# Week 3 — Chapter 3

## **Chapter Precap**

- Introducir el concepto de modelo de regresión y explicar qué hace que un modelo sea "bayesiano".
- Discutimos las probabilidades posteriores y previas.
- Presenta brms, un paquete de R para ajustar modelos de regresión bayesiana utilizando el lenguaje de programación Stan.
- Ajustamos un modelo de regresión bayesiana de "solo intercepto" y presentamos temas relacionados con el ajuste del modelo, como el 'shrinkage', las cadenas y las iteraciones
- Describimos la interpretación de la declaración del modelo brm e introducimos los conceptos de errores y residuos.

- Concepto muy vago y general.
- Definición general: Modelos que ayudan a predecir el valor de algún parámetro (por ejemplo, μ) para una distribución de probabilidad utilizando una combinación de variables predictoras.
- A menudo, los predictores se combinan linealmente, pero no tienen por qué serlo.

## Normal Regression Models

- A continuación, se muestra un resumen general de una regresión que supone errores distribuidos normalmente:
  - Tienes una variable que te interesa, y.
  - Se supone que la variación aleatoria alrededor de la media ( $\mu$ ) se distribuye normalmente.
  - Se supone que la variación aleatoria (el error) tiene una media de 0 y una desviación estándar de  $\sigma$ .

$$y_{[i]} \sim N(\mu, \sigma)$$
  $y_{[i]} = \mu + N(0, \sigma)$ 

# Predicting Variation in µ

- La media de esta distribución puede variar sistemáticamente.
- La variación en la media se puede entender utilizando algunas variables predictoras.
- La regresión es una herramienta para modelar estas relaciones.

$$\mu = x_1 + x_2 + x_3$$

$$\mu_{[i]} = x_{1[i]} + x_{2[i]} + x_{3[i]}$$

$$\mu_{[i]} = \alpha_1 \cdot x_{1[i]} + \alpha_2 \cdot x_{2[i]} + \alpha_3 \cdot x_{3[i]}$$

$$y_{[i]} = \mu + N(0, \sigma)$$

$$\mu_{[i]} = \alpha_1 \cdot x_{1[i]} + \alpha_2 \cdot x_{2[i]} + \alpha_3 \cdot x_{3[i]}$$

$$y_{[i]} = (\alpha_1 \cdot x_{1[i]} + \alpha_2 \cdot x_{2[i]} + \alpha_3 \cdot x_{3[i]}) + N(0, \sigma)$$

$$y_{[i]} = \alpha_1 \cdot x_{1[i]} + \alpha_2 \cdot x_{2[i]} + \alpha_3 \cdot x_{3[i]} + \varepsilon_{[i]}$$

• "Ajustar" un modelo de regresión significa estimar estas cantidades.

$$y_{[i]} = \alpha_1 \cdot x_{1[i]} + \alpha_2 \cdot x_{2[i]} + \alpha_3 \cdot x_{3[i]} + \varepsilon_{[i]}$$

• Estos son los 'parámetros' de nuestro modelo.

Our observations are expected to be randomly distributed around the mean value according to a normal distribution with a standard deviation equal to sigma  $(\sigma)$ , and a mean of mu  $(\mu)$ . We expect the mean of our variable to vary from trial to trial based on three predictors. The combination of these predictors is based on model-specific coefficients  $(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3)$  that are static across trials.

$$y_{[i]} \sim N(\mu, \sigma)$$

$$\mu_{[i]} = \alpha_1 \cdot x_{1[i]} + \alpha_2 \cdot x_{2[i]} + \alpha_3 \cdot x_{3[i]}$$

#### **Errores and Residuos**

- Los errores son la diferencia entre las observaciones y los valores esperados.
- Los errores son lo que modelamos probabilísticamente (la variación en μ es determinista).

$$y_{[i]} = \mu_{[i]} + \varepsilon_{[i]} \qquad \varepsilon_{[i]} = y_{[i]} - \mu_{[i]}$$
$$\varepsilon_{[i]} \sim N(0, \sigma)$$

#### **Errors and Residuals**

• No conocemos el  $\mu$  real y solo podemos estimarlo  $(\hat{\mu})$ .

