(rating~.,data=CBCr,nvmax=15,method="forward")
summary(regfit.fwd)
```

```
## Subset selection object
## Call: regsubsets.formula(rating ~ ., data = CBCr, nvmax = 15, method = "forward")
## 15 Variables (and intercept)
##           Forced in Forced out
## networkBBS      FALSE      FALSE
## networkCBC      FALSE      FALSE
## fact            FALSE      FALSE
## stars           FALSE      FALSE
## month2          FALSE      FALSE
## month3          FALSE      FALSE
## month4          FALSE      FALSE
## month5          FALSE      FALSE
## month9          FALSE      FALSE
## month10         FALSE      FALSE
## month11         FALSE      FALSE
## month12         FALSE      FALSE
## day2            FALSE      FALSE
```

```

## day7                FALSE      FALSE
## prevratings         FALSE      FALSE
## 1 subsets of each size up to 15
## Selection Algorithm: forward
##      networkBBS networkCBC fact stars month2 month3 month4 month5
## 1 ( 1 ) " "      " "      " " " " " " " " " "
## 2 ( 1 ) " "      " "      "*" " " " " " " " "
## 3 ( 1 ) " "      " "      "*" " " " " " " " "
## 4 ( 1 ) " "      " "      "*" "*" " " " " " "
## 5 ( 1 ) " "      " "      "*" "*" " " " " " "
## 6 ( 1 ) "*"      " "      "*" "*" " " " " " "
## 7 ( 1 ) "*"      " "      "*" "*" " " " " " "
## 8 ( 1 ) "*"      " "      "*" "*" " " " " "*" "
## 9 ( 1 ) "*"      "*"      "*" "*" " " " " "*" "
## 10 ( 1 ) "*"      "*"      "*" "*" "*" " " "*" "
## 11 ( 1 ) "*"      "*"      "*" "*" "*" " " "*" "*"
## 12 ( 1 ) "*"      "*"      "*" "*" "*" " " "*" "*"
## 13 ( 1 ) "*"      "*"      "*" "*" "*" "*" "*" "*"
## 14 ( 1 ) "*"      "*"      "*" "*" "*" "*" "*" "*"
## 15 ( 1 ) "*"      "*"      "*" "*" "*" "*" "*" "*"

##      month9 month10 month11 month12 day2 day7 prevratings
## 1 ( 1 ) " "      " "      " "      " " " " " " "*"
## 2 ( 1 ) " "      " "      " "      " "      " " " " "*"
## 3 ( 1 ) " "      " "      " "      "*"      " " " " "*"
## 4 ( 1 ) " "      " "      " "      "*"      " " " " "*"
## 5 ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      " " " " "*"
## 6 ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      " " " " "*"
## 7 ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      "*" " " " "*"
## 8 ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      "*" " " " "*"
## 9 ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      "*" " " " "*"
## 10 ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      "*" " " " "*"
## 11 ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      "*" " " " "*"
## 12 ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      "*" "*" " " "*"
## 13 ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      "*" "*" " " "*"
## 14 ( 1 ) "*"      "*"      " "      "*"      "*" "*" " " "*"
## 15 ( 1 ) "*"      "*"      "*"      "*"      "*" "*" " " "*"

```

```

regfit.bwd=regsubsets(rating~.,data=CBcR,nvmax=15,method="backward")
summary(regfit.bwd)

```

```

## Subset selection object
## Call: regsubsets.formula(rating ~ ., data = CBcR, nvmax = 15, method = "backward")
## 15 Variables (and intercept)
##      Forced in Forced out
## networkBBS      FALSE      FALSE
## networkCBC      FALSE      FALSE
## fact            FALSE      FALSE
## stars           FALSE      FALSE
## month2          FALSE      FALSE
## month3          FALSE      FALSE
## month4          FALSE      FALSE
## month5          FALSE      FALSE
## month9          FALSE      FALSE
## month10         FALSE      FALSE
## month11         FALSE      FALSE

```

