

# Regressions- och tidsserieanalys

## Föreläsning 4 - Multipel regression

**Mattias Villani**

Statistiska institutionen  
Stockholms universitet

Institutionen för datavetenskap  
Linköpings universitet



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



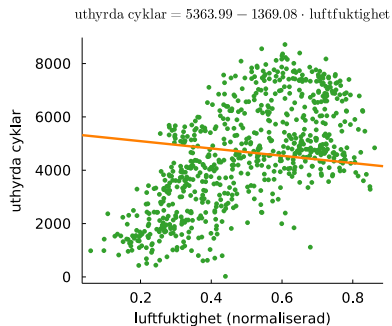
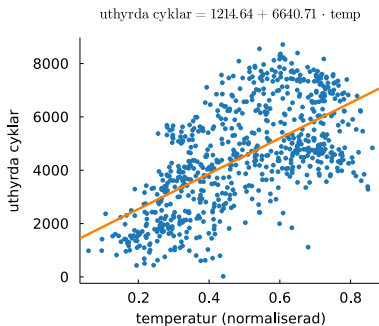
[@matvil](https://twitter.com/matvil)



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

- Multipel regression
- Hypotesttest ( $t$  och  $F$ )
- Variabelselektion

# Cykeluthyrning revisited



# Fler förklarande variabler - multipel regression

- Skatta enkel regression för varje förklarande variabel. 🙅
- Skatta multipel regression med alla förklarande variabler. 👍
- Regressionanpassning med två förklarande variabler

$$y = a + b_1x_1 + b_2x_2$$

- $b_1$  talar om hur  $y$  förändras när vi ändrar  $x_1$  med en enhet (utan att ändra  $x_2$ ).
- $b_2$  talar om hur  $y$  förändras när vi ändrar  $x_2$  med en enhet (utan att ändra  $x_1$ ).
- I multipel regression **kontrollerar** man **för** (tar hänsyn till) de **andra förklarande variabelernas effekt** på  $y$ .

# Minsta kvadrat-skattningar

- **Stickprov:**  $(y_i, x_{1i}, x_{2i})$  för  $i = 1, \dots, n$ .
- $x_{1i}$  är t ex den  $i$ :te observationens värde på  $x_1$ -variabeln.
- Hitta  $a$ ,  $b_1$  och  $b_2$  som **minimerar residualkvadratsumman**

$$Q = \sum_{i=1}^n (y_i - a - b_1 x_{1i} - b_2 x_{2i})^2$$

- Vi får nu tre ekvationer (från partialderivatorna) som ska lösas med avseende på  $a$ ,  $b_1$  och  $b_2$ . Se AJÅ.
- Med  $k$  förklarande variabler får vi  $k + 1$  ekvationer att lösa.

$$y = a + b_1 x_1 + b_2 x_2 + \dots + b_k x_k$$

- Använd dator! (enkelt programmera själv med linjär algebra).

# Enkel regression temp - R

```
> lmfit = lm(nRides ~ temp, data = bike); regsummary(lmfit)
```

Analysis of variance - ANOVA

```
-----
```

	df	SS	MS	F	Pr(>F)
Regr	1	1078688585	1078688585	473.47	2.8106e-81
Error	729	1660846807	2278254		
Total	730	2739535392			

Measures of model fit

```
-----
```

Root MSE	R2	R2-adj
1509.38845	0.39375	0.39292

Parameter estimates

```
-----
```

	Estimate	Std. Error	t value	Pr(> t )
(Intercept)	1214.6	161.16	7.5367	1.4327e-13
temp	6640.7	305.19	21.7594	2.8106e-81

## ■ Skattad modell

$$\text{antal uthyrningar} = 1214.64 + 6640.71 \cdot \text{temperatur}$$

# Multipel regression temp och hum - R

```
> lmfit = lm(nRides ~ temp + hum, data = bike); regsummary(lmfit)
```

Analysis of variance - ANOVA

```
-----  
              df          SS          MS          F          Pr(>F)  
Regr         2 1169231889 584615944 271.03 1.0559e-88  
Error       728 1570303503   2157010  
Total       730 2739535392
```

Measures of model fit

```
-----  
      Root MSE          R2          R2-adj  
1468.67638      0.42680      0.42522
```

Parameter estimates

```
-----  
              Estimate Std. Error t value  Pr(>|t|)  
(Intercept)   2657.9      272.42  9.7565 3.2258e-21  
temp           6887.0      299.38 23.0042 1.9558e-88  
hum           -2492.9      384.76 -6.4789 1.7012e-10
```