• Los residuos son la variación alrededor de nuestros valores predichos, son <u>errores</u> estimados  $(\hat{\varepsilon})$ .

$$\varepsilon_{[i]} = y_{[i]} - \mu_{[i]}$$

$$\hat{\varepsilon}_{[i]} = y_{[i]} - \hat{\mu}_{[i]}$$

$$\hat{\varepsilon}_{[i]} \sim N(0, \sigma)$$

# What's 'Bayesian' about our Models?

 Los modelos "tradicionales" (frecuentistas) se centran en las verosimilitudes de los parámetros para hacer inferencias.

$$P(\mu \mid y) = \frac{P(y \mid \mu) \cdot P(\mu)}{P(y)}$$

 Los modelos bayesianos hacen inferencias utilizando la probabilidad posterior de los parámetros.

## Teorema de Bayes

$$P(A \& B) = P(B \& A)$$

$$P(A | B) \cdot P(B) = P(B | A) \cdot P(A)$$

$$P(\mu | y) \cdot P(y) = P(y | \mu) \cdot P(\mu)$$

$$P(\mu \mid y) = \frac{P(y \mid \mu) \cdot P(\mu)}{P(y)}$$

## Teorema de Bayes

$$P(\mu \mid y) = \frac{P(y \mid \mu) \cdot P(\mu)}{P(y)}$$

# Probabilidad a priori

- La probabilidad de que haya diferentes valores del parámetro antes de recopilar datos.
- Esta expectativa a priori puede provenir del conocimiento del mundo, de experimentos previos, del sentido común o de alguna combinación de los mismos.

$$P(\mu \mid y) = \frac{P(y \mid \mu) \cdot P(\mu)}{P(y)}$$

#### Verosimilitud

- Producto de los valores de densidad de probabilidad correspondientes a los puntos de datos para un valor determinado de μ.
- Refleja la probabilidad de que los datos, y, se observen para valores concretos de μ.

$$P(\mu \mid y) = \frac{P(y \mid \mu) \cdot P(\mu)}{P(y)}$$

# Probabilidad marginal

- El numerador se tiene que escalar para que la densidad posterior tenga un área total bajo la curva igual a uno.
- La probabilidad marginal no varía en función de  $\mu$ , entonces no afecta a la probabilidad relativa a posteriori de valores de  $\mu$ .

$$P(\mu \mid y) = \frac{P(y \mid \mu) \cdot P(\mu)}{P(y)}$$

• Puedes ignorar esto.

# Probabilidad a posteriori

- La probabilidad a posteriori (después de la observación) de valores de μ dados los datos y, y la estructura del modelo.
- La posterior es una combinación de la distribución a priori y la verosimilitud, una combinación de información antigua y nueva.

$$P(\mu \mid y) = \frac{P(y \mid \mu) \cdot P(\mu)}{P(y)}$$

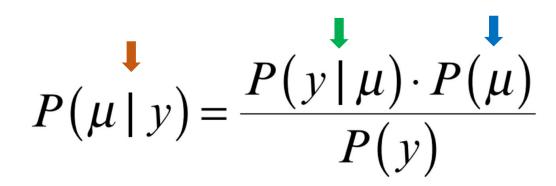
## **Bayes Theorem**

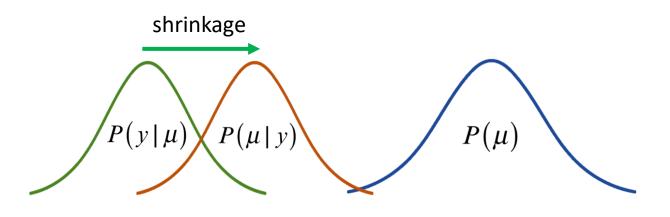
$$P(\mu|y) = \frac{P(y|\mu) \cdot P(\mu)}{P(y)} = \frac{P(y|\mu)}{P(y)} \cdot P(\mu)$$

