

Einfache Varianzanalyse

Peter Büchel

HSLU I

Stoc: Block 09

Einfache Varianzanalyse

- Ungepaarter t -Test: Vergleich von 2 Mittelwerten
- Einfache Varianzanalyse: Vergleich von mehreren Mittelwerten
- Beispiel:
 - ▶ Man will 3 Diäten auf ihre Wirksamkeit testen
 - ▶ Man wählt je 10 Personen zufällig aus
 - ▶ Misst den Gewichtsverlust nach 2 Monaten
 - ▶ Vergleicht die durchschnittlichen Gewichtsverluste
 - ▶ Wie bei t -Test: Sind Unterschiede statistisch signifikant?
 - ▶ Wieder Hypothesentest für Entscheid

Beispiel: Reissfestigkeit von Papier

- Papierhersteller, der Einkaufs-Papiertragtaschen herstellt, interessiert sich für die Verbesserung der Reissfestigkeit seines Produkts
- Vermutung: Reissfestigkeit hängt von Hartholz-Konzentration im Papierbrei ab
- Üblicherweise: Konzentrationen liegen in Bereich von 5 % bis 20 %
- Die Produktionsingenieure beschlossen, die Reissfestigkeit bei vier Hartholzkonzentrationsstufen mit einem vollständig randomisierten Versuchsplan zu untersuchen: bei 5 %, 10 %, 15 % und 20 %
- Für jede Konzentrationsstufe werden sechs Versuchsproben in einer Pilotanlage erstellt
- Die resultierenden 24 Papierproben werden in zufälliger Reihenfolge im Labor auf ihre Reissfestigkeit getestet

- Die gemessenen Reissfestigkeiten (in psi) sind in Tabelle festgehalten

Hartholz-Konzentration [%]	Versuchsprobe					
	1	2	3	4	5	6
5	7	8	15	11	9	10
10	12	17	13	18	19	15
15	14	18	19	17	16	18
20	19	25	22	23	18	20

- Bei Durchführung von Messungen darauf achten, dass Messumfeld so homogen wie möglich gehalten wird (möglichst gleiche Versuchsbedingungen)
- Falls wichtige Grössen ändern können, müssen sie miterfasst werden

- Weil man nie sicher ist, ob das gelingt, werden Messungen in zufälliger Reihenfolge durchgeführt
- Laborproben werden zufällig aus den 24 Proben gewählt, ohne Rücksicht auf die Hartholzkonzentration oder Fertigstellung der Probe
- Frage nach den Einflüssen der unterschiedlichen Behandlungen kann man zunächst untersuchen, indem man jede Gruppe durch einen *Zwei-Stichproben-Test* (d.h. z. B. durch den Rangsummen-Test von Wilcoxon, den t -Test von Student oder den Vorzeichen-Test) mit jeder anderen vergleicht
- Resultate für einen bestimmten Test in einer symmetrischen Matrix von p -Werten zusammenfassen

- Beispiel: Reissfestigkeit
- Tabelle: P -Werte für den Zwei-Stichproben t -Test für die Reissfestigkeit von Papier

Hartholz-Konzentration [%]	5 %	10 %	15 %	20 %
5 %	—			
10 %	0.0010	—		
15 %	0.00076	0.38	—	
20 %	0.00	0.006	0.010	—

- Vergleichen wir z.B. die Werte für 10 % und 20 %, so erhalten wir einen p -Wert von 0.006

- Code:

```
from pandas import DataFrame
import scipy.stats as st
import numpy as np
import seaborn as sns

rf = DataFrame({
    "HC": np.repeat(["5%", "10%", "15%", "20%"], [6, 6, 6, 6]),
    "Strength": [7, 8, 15, 11, 9, 10, 12, 17, 13, 18, 19, 15, 14, 18, 19, 17,
16, 18, 19, 25, 22, 23, 18, 20]
})

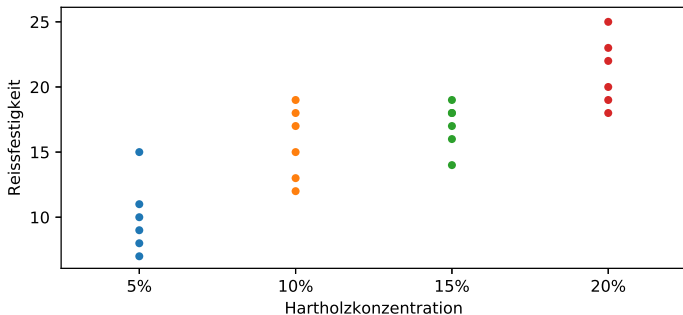
per5 = rf.loc[rf["HC"]=="5%", "Strength"]
per10 = rf.loc[rf["HC"]=="10%", "Strength"]
per15 = rf.loc[rf["HC"]=="15%", "Strength"]
per20 = rf.loc[rf["HC"]=="20%", "Strength"]

st.ttest_ind(per10,per20)

## Ttest_indResult(statistic=-3.4979930040209894, pvalue=0.00574574017074254)
```

