רגרסיה ומודלים לינאריים 52320 תשע"ו 2015-16
פתרון בוחן 1 22.12.2015

משקל כל סעיף הוא 20 נקודות כך שמספר הנקודות הכולל הוא 120. בכל מקרה, ציון הבוחן הוא 100 לכל היותר.

שימו לב שהשאלות הן בדרגת קושי שונה כך שמומלץ לא להתעכב יתר על המידה על שאלה מסויימת.

אנא הקפידו על ההנחיות הבאות:

- כתבו את ת.ז. (**לא את השם!**) בראש כל עמוד של טופס הבחינה.
- אין לצרף לטופס דפים נוספים.
- אין לתלוש דפים מטופס הבחינה.

לתשומת לבכם לגבי השאלות הפתוחות:

- **תשובה סופית ללא דרך לא תזכה בניקוד כלשהו (ציון 0).**
- בשאלות הפתוחות יש לכתוב את הפתרון רק במקום המוקצה לכך, מעל לכל קו כתבו שורה אחת בלבד בכתב יד קריא. (השאלות נכתבו כך שניתן לכתוב פתרון תמציתי לכל סעיף).
- מגבלת המקום תאכף באופן קפדני. פתרונות אשר יחרגו מהמקום המותר, יהיו בכתב קטן מכדי שיהיה קריא, ו/או יכללו יותר משורת כתב אחת לכל קו לא ייבדקו.
- מומלץ מאוד לפתור תחילה את השאלה במחברת הטיוטה ולהעתיק את עיקר הפתרון אל הטופס רק לאחר בדיקה.

חומר עזר מותר: מחשבון.

משך הבוחן: שעה

בהצלחה!

סימונים: נכתוב משתנים בכתיב וקטורי, כאשר $x, y, ..$ הם וקטורי עמודה. x_i מסמן את האיבר ה־i של וקטור x. עבור שני וקטורים x, y באורך n המכפלה הסקלרית שלהם היא $x^T y = \sum_{i=1}^n x_i y_i$.
תזכורת: עבור מ"מ וקטורי z ומטריצה A מתקיים: $E(Az) = AE(z); Var(Az) = AVar(z)A^T$.

1. עבור מודל רגרסיה מרובה: $y = X\beta + \epsilon$ עם $\epsilon \sim N(0, \sigma^2 I)$ יהי $\hat{\beta} = [X^T X]^{-1} X^T y$ אומד הרבועים הפחותים. נגדיר את שגיאת האמידה הרבועית הממוצעת של $\hat{\beta}$ כתוחלת של הנורמה האוקלידית של ההפרש בין וקטור הפרמטרים β לבין האומד שלו $\hat{\beta}$, כלומר $MSE_\beta \equiv E\left[||\hat{\beta} - \beta||^2\right] = E\left[(\hat{\beta} - \beta)^T (\hat{\beta} - \beta)\right]$.

(א) הוכיחו ששגיאת האמידה הרבועית הממוצעת ניתנת על ידי הביטוי: $MSE_\beta = \sigma^2 trace\left((X^T X)^{-1}\right)$. (תזכורת: עבור מטריצה רבועית A העקבה $(trace)$ מוגדרת כסכום איברי האלכסון: $trace(A) = \sum_i A_{ii}$)

פתרון : נחשב ונקבל:

$$MSE_\beta = E\left[||\hat{\beta} - \beta||^2\right] = E[||[X^T X]^{-1} X^T y - \beta||^2] =$$
$$E[||[X^T X]^{-1} X^T (X\beta + \epsilon) - \beta||^2] = E[||[X^T X]^{-1} X^T \epsilon||^2] =$$
$$E[\epsilon^T X[X^T X]^{-1} [X^T X]^{-1} X^T \epsilon] = \sum_{i,j=1}^n [X[X^T X]^{-1} [X^T X]^{-1} X^T]_{ij} E[\epsilon_i \epsilon_j] =$$
$$\sum_{i=1}^n [X[X^T X]^{-1} [X^T X]^{-1} X^T]_{ii} E[\epsilon_i^2] = \sigma^2 trace(X[X^T X]^{-1} [X^T X]^{-1} X^T) =$$
$$\sigma^2 trace(X^T X[X^T X]^{-1} [X^T X]^{-1}) = \sigma^2 trace([X^T X]^{-1})$$