$$\log(P(\mu|y)) = (\log(P(y|\mu)) - \log(P(y))) + \log(P(\mu))$$

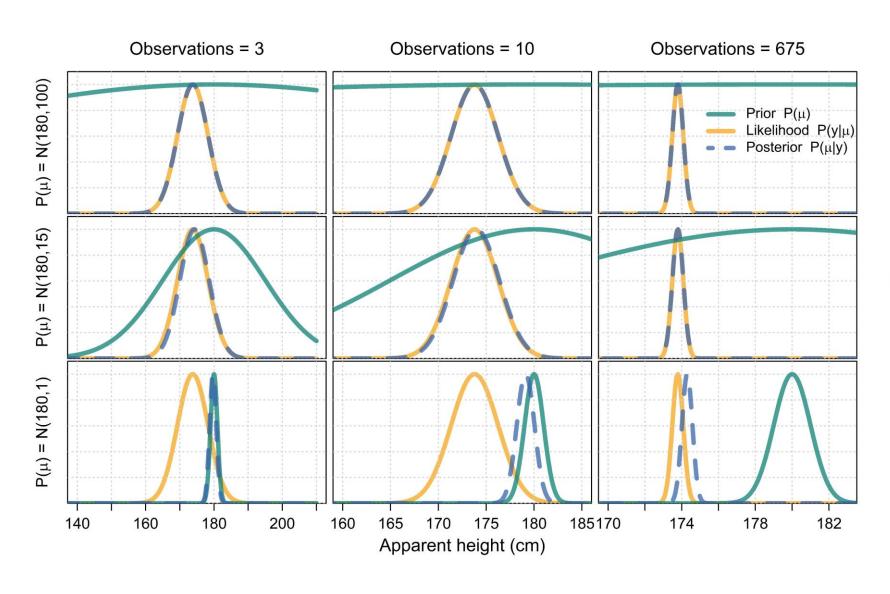
## Posterior Distributions and Shrinkage

- Las probabilidades a
   posteriori se pueden alejar
   de los valores de los
   parámetros más verosímiles,
   hacia los valores a priori.
- Este "tirón" se llama contracción ('shrinkage'), los valores se reducen hacia el prior.





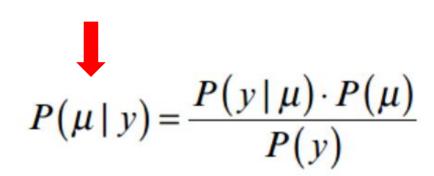
## Posterior Distributions and Shrinkage



$$P(\mu \mid y) = \frac{P(y \mid \mu) \cdot P(\mu)}{P(y)}$$

# Sampling from Posterior Distributions

- Muchos modelos complejos no se pueden analizar analíticamente.
- Las características de las probabilidades posteriores se investigan utilizando métodos numéricos.



 Los modelos bayesianos modernos requieren un software de muestreo sofisticado.

#### Stan and brms

 Stan – "Stan is a state-of-the-art platform for statistical modeling and high-performance statistical computation."

• brms – An interface for the easy use of Stan in R.

#### Data and Research Questions

```
# load book package and brms
library (bmmb)
library (brms)
# load and subset experimental data
data (exp data)
men = exp data[exp data$C v=='m',]
mens height = men$height
```

#### Data and Research Questions

Objetivo: Utilizar los datos de nuestro experimento para responder a estas preguntas:

(1) ¿Qué tan alto "suena" el hombre adulto promedio?

(2) ¿Podemos establecer límites a las alturas aparentes creíbles en función de los datos que recopilamos?

## Description of the Model

- La altura aparente para observación i se distribuye normalmente con algún valor esperado específico para esa observación y alguna desviación estándar desconocida (pero fija).
- El valor esperado para cualquier prueba determinada( $\mu_{[i]}$ ) es igual al intercepto del modelo para todos los ensayos (es decir, es fijo, tenemos el mismo valor esperado para todas las observaciones).

$$y_{[i]} \sim N(\mu_{[i]}, \sigma)$$
 height<sub>[i]</sub>  $\sim N(\mu_{[i]}, \sigma)$   
 $\mu_{[i]} = \alpha_1 \cdot 1$   $\mu_{[i]} = \text{Intercept}$ 

#### The Model Formula

• La variable dependiente va a la izquierda de la  $\sim$ , los predictores van a la derecha.