- Unterschied zwischen 5 % und 10 % Hartholz-Konzentration mit einem p -Wert von 0.0010 signifikant
- Unterschied zwischen 10 % und 15 % Hartholz-Konzentration mit einem p -Wert von 0.35 *nicht* signifikant

- Unterschiede können graphisch mit Hilfe von *Stripcharts*



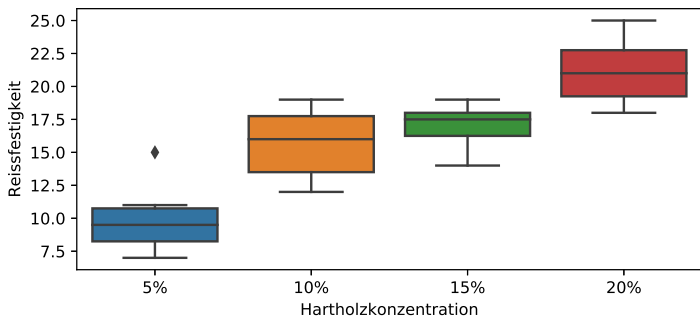
- Code:

```
sns.stripplot(x="HC", y="Strength", data=rf)

plt.xlabel("Hartholzkonzentration")
plt.ylabel("Reißfestigkeit")

plt.show()
```

- Oder Boxplot:



- Code:

```
sns.boxplot(x="HC", y="Strength", data=rf)

plt.xlabel("Hartholzkonzentration")
plt.ylabel("Reissfestigkeit")

plt.show()
```

Vorsicht bei Paarvergleichen

- Vielzahl von Paar-Vergleichen problematisch von der Grundidee des statistischen Hypothesentests her
- Bsp: 7 Gruppen werden miteinander verglichen
- Anzahl Paarvergleich-Tests:

$$\frac{7 \cdot 6}{2} = 21$$

- Haben 7 Mittelwerte: μ_1, \dots, μ_7
- Annahme: Es gibt *keinen* wahren Unterschied zwischen den Mittelwerten
- D. h.: Alle Nullhypothesen sollten beibehalten werden

$$\mu_1 = \mu_2, \quad \mu_1 = \mu_3, \quad \dots, \quad \mu_6 = \mu_7$$

- p -Werte von Paar-Vergleichen:

	1	2	3	4	5	6	7
1							
2	0.22						
3	0.42	0.53					
4	0.71	0.09	0.74				
5	0.31	0.55	0.21	0.89			
6	0.38	0.03	0.91	0.44	0.67		
7	0.23	0.43	0.10	0.15	0.27	0.39	

- Hier: Unterschied zwischen zwei Gruppen wird angezeigt:

$$\hat{\mu}_2 \neq \hat{\mu}_6$$

- $\hat{\mu}_2, \hat{\mu}_6$: Gemessene Mittelwerte

- Aber: Kein wahrer Unterschied vorhanden
- Problematik: Konstruktion Hypothesentest
- Zeigt Unterschied nur mit einer bestimmten Wahrscheinlichkeit an
- Werden sehr viele Hypothesentest gemacht, wird zu einer Wahrscheinlichkeit von 5 % Nullhypothese verworfen, obwohl keine Unterschied vorhanden ist

