

Regressions- och tidsserieanalys

Föreläsning 10 - AR modeller och Enkel logistisk regression.

Mattias Villani 🧑

Statistiska institutionen
Stockholms universitet

Institutionen för datavetenskap
Linköpings universitet



mattiasvillani.com



@matvil



[mattiasvillani](https://github.com/mattiasvillani)

- AR modeller och partiell autokorrelation
- Regression för tidsserier
- Odds och logodds
- Enkel logistisk regression

Autokorrelationsfunktion - AR(1)

- AR(1) som populationsmodell:

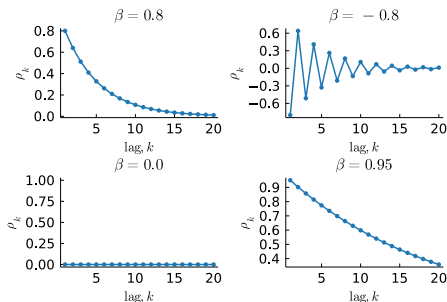
$$y_t = \alpha + \beta y_{t-1} + \varepsilon_t, \quad \varepsilon_t \sim N(0, \sigma_\varepsilon^2)$$

- Autokorrelationsfunktion (ACF)

$$\rho_k = \text{corr}(y_t, y_{t-k}), \text{ för } k = 1, 2, \dots$$

- ACF för AR(1)

$$\rho_k = \beta^k, \text{ för } k = 1, 2, \dots$$



Partiell autokorrelationsfunktion - PACF

■ AR(p)

$$y_t = \alpha + \beta_1 y_{t-1} + \dots + \beta_p y_{t-p} + \varepsilon_t, \quad \varepsilon_t \sim N(0, \sigma_\varepsilon^2)$$

■ Partiell ACF (PACF) multipel regressions-variant av ACF

$$\rho_k^* = \text{corr} \left(y_t, y_{t-k} \mid \underbrace{y_{t-1}, \dots, y_{t-k-1}}_{\text{laggar mellan } t \text{ och } t-k} \right), \text{ för } k = 1, 2, \dots$$

■ PACF för lag k kontrollerar för laggarna mellan t och $t - k$.

Partiell autokorrelationsfunktion - AR(1)

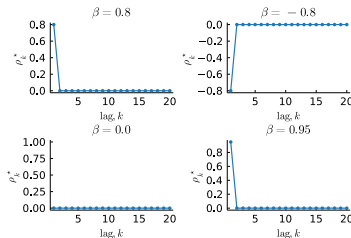
■ AR(1)

$$y_t = \alpha + \beta y_{t-1} + \varepsilon_t, \quad \varepsilon_t \sim N(0, \sigma_\varepsilon^2)$$

■ PACF för AR(1) i populationen:

$$\rho_1^* = \beta$$

$$\rho_k^* = 0, \text{ för } k = 2, 3, \dots$$



■ Identifiera AR-modell:

- ▶ skatta PACF från data.
- ▶ bara första laggen signifikant \Rightarrow AR(1) bra modell.

Partiell autokorrelationsfunktion - AR(2)

■ AR(2)

$$y_t = \alpha + \beta_1 y_{t-1} + \beta_2 y_{t-2} + \varepsilon_t, \quad \varepsilon_t \sim N(0, \sigma_\varepsilon^2)$$

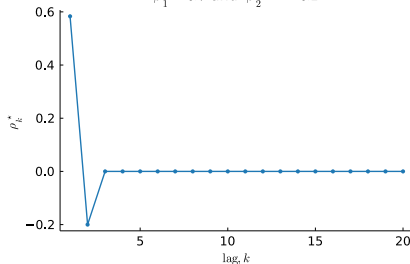
■ Partiell ACF för AR(2) i populationen:

$$\rho_1^* = \frac{\beta_1}{1 - \beta_2}$$

$$\rho_2^* = \beta_2$$

$$\rho_k^* = 0, \text{ för } k = 3, 4, \dots$$

$$\beta_1 = 0.7 \text{ and } \beta_2 = -0.2$$



Regression för tidsserier

■ Regression

$$y = \alpha + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_k x_k + \varepsilon$$

där **feltermerna** ε antas bara **oberoende** från $N(0, \sigma_\varepsilon^2)$.

■ **Oberoende = okorrelerade** för **normalfördelade** variabler.