y ~ predictors

height ~ 1

## Fitting a Model



```
model = brms::brm (height ~ 1, data = men, chains = 1, cores = 1)
## Compiling Stan program...
## Start sampling
## SAMPLING FOR MODEL '03859e54349182b6cd9cd51aa7ca25d3' NOW
(CHAIN 1).
## Chain 1:
## Chain 1: Gradient evaluation took 0 seconds
## Chain 1: 1000 transitions using 10 leapfrog steps per
transition would take 0 seconds.
## Chain 1: Adjust your expectations accordingly!
## Chain 1:
## Chain 1:
## Chain 1: Iteration: 1 / 2000 [ 0%] (Warmup)
## Chain 1: Iteration: 200 / 2000 [ 10%]
                                           (Warmup)
## Chain 1: Iteration: 400 / 2000 [ 20%]
                                           (Warmup)
## Chain 1: Iteration: 600 / 2000 [ 30%]
                                           (Warmup)
## Chain 1: Iteration: 800 / 2000 [ 40%]
                                           (Warmup)
## Chain 1: Iteration: 1000 / 2000 [ 50%]
                                           (Warmup)
## Chain 1: Iteration: 1001 / 2000 [ 50%]
                                           (Sampling)
## Chain 1: Iteration: 1200 / 2000 [ 60%]
                                           (Sampling)
## Chain 1: Iteration: 1400 / 2000 [ 70%]
                                           (Sampling)
## Chain 1: Iteration: 1600 / 2000 [ 80%]
                                           (Sampling)
## Chain 1: Iteration: 1800 / 2000 [ 90%]
                                           (Sampling)
## Chain 1: Iteration: 2000 / 2000 [100%]
                                           (Sampling)
## Chain 1:
## Chain 1: Elapsed Time: 0.103 seconds (Warm-up)
## Chain 1:
                          0.057 seconds (Sampling)
## Chain 1:
                           0.16 seconds (Total)
```

#### The Model Print Statement

 Al evaluar el nombre del modelo en la consola, se muestra el resumen del modelo.

```
# inspect model
model
```

```
Family: gaussian
  Links: mu = identity; sigma = identity
Formula: height ~ 1
   Data: men (Number of observations: 675)
  Draws: 1 chains, each with iter = 2000; warmup = 1000; thin = 1;
         total post-warmup draws = 1000
Population-Level Effects:
          Estimate Est.Error 1-95% CI u-95% CI Rhat Bulk ESS Tail ESS
Intercept 173.78
                       0.30 173.16
                                      174.33 1.00
                                                        1055
                                                                  714
Family Specific Parameters:
      Estimate Est.Error 1-95% CI u-95% CI Rhat Bulk ESS Tail ESS
                                      8.21 1.00
          7.77
                   0.22
                            7.37
                                                    1139
                                                              741
sigma
Draws were sampled using sampling(NUTS). For each parameter, Bulk_ESS
and Tail_ESS are effective sample size measures, and Rhat is the potential
scale reduction factor on split chains (at convergence, Rhat = 1).
```

#### Fit and Model Information

• Información sobre el modelo y el muestreo realizado.

```
Family: gaussian
Links: mu = identity; sigma = identity

Formula: height ~ 1

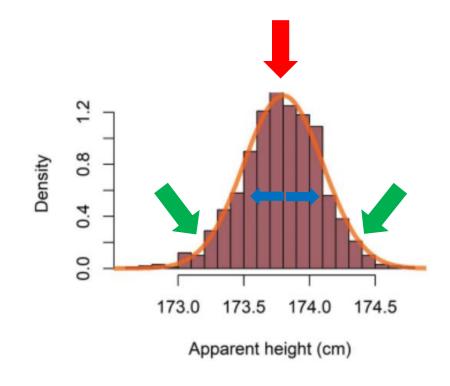
Data: men (Number of observations: 675)

Draws: 1 chains, each with iter = 2000; warmup = 1000; thin = 1;

total post-warmup draws = 1000
```

## Population-Level Effects

- "Population-level effects" son compartidos por todas las observaciones, o al menos por todas las observaciones de un grupo determinado.
- Tu modelo te dará información sobre la distribución posterior: la media, el error estándar y el intervalo de credibilidad del 95%.