## ■ Skattad modell:

antal uthyrningar =  $2657.9 + 6886.97 \cdot \text{temperatur} - 2492.85 \cdot \text{luftfuktighet}$

# Multipel regression temp, hum, wind - R

```
> lmfit = lm(nRides ~ temp + hum + windspeed, data = bike); regsummary(lmfit)
```

Analysis of variance - ANOVA

```
-----  
              df          SS          MS          F          Pr(>F)  
Regr         3 1262638191 420879397 207.18 4.2551e-97  
Error      727 1476897201  2031495  
Total      730 2739535392
```

Measures of model fit

```
-----  
      Root MSE          R2          R2-adj  
1425.30539      0.46090      0.45867
```

Parameter estimates

```
-----  
              Estimate Std. Error t value  Pr(>|t|)  
(Intercept)   4084.4      337.86 12.0888 8.7098e-31  
temp           6625.5      293.09 22.6062 4.1807e-86  
hum           -3100.1      383.99 -8.0734 2.8330e-15  
windspeed     -4806.9      708.90 -6.7808 2.4754e-11
```

## ■ Skattad modell:

antal uthyrningar =  $4084.4 + 6625.5 \cdot \text{temp} - 3100.1 \cdot \text{hum} - 4806.9 \cdot \text{wind}$



# Multipel regression

- **Multipel** regression med  $k$  förklarande variabler:

$$y = a + b_1x_1 + b_2x_2 + \dots + b_kx_k$$

- **Residualvariansen** mäter graden av spridning kring linjen

$$s_e^2 = \frac{\sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2}{n - (k + 1)},$$

där de predikterade värden ges av regressionekvationen

$$\hat{y}_i = a + b_1x_{1i} + b_2x_{2i} + \dots + b_kx_{ki}.$$

- **Andel förklarad variation**

$$R^2 = \frac{SSR}{SST} = \frac{\sum(\hat{y}_i - \bar{y})^2}{\sum(y_i - \bar{y})^2}$$

- Alternativt sätt (kom ihåg att  $SST = SSR + SSE$ )

$$R^2 = \frac{SSR}{SST} = \frac{SST - SSE}{SST} = 1 - \frac{SSE}{SST} = 1 - \frac{\sum(y_i - \hat{y}_i)^2}{\sum(y_i - \bar{y})^2}$$

# Multipel regression som sannolikhetsmodell

- **Populationsmodell** för regression med två förklarande variabler:

$$y = \alpha + \beta_1 x_1 + \beta_2 x_2 + \varepsilon, \quad \varepsilon \sim N(0, \sigma_\varepsilon^2)$$

- **Populationsmodell för multipel regression** med  $k$  förklarande variabler:

$$y = \alpha + \beta_1 x_1 + \beta_2 x_2 + \dots + \beta_k x_k + \varepsilon, \quad \varepsilon \sim N(0, \sigma_\varepsilon^2)$$

- $\beta_j$  talar om hur  $y$  förändras när vi ändrar  $x_j$  med en enhet (utan att ändra de andra  $x$ -variablerna).
- Samma **antaganden** som tidigare:
  - ▶ Feltermerna  $\varepsilon_i$  har **samma varians**  $\sigma_\varepsilon^2$  (homoskedasticitet)
  - ▶ Feltermerna är **normalfördelade**
  - ▶ Feltermerna är **oberoende**.

# Konfidensintervall

## ■ Exakt 95% konfidensintervall för $\beta_j$

$$b_j \pm t_{0.975}(n - k - 1) \cdot s_{b_j}$$

där  $s_{b_j}$  är standardfelet för  $b_j$  (liknande  $b$ , men mer komplex).

## ■ Cykeluthyrning med $k = 3$ förklarande variabler

$$t_{0.975}(n - k - 1) = t_{0.975}(727) = 1.963$$

Parameter estimates

	Estimate	Std. Error	t value	Pr(> t )	2.5 %	97.5 %
(Intercept)	4084.4	337.86	12.0888	8.7098e-31	3421.1	4747.7
temp	6625.5	293.09	22.6062	4.1807e-86	6050.1	7200.9
hum	-3100.1	383.99	-8.0734	2.8330e-15	-3854.0	-2346.3
windspeed	-4806.9	708.90	-6.7808	2.4754e-11	-6198.7	-3415.2

```
> lmfit = lm(nRides ~ temp + hum + windspeed, data = bike);  
> regsummary(lmfit, conf_intervals = T)
```