■ Regressionen skattas med

$$y = a + b_1 x_1 + \dots + b_k x_k$$

och vi får residualer

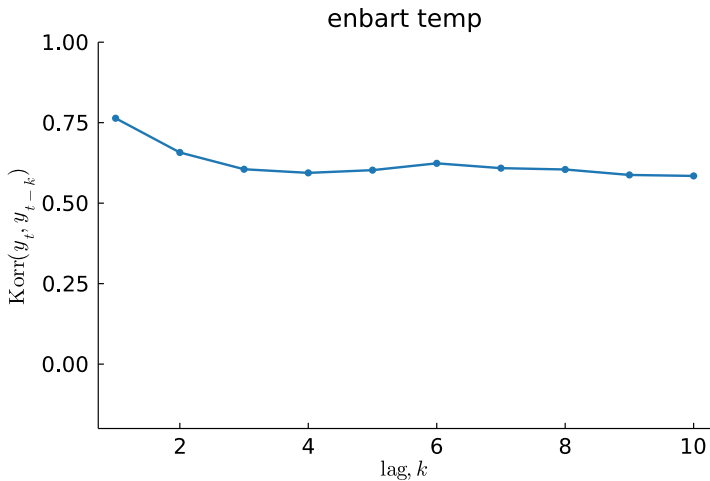
$$e_t = y_t - \hat{y}_t.$$

■ Vi kan undersöka om **residualerna är okorrelerade**.

■ Två metoder:

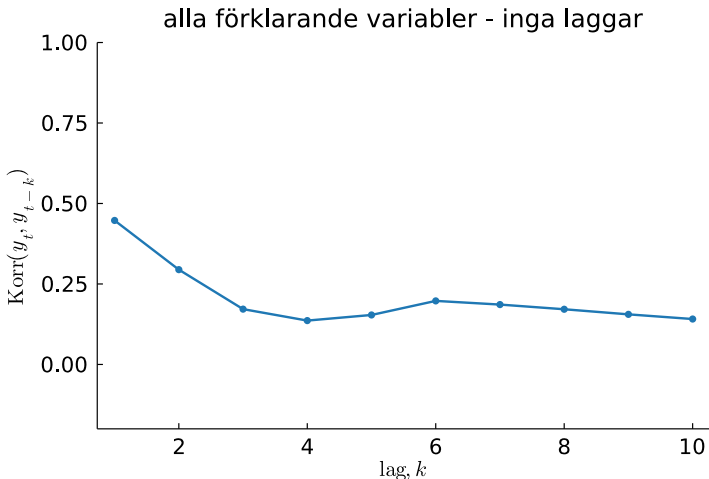
- ▶ Visuellt genom att **plotta autokorrelationsfunktionen för** e_t
- ▶ **Durbin-Watson test**

ACF residualer - temp



ACF residualer - alla variabler

- Regression med alla förklarande variabler:
temp,hum,windspeed,holiday,workingday,säsong,yr.



Regression för tidsserier

■ Regressionsmodeller för tidsserier

$$y_t = \alpha + \beta_1 x_t + \varepsilon_t$$

får ofta korrelerade residualer. 🙄

■ Kombinera enkel regression och AR(1) 😊

$$y_t = \alpha + \beta_1 x_t + \beta_2 y_{t-1} + \varepsilon_t$$

■ Kombinera multipel regression och AR(p) 😍

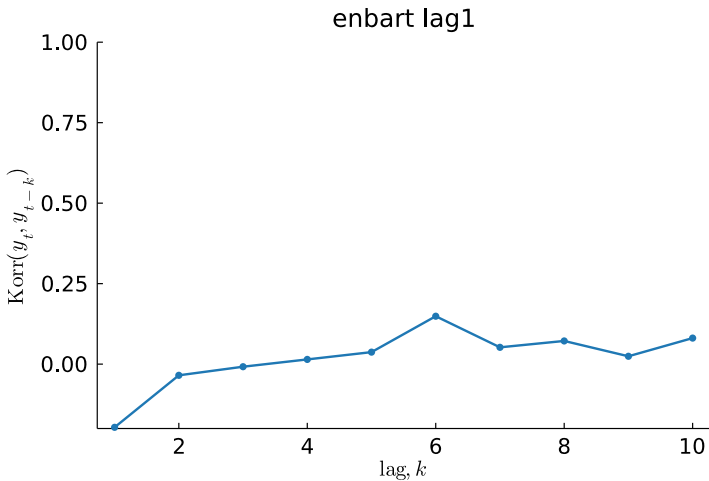
$$y_t = \alpha + \beta_1 x_t + \dots + \beta_k x_{kt} + \beta_{k+1} y_{t-1} + \dots + \beta_{k+p} y_{t-p} + \varepsilon_t$$