```

## month12          FALSE      FALSE
## day2             FALSE      FALSE
## day7             FALSE      FALSE
## prevratings      FALSE      FALSE
## 1 subsets of each size up to 15
## Selection Algorithm: backward
##
##      networkBBS networkCBC fact stars month2 month3 month4 month5
## 1  ( 1 ) " "      " "      " " " " " " " " " "
## 2  ( 1 ) " "      " "      "*" " " " " " " " "
## 3  ( 1 ) " "      " "      "*" " " " " " " " "
## 4  ( 1 ) " "      " "      "*" "*" " " " " " "
## 5  ( 1 ) " "      " "      "*" "*" " " " " " "
## 6  ( 1 ) "*"      " "      "*" "*" " " " " " "
## 7  ( 1 ) "*"      " "      "*" "*" " " " " " "
## 8  ( 1 ) "*"      " "      "*" "*" " " " " "*" "
## 9  ( 1 ) "*"      "*"      "*" "*" " " " " "*" "
## 10 ( 1 ) "*"      "*"      "*" "*" "*" " " "*" "
## 11 ( 1 ) "*"      "*"      "*" "*" "*" " " "*" "*"
## 12 ( 1 ) "*"      "*"      "*" "*" "*" " " "*" "*"
## 13 ( 1 ) "*"      "*"      "*" "*" "*" "*" "*" "*"
## 14 ( 1 ) "*"      "*"      "*" "*" "*" "*" "*" "*"
## 15 ( 1 ) "*"      "*"      "*" "*" "*" "*" "*" "*"
##
##      month9 month10 month11 month12 day2 day7 prevratings
## 1  ( 1 ) " "      " "      " "      " " " " " " "*"
## 2  ( 1 ) " "      " "      " "      " "      " " " " "*"
## 3  ( 1 ) " "      " "      " "      "*"      " " " " "*"
## 4  ( 1 ) " "      " "      " "      "*"      " " " " "*"
## 5  ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      " " " " "*"
## 6  ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      " " " " "*"
## 7  ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      "*" " " "*"
## 8  ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      "*" " " "*"
## 9  ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      "*" " " "*"
## 10 ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      "*" " " "*"
## 11 ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      "*" " " "*"
## 12 ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      "*" "*" "*"
## 13 ( 1 ) " "      "*"      " "      "*"      "*" "*" "*"
## 14 ( 1 ) "*"      "*"      " "      "*"      "*" "*" "*"
## 15 ( 1 ) "*"      "*"      "*"      "*"      "*" "*" "*"

```

Possiamo notare che applicando i metodi di selezione `exhaustive`, `forward` e `backward` otteniamo la selezione delle variabili nello stesso ordine.

A questo punto andiamo a selezionare il modello migliore, andando a trovare quali e quante sono le variabili che ci permettono di prevedere meglio la variabile target. Per questo scopo, andiamo ad utilizzare di nuovo la k-folds cross validation con $k = 10$.

```

k=10
predict.regsubsets=function(object,newdata,id,...){
  form=as.formula(object$call[[2]])
  mat=model.matrix(form,newdata)
  coefi=coef(object,id=id)
  xvars=names(coefi)
  mat[,xvars]%%coefi
}
set.seed(1)

```

```

folds=sample(1:k,nrow(CBCr),replace=TRUE)
cv.errors=matrix(NA,k,15, dimnames=list(NULL, paste(1:15)))
for(j in 1:k){
  best.fit=regsubsets(rating~.,data=CBCr[folds!=j,],nvmax=15)
  for(i in 1:15){
    pred=predict(best.fit,CBCr[folds==j,],id=i)
    cv.errors[j,i]=mean( (CBCr$rating[folds==j]-pred)^2)
  }
}
mean.cv.errors=apply(cv.errors,2,mean)
mean.cv.errors

```

```

##      1      2      3      4      5      6      7      8
## 5.696734 5.591594 5.262762 5.454305 5.915720 6.048468 5.896608 5.974218
##      9     10     11     12     13     14     15
## 5.745726 5.398565 5.367793 5.275533 5.217724 5.273894 5.297743

```

