

CORREG : RÉGRESSION SUR VARIABLES CORRÉLÉES ET APPLICATION À L'INDUSTRIE SIDÉRURGIQUE

Clément Théry¹ & Christophe Biernacki² & Gaétan Loridant³

¹ *ArcelorMittal, Université Lille 1, Inria, CNRS, clement.thery@inria.fr*

² *Université Lille 1, Inria, CNRS, christophe.biernacki@math.univ-lille1.fr*

³ *Etudes Industrielles ArcelorMittal Dunkerque, gaetan.loridant@arcelormittal.com*

Résumé. La régression linéaire suppose en général l'usage de variables explicatives décorréliées, hypothèse souvent irréaliste pour les bases de données d'origine industrielle où de nombreuses corrélations sont dues au process, à des lois physiques, *etc.* Le modèle proposé explicite les corrélations présentes sous la forme d'une famille de régressions linéaires entre covariables, permettant d'obtenir par marginalisation un modèle de régression parcimonieux libéré des corrélations, facilement interprétable et compatible avec les méthodes de sélection de variables. La structure de corrélations est estimée à l'aide d'un algorithme de type MCMC. Un package R (CORREG) permet la mise en oeuvre de cette méthode qui sera illustrée sur données simulées et sur données réelles issues de l'industrie sidérurgique.

Mots-clés. Régression, corrélations, industrie, sélection de variables, modèles génératifs, ...

Abstract. Linear regression generally suppose to have decorrelated covariates. This hypothesis is often unrealistic with industrial datasets that contains many highly correlated covariates (due to the process, physical laws, *etc.*). The proposed generative model consists in explicit modeling of the correlations with a family of linear regressions between the covariates permitting to obtain by marginalization a parsimonious correlation-free regression model, easily understandable and compatible with variable selection methods. The structure of correlations is found with an MCMC algorithm. An R package (CORREG) implements this new method which will be illustrated on both simulated datasets and real-life datasets from steel industry.

Keywords. Regression, correlations, industry, variable selection, generative models, ...

1 Introduction

La régression linéaire classique suppose la décorrélation des covariables, source de problèmes en termes de variance des estimateurs. En effet, pour une variable réponse Y et un ensemble de covariables $X \in \mathcal{R}^p$, la régression $Y = XA + \varepsilon$ avec $\varepsilon \sim \mathcal{N}(0, \sigma^2)$ donne un estimateur de variance $\text{Var}(\hat{A}|X) = \sigma^2(X'X)^{-1}$ dégénéré si les colonnes de X sont linéairement

corrélées. Les méthodes de sélection comme le LASSO [4] muni du LAR [1] sont elles-mêmes touchées par ce problème de corrélation [5].

Notre idée est de modéliser explicitement les corrélations présentes entre covariables sous la forme d'une famille de régression entre celles-ci. Nous présenterons donc le modèle génératif associé et l'algorithme MCMC permettant de choisir la famille de régression à utiliser avant d'illustrer l'efficacité de la méthode sur des données simulées puis sur des données réelles.

2 Modèle supprimant les co-variables corrélées

On suppose le modèle génératif suivant :

- Régression principale :

$$Y_{|X,S} = XA + \varepsilon_Y = X_1A_1 + X_2A_2 + \varepsilon_Y \text{ avec } \varepsilon_Y \sim \mathcal{N}(0, \sigma_Y^2) \quad (1)$$

- Famille de p_2 régressions entre covariables corrélées :

$$\forall j \in I_2 : X_{|X_1,S}^j = X_1B_1^j + \varepsilon_j \text{ avec } \varepsilon_j \sim \mathcal{N}(0, \sigma_j^2) \quad (2)$$

- Mélanges gaussiens indépendants pour les covariables non corrélées :

$$\forall j \notin I_2 : X^j \sim \sum_{k=1}^{k_j} \pi_k \mathcal{N}(\mu_{k_j}, \sigma_{k_j}^2) \quad (3)$$

Où $I_1 = \{I_1^1, \dots, I_1^{p_1}\}$ est le vecteur des indices des variables à droite dans (2) , $I_2 = \{j | \#I_1^j > 0\}$ est l'ensemble des indices des variables corrélées à gauche dans (2). On a donc une partition des données $X = (X_1, X_2)$ où $X_2 = X^{I_2}$ et $X_1 = X \setminus X_2$ (pour alléger les notations).