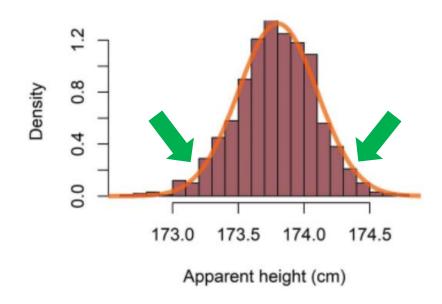


```
Population-Level Effects:

Estimate Est.Error 1-95% CI u-95% CI Rhat Bulk_ESS Tail_ESS
Intercept 173.78 0.30 173.16 174.33 1.00 1055 714
```

#### **Credible Intervals**

- Los intervalos creíbles (CI) indican qué valores son creíbles para los parámetros, en función de los datos y la estructura del modelo.
- Se basan en los cuantiles de su distribución posterior.
- Los intervalos del 95% son comunes, pero no especiales de ninguna manera.



```
Population-Level Effects:

Estimate Est.Error 1-95% CI u-95% CI Rhat Bulk_ESS Tail_ESS
Intercept 173.78 0.30 173.16 174.33 1.00 1055 714
```

## Family Specific Parameters

 La mayoría de las distribuciones tienen al menos un parámetro de ubicación (como μ). height<sub>[i]</sub> ~  $N(\mu_{[i]}, \sigma)$  $\mu_{[i]} = Intercept$ 

• Algunas distribuciones tienen *otros* parámetros (por ejemplo,  $\sigma$ ). Estos van en los 'family specific parameters'.

```
Family Specific Parameters:

Estimate Est.Error 1-95% CI u-95% CI Rhat Bulk_ESS Tail_ESS sigma 7.77 0.22 7.37 8.21 1.00 1139 741
```

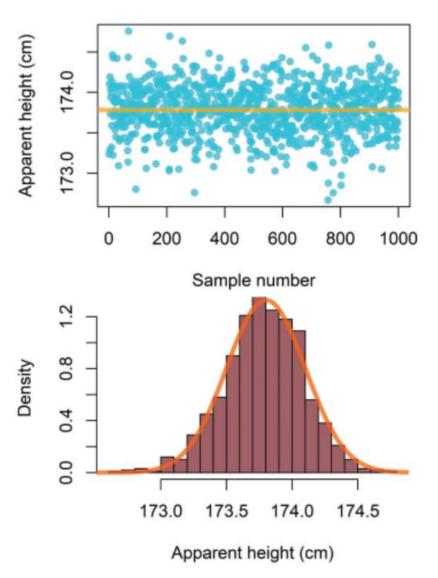
# **Boilerplate Text**

 Relacionado con el proceso de muestreo, más o menos lo mismo siempre.

Draws were sampled using sampling(NUTS). For each parameter, Bulk\_ESS and Tail\_ESS are effective sample size measures, and Rhat is the potential scale reduction factor on split chains (at convergence, Rhat = 1).

# Seeing the Samples

```
# get posterior samples from model
samples = bmmb::get samples (model)
# check number of samples
nrow (samples)
  [1] 1000
# see first six samples
head (samples)
##
     b_Intercept sigma lprior lp__
## 1
           173.2 7.518 -5.885 -2347
           174.1 7.613 -5.880 -2345
           173.3 7.940 -5.945 -2346
           174.2 7.564 -5.872 -2346
           173.7 7.879 -5.924 -2345
## 6
           174.0 7.859 -5.916 -2345
```



## Getting the Residuals

```
model_residuals = residuals (model, )
head (model_residuals)

## Estimate Est.Error Q2.5 Q97.5

## [1,] -3.8844 0.2988 -4.4347 -3.2638

## [2,] -0.2844 0.2988 -0.8347 0.3362

## [3,] -1.7844 0.2988 -2.3347 -1.1638

## [4,] -16.0844 0.2988 -16.6347 -15.4638

## [5,] -20.3844 0.2988 -20.9347 -19.7638

## [6,] 0.4156 0.2988 -0.1347 1.0362
```

```
model_residuals = residuals (model, summary=FALSE)
dim (model_residuals)
## [1] 1000 675
```