```

min=which.min(mean.cv.errors)
min

```

```

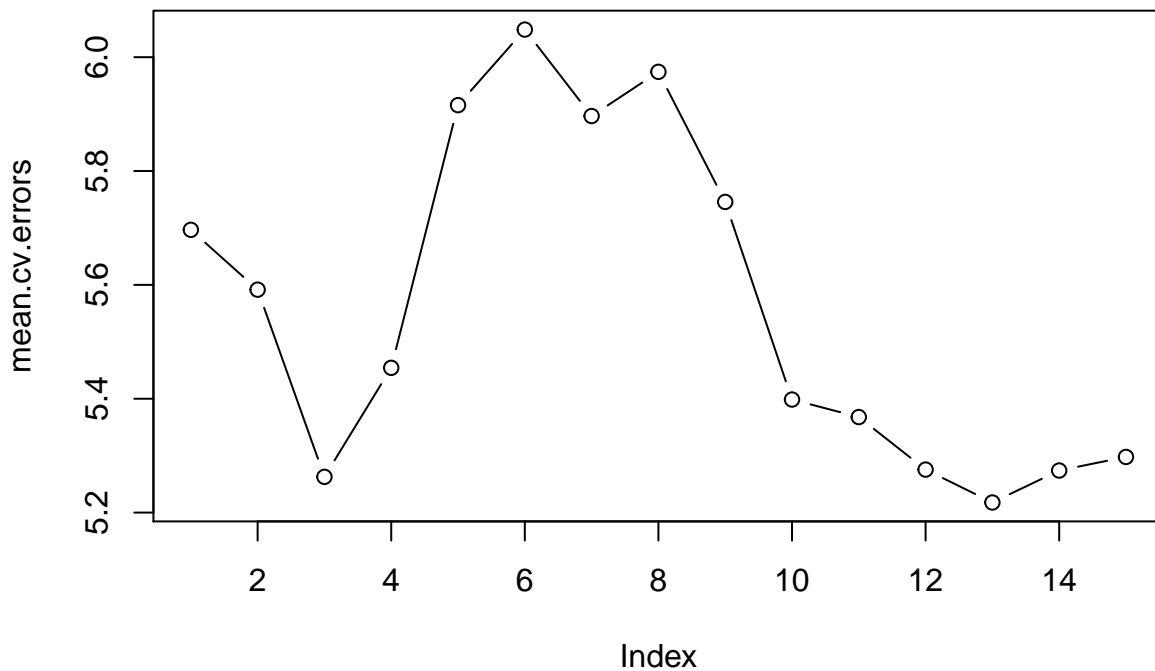
## 13
## 13

```

```

par(mfrow=c(1,1))
plot(mean.cv.errors,type='b')

```



```

reg.best=regsubsets(rating~.,data=CBCr[train,], nvmax=15)

```

```

reg.best.coef = coef(reg.best,min)
reg.best.coef

```

```

## (Intercept) networkBBS networkCBC      fact      stars      month2
## 12.3360770 -2.6882014 -1.6412308  1.8859730  0.6808614  2.0583847
##      month3      month4      month5      month10      month12      day2
##  0.2895100 -0.8872171 -0.5543490 -1.0922085  1.4942182 -2.8997869

```

```
##          day7 prevratings
## -0.7537724  0.1734741

reg.best.pred=predict(best.fit,CBCr[test,],id=min)
mean( (CBCr$rating[test]-reg.best.pred)^2)

