

# Régression linéaire multiple

Myriam Maumy<sup>1</sup>

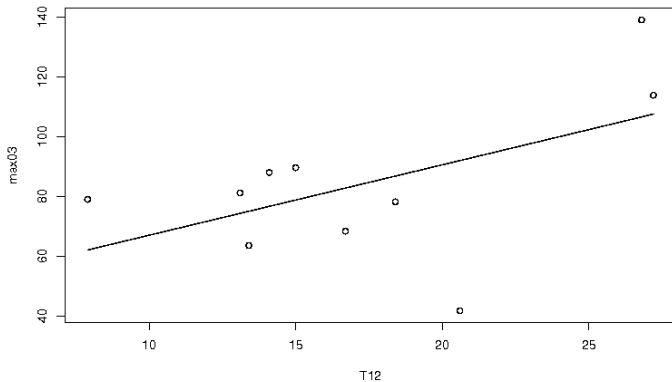
<sup>1</sup>IRMA, Université Louis Pasteur  
Strasbourg, France

Master 2ème Année 7-11-2005

- **Problème** : Etude de la concentration d' $O_3$  dans l'air.
- **Modèle** : La température (v.a.  $X$ ) et la concentration d' $O_3$  (v.a.  $Y$ ) sont liées de manière linéaire :

$$Y = \beta_0 + \beta_1 X + \varepsilon.$$

- **Observations** :  $n = 10$  mesures de la température et de la concentration d' $O_3$ .
- **But** : Estimer  $\beta_0$  et  $\beta_1$  afin de prédire la concentration d'ozone connaissant la température.



Souvent la régression linéaire est trop simpliste. Il faut alors utiliser d'autres modèles plus réalistes mais parfois plus complexes :

- Utiliser d'autres fonctions que les fonctions affines comme les fonctions polynômiales, exponentielles, logarithmiques. . .
- Considérer plusieurs variables explicatives.

**Exemple :** La température **et** la vitesse du vent

Le principe de la régression linéaire multiple est simple :

- Déterminer la variable expliquée  $Y$ .

**Exemple :** La concentration d' $O_3$ .

- Déterminer  $(p - 1)$  variables explicatives  $X_1, \dots, X_{p-1}$

**Exemple :**  $X_1$  température,  $X_2$  vitesse du vent. . .

- Il ne reste plus qu'à appliquer un modèle linéaire :

$$Y = \beta_0 + \beta_1 X_1 + \dots + \beta_{p-1} X_{p-1} + \varepsilon$$

Dans un échantillon de  $n$  individus, on mesure  $y_i, x_{i,1}, \dots, x_{i,p-1}$  pour  $i = 1 \dots n$ .

Observations	$Y$	$X_1$	$\dots$	$X_{p-1}$
1	$y_1$	$x_{1,1}$	$\dots$	$x_{1,p-1}$
2	$y_2$	$x_{2,1}$	$\dots$	$x_{2,p-1}$
$\vdots$	$\vdots$	$\vdots$	$\vdots$	$\vdots$
$n$	$y_n$	$x_{n,1}$	$\dots$	$x_{n,p-1}$

**Remarque :** Les variables  $x_{i,j}$  sont fixes tandis que les variables  $y_i$  sont aléatoires.

**But :** estimer les paramètres  $\beta_0, \dots, \beta_{p-1}$  du modèle de régression et ce de manière optimale.

**Méthode :** La méthode des moindres carrés. Cette méthode revient à minimiser la quantité suivante :

$$\sum_{i=1}^n \left( y_i - \left( \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 x_{i,1} + \dots + \hat{\beta}_{p-1} x_{i,p-1} \right) \right)^2$$

Le système peut se réécrire :

$$\begin{pmatrix} y_1 \\ \vdots \\ y_n \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & x_{1,1} & \cdots & x_{1,p-1} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots \\ 1 & x_{n,1} & \cdots & x_{n,p-1} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \beta_0 \\ \vdots \\ \beta_{p-1} \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} \varepsilon_1 \\ \vdots \\ \varepsilon_n \end{pmatrix}$$

$$\underset{\mathbf{y}}{\mathbf{y}} = \underset{\mathbf{X}}{\mathbf{X}} \underset{\boldsymbol{\beta}}{\boldsymbol{\beta}} + \underset{\boldsymbol{\varepsilon}}{\boldsymbol{\varepsilon}}$$

**Vecteur des résidus :**  $\boldsymbol{\varepsilon} = \mathbf{y} - \hat{\mathbf{y}} = \mathbf{y} - \mathbf{X}\hat{\boldsymbol{\beta}}$

**Remarque :** Les variables  $\mathbf{y}$  et  $\mathbf{X}$  sont mesurées tandis que l'estimateur  $\hat{\boldsymbol{\beta}}$  est à déterminer

