

Tutoriel sur les tests multiples (et au-delà)

Timothée Flutre

16/06/2015

Pré-requis

Tester une seule “association potentielle”

Tester de multiples “associations potentielles”

Perspectives

Annexes

Licence: CC BY-SA 4.0

Pré-requis

Philo de modélisation statistique en trois phrases

- ▶ Box (1987): “Essentially, all models are wrong, but some are useful.”

Philo de modélisation statistique en trois phrases

- ▶ Box (1987): “Essentially, all models are wrong, but some are useful.”
- ▶ Kass (2011): “When we use a statistical model to make a statistical inference, we implicitly assert that the variation exhibited by data is captured reasonably well by the statistical model, so that the theoretical world corresponds reasonably well to the real world.”

Philo de modélisation statistique en trois phrases

- ▶ Box (1987): “Essentially, all models are wrong, but some are useful.”
- ▶ Kass (2011): “When we use a statistical model to make a statistical inference, we implicitly assert that the variation exhibited by data is captured reasonably well by the statistical model, so that the theoretical world corresponds reasonably well to the real world.”
- ▶ Berger & Berry (1988): “It is not possible to provide an absolutely objective answer [to a statistical test]; the strength of the evidence will depend on the person interpreting the data.”

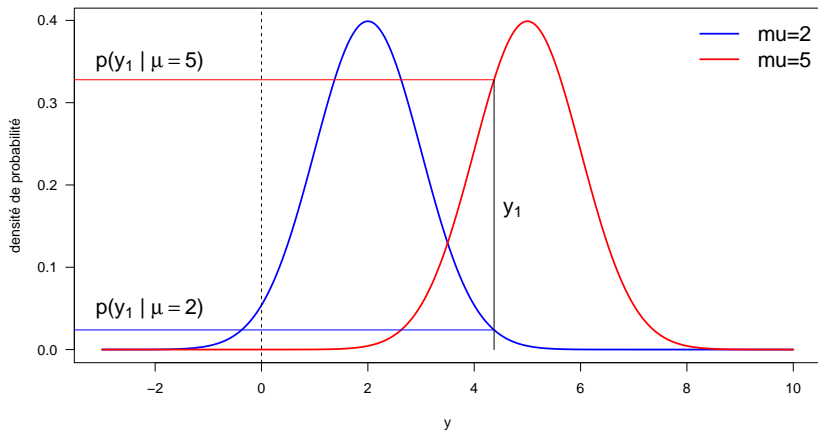
Notations

- ▶ données: variables observées, lettres romaines, y, x
 - ▶ paramètres: variables non-observées, lettres grecques, θ, β
 - ▶ ensembles: majuscules, \mathcal{D} (données) et Θ (paramètres)
 - ▶ vecteurs: en gras, $\mathbf{y}, \boldsymbol{\beta}$
-
- ▶ vraisemblance: proba des données sachant les paramètres, mais fonction des paramètres, $\mathcal{L}(\Theta) = p(\mathcal{D} | \Theta)$
 - ▶ maximum de vraisemblance: pour estimer les paramètres, $\hat{\theta} = \operatorname{argmax}_{\theta} \mathcal{L} \Leftrightarrow \frac{\partial \mathcal{L}}{\partial \theta}(\hat{\theta}) = 0$

Concrètement...

Simuler $Y \sim \mathcal{N}(\mu, \sigma^2)$ avec $\sigma^2 = 1$ renvoie $y_1 = 4.37$: que vaut μ ?

$$\mathcal{L}(\mu) = p(y_1|\mu) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp\left(-\frac{(y_1-\mu)^2}{2}\right)$$



Tester une seule “association potentielle”

Exemple 1

On veut tester si le SNP chr3_716254_A_C est associé avec le caractère “rendement” au sein de N variétés.

- ▶ données \mathcal{D} : (x_i, y_i) génotype et phénotype de la variété i
- ▶ paramètres Θ : μ moyenne globale, β effet du génotype, σ^2 variance des erreurs
- ▶ hypothèses: ...
- ▶ vraisemblance $\mathcal{L}(\Theta) = p(\mathcal{D}|\Theta)$:

$$\forall i, y_i = \mu + \beta x_i + \epsilon_i \text{ avec } \epsilon_i \stackrel{iid}{\sim} \mathcal{N}(0, \sigma^2)$$

- ▶ estimer par maximum de vraisemblance l'effet du génotype au SNP sur le phénotype, $\hat{\beta}$, et son erreur standard, s

Exemple 2

On veut tester si l'expression du gène MAP3 dans la variété Inadur change selon qu'on irrigue ou pas.