## [1] 2.301024
```

Regressione Ridge e Lasso

Nel metodo dei minimi quadrati standard, la funzione obiettivo da minimizzare è:

$$\sum_{k=1}^n \left(Y_k - \sum_{j=0}^q \beta_j X_j^{(k)} \right)^2.$$

Quando però vogliamo diminuire il valore della varianza e quindi penalizzare i coefficienti di regressione troppo grandi per cercare di evitare l'overfitting, possiamo introdurre dei termini aggiuntivi alla funzione obiettivo:

- Un metodo è quello che viene chiamato **Ridge Regression**. In questo caso, la funzione obiettivo diventa:

$$\sum_{k=1}^n \left(Y_k - \sum_{j=0}^q \beta_j X_j^{(k)} \right)^2 + \lambda \sum_{j=1}^q \beta_j^2.$$

Andando ad aumentare il coefficiente di penalità λ , facciamo tendere al limite i coefficienti a zero, facendo crescere il bias, ma eventualmente riducendo il MSE a causa della riduzione della varianza. Con questa norma sui coefficienti andiamo a penalizzare di più i coefficienti grandi.

- Un metodo alternativo è quello della **Lasso Regression**. In questo caso anzichè essere penalizzati con la norma L_2 come nel caso precedente, i coefficienti vengono penalizzati con la norma L_1 , quindi la formula diventa:

$$\sum_{k=1}^n \left(Y_k - \sum_{j=0}^q \beta_j X_j^{(k)} \right)^2 + \lambda \sum_{j=1}^q |\beta_j|.$$

In questo caso penalizziamo maggiormente i β più piccoli, infatti il comportamento di questa regressione è molto simile alla precedente, però adesso riusciamo direttamente a fare la selezione di variabili perchè alcuni coefficienti vanno a zero anche quando la penalità λ assume un valore finito.

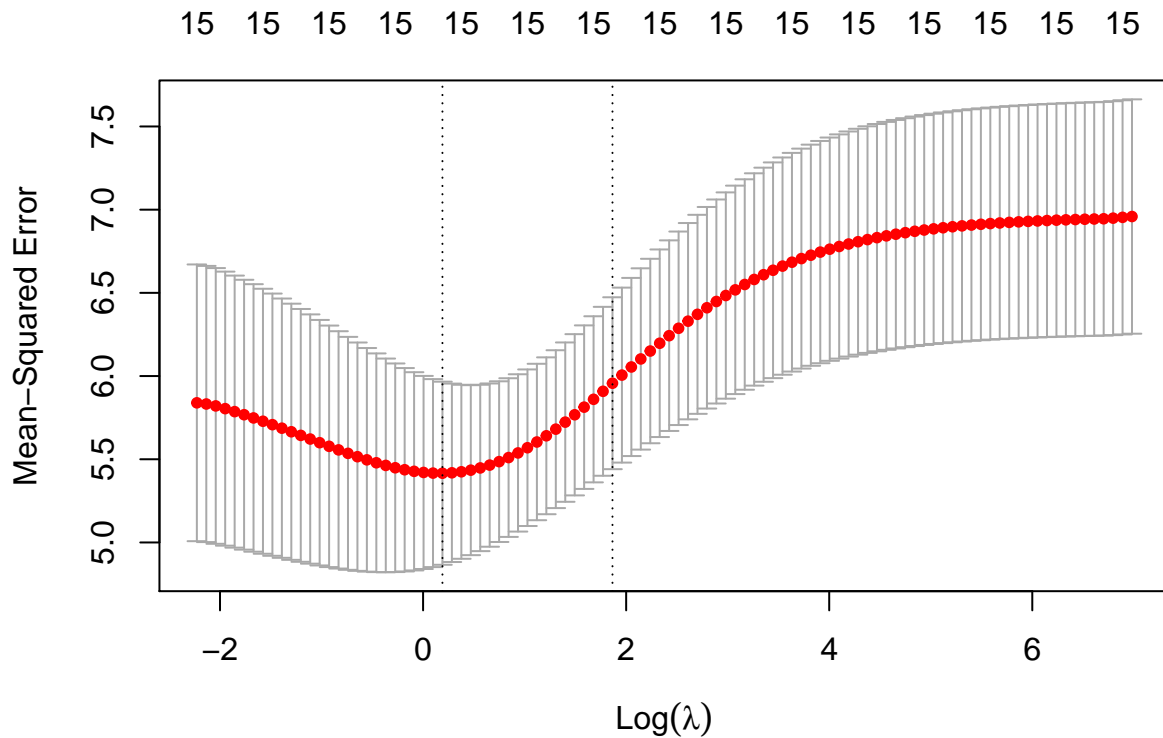
```
library(glmnet)
x=model.matrix(rating~.,CBCr)[,-1] #tolgo l'intercetta perchè Beta_0 non va penalizzato
y=CBCr$rating
y.test=y[test]
grid=10^seq(10,-2,length=100)
```

La funzione `glmnet` della package `glmnet` implementa sia i due casi estremi di regressione ridge e lasso, sia regressioni intermedie a seconda del valore di α che fissiamo.

Regressione ridge

Inizialmente otteniamo 100 diversi modelli di regressione, uno per ogni valore di λ , e poi tramite la cross-validation scegliamo il miglior valore di λ .