On suppose $I_1 \cap I_2 = \emptyset$, *i.e.* les variables dépendantes dans X n'en expliquent pas d'autres. On note $p_2 = \#I_2$ le nombre de régressions entre covariables et $p_1 = (p_1^1, \dots, p_1^{p_2})$.

On a ainsi rendu explicites les corrélations au sein de X sous la forme d'une structure de sous-régressions linéaires $S = (I_1, I_2, p_1, p_2)$. Ce modèle génératif est identifiable sous certaines conditions simples (sur les k_i) non détaillées ici.

On remarque que (1) et (2) impliquent par simple intégration sur X_2 , un modèle de régression en Y s'exprimant uniquement en fonction des variables non corrélées X_1 :

$$Y_{|X,S} = X_1(A_1 + \sum_{j \in I_2} B_{I_1}^j A_j) + \sum_{j \in I_2} \varepsilon_j A_j + \varepsilon_Y = X_1\alpha_1 + \varepsilon_\alpha \quad (4)$$

L'estimateur classique du Maximum de Vraisemblance de α est sans biais et s'exprime par

$$\hat{\alpha}_1 = (X_1' X_1)^{-1} X_1' Y \text{ et sa matrice de variance} \quad (5)$$

$$\text{Var} [\hat{\alpha}_1 | X, S] = (\sigma_Y^2 + \sum_{j \in I_2} \sigma_j^2 A_j^2) (X_1' X_1)^{-1} \quad (6)$$

peut être notablement mieux conditionnée que celle de \hat{A} initial.

En outre, ce nouveau modèle réduit consiste en une régression linéaire classique qui peut donc bénéficier des outils de sélection de variables au même titre que le modèle complet.

Notons enfin que la structure explicite entre les variables permet de mieux comprendre les phénomènes en jeu et la parcimonie du modèle facilite son interprétation.

Remarque : En ajoutant une étape de sélection de variables on obtient ainsi deux types de 0 : ceux issus de l'étape de décorrélation et ceux issus de cette éventuelle étape de sélection de type LASSO.

3 Estimation de la structure de corrélation

Le choix de structure s'appuie sur un critère noté BIC^* et qui correspond à la vraisemblance pénalisée de la structure à la manière du critère BIC [3], mais en prenant comme loi *a priori* sur S une loi uniforme hiérarchique $P(S) = P(I_1 | p_1, I_2, p_2) P(p_1 | I_2, p_2) P(I_2 | p_2) P(p_2)$ plutôt qu'une loi uniforme simple. On a donc :

$$BIC^* = BIC + \ln(P(S)) \quad (7)$$

L'équiprobabilité ainsi supposée des p_2 et p_1^j vient pénaliser davantage la complexité sous l'hypothèse $p_2 < \frac{p}{2}$, hypothèse réaliste sur le nombre de régressions entre covariables. La recherche du meilleur S selon BIC^* n'est pas un problème simple et on va s'appuyer sur un algorithme MCMC. On a

A chaque étape de l'algorithme, pour $S \in \mathcal{S}$ (ensemble des structures réalisables) on définit un voisinage \mathcal{V}_S et donc la fonction de transition est guidée par BIC^* de la façon suivante :

$$\forall (S, \tilde{S}) \in \mathcal{S}^2 : \mathcal{P}(S, \tilde{S}) = \mathbf{1}_{\{\tilde{S} \in \mathcal{V}_S\}} \frac{\exp(\frac{-1}{2} BIC^*(\tilde{S}))}{\sum_{S_l \in \mathcal{V}_S} \exp(\frac{-1}{2} BIC^*(S_l))} \quad (8)$$