## Getting the Residuals

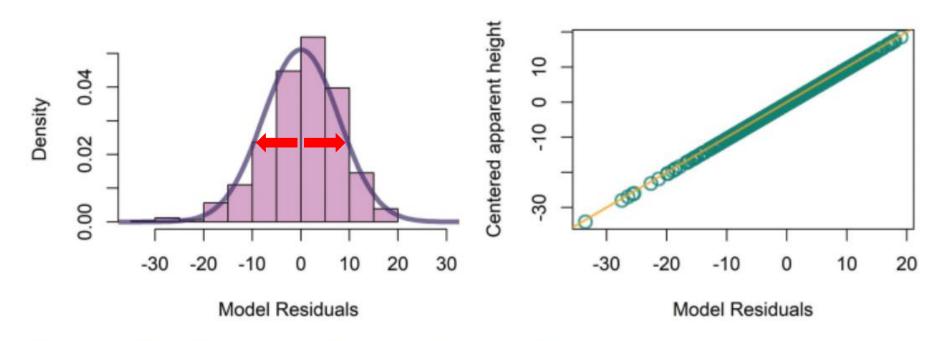


Figure 3.3 (left) Histogram of the residuals for model. (right) A comparison of our residuals and centered height judgments shows that these are nearly equal.

```
Family Specific Parameters:

Estimate Est.Error 1-95% CI u-95% CI Rhat Bulk_ESS Tail_ESS sigma 7.77 0.22 7.37 8.21 1.00 1139 741
```

### Model Convergence

```
## Warning messages:
## 1: Bulk Effective Samples Size (ESS) is too low,
indicating posterior means and
## medians may be unreliable. Running the chains for more
iterations may help. See:
## http://mc-stan.org/misc/warnings.html#bulk-ess
## 2: Tail Effective Samples Size (ESS) is too low,
indicating posterior variances
## and tail quantiles may be unreliable.
## Running the chains for more iterations may help. See
## http://mc-stan.org/misc/warnings.html#tail-ess
```

```
Population-Level Effects:

Estimate Est.Error 1-95% CI u-95% CI Rhat Bulk_ESS Tail_ESS
Intercept 173.78 0.30 173.16 174.33 1.00 1055 714
```

## Model Convergence: Cores and Chains

- Cada secuencia de muestras es una 'cadena'.
- Puede estimar varias cadenas simultáneamente en varios núcleos.
- Esto puede acelerar bastante el tiempo de cálculo.

```
parallel::detectCores()

# Fit the model yourself
model_multicore =
   brms::brm (height ~ 1, data = men, chains = 4, cores = 4)
```

### Model Convergence: Iterations and Warmup

- Stan utiliza el calentamiento para afinar el sampler y encontrar buenos valores de parámetros.
- Solo se conservan las muestras después del calentamiento: iter-warmup.

## Model Convergence: Thinning

- 'Thinning' conserva solo cada enésima muestra: (iter – warmup)/thin.
- Por lo tanto, si está muestreando de cores cadenas, terminará con: (iter warmup)/thin · cores muestras totales.

#### **Divergent Transitions**

- Las transiciones divergentes no deben ser ignoradas.
- Te dicen que algo anda mal con tu modelo.

```
## There were n divergent transitions after warmup.

Increasing adapt_delta

## above 0.8 may help. See

## http://mc-stan.org/misc/warnings.html#divergent-

transitions-after-warmup`
```

 Puede (tal vez) solucionar esto cambiando adapt\_delta como se muestra debajo.

```
brms::brm (height ~ 1, data = men, chains = 4, cores = 4, warmup = 1000,
    iter = 3000, thin = 2, control = list(adapt_delta = 0.9))
```

## **Specifying Priors**

- La función get\_prior se puede utilizar para ver cuales priors necesita tu modelo.
- Puede especificar priores para las clases de parámetros.
   Hasta el momento, estos son:
  - Intercept: Una clase única, solo para interceptaciones.
  - sigma: Esto es para la desviación estándar de nuestros parámetros de error, sigma ( $\sigma$ ).