■ Cykeluthyrning:

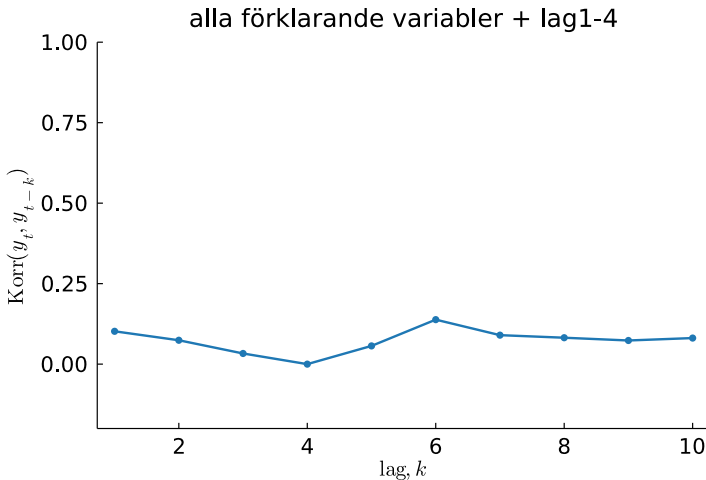
$$\text{AntalUthyr}_{\text{idag}} = a + b_1 \cdot \text{temp}_{\text{idag}} + b_2 \cdot \text{AntalUthyr}_{\text{igar}}$$

■ Standardfel och hypotestest måste korrigeras om laggar av y_t används som förklarande variabel.

ACF residualer - enbart lag 1



ACF residualer - alla variabler + lag 1-4



Durbin-Watson test

- Test för autokorrelation (i feltermen).

- Teststatistika

$$d = \frac{\sum_{t=2}^T (e_t - e_{t-1})^2}{\sum_{t=1}^T e_t^2}$$

- Durbin-Watson **testar första autokorrelationen** (AJÅ)

$$d \approx 2(1 - r_1)$$

- Teststatistikan uppfyller

$$0 \leq d \leq 4$$

- Grova **kritiska gränser**:

d nära 2 \implies ej signifikant

$d < 1$ \implies signifikant positiv autokorrelation

$d > 1$ \implies signifikant negativ autokorrelation

- Durbin-Watson test kan inte användas när man har laggar av målvariabeln (y_{t-1} etc) som förklarande variabler.

Durbin-Watson test - cykeluthyrning

```
> library(car)
> lmfit = lm(nRides ~ temp , data = bike)
> durbinWatsonTest(lmfit)
lag Autocorrelation D-W Statistic p-value
1      0.7641582      0.4678707      0
Alternative hypothesis: rho != 0

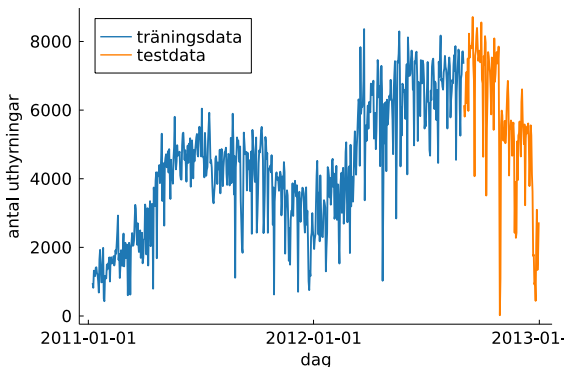
> lmfit = lm(nRides ~ temp + hum + windspeed + holiday + workingday + as.factor(season) + yr, data = bike)
> durbinWatsonTest(lmfit)
lag Autocorrelation D-W Statistic p-value
1      0.4472755      1.104221      0
Alternative hypothesis: rho != 0
```

Förklarande variabler	R^2	$r_1^{(\text{res})}$	d	p -värde
temp	0.385	0.764	0.471***	< 1e-93
temp,hum,windspeed,holiday,workingday,säsong,yr	0.795	0.447	1.104***	< 1e-33

Cykeluthyrningar - utvärdera prognosförmåga

- **Träningsdata:** Jan 1, 2011 - Aug 31, 2012.
- **Testdata:** Sept 1, 2012 - Dec 31, 2012.
- **Prediktionsmått RMSE**

$$\text{RMSE}_{\text{test}} = \sqrt{\frac{1}{n_{\text{test}}} \sum_{t \in \text{Testdata}} (y_t - \hat{y}_t)^2}$$



Cykeluthyrningar

■ Träningsdata: Jan 1, 2011 - Aug 31, 2012.