(ב) כעת הניחו שמבצעים טרנספורמציות לינאריות על X ועל y: $X' = aX + b\mathbf{1}\mathbf{1}^\mathbf{T}, y' = cy + d\mathbf{1}$ עבור סקלרים a, b, c, d עם $a, c \neq 0$ וכאשר $\mathbf{1}$ וקטור עמודה ועושים רגרסיה לינארית מרובה של y' מול X' עבור המודל $y' = X'\beta' + \epsilon'$. כיצד תשתנה שגיאת האמידה הרבועית הממוצעת של האומד $\hat{\beta}'$ עבור β' ביחס לשגיאה בסעיף הקודם של האומד $\hat{\beta}$ עבור β?

פתרון : נפתור עבור a, b, c, d כאשר $b = d = 0$ כפי שהיה בבוחן. ראשית נכתוב מודל חדש ל־y' באופן הבא:
$y' = cy = c(X\beta + \epsilon) = c[(a^{-1}X')\beta + \epsilon] = X'ca^{-1}\beta + +c\epsilon = X'\beta' + \epsilon'$
כאשר $\beta' = ca^{-1}\beta$ וכאשר $\epsilon' = c\epsilon$ ולכן $\epsilon' \sim N(0, c^2\sigma^2 I_n)$.

נקבל: $MSE_{\beta'} = E\left[||\hat{\beta}' - \beta'||^2\right] = c^2\sigma^2 trace([X'^T X']^{-1}) = c^2\sigma^2 trace([a^2 X^T X]^{-1}) = \frac{c^2}{a^2}\sigma^2 trace([X^T X]^{-1}) = \frac{c^2}{a^2} MSE_\beta$

2. מעוניינים להתאים מודל רגרסיה עבור נתוני תמותה ב־60 ערים בארה"ב (הנתונים נאספו בשנת 1960).

המשתנה המוסבר הינו mortrate והוא מציין שיעורי תמותה ל־$100,000$ איש בשנה. לדוגמא בעיר בוסטון נרשמו 934.7 מקרי מוות עבור כל $100,000$ איש.

המשתנים המסבירים שנאספו על כל עיר הם: כמות משקעים שנתית בס"מ (precip), טמפרטורה ממוצעת בינואר בצלסיוס (jantemp), חציון מספר שנות חינוך (educ), אחוז לא־לבנים בעיר, בטווח בין אפס למאה (pctnonwt). המודל כולל גם חותך.

המטריצה $\left(X^T X\right)^{-1}$ חושבה והתקבל

```
          intercept       precip        jantemp       educ          pctnonwt
intercept  5.3935688384 -8.900133e-04  1.305460e-02 -4.100702e-01 -3.936508e-03
precip    -0.0008900133  4.002277e-07  1.471286e-07  5.052542e-05 -3.744107e-06
jantemp    0.0130546034  1.471286e-07  7.104761e-04 -1.029001e-03 -2.262434e-04
educ      -0.4100701597  5.052542e-05 -1.029001e-03  3.272483e-02  3.495447e-04
pctnonwt  -0.0039365084 -3.744107e-06 -2.262434e-04  3.495447e-04  3.288717e-04
```

(תזכורת: עבור הסימון שמתקבל בפלט: לדוגמא $3.21\text{e} - 04 = 0.000321$).

לפניכם פלט תוצאות רגרסיה כפי שהתקבל ב **R**. מבחן ה־F המתואר בפלט משווה בין המודל המלא (כלומר $\beta \in \mathbb{R}^5$) לבין מודל המכיל רק את החותך, כלומר: $H_0 : \beta_2 = \beta_3 = \beta_4 = \beta_5 = 0$.

```
Call: lm(formula = mortrate ~ precip + jantemp + educ + pctnonwt, data = airpol)

Residuals:
Min       1Q  Median      3Q     Max
-91.353 -25.281  -2.066  26.452  80.879

Coefficients:
              Estimate Std. Error t value  Pr(>|t|)
(Intercept) 1077.25383   88.59183  12.160  < 2e-16 ***
precip         0.03070    0.02413   1.272  0.20870
jantemp       -3.50989    1.01679  -3.452  0.00108 **
educ         -19.90855       A        B    0.00558 **
pctnonwt       4.74294    0.69178   6.856  6.49e-09 ***
--- Signif. codes:  0 ‘***’ 0.001 ‘**’ 0.01 ‘*’ 0.05 ‘.’ 0.1 ‘ ’ 1

Residual standard error: 38.15 on 55 degrees of freedom
Multiple R-squared:  0.6494,    Adjusted R-squared:
F-statistic:  C    on 4 and 55 DF,  p-value: 5.705e-12
```