La méthode des moindres carrés consiste à trouver le vecteur  $\hat{\boldsymbol{\beta}}$  qui minimise  $\|\boldsymbol{\varepsilon}\|^2 = {}^t\boldsymbol{\varepsilon}\boldsymbol{\varepsilon}$ .



$$\begin{aligned}\|\varepsilon\|^2 &= {}^t(\mathbf{y} - \mathbf{X}\hat{\beta})(\mathbf{y} - \mathbf{X}\hat{\beta}) \\ &= {}^t\mathbf{y}\mathbf{y} - {}^t\hat{\beta}^t\mathbf{X}\mathbf{y} - {}^t\mathbf{y}\mathbf{X}\hat{\beta} + {}^t\hat{\beta}^t\mathbf{X}\mathbf{X}\hat{\beta} \\ &= {}^t\mathbf{y}\mathbf{y} - 2{}^t\hat{\beta}^t\mathbf{X}\mathbf{y} + {}^t\hat{\beta}^t\mathbf{X}\mathbf{X}\hat{\beta}\end{aligned}$$

car  ${}^t\hat{\beta}^t\mathbf{X}\mathbf{y}$  est un scalaire. Donc il est égal à sa transposée.

La dérivée par rapport à  $\hat{\beta}$  est alors égale à :

$$-2{}^t\mathbf{X}\mathbf{y} + 2{}^t\mathbf{X}\mathbf{X}\hat{\beta}$$

- **Problème** : On cherche  $\hat{\beta}$  qui annule cette dérivée. Donc on doit résoudre l'équation suivante :

$${}^t\mathbf{XX}\hat{\beta} = {}^t\mathbf{Xy}$$

- **Solution** : On trouve après avoir inversé la matrice  ${}^t\mathbf{XX}$  (il faut naturellement vérifier que  ${}^t\mathbf{XX}$  est carrée et inversible c'est-à-dire qu'aucune des colonnes qui compose cette matrice ne soit proportionnelle aux autres colonnes)

$$\hat{\beta} = ({}^t\mathbf{XX})^{-1}{}^t\mathbf{Xy}$$

Retrouvons les résultats de la régression linéaire simple ( $p = 2$ )

$${}^t\mathbf{X}\mathbf{X} = \begin{pmatrix} n & \sum x_i \\ \sum x_i & \sum x_i^2 \end{pmatrix}; \quad {}^t\mathbf{X}\mathbf{y} = \begin{pmatrix} \sum y_i \\ \sum x_i y_i \end{pmatrix}$$

Donc :

$$\begin{aligned} ({}^t\mathbf{X}\mathbf{X})^{-1} &= \frac{1}{n \sum x_i^2 - (\sum x_i)^2} \begin{pmatrix} \sum x_i^2 & -\sum x_i \\ -\sum x_i & n \end{pmatrix} \\ &= \frac{1}{\sum (x_i - \bar{x})^2} \begin{pmatrix} \sum x_i^2 / n & -\bar{x} \\ -\bar{x} & 1 \end{pmatrix} \end{aligned}$$

Finalement on retrouve bien :

$$\hat{\beta} = \begin{pmatrix} \hat{\beta}_0 \\ \hat{\beta}_1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \frac{\bar{y} \sum x_i^2 - \bar{x} \sum x_i y_i}{\sum (x_i - \bar{x})^2} \\ \frac{\sum x_i y_i - n \bar{x} \bar{y}}{\sum (x_i - \bar{x})^2} \end{pmatrix}$$

ce qui correspond aux estimateurs de la régression linéaire simple que nous avons déjà rencontrés dans le cours 2.

```
> a <- lm(max03 ~ T12 + VX)
> summary(a)
```

```
Call :
lm(formula = max03 ~ T12 + VX)
```

```
Residuals :
Min 1Q Median 3Q Max
-47.860 -10.561  5.119 10.645 26.506
```

```
Coefficients :
Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
(Intercept) 36.6520 26.5324  1.381 0.210
T12  2.6623  1.4202  1.875 0.103
VX  0.5431  0.7775  0.699 0.507

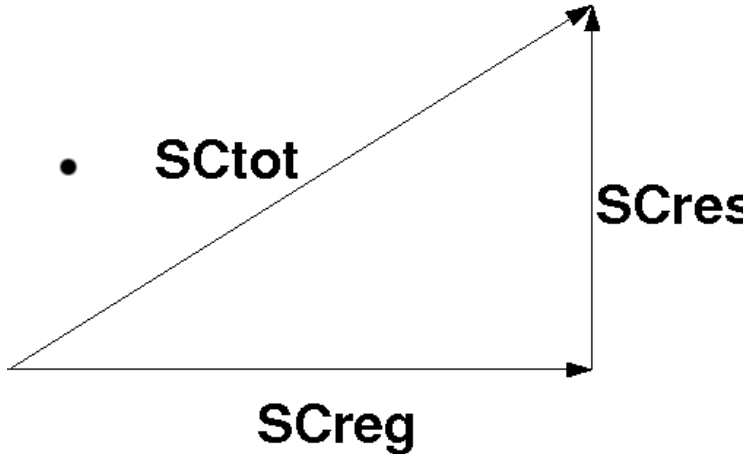
Residual standard error : 24.78 on 7 degrees of freedom
Multiple R-Squared : 0.3351, Adjusted R-squared : 0.1452
F-statistic : 1.764 on 2 and 7 DF, p-value : 0.2396
```