- ▶ données \mathcal{D} : (x_i, y_i) indicateur d'irrigation et expression pour le plant i
- ▶ paramètres Θ : μ moyenne globale, β effet de l'irrigation, σ^2 variance des erreurs
- ▶ hypothèses: ...
- ▶ vraisemblance $\mathcal{L}(\Theta) = p(\mathcal{D}|\Theta)$:

$$\forall i, y_i = \mu + \beta x_i + \epsilon_i \text{ avec } \epsilon_i \stackrel{iid}{\sim} \mathcal{N}(0, \sigma^2)$$

- ▶ estimer par maximum de vraisemblance l'effet de l'irrigation sur l'expression du gène, $\hat{\beta}$, et son erreur standard, s

Estimation de paramètre

Procédure générique: maximum de vraisemblance

- ▶ vraisemblance: $\mathcal{L}(\Theta) = \prod_{i=1}^N p(y_i | x_i, \mu, \beta, \sigma)$

Estimation de paramètre

Procédure générique: maximum de vraisemblance

- ▶ vraisemblance: $\mathcal{L}(\Theta) = \prod_{i=1}^N p(y_i|x_i, \mu, \beta, \sigma)$
- ▶ maximisation: $\frac{\partial \mathcal{L}}{\partial \beta}(\hat{\beta}) = 0$

Estimation de paramètre

Procédure générique: maximum de vraisemblance

- ▶ vraisemblance: $\mathcal{L}(\Theta) = \prod_{i=1}^N p(y_i | x_i, \mu, \beta, \sigma)$
- ▶ maximisation: $\frac{\partial \mathcal{L}}{\partial \beta}(\hat{\beta}) = 0$
- ▶ estimation: $\hat{\beta} = \frac{\sum_i (x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})}{\sum_i (x_i - \bar{x})^2}$

Estimation de paramètre

Procédure générique: maximum de vraisemblance

- ▶ vraisemblance: $\mathcal{L}(\Theta) = \prod_{i=1}^N p(y_i | x_i, \mu, \beta, \sigma)$
- ▶ maximisation: $\frac{\partial \mathcal{L}}{\partial \beta}(\hat{\beta}) = 0$
- ▶ estimation: $\hat{\beta} = \frac{\sum_i (x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})}{\sum_i (x_i - \bar{x})^2}$
- ▶ estimateur fréquentiste: $B = \frac{\sum_i (x_i - \bar{x})(Y_i - \bar{Y})}{\sum_i (x_i - \bar{x})^2}$

Estimation de paramètre

Procédure générique: maximum de vraisemblance

- ▶ vraisemblance: $\mathcal{L}(\Theta) = \prod_{i=1}^N p(y_i | x_i, \mu, \beta, \sigma)$
- ▶ maximisation: $\frac{\partial \mathcal{L}}{\partial \beta}(\hat{\beta}) = 0$
- ▶ estimation: $\hat{\beta} = \frac{\sum_i (x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})}{\sum_i (x_i - \bar{x})^2}$
- ▶ estimateur fréquentiste: $B = \frac{\sum_i (x_i - \bar{x})(Y_i - \bar{Y})}{\sum_i (x_i - \bar{x})^2}$
- ▶ $E[B] = \beta$ et $V[B] = \frac{\sigma^2}{\sum_i (x_i - \bar{x})^2} \Rightarrow s^2 = \frac{1}{N-2} \frac{\sum_i (y_i - \hat{y}_i)^2}{\sum_i (x_i - \bar{x})^2}$