Theoretische Überlegung, wie Resultate dieser Tests aussehen können

- Aufgrund der Irrtums-W'keit von 5 % ist es anschaulich klar, dass ab und zu unter 21 Tests eine „Fehlentscheidung 1. Art“, nämlich dass die Nullhypothese fälschlicherweise verworfen wird, auftritt
- Bei 21 Tests ist die erwartete Anzahl Fehlentscheide 1. Art:

$$21 \cdot 0.05 \sim 1$$

- D.h.: Im Mittel 1 Hypothesentest wird fälschlicherweise verworfen
- Die Nullhypothese, „alle Gruppen gehorchen dem gleichen Modell“, wird also viel zu oft verworfen, wenn die Regel lautet:
- „Die Nullhypothese wird verworfen, wenn der extremste Unterschied auf dem Niveau $\alpha = 5\%$ signifikant ist“

- Wie kann man das vermeiden?
- Eine konsequente Antwort heisst: Wir dürfen nur *eine* Frage stellen, die wir mit einem Test beantworten
- Die sinnvolle Frage lautet: „Gibt es überhaupt Unterschiede zwischen den Gruppen?“
- Oder anders gesagt: „Unterscheidet sich wenigstens eine der Gruppen von einer andern?“
- Nullhypothese: „Alle Gruppen folgen dem gleichen Modell.“

Gruppenmittel-Modell

- Beispiel zum Datensatz **Reissfestigkeit** von Papier, lässt sich durch ein lineares Modell (oder als Verallgemeinerung des Zwei-Stichproben-Modells) festhalten
- Wir wollen g Gruppen vergleichen, wobei in jeder Gruppe gerade m Beobachtungen gemacht werden
- Datensatz **Reissfestigkeit**:
 - ▶ 4 unterschiedliche Hartholzkonzentrationen verwendet, also ist $g = 4$
 - ▶ für jede Hartholzkonzentration $m = 6$ Messungen für Reissfestigkeit
- Ziel ist es, ein Modell zu entwickeln, dass die Reissfestigkeit in Abhängigkeit der Hartholzkonzentrationsstufen beschreibt

Allgemeines Modell

- Einfachstes Modell: Einzelne Beobachtungen innerhalb einer Gruppe streuen um einen gemeinsamen Wert:

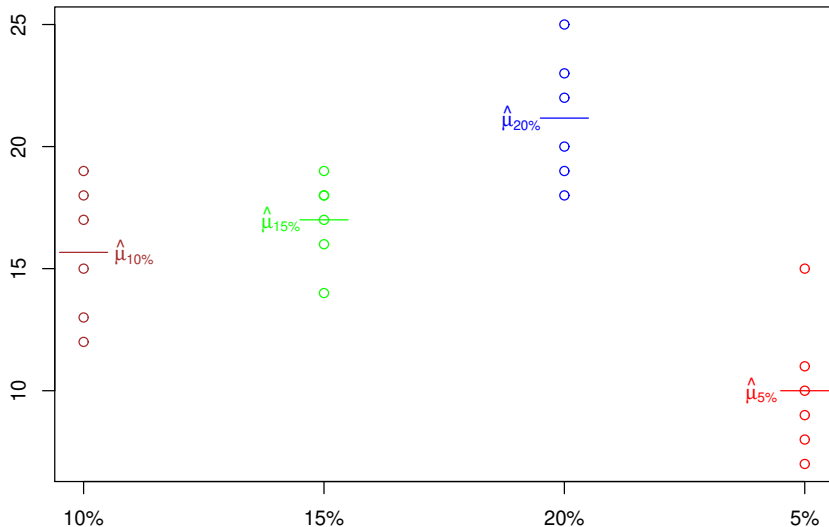
$$Y_{ij} = \mu_i + \varepsilon_{ij} \quad i = 1, 2, \dots, g; \quad j = 1, 2, \dots, m$$

wobei Y_{ij} die j -te Beobachtung in der i -ten Gruppe ist

- Grösse μ_i : „Mittelwert“ der i -ten Gruppe
- Annahme: Fehlerterme ε_{ij} unabhängig identisch normalverteilt sind
- Alle Gruppen dieselbe Standardabweichung des Fehlerterms in diesem Modell

Beispiel

- Datensatz **Reissfestigkeit**:



- Lineare Regression: Y_{ij} ist die Zielgrösse (die wir vorhersagen möchten), die Behandlungsart μ_i ist eine Faktorvariable (zu variierende Grösse)
- Äquivalente Modellformulierung:

$$Y_{ij} = \mu + \tau_i + \varepsilon_{ij} \quad i = 1, 2, \dots, g; \quad j = 1, 2, \dots, m$$