■ Testdata: Sept 1, 2012 - Dec 31, 2012.

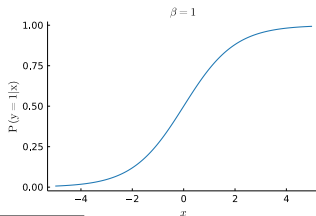
Förklarande variabler	R^2	RMSE _{test}
temp	0.385	2346.60
temp,hum,windspeed,holiday,workingday,säsong,yr	0.795	1292.07
lag1	0.714	1274.32
lag1,lag2	0.730	1279.30
lag1-lag4	0.746	1267.84
lag1-lag6	0.764	1262.10
temp,hum,windspeed,holiday,workingday,säsong,yr,lag1	0.825	1127.63
temp,hum,windspeed,holiday,workingday,säsong,yr,lag1-lag4	0.827	1118.83
temp,hum,windspeed,holiday,workingday,säsong,yr,lag1-lag6	0.830	1117.63
temp,hum,windspeed,holiday,workingday,säsong,yr,lag1-lag6,Lasso	NA	1118.34

Logistisk regression för binär responsvariabel ¹

- **Binär responsvariabel:** $y = 0$ och $y = 1$.
 - ▶ företag i konkurs ($y_i = 1$) eller ej konkurs ($y_i = 0$).
 - ▶ handskriven 1:a ($y_i = 1$) eller 0:a ($y_i = 0$).
 - ▶ mynt på eBay sålt ($y_i = 1$) eller icke sålt ($y_i = 0$).
- **Logistisk regression** är modell för sannolikheten för 1:a

$$P(y = 1|x) = \frac{\exp(\beta_0 + \beta_1 x)}{1 + \exp(\beta_0 + \beta_1 x)}$$

- Vilka faktorer (x-variabler) ökar/minskar $P(\text{konkurs})$?



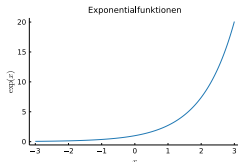
¹Videon med matterepetition [PotenserLogaritmer.mp4](#) finns i Videos mappen på Athena. Se även slides PotensOchLogaritm.pdf.

Exponentialfunktioner

■ Exponentialfunktioner

$$\exp(x) = e^x$$

där $e \approx 2.71828$ är **Eulers tal** som **bas**, istället för basen 10.



■ Som för alla potensal:

$$e^x \cdot e^y = e^{x+y}$$

och

$$(e^x)^y = e^{xy}$$

■ Uttryckt i $\exp(x)$ notation

$$\exp(x) \exp(y) = \exp(x + y)$$

Odds och logodds

- Låt $P(A)$ vara sannolikheten för en händelse A .

$$P(A) = \frac{\text{antal fall där } A \text{ inträffar}}{\text{antal möjliga fall}}$$

- Odds

$$\text{Odds}(A) = \frac{\text{antal fall där } A \text{ inträffar}}{\text{antal fall där } A \text{ inte inträffar}}$$

$$\text{Odds}(A) = \frac{P(A)}{1 - P(A)}$$

- Exempel: Sannolikheten att slå en 6:a med en vanlig tärning:
 - ▶ Sannolikhet $P(A) = 1/6$
 - ▶ Odds

$$\text{Odds}(A) = \frac{1/6}{5/6} = \frac{1}{5}$$

Oddset är 1 : 5 ("1mot 5").

Logistisk regression - oddskvot

■ Logistisk regression

$$P(y = 1|x) = \frac{\exp(\beta_0 + \beta_1 x)}{1 + \exp(\beta_0 + \beta_1 x)}$$

$$P(y = 0|x) = \frac{1}{1 + \exp(\beta_0 + \beta_1 x)}$$

■ Odds

$$\text{Odds}(y = 1|x) = \frac{P(y = 1|x)}{P(y = 0|x)} = \exp(\beta_0 + \beta_1 x)$$

■ Odds i logistisk regression är **multiplikativa effekter**

$$\text{Odds}(y = 1|x) = \exp(\beta_0) \cdot \exp(\beta_1 x) = \exp(\beta_0) \cdot \exp(\beta_1)^x$$

■ Jämför med **exponentiell tillväxt**: $y = a \cdot b^x$.