# **Specifying Priors**

- Puede establecer priores utilizando la función set\_prior.
- Puede hacer esto para clases completas o para parámetros individuales (más sobre esto más adelante).
- Abajo, especificamos los valores previos para nuestros dos parámetros del modelo.

### An Updated Model Description

height<sub>[i]</sub> ~ 
$$N(\mu_{[i]}, \sigma)$$
  
 $\mu_{[i]} = Intercept$ 

```
Priors:

Intercept ~ N(176,15)

\sigma ~ N(0,15)
```

### An Updated Model Description

## Comparison of Slightly Different Priors

```
bmmb::short_summary (model_thinned)
## Formula: height ~ 1
## Population-Level Effects:
## Estimate Est.Error 1-95% CI u-95% CI
## Intercept 173.8 0.3 173.2 174.4
##
## Family Specific Parameters:
## Estimate Est.Error 1-95% CI u-95% CI
## sigma 7.77 0.21 7.38 8.2
```

```
bmmb::short_summary (model_priors)
## Formula: height ~ 1
## Population-Level Effects:
## Estimate Est.Error 1-95% CI u-95% CI
## Intercept 173.8 0.31 173.2 174.4
##
## Family Specific Parameters:
## Estimate Est.Error 1-95% CI u-95% CI
## sigma 7.77 0.21 7.37 8.19
```

### The Log Prior and Log Posterior Densities

- Esta parte será importante cuando hablemos de comparación de modelos.
- Realmente no necesitas preocuparte por eso por ahora.
- ¿Qué son el logaritmo posterior (lp) y el logaritmo previo (lprior)?

```
# get posterior samples from model
samples = bmmb::get samples (model)
# check number of samples
nrow (samples)
## [1] 1000
 see first six samples
head (samples)
     b Intercept sigma lprior lp
           173.2 7.518 -5.885 -2347
           174.1 7.613 -5.880 -2345
           173.3 7.940 -5.945 -2346
           174.2 7.564 -5.872 -2346
           173.7 7.879 -5.924 -2345
           174.0 7.859 -5.916 -2345
```

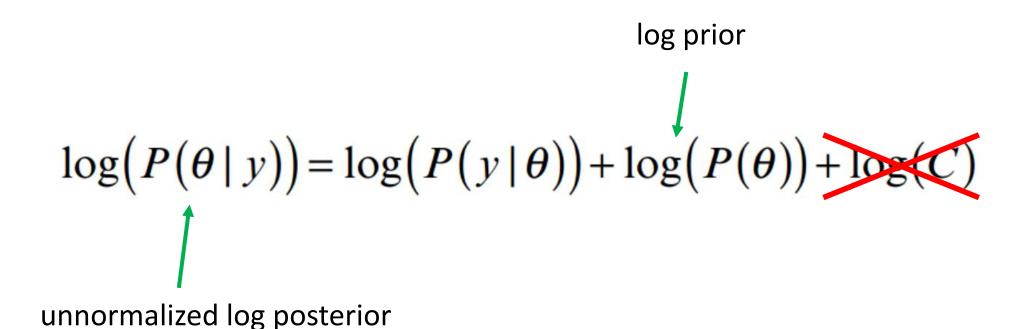
### The Log Prior and Log Posterior Densities

$$P(\mu \mid y) = \frac{P(y \mid \mu) \cdot P(\mu)}{P(y)}$$

$$P(\theta \mid y) = [P(y \mid \theta) \cdot P(\theta)] \cdot C$$

$$\log(P(\theta \mid y)) = \log(P(y \mid \theta)) + \log(P(\theta)) + \log(C)$$

### The Log Prior and Log Posterior Densities

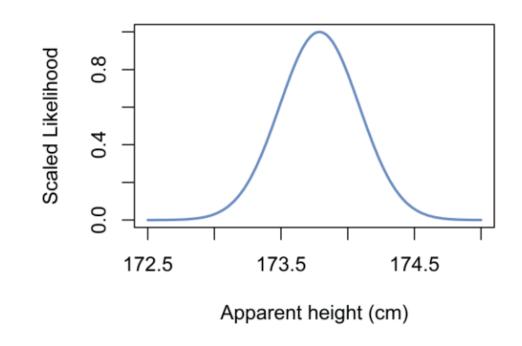


## Answering our Research Questions: Last Week

(1) ¿Qué tan alto "suena" el hombre adulto promedio?