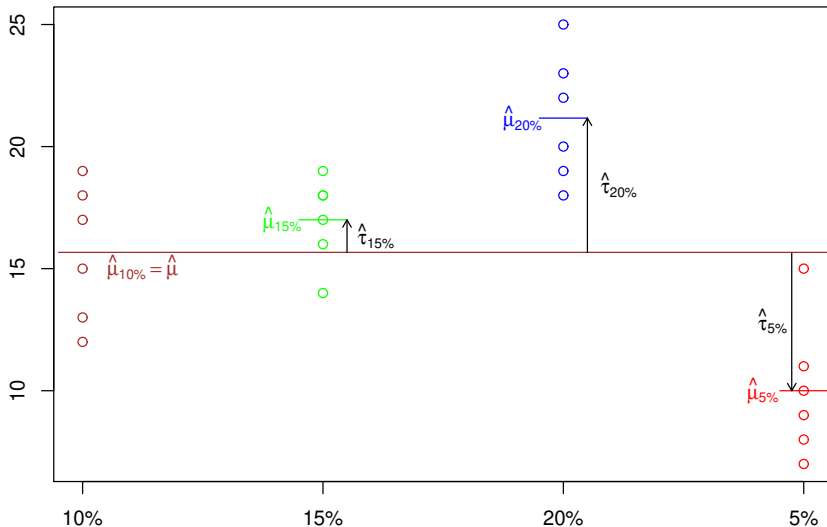
mit dem Fehler

$$\varepsilon_{ij} \sim \mathcal{N}(0, \sigma^2)$$

- Parameter μ haben also alle Beobachtungen gemeinsam („globaler Mittelwert“)
- Parameter τ_i ($i = 1, \dots, g$) behandlungsspezifische Abweichungen von diesem globalen Mittelwert
- Beispiel: Spezifisch für jede Hartholz-Konzentration

Beispiel

- Datensatz **Reissfestigkeit**:



- Diese Parameter heissen auch *Behandlungseffekte* (eng. *treatment effects*)
- Parameter in diesem Modell nicht mehr eindeutig identifizierbar, da $g + 1$ Parameter $\mu, \tau_1, \dots, \tau_g$ für g unterschiedliche Gruppenmittelwerte vorhanden
- Benötigen Nebenbedingung, wobei es deren mehrere gibt
- Beispiel:

$$\mu = \mu_1$$

und folglich

$$\tau_1 = 0, \quad \tau_2 = \mu_2 - \mu, \quad \tau_3 = \mu_3 - \mu$$

- Gruppe 1 bildet hier die Referenz, oder die sogenannte *Baseline*
- Nur $g - 1$ der Behandlungseffekte τ_i frei variierbar

Parameterschätzung

- Wie schätzen wir nun die Parameter

$$\mu, \quad \tau_1, \quad \dots, \quad \tau_g$$

so dass das Modell möglichst gut zu den Daten passt?

- Kriterium: Summe der quadrierten Residuen minimieren:

$$\sum_{i=1}^g \sum_{j=1}^m (Y_{ij} - \hat{\mu} - \hat{\tau}_i)^2$$

- Es kann gezeigt werden, dass

$$\hat{\mu}_i = \frac{1}{m} \sum_{j=1}^m Y_{ij}$$

- Details (mühsam): siehe Skript
- Konkret mit

Beispiel: Reissfestigkeit Papier

- Koeffizienten des Gruppenmittel-Modells für **Reissfestigkeit**
- Code:

```
from pandas import DataFrame
import pandas as pd
import numpy as np
import scipy.stats as st

from statsmodels.formula.api import ols
from statsmodels.stats.anova import anova_lm

rf = DataFrame({
    "HC": np.repeat(["5%", "10%", "15%", "20%"], [6, 6, 6, 6]),
    "Strength": [7, 8, 15, 11, 9, 10, 12, 17, 13, 18, 19, 15, 14, 18, 19, 17,
16, 18, 19, 25, 22, 23, 18, 20]
})

fit = ols("Strength~HC", data=rf).fit()
fit.summary()
```