■ Tolkning intercept β_0

$$\text{Odds}(y = 1|x = 0) = \exp(\beta_0)$$

Logistisk regression - oddskvot

■ Odds

$$\text{Odds}(y = 1|x) = \exp(\beta_0 + \beta_1 x) = \exp(\beta_0) \cdot \exp(\beta_1)^x$$

■ För $x = 1$

$$\text{Odds}(y = 1|x = 1) = \exp(\beta_0) \exp(\beta_1)$$

■ För $x = 2$

$$\text{Odds}(y = 1|x = 2) = \exp(\beta_0) \exp(\beta_1)^2$$

■ Tolkning β_1 : x ökar med en enhet, oddset multipliceras med

$$\exp(\beta_1)$$

■ **Oddskvot** för att tolka β_1

$$\text{OR}(x) = \frac{\text{Odds}(y = 1|x + 1)}{\text{Odds}(y = 1|x)} = \exp(\beta_1)$$

Oddskvot - exempel

- Sannolikhet för cancer ($y = 1$) bestäms av personens ålder x

$$P(y = 1|x) = \frac{\exp(-4.6 + 0.04 \cdot x)}{1 + \exp(-4.6 + 0.04 \cdot x)}$$

- Dvs $\beta_0 = -4.6$ och $\beta_1 = 0.04$.
- Oddskvoten: ökning av odds med ca 4% per levnadsår:

$$\exp(\beta_1) = \exp(0.04) = 1.040811$$

- Oddset för en nyfödd är ca 1 : 100

$$\text{Odds}(y = 1|x = 0) = \exp(-4.6) = 0.01005184$$

- Oddset för en 1-åring

$$\exp(\beta_0) \exp(\beta_1) = 0.01005184 \cdot 1.040811 = 0.01046207$$

- Oddset för en 2-åring

$$\text{Odds}(y = 1|x = 1) \exp(\beta_1) = 0.01046207 \cdot 1.040811$$

- Oddset för en 100-åring: $\exp(\beta_0 + 100\beta_1) = 0.548811$

Logistisk regression - log-odds

- Repetition: Logaritm med bas 10:

$$\log(10^a) = a$$

- **Naturlig logaritm** (bas $e \approx 2.7183$)

$$\ln(\exp(a)) = \ln e^a = a$$

- Logistisk regression

$$P(y = 1|x) = \frac{\exp(\beta_0 + \beta_1 x)}{1 + \exp(\beta_0 + \beta_1 x)}$$

- Odds

$$\text{Odds}(y = 1|x) = \exp(\beta_0 + \beta_1 x)$$

- **Log-odds**

$$\text{LogOdds}(y = 1|x) = \beta_0 + \beta_1 x$$

- Logistisk regression är en **linjär modell** för log-oddset.

Vilka överlevde Titanic? Enkel logistisk regression

- $n = 891$ personer på Titanic, varav 342 överlevande.
- Responsvariabel: $y = 1$ om överlevde, annars $y = 0$.
- Förklarande variabel: age

```
> library(regkurs)
> fit <- glm(survived ~ age, data = titanic, family = binomial)
> logisticregsummary(fit)
```

Parameter estimates

```
-----
                Estimate Std. Error z value Pr(>|z|)
(Intercept) -0.2091888   0.1594937 -1.3116 0.189662
age          -0.0087744   0.0049474 -1.7735 0.076139
```

Odds ratio estimates

```
-----
                Estimate Std. Error z value Pr(>|z|)
(Intercept)   0.81124      1.1729 -1.3116 0.189662
age           0.99126      1.0050 -1.7735 0.076139
```

~ |

Vilka överlevde Titanic? Enkel logistisk regression

Parameter estimates

	Estimate
(Intercept)	-0.2091888
age	-0.0087744

Odds ratio estimates

	Estimate
(Intercept)	0.81124
age	0.99126

- Oddset för att överleva för en nyfödd ($\text{age}=0$) är $\exp(-0.2091888) = 0.81124$.
- Oddset för att överleva för en 1-åring:
 $0.81124 \cdot 0.99126 = 0.8041498$
- ... vilket är en minskning med $(1 - 0.99126) \cdot 100 = 0.874\%$.
- Varje extra levnadsår minskar oddset med lite mindre än 1%.