Unos 173.8 cm de altura.

(2) ¿Podemos establecer límites a las alturas aparentes creíbles en función de los datos que recopilamos?

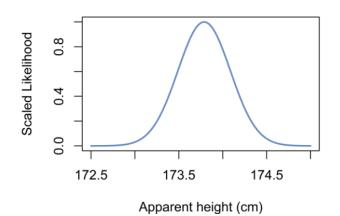


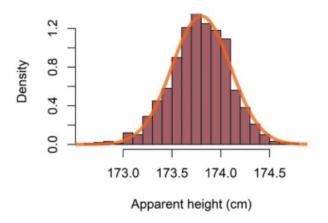
Sí, entre 173 y 174.5 cm.

### Answering our Research Questions: This Week

- (1) ¿Qué tan alto "suena" el hombre adulto promedio?
- (2) ¿Podemos establecer límites a las alturas aparentes medias creíbles en función de los datos que hemos recopilado?

Según nuestro modelo, es probable que la altura aparente media de los machos adultos sea de 173.8 cm, y existe una probabilidad del 95% de que la media poblacional esté entre 173.2 y 174.4 dados nuestros datos y la estructura del modelo.





```
## Population-Level Effects:

## Estimate Est.Error 1-95% CI u-95% CI Rhat Bulk_ESS Tail_ESS

## Intercept 173.78 0.30 173.16 174.33 1.00 1055 714
```

### **Answering our Research Questions**

• En un artículo podríamos informar esto como: "La altura aparente media es 174 cm (C.I. = 0.3, IC 95% = [173.2, 174.4])".

```
## Population-Level Effects:
## Estimate Est.Error 1-95% CI u-95% CI Rhat Bulk_ESS Tail_ESS
## Intercept 173.78 0.30 173.16 174.33 1.00 1055 714
```

• ¡Es necesario presentar los intervalos además de las estimaciones puntuales!

## Traditionalist's Corner: One-Sample t-test

```
t.test (mens height)
   One Sample t-test
##
## data: mens height
## t = 582, df = 674, p-value <2e-16
## alternative hypothesis: true mean is not equal to 0
## 95 percent confidence interval:
## 173.2 174.4
## sample estimates:
## mean of x
```

```
## Population-Level Effects:

## Estimate Est.Error 1-95% CI u-95% CI Rhat Bulk_ESS Tail_ESS

## Intercept 173.78 0.30 173.16 174.33 1.00 1055 714
```

# Traditionalist's Corner: OLS Regression

```
## Population-Level Effects:

## Estimate Est.Error 1-95% CI u-95% CI Rh

## Intercept 173.78 0.30 173.16 174.33 1

##

## Family Specific Parameters:

## Estimate Est.Error 1-95% CI u-95% CI Rhat

## sigma 7.77 0.22 7.37 8.21 1.00
```

```
ols_model = lm (mens_height ~ 1)
summary (ols model)
##
## Call:
## lm(formula = mens height ~ 1)
##
## Residuals:
     Min
         10 Median 30 Max
## -34.09 -4.59 0.71 5.31 18.51
##
## Coefficients:
              Estimate Std. Error t val
  (Intercept) 173.788
  Signif. codes: 0 '***' 0.001
  Residual standard error: 7.76 on 674
```

#### **Exercises**

Use the data in 'exp\_ex' to do one of the following. You may also use your own data to answer a related question. In any case, describe the model, present and explain the results, and include at least two figures.

- Easy: Analyze the (pre-fit) model that's exactly like model\_priors, except using the data in exp\_ex (bmmb::get\_model("3\_model\_priors\_ex.RDS")).
- 2. Medium: Fit a model just like model\_priors, but for the data from some other group, for either the original or big resonance levels.
- Hard: Fit two models like model\_priors for two arbitrary groups, and compare results across models.

BE CAREFUL: Data must be normally distributed, not skewed, not distributed near its bounds...