```
ridge.mod=glmnet(x[train,],y[train],alpha=0,lambda=grid)
set.seed(1)
cv.out=cv.glmnet(x[train,],y[train],alpha=0)
plot(cv.out)
```



Osservando il grafico del MSE in funzione di $\log(\lambda)$, vediamo che c'è una certa variabilità nella stima e che il miglior valore di λ per la regressione ridge è:

```
bestlam=cv.out$lambda.min
bestlam
```

```
## [1] 1.210081
```

Utilizzando il valore migliore di λ otteniamo che il MSE è:

```
ridge.pred=predict(ridge.mod,s=bestlam,newx=x[test,])
mean((ridge.pred-y.test)^2)
```

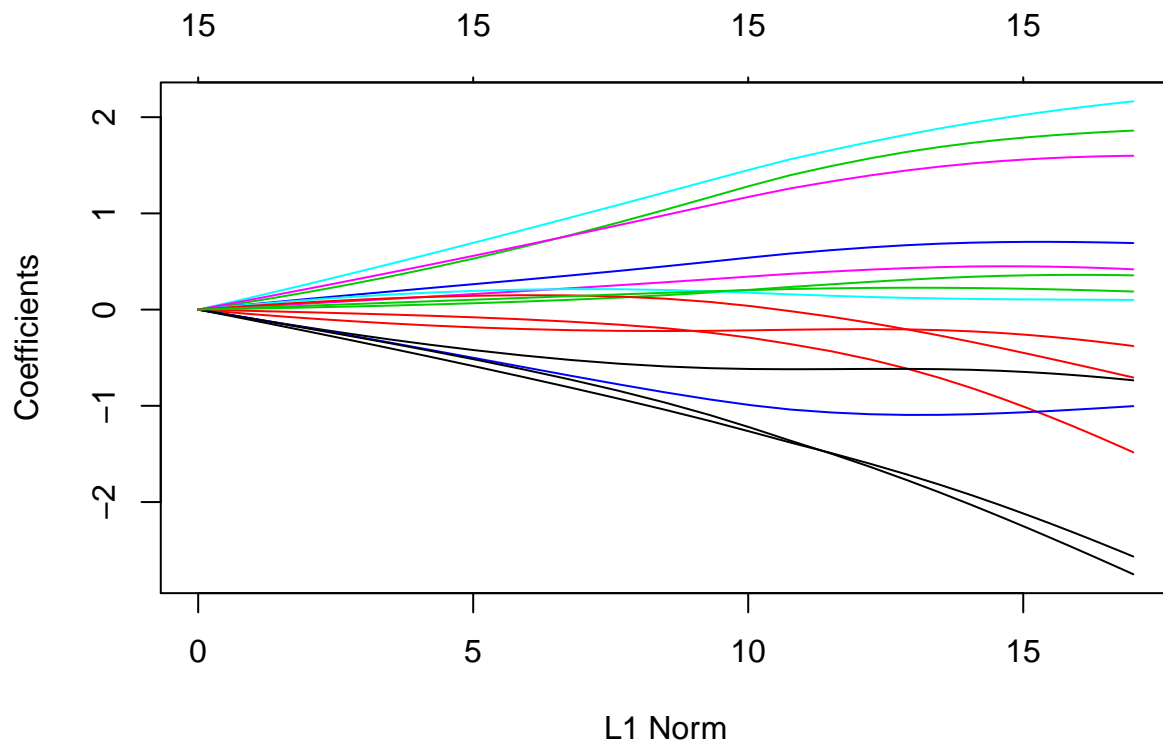
```
## [1] 3.118287
```

Visto che questo è il modello migliore vado a prevederlo con tutti i dati e trovo i seguenti coefficienti:

```
out=glmnet(x,y,alpha=0)
ridge.coef = predict(out,type="coefficients",s=bestlam)[1:16,]
ridge.coef
```