La chaîne de Markov ainsi constituée est ergodique dans un espace d'états finis et possède une unique loi stationnaire dont le mode correspond à la structure de plus grande valeur de BIC^*

n	p_2	bon gauche	faux gauche	LAR	CORREG \hat{S}	CORREG vrai S
30	16	8	5.39	2 466 225.35	13 796.03	588.9
30	32	17.05	2.7	979.16	196.33	141.2
50	0	0	0	499.18	499.18	499.18
50	16	9.18	4.94	315.34	202.64	193.38
50	32	19.13	2.24	179.89	138.96	120.21
400	32	23.66	1.13	105.38	103.88	102.81

Table 1: Y ne dépend pas de X_2 . CORREG gagne même en se trompant un peu sur S .

L’initialisation peut se faire en utilisant la matrice des corrélations et/ou la méthode du Graphical Lasso [2]. La grande dimension de l’espace parcouru rend préférable (pour un temps de calcul égal) l’utilisation de multiples chaînes courtes plutôt qu’une seule très longue (permettant aussi la parallélisation).

En pratique, on commence par estimer pour chaque variable de X sa densité sous l’hypothèse d’un mélange gaussien (avec Mixmod [6]). On peut alors calculer la loi jointe de X pour chaque structure réalisable rencontrée durant l’algorithme MCMC. Sans cette hypothèse générative supplémentaire sur X_1 , l’utilisation de BIC^* serait compromise. Notons cependant la souplesse de cette hypothèse due à la grande flexibilité des mélanges gaussiens.

4 Résultats sur données simulées

L’ensemble de la méthode a été programmé dans un package R dénommé CORREG. Pour les simulations présentées dans les tableaux 1, 2 et 3, chacune des configurations a été simulée 100 fois. Les tableaux affichent le nombre de variable dépendantes trouvées, le nombre de variables jugées dépendantes à tort et les erreurs moyennes en prédiction (MSE) sur Y à partir d’échantillons de validation de 1 000 individus. Pour l’ensemble des simulations $p = 40$, $\sigma_Y = 10$, $\sigma = 0.001$, les X indépendants suivent des mélanges gaussiens à $\lambda = 5$ classes de moyenne selon une loi de poisson de paramètre λ et d’écart-type λ . Les B_1^j suivent la même loi de poisson mais avec un signe aléatoire. On cherche ici à se comparer à la méthode *LASSO* dans les cas où celle-ci est en difficulté (fortes corrélations 2 à 2) donc les p_1^j non nuls valent tous 1 dans le vrai modèle. CORREG a travaillé avec, p_2 et p_1 libres et a utilisé Mixmod pour estimer les densités dans X_1 .

Les résultats (tableaux 1 à 3) montrent que CORREG est équivalent au LASSO en l’absence de corrélations et le bat quand les corrélations sont fortes. On retrouve le phénomène attendu du LASSO moins impacté par les corrélations quand n grandit. On constate enfin la convergence asymptotique de CORREG vers le vrai modèle de régression en Y , comme pour le LASSO.

Les données industrielles sont fortement corrélées de manière naturelle : largeur et

n	p_2	bon gauche	faux gauche	LAR	CORREG \hat{S}	CORREG vrai S
30	16	8.48	4.88	3 511 185.23	10 686.62	738.89
30	32	16.89	2.78	565.51	189.54	139.24
50	0	0	0	529.94	529.94	529.94
50	16	8.89	5.4	347.59	233.99	197.95
50	32	18.95	2.44	163.7	139.39	121.56
400	32	23.49	1.06	104.52	103.6	102.67

Table 2: Y dépend de X entier.

n	p_2	bon gauche	faux gauche	LAR	CORREG \hat{S}	CORREG vrai S
30	16	8.29	5	5 851.45	559.58	340.29
30	32	17	2.59	893	196.01	135.78
50	16	8.98	5.19	201.56	164.58	162.49
50	32	19.05	2.32	172.93	136.77	121.19
400	32	23.51	1.09	104.49	103.02	102.26