(א) בכיתה למדנו על מבחן F כללי עבור השערת האפס: $H_0 : A\beta = a$ כאשר $A \in \mathbb{R}_{(\text{p-k}) \times \text{p}}$ מטריצה ו־$a \in \mathbb{R}^{p-k}$ וקטור. כתבו את המטריצה A והוקטור a המתאימים למבחן לעיל.

פתרון : נכתוב את המטריצה $A = \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$ והוקטור: $a = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}$ כך שהאילוץ $A\beta = a$ נותן אכן:

$\beta_2 = \beta_3 = \beta_4 = \beta_5 = 0$

(ב) כתבו ביטוי לסטטיסטי של F עבור המבחן לעיל (כלומר מודל עם כל המשתנים לעומת מודל בו יש רק חותך) במקרה הכללי כפונקציה של n, p, SSE, SST (כאן p מספר המשתנים **כולל החותך**). **תזכורת:** עבור מבחן F הכללי מהסעיף

הקודם, ניתן לכתוב את הסטטיסטי F כ- $F=\frac{(||\hat{y^{(0)}}-y||^2-||\hat{y}-y||^2)/(p-k)}{||\hat{y}-y||^2/(n-p)}$ כאשר $\hat{y}$ וקטור התחזיות במודל הלא מוגבל ו- $\hat{y^{(0)}}$ הוא וקטור התחזיות במודל תחת H_0.

פתרון : ראשית במודל רק עם חותך יש פרמטר אחד לכן $k=1$. **כמו כן** $||\hat{y^{(0)}}-y||^2=SST$ **מכיוון ש-**$\hat{y^{(0)}}$**הוא ממוצע התחזיות . לכן נקבל:** $F=\frac{(SST-SSE)/(p-1)}{SSE/(n-p)}$.

(ג) כתבו ליד כל אות את המספר החסר (יש לדייק עד 2 ספרות אחרי הנקודה. אין צורך בכתיבת הסבר):

A__6.901__**פתרון : נחשב** $\hat{st.d.}(\hat{\beta}_4)=s\sqrt{[(X^TX)^{-1}]_{44}}=38.15\times\sqrt{0.03272483}=6.901$

B___-2.88_**פתרון : נחשב:** $\frac{\hat{\beta}_4}{\hat{st.d.}(\hat{\beta}_4)}=\frac{-19.90855}{6.901}=-2.88$

C___101.740_**פתרון : נחשב את הסטטיסטי של** F **לפי הנוסחה בסעיף הקודם, כאשר** $SST=\frac{SSE}{1-R^2}=\frac{38.15^2}{1-0.6491}=4147.6845$ **ונקבל:** $F=\frac{(SST-SSE)/(p-1)}{SSE/(n-p)}=\frac{(4147.6845-38.15^2)/(4-1)}{38.15^2/(60-5)}=101.740$

(ד) השתמשו ב-$\hat{\beta}$ כדי לחשב אומדן לתוחלת שיעור התמותה ל-$100,000$ איש בשנה בעיר בה הטמפרטורה הממוצעת בינואר היא 5 מעלות, כמות המשקעים הממוצעת בשנה במ"מ היא 1150 מספר שנות ההשכלה החציוני הינו 10.5 ואחוז הלא לבנים בעיר הוא 12.

פתרון : התוחלת אותה יש לאמוד היא: $\beta_1+1150\beta_2+5\beta_3+10.5\beta_4+12\beta_5$. **האומדן הוא:**

$\hat{\beta}_1+1150\hat{\beta}_2+5\hat{\beta}_3+10.5\hat{\beta}_4+12\hat{\beta}_5=1077.25383+1150\times0.0307+5\times(-3.50989)+10.5\times(-19.90855)+12\times4.74294=942.885$