Estimation de paramètre

Procédure générique: maximum de vraisemblance

- ▶ vraisemblance: $\mathcal{L}(\Theta) = \prod_{i=1}^N p(y_i | x_i, \mu, \beta, \sigma)$
- ▶ maximisation: $\frac{\partial \mathcal{L}}{\partial \beta}(\hat{\beta}) = 0$
- ▶ estimation: $\hat{\beta} = \frac{\sum_i (x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})}{\sum_i (x_i - \bar{x})^2}$
- ▶ estimateur fréquentiste: $B = \frac{\sum_i (x_i - \bar{x})(Y_i - \bar{Y})}{\sum_i (x_i - \bar{x})^2}$
- ▶ $E[B] = \beta$ et $V[B] = \frac{\sigma^2}{\sum_i (x_i - \bar{x})^2} \Rightarrow s^2 = \frac{1}{N-2} \frac{\sum_i (y_i - \hat{y}_i)^2}{\sum_i (x_i - \bar{x})^2}$
- ▶ hypothèse: erreurs Normales $\Rightarrow Y_i \sim \mathcal{N} \Rightarrow B \sim \mathcal{N}$

Test d'hypothèse

- ▶ hypothèse nulle, H_0 : “ $\beta = 0$ ”

Test d'hypothèse

- ▶ hypothèse nulle, H_0 : “ $\beta = 0$ ”
- ▶ statistique de test (Wald): $Z|H_0 = \frac{B}{\sqrt{\text{Var}(B)}} \sim \mathcal{N}(0, 1)$

Test d'hypothèse

- ▶ hypothèse nulle, H_0 : “ $\beta = 0$ ”
- ▶ statistique de test (Wald): $Z|H_0 = \frac{B}{\sqrt{\text{Var}(B)}} \sim \mathcal{N}(0, 1)$
- ▶ réalisation: $z = \frac{\hat{\beta}}{s}$

Test d'hypothèse

- ▶ hypothèse nulle, H_0 : “ $\beta = 0$ ”
- ▶ statistique de test (Wald): $Z|H_0 = \frac{B}{\sqrt{\text{Var}(B)}} \sim \mathcal{N}(0, 1)$
- ▶ réalisation: $z = \frac{\hat{\beta}}{s}$
- ▶ probabilité critique: $p = P(Z \geq z|H_0)$

Test d'hypothèse

- ▶ hypothèse nulle, H_0 : “ $\beta = 0$ ”
- ▶ statistique de test (Wald): $Z|H_0 = \frac{B}{\sqrt{\text{Var}(B)}} \sim \mathcal{N}(0, 1)$
- ▶ réalisation: $z = \frac{\hat{\beta}}{s}$
- ▶ probabilité critique: $p = P(Z \geq z|H_0)$
- ▶ Wald: approxime LRT mais équivalent asymptotiquement

Test d'hypothèse

- ▶ hypothèse nulle, H_0 : “ $\beta = 0$ ”
- ▶ statistique de test (Wald): $Z|H_0 = \frac{B}{\sqrt{\text{Var}(B)}} \sim \mathcal{N}(0, 1)$
- ▶ réalisation: $z = \frac{\hat{\beta}}{s}$
- ▶ probabilité critique: $p = P(Z \geq z|H_0)$
- ▶ Wald: approxime LRT mais équivalent asymptotiquement
- ▶ Z-score: perte d'info de $(\hat{\beta}, s)$ à z

Simuler un petit jeu de données

```
set.seed(1859)
N <- 100
x <- rbinom(n=N, size=2, prob=0.3)
mu <- 4
pve <- 0.4 # = var(x beta) / var(y)
sigma <- 1
(beta <- sigma * sqrt(pve / ((1 - pve) * var(x))))
```

```
## [1] 1.338481
```

```
e <- rnorm(n=N, mean=0, sd=sigma)
y <- mu + beta * x + e
```

Faire l'inférence (built-in)

```
##
```

```
## Call:
```

```
## lm(formula = y ~ x)
```

```
##
```

```
## Residuals:
```

```
##      Min       1Q   Median       3Q      Max
```

##	-2.6384	-0.6207	-0.1253	0.6976	2.4843
----	---------	---------	---------	--------	--------

```
##
```

```
## Coefficients:
```

```
##              Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
```

## (Intercept)	4.1229	0.1331	30.965	< 2e-16 ***
## x	1.0450	0.1639	6.376	5.98e-09 ***

```
## ---
```

```
## Signif. codes:  0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1
```

```
##
```

```
## Residual standard error: 0.9948 on 98 degrees of freedom
```

```
## Multiple R-squared:  0.2932, Adjusted R-squared:  0.286
```

```
## F-statistic: 40.66 on 1 and 98 DF, p-value: 5.975e-09
```