- **ols**: ordinary least square

● Output:

```
##                                OLS Regression Results
## =====
## Dep. Variable:                Strength    R-squared:                0.746
## Model:                        OLS        Adj. R-squared:         0.708
## Method:                       Least Squares    F-statistic:             19.61
## Date:                         Mon, 20 Apr 2020    Prob (F-statistic):      3.59e-06
## Time:                         11:19:09          Log-Likelihood:          -54.344
## No. Observations:             24              AIC:                    116.7
## Df Residuals:                 20              BIC:                    121.4
## Df Model:                     3
## Covariance Type:              nonrobust
## =====
##                                coef      std err          t      P>|t|      [0.025      0.975]
## -----
## Intercept                    15.6667      1.041      15.042      0.000      13.494      17.839
## HC[T.15%]                    1.3333      1.473       0.905      0.376      -1.739      4.406
## HC[T.20%]                    5.5000      1.473      3.734      0.001       2.428      8.572
## HC[T.5%]                     -5.6667      1.473     -3.847      0.001     -8.739     -2.594
## =====
## Omnibus:                      0.929    Durbin-Watson:           2.181
## Prob(Omnibus):                0.628    Jarque-Bera (JB):        0.861
## Skew:                         0.248    Prob(JB):                0.650
## Kurtosis:                     2.215    Cond. No.:               4.79
## =====
##
## Warnings:
## [1] Standard Errors assume that the covariance matrix of the errors is correctly specified.
```


- Kürzer:

```
fit.params
## Intercept      15.666667
## HC[T.15%]      1.333333
## HC[T.20%]      5.500000
## HC[T.5%]       -5.666667
## dtype: float64
```

- Beachte: Output der Parameter für HC10 % fehlt
- Der ist aber, da er zuerst auftritt, gleich 0 (Baseline)

- Python-Befehl `ols`: Globaler Mittelwert geschätzt durch $\hat{\mu} = 15.66$
- Parametrisierung $\mu = \mu_1$
- Die geschätzten Gruppenmittelwerte lauten somit:

$$\hat{\mu}_{5\%} = 15.7 - 5.7 = 10$$

$$\hat{\mu}_{10\%} = 15.7 + 0 = 15.7$$

$$\hat{\mu}_{15\%} = 15.7 + 1.3 = 17$$

$$\hat{\mu}_{20\%} = 15.7 + 5.5 = 21.2$$

- 95 %-Vertrauensintervalle

- Code:

```
fit_pred = fit.get_prediction()
fit_pred.conf_int()

## [[ 7.8274691  12.1725309 ]
## [ 7.8274691  12.1725309 ]
## [ 7.8274691  12.1725309 ]
## [ 7.8274691  12.1725309 ]
## [ 7.8274691  12.1725309 ]
## [ 7.8274691  12.1725309 ]
## [13.49413576 17.83919757]
## [13.49413576 17.83919757]
## [13.49413576 17.83919757]
## [13.49413576 17.83919757]
## [13.49413576 17.83919757]
## [13.49413576 17.83919757]
## [14.8274691  19.1725309 ]
## [14.8274691  19.1725309 ]
## [14.8274691  19.1725309 ]
## [14.8274691  19.1725309 ]
## [14.8274691  19.1725309 ]
## [14.8274691  19.1725309 ]
## [14.8274691  19.1725309 ]
```

- Somit ist zum Beispiel das 95 %-Vertrauensintervall für $\mu_{5\%}$
[7.8, 12.2]

Beispiel: Fleischverpackung

- Studie: Effekt der Verpackungsart auf das Bakterienwachstum von gelagertem Fleisch untersuchen
- Es wurden vier Verpackungsarten („Behandlungsarten“) untersucht:
 - ▶ Kommerzielle Plastikverpackung (mit Umgebungsluft)
 - ▶ Vakuumverpackung
 - ▶ 1 % CO, 40 % O₂, 59 % N
 - ▶ 100 % CO₂
- Versuchseinheiten besteht aus 12 Rindssteaks von rund 75 g
- Interessieren für die Wirksamkeit einer Verpackungsart, das Bakterienwachstum zu unterdrücken
- Gemessene Zielgrösse: (Logarithmus) Anzahl Bakterien pro Quadratzentimeter