Table 3: Y dépend de X_2 uniquement (cas normalement défavorable à CORREG).

poids d'une brame ($\rho = 0.905$), température avant et après un outil ($\rho = 0.983$), rugosité des deux faces du produit ($\rho = 0.919$), Moyenne et maximum d'une courbe ($\rho = 0.911$). Exemples de Sous-régressions obtenues par CORREG ayant une interprétation physique :

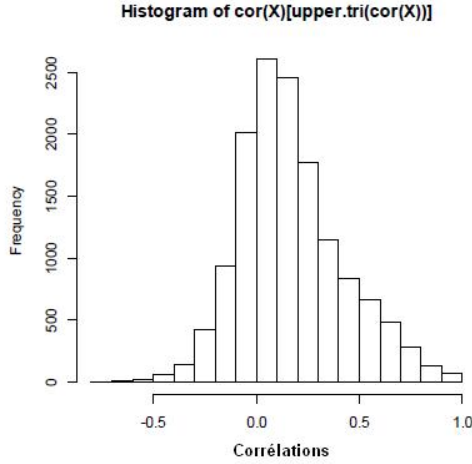
- Moyenne = f (Min , Max , Sigma) pour des données courbes
- Largeur du produit = f (débit de fonte , vitesse de la coulée continue)
Vrai modèle physique (non linéaire) :
Largeur = $\frac{\text{débit}}{\text{vitesse} \times \text{épaisseur}}$ (Mais dans ce cas précis l'épaisseur est constante)

D'autres sous-régressions traduisent des modèles physiques qui régulent le process industriel sur la base d'expertises métallurgiques.

Exemple de régression sur une variable réponse dans le cadre de données réelles :

5 Conclusion et perspectives

CORREG est fonctionnel et disponible sur R-forge. L'outil a d'ores et déjà montré son efficacité sur de vraies problématiques de régression en entreprise. La force de CORREG est la grande interprétabilité du modèle proposé, qui est constitué de plusieurs modèles de régression simples et donc facilement accessibles aux non statisticiens (régressions



	MSE	Variabes retenues
LASSO (lars)	0.80	54
CorReg (et lars)	0.53	24

Figure 1: Résultats obtenus sur données réelles : $n = 117$ et $p = 168$. L’erreur est réduite d’un tiers alors que la complexité du modèle est divisée par 2.5.

linéaires) tout en luttant efficacement contre les problématiques de corrélations, omniprésentes dans l’industrie. On note néanmoins le besoin d’élargir le champ d’application à la gestion des valeurs manquantes, très présentes dans l’industrie. Cet aspect est envisagé sérieusement pour la prochaine version de CORREG. En effet, le modèle génératif actuel permettrait cette nouvelle fonctionnalité sans hypothèse supplémentaire.

Bibliographie

- [1] Efron, B., Hastie, T., Johnstone, I. et Tibshirani, R. (2004), Least angle regression. *The Annals of statistics*, 32(2):407-499.
- [2] Friedman, J., Hastie, T. et Tibshirani, R. (2008), Sparse inverse covariance estimation with the graphical lasso. *Biostatistics*, 9(3):432-441 .
- [3] Lebarbier, E. et Mary-Huard, T. (2006), Une introduction au critère bic: fondements théoriques et interprétation. *Journal de la SFdS*, 147(1):39-57.
- [4] Tibshirani, R. (1996). Regression shrinkage and selection via the lasso, *Journal of the Royal Statistical Society. Series B (Methodological)*, pages 267-288.
- [5] Zhao, P. et Yu, B. (2006), On model selection consistency of lasso, *J. Mach. Learn. Res.* 7:2541-2563.
- [6] Biernacki, C., Celeux, G., Govaert, G., & Langrognet, F. (2006), Model-based cluster and discriminant analysis with the MIXMOD software, *Computational Statistics & Data Analysis*, 51(2), 587-600.