Faire l'inférence (custom, estimation)

```
(beta.hat <- ((t(x) %*% y - N * mean(x) * mean(y)) /  
              (t(x) %*% x - N * mean(x)^2))[1,1])
```

```
## [1] 1.045039
```

```
(sigma.hat <- sqrt((1/(N-2) * sum(res$residuals^2))))
```

```
## [1] 0.9947526
```

```
(se.beta.hat <- sqrt(sigma.hat^2 /  
                    (t(x) %*% x - N * mean(x)^2)[1,1]))
```

```
## [1] 0.1638911
```

Faire l'inférence (custom, test)

```
(z.score <- beta.hat / se.beta.hat)
```

```
## [1] 6.376424
```

```
(pvalue <- 2 * pt(q=z.score, df=N-2, lower.tail=FALSE))
```

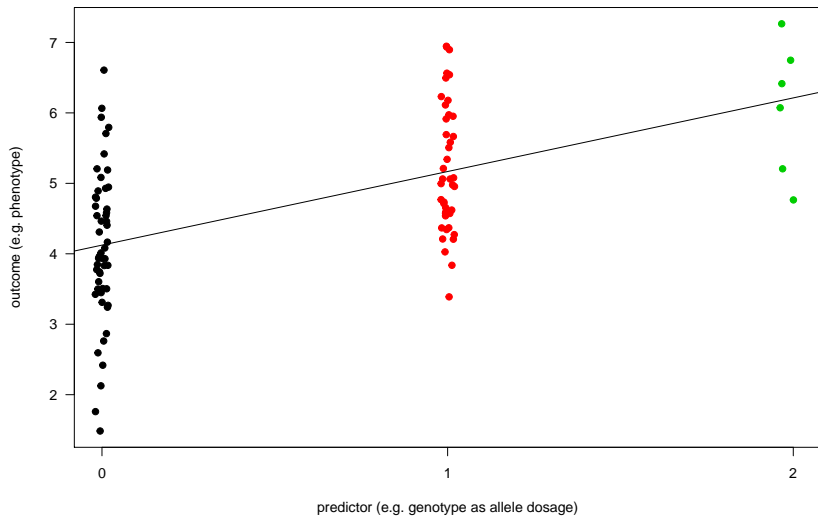
```
## [1] 5.975296e-09
```

```
(pvalue <- 2 * pnorm(q=z.score, mean=0, sd=1, lower.tail=FALSE))
```

```
## [1] 1.812709e-10
```

Visuellement

Simple linear regression



Significativité de l'association

Si l'hypothèse nulle est fausse, on s'attend à ce que la proba critique soit faible, donc on rejette H_0 si $p \leq \text{seuil}$, mais lequel?

Plusieurs cas possibles:

	garder H_0	rejeter H_0
H_0 vraie	VN	FP
H_0 fausse	FN	VP

On veut généralement limiter la proba, notée α , d'avoir un faux positif (erreur de type I).

Comme, sous H_0 , la proba critique suit une loi Uniforme sur $[0, 1]$, on a donc: $P(p \leq \text{seuil} | H_0) = \text{seuil}$.

\Rightarrow on choisit de rejeter H_0 si $p \leq \alpha$, par ex le fameux 5%

Point de vue bayésien

facteur de bayes:
$$BF = \frac{P(\mathcal{D}|H_0)}{P(\mathcal{D}|H_1)} = \frac{\int p(\Theta_0) p(\mathcal{D}|\Theta_0) d\Theta_0}{\int p(\Theta_1) p(\mathcal{D}|\Theta_1) d\Theta_1}$$

- ▶ garder H_0 si $\frac{P(H_0|\mathcal{D})}{P(H_1|\mathcal{D})} = BF \frac{P(H_0)}{P(H_1)} < \frac{\text{coût}_{II}}{\text{coût}_I}$
- ▶ difficultés: intégration, prior, seuil

Idée (Johnson, Wakefield, Wen & Stephens): remplacer la vraisemblance $\mathbf{y}|\Theta$ par $\hat{\beta}|\beta \sim \mathcal{N}(\beta, s^2)$

- ▶ $BF \approx ABF = \sqrt{\frac{s_0^2 + s^2}{s^2}} \exp\left(-\frac{z^2}{2} \frac{s_0^2}{s_0^2 + s^2}\right)$ avec $\beta \sim \mathcal{N}(0, s_0^2)$