Beispiel: Fleischverpackung

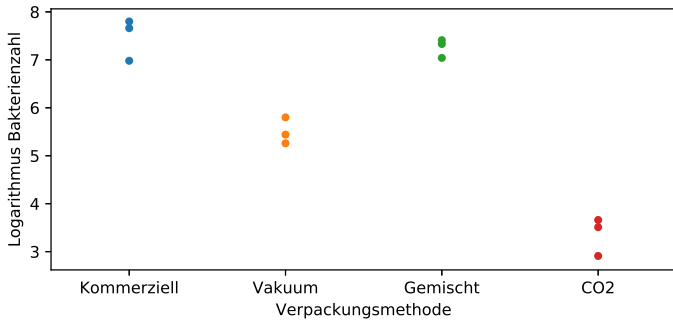
- Datensatz **Meat** graphisch darstellen
- Code:

```
meat = DataFrame({
    "Treatment":
    np.repeat(["Kommerziell", "Vakuum", "Gemischt", "CO2"], [3, 3,
    3, 3]),
    "meat_id": [7.66, 6.98, 7.80, 5.26, 5.44, 5.80, 7.41, 7.33,
    7.04, 3.51, 2.91, 3.66]
})

sns.stripplot(x="Treatment", y="meat_id", data=meat)
plt.xlabel("Verpackungsmethode")
plt.ylabel("Logarithmus Bakterienzahl")

plt.show()
```

● Plot:



- Koeffizienten des Gruppenmittel-Modells für den Datensatz **Meat**

- Code:

```
fit = ols("steak_id~Treatment",data=meat).fit()

fit.params
## Intercept                3.36
## Treatment[T.Gemischt]    3.90
## Treatment[T.Kommerziell] 4.12
## Treatment[T.Vakuum]      2.14
## dtype: float64
```

- Somit lauten die geschätzten Gruppenmittelwerte

$$\hat{\mu}_{\text{CO}_2} = 3.36 - 0 = 3.36$$

$$\hat{\mu}_{\text{Kommerziell}} = 3.36 + 4.12 = 7.48$$

$$\hat{\mu}_{\text{Gemischt}} = 3.36 + 3.90 = 7.26$$

$$\hat{\mu}_{\text{Vakuum}} = 3.36 + 2.14 = 5.50$$

- 95 %-Vertrauensintervalle **Python** wie folgt:
- Code:

```
fit_pred = fit.get_prediction()

fit_pred.conf_int()

## [[7.02684427 7.93315573]
##  [7.02684427 7.93315573]
##  [7.02684427 7.93315573]
##  [5.04684427 5.95315573]
##  [5.04684427 5.95315573]
##  [5.04684427 5.95315573]
##  [6.80684427 7.71315573]
##  [6.80684427 7.71315573]
##  [6.80684427 7.71315573]
##  [2.90684427 3.81315573]
##  [2.90684427 3.81315573]
##  [2.90684427 3.81315573]]
```

- 95 %-Vertrauensintervall für $\mu_{\text{Kommerziell}}$

[7.03, 7.93]

Anova-Test

- *Anova: Analysis of Variance*
- Frage: Gibt es überhaupt Unterschiede zwischen den Gruppen?
- Nullhypothese:

$$H_0 : \mu_1 = \mu_2 = \dots = \mu_g$$

- Alternativhypothese: Mindestens zwei Gruppen unterscheiden sich, also $\mu_i \neq \mu_j$ mit mit mindestens einem Paar $i \neq j$
- Bsp: Nullhypothese verwerfen, falls:

$$\mu_3 \neq \mu_5$$

- Gesucht Teststatistik, die extreme Werte annimmt, wenn sich die Gruppen in ihrer Lage unterscheiden