## ■ **p-värdet** beräknas på samma sätt som i enkel regression, men från $t_{0.975}(n - k - 1)$ fördelningen.

# Signifikanstest för en regressionkoefficient $t$ -test

- **Nollhypotes** som testar om  $x_j$  är en signifikant variabel

$$H_0 : \beta_j = 0$$

$$H_1 : \beta_j \neq 0$$

- **Teststatistiska**

$$t = \left| \frac{b_j - 0}{s_{b_j}} \right|$$

- Vi förkastar nollhypotesen på signifikansnivån  $\alpha = 0.05$  om

$$t_{\text{obs}} > t_{\text{crit}} = t_{0.975}(n - k - 1) \text{ (från tabell).}$$

- Cykeluthyrning. Testa om windspeed är en signifikant variabel:

$$t_{\text{obs}} = |(-4806.92 - 0)/708.90| = 6.780$$

och  $t_{\text{crit}} = t_{0.975}(727) = 1.963$ . Eftersom  $t_{\text{obs}} > t_{\text{crit}}$  så förkastar vi  $H_0$  på 5% signifikansnivå.

# ANOVA - medelversionen

## ■ Mean Squared Error (MSE)

$$\text{MSE} = \frac{\text{SSE}}{n - (k + 1)} = \frac{\sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2}{n - (k + 1)} = s_e^2$$

## ■ Mean Square Regression (MSR)

$$\text{MSR} = \frac{\text{SSR}}{k}$$

## ■ Mean Square Total (MST)

$$\text{MST} = \frac{\text{SST}}{n - 1}$$

## ■ Notera att frihetsgraderna summerar också

$$\begin{array}{rccccccc} \text{df}(\text{SST}) & = & \text{df}(\text{SSE}) & = & \text{df}(\text{SSR}) & & \\ n - 1 & = & n - (k + 1) & & + & & k \end{array}$$

# Signifikanstest för flera regressionkoefficienter

## ■ F-test statistiska

$$F = \frac{MSR}{MSE}$$

## ■ Nollhypotesen om ingen regression

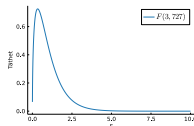
$$H_0 : \beta_1 = \beta_2 = \dots = \beta_k = 0$$

$$H_1 : \text{åtminstone något } \beta_j \neq 0$$

## ■ Under $H_0$ följer $F$ en $F$ -fördelning med $k$ och $n - (k + 1)$ frihetsgrader.

$$F \sim F(k, n - k - 1)$$

## ■ Cykeluthyrningsdata: $F_{\text{obs}} = 207.18$ . $F_{0.95}(3, 727) = 2.617$ . Vi tokförkastar nollhypotesen om ingen regression!



- Ju fler förklarande variabler desto mer förklarar regressionen.
- $R^2$  kan inte minska när man lägger till fler förklarande variabler. Se upp för överanpassning!
- $R^2_{\text{adjusted}}$  ("justerad  $R^2$ "), se AJÅ, kan minska om en förklarande variabel bara ger en liten ökning av  $R^2$ .
- Andra vanliga informationskriterier: AIC, BIC.
- Full sökning: Gå igenom alla möjliga kombinationer av förklarande variabler och välj modell med högst  $R^2_{\text{adjusted}}$ . Beräkningstungt.

---

<sup>1</sup>Videon [variabelselektion.mp4](#) finns i Videos mappen på Athena.

# Stepwise selection and beyond

## ■ Forward selection:

- 1 Börja med bara interceptet.
- 2 Lägg till  $x$ -variabeln med högst  $t_{\text{obs}}$ , om  $t_{\text{obs}} > 2$ , annars stanna.
- 3 Lägg till  $x$ -variabeln med högst  $t_{\text{obs}}$ , givet att valda variabeln i Steg 2 ingår i modellen, om  $t_{\text{obs}} > 2$ , annars stanna.
- 4 Fortsätt tills ingen ny förklarande variabel har  $t_{\text{obs}} > 2$  i modellen där alla tidigare variabler ingår.

- **Backward selection.** Starta med alla variabler i modellen. Ta bort den variabel som har lägst  $t_{\text{obs}}$ . Skatta modellen utan denna variabel. Fortsätt tills alla variabler som är kvar har  $t_{\text{obs}} > 2$ .

- Det finns massor av andra (bättre) variabelselektionsstrategier.  
**Bayesian variable selection.** *Bayesian Learning 7.5 hp.*