```
## (Intercept) networkBBS networkCBC fact stars month2
## 10.8661347 -0.9239472 -0.4029247 1.0714338 0.4028060 0.8208067
## month3 month4 month5 month9 month10 month11
## 0.3900432 -0.8418938 -0.5263012 -0.1256020 -0.7589928 0.1144954
## month12 day2 day7 prevratings
## 1.1944859 -0.6248807 0.1163332 0.1999120
```

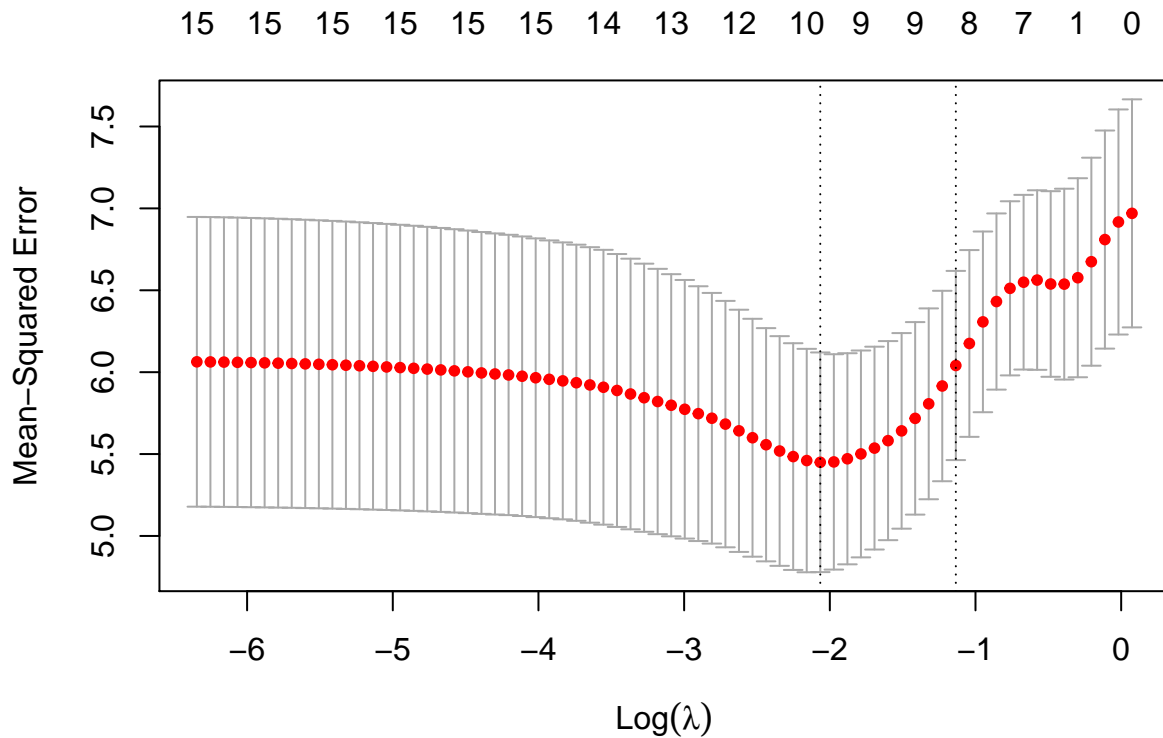
```
plot(ridge.mod)
```



Regressione lasso

Svolgiamo lo stesso procedimento con la regressione lasso:

```
lasso.mod=glmnet(x[train,],y[train],alpha=1,lambda=grid)
set.seed(1)
cv.out=cv.glmnet(x[train,],y[train],alpha=1)
plot(cv.out)
```

Osser-

vando il grafico del MSE in funzione di $\log(\lambda)$, vediamo che c'è una certa variabilità nella stima e che il miglior valore di λ per la regressione lasso è:

```
bestlam=cv.out$lambda.min
bestlam
```

```
## [1] 0.1267699
```

Utilizzando il valore migliore di λ otteniamo che il MSE è:

```
lasso.pred=predict(lasso.mod,s=bestlam,newx=x[test,])
mean((lasso.pred-y.test)^2)
```

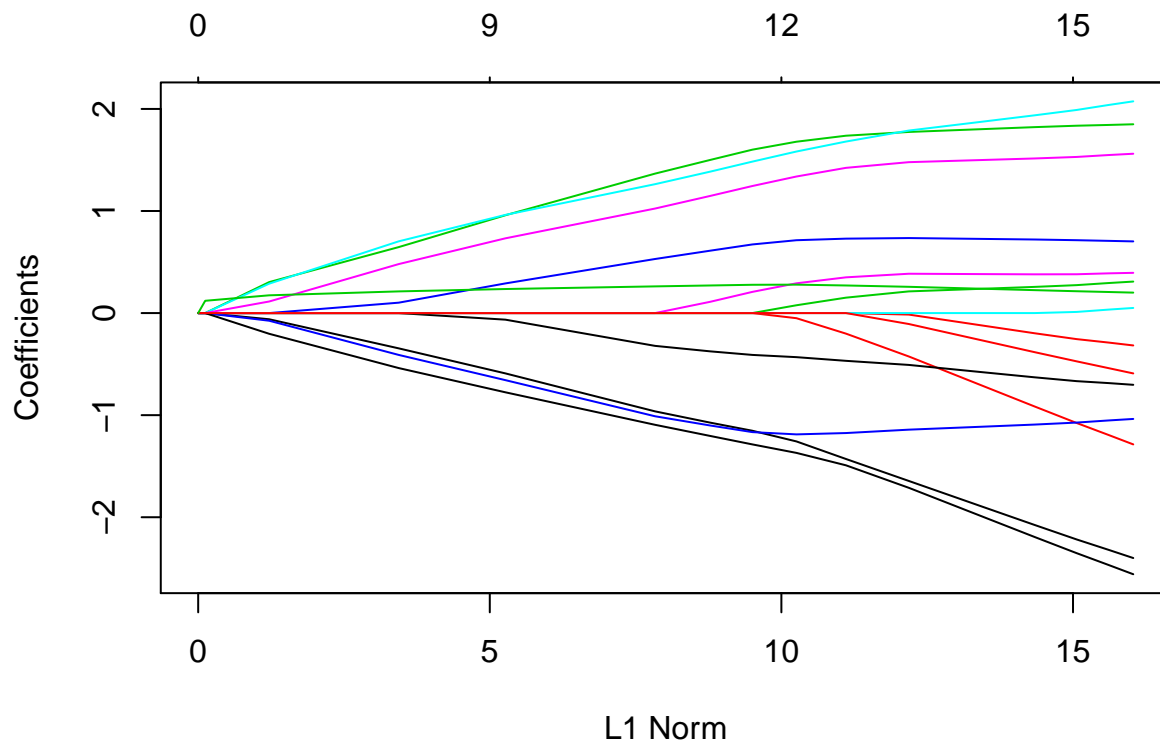
```
## [1] 3.216354
```

Visto che questo è il modello migliore per la regressione lasso vado a prevederlo con tutti i dati e trovo i seguenti coefficienti:

```
out=glmnet(x,y,alpha=1,lambda=grid)
lasso.coef=predict(out,type="coefficients",s=bestlam)[1:16,]
lasso.coef
```

```
## (Intercept) networkBBS networkCBC      fact      stars      month2
## 8.99835558 -0.68477203 0.00000000 1.40193054 0.48142148 0.72228587
##      month3      month4      month5      month9      month10      month11
## 0.25149499 -0.56701902 -0.01786204 0.00000000 -0.83165645 0.00000000
##      month12      day2      day7 prevratings
## 1.38828580 -0.51610040 0.00000000 0.30752700
```

```
plot(lasso.mod)
```



Conclusioni

In conclusione possiamo dire che il modello migliore con un MSE di 2.301024 è il modello di subset selection con 13 variabili con coefficienti:

```
reg.best.coef
```

```
## (Intercept) networkBBS networkCBC fact stars month2
## 12.3360770 -2.6882014 -1.6412308 1.8859730 0.6808614 2.0583847
## month3 month4 month5 month10 month12 day2
## 0.2895100 -0.8872171 -0.5543490 -1.0922085 1.4942182 -2.8997869
## day7 prevratings
## -0.7537724 0.1734741
```

Andando ad osservare i diversi coefficienti nel modello, possiamo trarre diverse conclusioni. Innanzitutto osserviamo che il network CBC di default ha un rating più basso di ABN, ma più alto di BBS. Inoltre quando viene mandato in onda un film basato su una storia vera il rating aumenta, perchè il coefficiente è positivo, così come lo fa aumentare la presenza di star nel film. Come nell'analisi iniziale, anche il rating del programma precedente fa aumentare il rating del programma serale, ma come si è visto l'uso di questa informazione da sola ha una previsione meno precisa.

```
mean(abs(reg.best.pred-y.test))
```

```
## [1] 1.277023
```

Il modello migliore che abbiamo trovato è buono, ma non è ottimo perché l'errore assoluto medio di previsione del rating è 1.28 quindi implica che (se ogni punto in meno di rating si perdono 1 milione di dollari come nella parte B del Business Case) c'è il rischio di guadagnare un milione e 300 mila dollari in meno rispetto alla previsione.