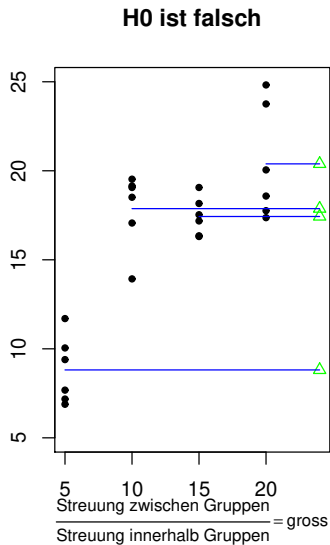
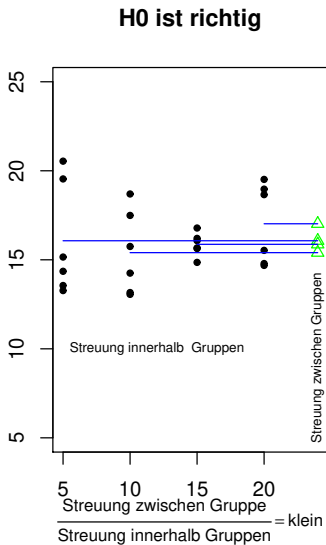
- Wenn sich Gruppenmittelwerte stark unterscheiden
→ Nullhypothese falsch
- Was „stark“ heisst, hängt aber auch von der Streuung der Beobachtungen *innerhalb* der Gruppen ab
- Wie beim t -Test sogenannten F -Wert bilden
- Wenn F gross → Nullhypothese verwerfen
- Wenn F klein → Nullhypothese beibehalten
- Definition: F -Wert:

$$F = \frac{\text{Streuung der Gruppenmittelwerte}}{\text{Mittelwert der Streuungen der Gruppen}}$$

- Technische Details zur Berechnung dieses F -Wertes erheblich
(machen das hier nicht)

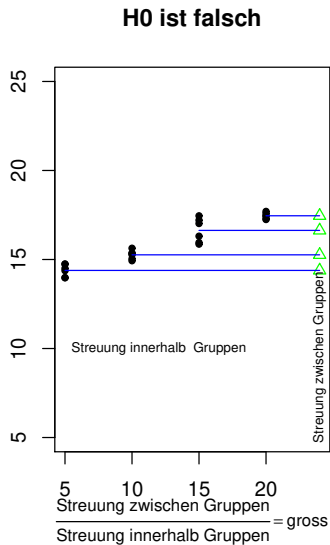
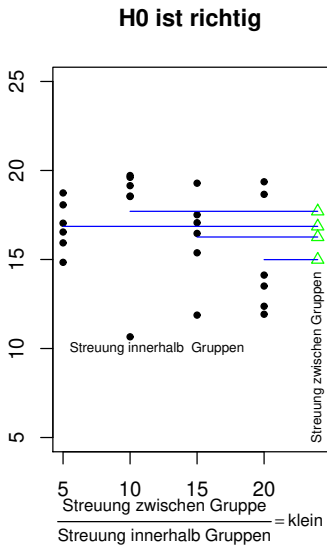
- Graphische Interpretation

- Abbildung:



- Abbildung: auf beiden Seiten Streuung *innerhalb* der Gruppen gleich
- Mittelwert der Streuungen gleich
- Nenner des F -Wertes ist auf beiden Seiten der Abbildung gleich
- Linke Seite Streuung der Mittelwerte kleiner als auf der rechten Seiten
- Zähler des F -Werte auf der linken Seite ist kleiner als der Zähler auf der rechten Seite
- Bei gleichbleibendem Nenner ist der F -Wert auf der linken Seite kleiner als der F -Wert auf der rechten Seiten
- Wenn der F -Wert klein genug \rightarrow Nullhypothese *nicht* verwerfen

● Abbildung:

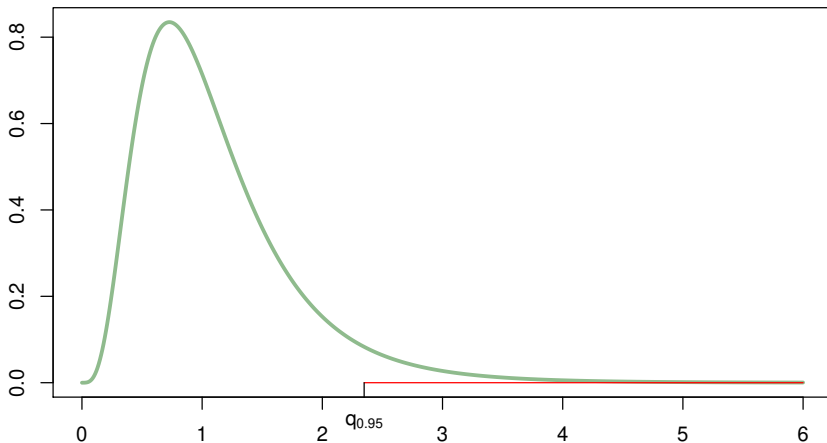


- Abbildung: auf beiden Seiten Streuung der Mittelwerte gleich
- Zähler des F -Wertes auf beiden Seiten der Abbildung gleich
- Auf linker Seite Streuung in den Gruppen grösser als auf der rechten Seite
- Nenner des F -Wertes auf der linken Seite ist grösser als der Zähler auf der rechten Seite
- Bei gleichbleibendem Zähler ist der F -Wert auf der linken Seite kleiner als der F -Wert auf der rechten Seite
- Wenn F -Wert klein genug \rightarrow Nullhypothese *nicht* verwerfen

- Wie früher Teststatistik-Werte: F -Werte in Verteilung der Teststatistik unter der Null-Hypothese in p -Werte umrechnen
- p -Wert-Skala: Verwerfungsbereiche (unplausible Werte) einfach zu merken
- Bei p -Werten kleiner als das Niveau wird die Null-Hypothese verworfen, sonst beibehalten

F-Kurve

- Graph einer F -Kurve:



- Liegt F -Wert im roten Bereich (Verwerfungsbereich), dann wird H_0 verworfen

Bespiel: Papier Reissfestigkeit

- Varianzanalyse-Tabelle: Python

```
rf = DataFrame({  
    "HC": np.repeat(["5%", "10%", "15%", "20%"], [6, 6, 6, 6]),  
    "Strength": [7, 8, 15, 11, 9, 10, 12, 17, 13, 18, 19, 15, 14, 18,  
19, 17, 16, 18, 19, 25, 22, 23, 18, 20]  
})
```

```
fit = ols("Strength~HC", data=rf).fit()
```

```
anova_lm(fit)
```

##	df	sum_sq	mean_sq	F	PR(>F)
## HC	3.0	382.791667	127.597222	19.605207	0.000004
## Residual	20.0	130.166667	6.508333	NaN	NaN

- 1. Spalte: **df** sind die Freiheitsgrade (degrees of freedom)
- 2. Spalte: **sum_sq** die Quadratsummen (Sum of Squares)
- 3. Spalte: **mean_sq** die mittlere Quadratsumme (Mean Squared)
- 4. Spalte; gefolgt von der Teststatistik **F** und zuletzt der *P*-Wert (**Pr(>F)**).
- Wert der Teststatistik und der entsprechende *P*-Wert werden auf der Zeile der Behandlung (entspricht hier der Zeile **HC**) aufgeführt
- *P*-Wert von $4 \cdot 10^{-6}$ besagt, dass ein Effekt von unterschiedlichen Hartholz-Konzentrationen signifikant auf dem 5 % Niveau nachgewiesen werden kann
- Die Gruppenmittelwerte unterscheiden sich also signifikant
- Schon aus Boxplots aus ersichtlich

Beispiel: Fleischverpackung

- Varianzanalyse-Tabelle für den Datensatz **Meat**

```
meat = DataFrame({  
  "Treatment": np.repeat(["Kommerziell", "Vakuum", "Gemischt", "CO2"], [3, 3, 3, 3]),  
  "steak_id": [7.66, 6.98, 7.80, 5.26, 5.44, 5.80, 7.41, 7.33, 7.04, 3.51, 2.91, 3.66]  
})
```

```
fit = ols("steak_id~Treatment", data=meat).fit()
```

```
anova_lm(fit)
```

##	df	sum_sq	mean_sq	F	PR(>F)
## Treatment	3.0	32.8728	10.95760	94.584376	0.000001
## Residual	8.0	0.9268	0.11585	NaN	NaN

- p -Wert von $1 \cdot 10^{-6}$ besagt, dass ein Effekt von unterschiedlichen Verpackungsmethoden signifikant auf dem 5 % Niveau nachgewiesen werden kann
- Die Gruppenmittelwerte unterscheiden sich also signifikant
- Diese Feststellung deckt sich mit der Beobachtung in Abbildung

Bemerkung

- Anova: Entscheidet nur, ob es einen Unterschied zwischen Mittelwerten gibt
- Macht *keine* Aussage, *welcher* abweicht
- Muss graphisch ermittelt werden