Pour un N donné et un s_0^2 peu informatif, choisir $P(H_0)$ (ex. 0.5) et $\frac{\text{coût}_{II}}{\text{coût}_I}$ (ex. 1) permet de choisir le seuil sur le Z-score, et donc sur la proba critique, *seuil qui dépend maintenant de la puissance du test (via nb d'échantillons, N), quel que soit le nombre de tests...*

Tester de multiples “associations potentielles”

Une analyse typique de génomique

1. génotyper N individus à P marqueurs, et phénotyper ces individus; ou bien mesurer l'expression de P gènes chez N individus avec ou sans traitement

Une analyse typique de génomique

1. génotyper N individus à P marqueurs, et phénotyper ces individus; ou bien mesurer l'expression de P gènes chez N individus avec ou sans traitement
2. estimer chaque effet par maxlik, $\hat{\beta}_j$ (erreur standard s_j)

Une analyse typique de génomique

1. génotyper N individus à P marqueurs, et phénotyper ces individus; ou bien mesurer l'expression de P gènes chez N individus avec ou sans traitement
2. estimer chaque effet par maxlik, $\hat{\beta}_j$ (erreur standard s_j)
3. les transformer en scores standardisés, $z_j = \frac{\hat{\beta}_j}{s_j}$

Une analyse typique de génomique

1. génotyper N individus à P marqueurs, et phénotyper ces individus; ou bien mesurer l'expression de P gènes chez N individus avec ou sans traitement
2. estimer chaque effet par maxlik, $\hat{\beta}_j$ (erreur standard s_j)
3. les transformer en scores standardisés, $z_j = \frac{\hat{\beta}_j}{s_j}$
4. calculer les valeurs critiques, p_j , en supposant $Z_j|H_0 \sim \mathcal{N}(0, 1)$

Cas possibles (tableau)

	garder H_0	rejeter H_0	
H_0 vraie	VN	FP	P_0
H_0 fausse	FN	VP	P_1
		R	P

Problème

Avec la même procédure que précédemment, le nombre de faux positifs augmente linéairement avec le nombre de tests...

Par exemple, même si H_0 est toujours fausse ($P_0 = P$) et $\alpha = 5\%$:

- ▶ $P = 500 \Rightarrow E[FP] = 25$
- ▶ $P = 1000 \Rightarrow E[FP] = 50$
- ▶ $P = 2000 \Rightarrow E[FP] = 100$

Family-Wise Error rate (FWER)

A contrôler, par exemple via la procédure de Bonferroni:

$$\begin{aligned} FWER|\mathcal{H}_0 &= \Pr(FP \geq 1|\mathcal{H}_0) = \Pr\left(\bigcup_{j=1}^P \{p_j \leq \alpha_j | H_{0j}\}\right) \\ &\leq \sum_j \Pr(p_j \leq \alpha_j | H_{0j}) \\ &\leq \sum_j \alpha_j \leq \alpha \quad \text{si } \forall j \alpha_j \leq \alpha \end{aligned}$$

- ▶ en pratique: `R> p.adjust(pvalues, "bonferroni")`
- ▶ FWER: critère (très) stringent (surtout si P large)
- ▶ Bonferroni: d'autant plus conservatif que tests corrélés

False Discovery rate (FDR)

$FDR = E[FP/R]$ et, par définition, $FDR = 0$ si $R = 0$

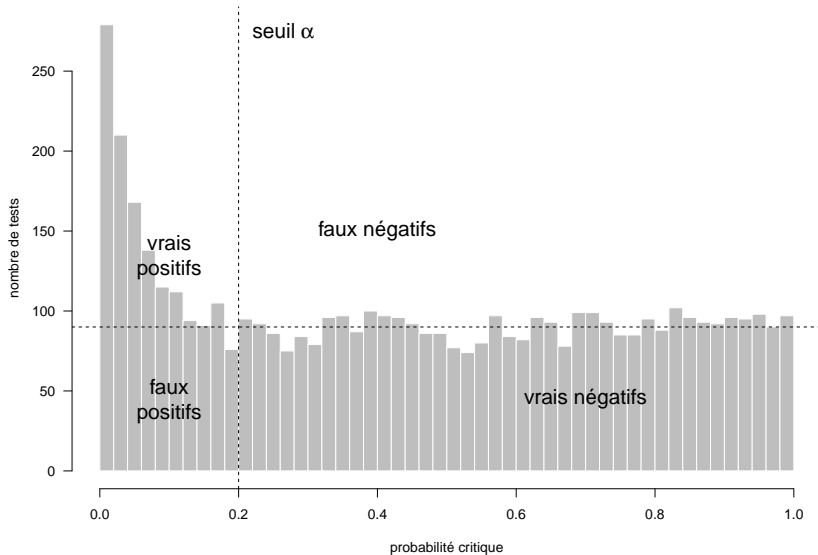
A contrôler, par exemple via la procédure de Benjamini-Hochberg:

- ▶ en pratique: `R > p.adjust(pvalues, "bh")`

Remarquez: $FDR = \Pr(R > 0) E[FP/R | R > 0]$

- ▶ problème: contrôler le FDR peut se faire en diminuant $\Pr(R > 0)$ et non $E[FP/R | R > 0]$...
- ▶ solution: contrôler le positive FDR: $pFDR = E[FP/R | R > 0]$

Cas possibles (graphique)

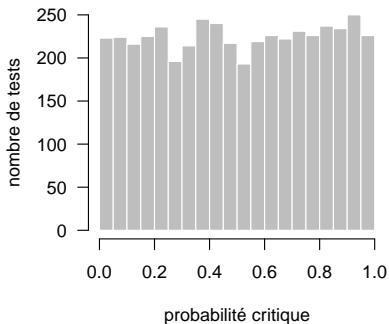


pFDR et modèle de mélange

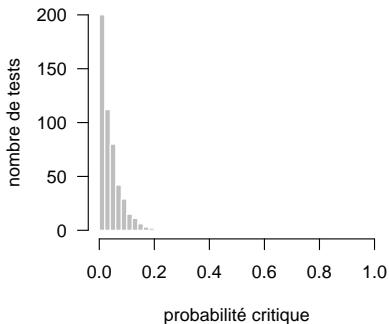
$$\forall j, p_j = \pi_0 \mathcal{U}_{[0,1]} + (1 - \pi_0) f_1$$

Exemple avec $\pi_0 = 0.9$:

Proba critiques sous H0



Proba critiques sous H1



Procédure de Storey

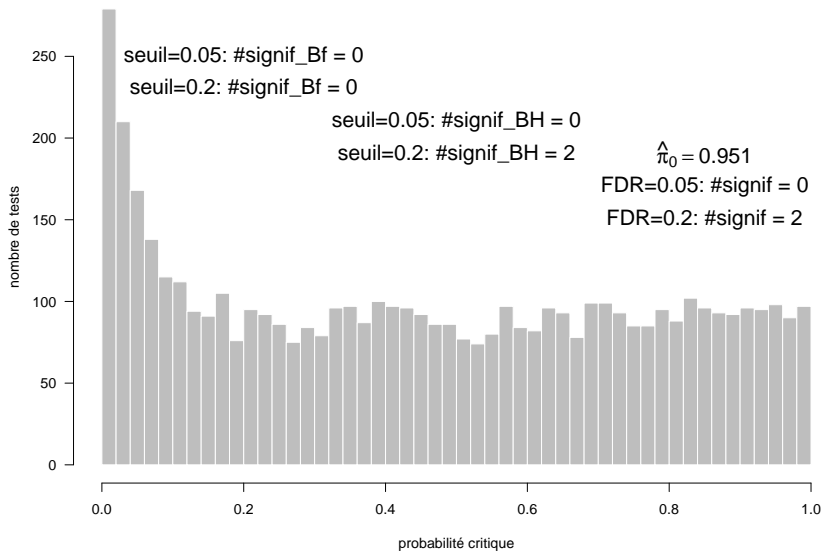
$$\widehat{pFDR}(\alpha) = \hat{\pi}_0 \frac{\alpha P}{\#\{p_j \leq \alpha\}}$$

- ▶ $\hat{\pi}_0$: calculer avec les proba critiques proches de 1

Si on ne veut pas fixer le seuil α par avance, on peut calculer une q -value par test, cad le pFDR pour tous les tests aussi *ou plus* significatifs que le test en question (fréquentiste):

- ▶ en pratique: `R> qvalue(pvalues)`

Application sur l'exemple



local FDR (lfdr)