## Résultats préliminaires :

- $\sum \hat{y}_i^2 = \sum \hat{y}_i y_i$  ou (forme matricielle)  ${}^t\hat{\mathbf{y}}\hat{\mathbf{y}} = {}^t\mathbf{y}\hat{\mathbf{y}}$
- $\sum \hat{y}_i = \sum y_i$

## Propriété des moindres carrés :

$$\begin{aligned}\sum (y_i - \bar{y})^2 &= \sum (\hat{y}_i - \bar{y})^2 + \sum (y_i - \hat{y}_i)^2 \\ \text{SC}_{\text{tot}} &= \text{SC}_{\text{reg}} + \text{SC}_{\text{res}}\end{aligned}$$



Le **coefficient de détermination** est défini par :

$$R^2 = \frac{SC_{reg}}{SC_{tot}}$$

Intuitivement ce coefficient quantifie la capacité du modèle à expliquer les variations de  $Y$ .

- Si  $R^2$  est proche de 1 alors le modèle est proche de la réalité.
- Si  $R^2$  est proche de 0 alors le modèle explique très mal la réalité. Il faut alors trouver un meilleur modèle.



On fait les hypothèses suivantes :

$$\mathbf{y} = \mathbf{X}\beta + \varepsilon$$

où le vecteur aléatoire  $\varepsilon$  suit une loi *multinormale* qui vérifie les hypothèses suivantes :

- $\mathbb{E}[\varepsilon] = 0$
- $\text{Var}[\varepsilon] = \sigma^2 \mathbf{I}_n$ ,

où  $\sigma^2$  est la variance de la population et  $\mathbf{I}_n$  est la matrice identité de taille  $n$ .

Ceci implique que :

- $\mathbb{E}[\mathbf{y}] = \mathbf{X}\beta$
- $\text{Var}[\mathbf{y}] = \sigma^2 \mathbf{I}_n$

On peut alors démontrer, **sous ces hypothèses** :

- $\mathbb{E}[\hat{\beta}] = \beta$ . Ce qui signifie que  $\hat{\beta}$  est un estimateur sans biais
- $\text{Var}[\hat{\beta}] = \sigma^2 (\mathbf{X}^t \mathbf{X})^{-1}$

Il reste un **problème** : Estimer la variance  $\sigma^2$  qui est a priori une quantité inconnue.

Un estimateur sans biais de la variance  $\sigma^2$  est défini par :

$$s^2 = \frac{\sum (y_i - \hat{y}_i)^2}{n - p} = \frac{SC_{res}}{n - p} = \frac{SC_{tot} - SC_{reg}}{n - p},$$

où

- $n$  est le nombre d'individus/d'observations,
- $p$  est le nombre de variables explicatives.

On appelle la quantité  $(n - p)$  *le nombre de degrés de liberté*.

**But :** Tester l'hypothèse

$$H_0 : \beta_j = b_j$$

contre l'hypothèse alternative

$$H_1 : \beta_j \neq b_j.$$

## Méthode :

- Calculer la statistique

$$t_{obs} = \frac{\hat{\beta}_j - b_j}{s(\hat{\beta}_j)}$$

où  $s^2(\hat{\beta}_j)$  est l'élément diagonal d'indice  $j$  de  $s^2(t\mathbf{XX})^{-1}$ .

- Si l'hypothèse  $H_0$  est vraie, alors  $t_{obs}$  suit une loi de Student avec  $(n - p)$  degrés de liberté.

- Valeur critique :  $t_{(\alpha/2, n-p)}$  le  $(1 - \alpha/2)$ -quantile d'une loi de Student avec  $(n - p)$  degrés de liberté (cf table de Student).
- On rejette  $H_0$  si  $|t_{obs}| > t_{(\alpha/2, n-p)}$ .

**Cas particulier :** tester si  $\beta_j = 0$  pour un certain  $j$ .

Si l'hypothèse  $\beta_j = 0$  est acceptable alors la variable  $X_j$  n'est pas significative au sein du modèle. On peut simplifier le modèle, ...et recommencer !