Proba qu'une certaine découverte est fausse à un seuil donné:

$$lfdr_j = \Pr(\beta_j = 0 | z_j)$$

- ▶ via le modèle de mélange en bayésien: $lfdr_j = \frac{\pi_0 f(z_j | \beta_j)}{f(z_j)}$

En pratique:

- ▶ p_j transformée: locfdr (Efron, mais archive CRAN)
- ▶ z_j : mixfdr (Muralidharan, aussi archive CRAN)
- ▶ $\hat{\beta}_j, s_j$: ashR (Stephens, dépôt GitHub)

False Sign rate (FSR)

Gelman & Tuerlinckx (2000): “we do not believe that $\beta = 0$ is a reasonable possibility for continuous parameters”

- ▶ type S error: wrongly identifying the sign of β with confidence

$\Pr(\text{type S error} \mid \text{claim with confidence})$

$$= \Pr(\text{sign}(\beta_j) \neq \text{sign}(\hat{\beta}_j) \mid 0 \notin \hat{\beta}_j \pm 1.96 s_j)$$

Perspectives

Erreurs corrélées

Vraisemblance: $\forall j, \mathbf{y} = \mathbf{1}\mu + \mathbf{x}_j\beta_j + Z\mathbf{u} + \epsilon$

- ▶ $\mathbf{u} \sim \mathcal{N}(\mathbf{0}, \sigma_a^2 K)$
- ▶ $\epsilon \sim \mathcal{N}(\mathbf{0}, \sigma^2 I)$
- ▶ $\text{Cov}[\mathbf{u}, \epsilon] = 0$

Utiliser le logiciel GEMMA (Zhou & Stephens, 2012):

- ▶ pour chaque SNP: $\hat{\beta}_j$ et s_j , statistique de Wald, p-value
- ▶ q-value, etc

Analyser tous les SNPs dans le même modèle

Vraisemblance: $\mathbf{y} = \mathbf{1}\mu + X\boldsymbol{\beta} + \boldsymbol{\epsilon}$ avec $\boldsymbol{\epsilon} \sim \mathcal{N}(\mathbf{0}, \sigma^2 I)$

Prior: $\boldsymbol{\beta} \sim \mathcal{N}(\mathbf{0}, \sigma_{\beta}^2 I)$

Exemple de la taille chez l'homme:

- ▶ Yang et coll. (Nat Genet, 2010)
- ▶ Wood et coll. (Nat Genet, 2014)

Essayer le logiciel GCTA (maintenu par le labo de Peter Visscher).

Sélectionner les SNPs

Vraisemblance: $\mathbf{y} = \mathbf{1}\mu + X\boldsymbol{\beta} + \boldsymbol{\epsilon}$ avec $\boldsymbol{\epsilon} \sim \mathcal{N}(\mathbf{0}, \sigma^2 I)$

Prior: $\boldsymbol{\beta} \sim \pi_0 \delta_0 + (1 - \pi_0) \mathcal{N}(\mathbf{0}, \sigma_{\beta}^2 I)$

$\Rightarrow \text{lfdr}_j = \Pr(\beta_j = 0 \mid \mathbf{y}, X)$

- ▶ BVSR: Guan & Stephens (Ann Appl Stat, 2011); comparaison avec LASSO; logiciel piMASS
- ▶ étendu par BSLMM: Zhou, Carbonetto & Stephens (PLoS Genet, 2013); logiciel GEMMA

Tester différentes combinaisons de SNPs

- ▶ MLMM: Segura et coll. (Nat Genet, 2012)
- ▶ BLMM: Wen (Biostat, 2015)

Remerciements

- ▶ Matthew Stephens
- ▶ Xiaoquan Wen, Xiang Zhou et Heejung Shim

Annexes

```
print(sessionInfo(), locale=FALSE)
```

```
## R version 3.2.0 (2015-04-16)
## Platform: x86_64-pc-linux-gnu (64-bit)
## Running under: Ubuntu 14.04.2 LTS
##
## attached base packages:
## [1] stats      graphics  grDevices  utils      datasets  me
##
## other attached packages:
## [1] qvalue_1.38.0   knitr_1.10.5    rmarkdown_0.5.1
##
## loaded via a namespace (and not attached):
## [1] magrittr_1.5    formatR_1.2     tools_3.2.0     htr
## [5] yaml_2.1.13     stringi_0.4-1   stringr_1.0.0   dig
## [9] evaluate_0.7    tcltk_3.2.0
```