## Смешанные линейные модели (вложенные случайные факторы)

Линейные модели...

Марина Варфоломеева, Вадим Хайтов

СПбГУ



#### Вы узнаете

 Что такое вложенные случайные факторы и в каких случаях они применяются

#### Вы сможете

- Объяснить, что такое вложенные случайные факторы
- Привести примеры иерархических случайных факторов
- Вычислить коэффициент внутриклассовой корреляции для случая с двумя вложенными случайными факторами
- Подобрать смешаную линейную модель со вложенными случайными факторами

## Смешанные модели со вложенными случайными факторами





#### Факторы образуют иерархическую последовательность вложенности

 лес -> дерево в лесу -> ветка на дереве -> наблюдение (личинки насекомых)

#### Факторы образуют иерархическую последовательность вложенности

 лес -> дерево в лесу -> ветка на дереве -> наблюдение (личинки насекомых)

Внутри каждого уровня главного фактора будут разные (нестрого сопоставимые) уровни вложенного фактора

Деревья, с которых собирали личинок, будут разные в разных лесах (разные экземпляры).

#### Факторы образуют иерархическую последовательность вложенности

 лес -> дерево в лесу -> ветка на дереве -> наблюдение (личинки насекомых)

## Внутри каждого уровня главного фактора будут разные (нестрого сопоставимые) уровни вложенного фактора

Деревья, с которых собирали личинок, будут разные в разных лесах (разные экземпляры).

## Уровни вложенных факторов описывают иерархию взаимного сходства наблюдений

Личинки с разных деревьев из одного леса имеют право быть похожими друг на друга больше, чем на личинок из другого леса Личинки на одном дереве имеют право быть похожими друг на друга больше, чем на личинок с другого дерева И т.п.

## Другие примеры вложенных факторов

- регион -> город -> больница -> наблюдение (пациент)
- самка -> выводок -> наблюдение (особь)
- лес -> дерево в лесу -> гнездо на дереве -> наблюдение (птенец)
- улитка -> спороциста в улитке -> наблюдение (редия)



## Пример: Высота растений и выпас скота

Вообще-то, статья Gennet et al. 2017 о птицах, но чтобы про них что-то лучше понять, нужно разобраться с их местообитанием.

Как в разные годы высота растительного покрова зависит от выпаса скота, экспозиции склона и проективного покрытия местных растений?

#### Зависимая переменная:

height - высота растительного покрова

#### Предикторы:

- graze выпас коров (0, 1)
- AspectCat экспозиция (S, N)
- nativecov покрытие местной флоры %
- slope наклон
- vear год наблюдений
- Park парк
- plotID уникальный идентификатор участка

Данные: Gennet, S., Spotswood, E., Hammond, M. and Bartolome, J.W., 2017. Livestock grazing supports native plants and songbirds in a California annual grassland. PloS one, 12(6), p.e0176367.



#### Открываем данные

Откроем и переформатируем данные так, чтобы не было дублирования и каждому участку соответствовала одна строчка.

```
library(readxl)
library(tidyr)
gr <- read_excel("data/Grazing_native_plants_Gennet_et_al._2017_S1.xlsx")
graz <- gr %>% spread(Species, presence)
```

### Знакомство с данными

Есть ли пропущенные значения?

```
sum(is.na(graz))
```

```
# [1] 0
```

Сколько участков было в каждом парке в каждый год?

```
with(graz, table(Park, year))
```

```
year
Park 2004 2005 2006 2007 2008 2009 2010 2011
 MT
       6
           10
                10
                     10
                          10
                               10
                                   10
                                        10
 PR
       6
            6
                 6
                      6
                          6
                               6
                                    6
                                         6
                               9 9
 SU
          9
                 9
                    9
                          9
                                         9
 VC
      10
           10
                10
                     10
                          11
                               11
                                   11
                                        11
```



### Наводим порядок

Сделаем факторами переменные, которые понадобятся для модели

```
graz$graze_f <- factor(graz$graze)
graz$AspectCat <- factor(graz$AspectCat)
graz$year_f <- factor(graz$year)</pre>
```

Извлечем корень из обилия местных видов

```
graz$nativecov sq <- sqrt(graz$nativecov)</pre>
```

### Модель

Вспомним главный вопрос исследования и подберем модель

Как в разные годы высота растительного покрова зависит от выпаса скота, экспозиции склона и проективного покрытия местных растений?



#### Модель

Вспомним главный вопрос исследования и подберем модель

Как в разные годы высота растительного покрова зависит от выпаса скота, экспозиции склона и проективного покрытия местных растений?

Нам нужно учесть, что в разные годы из-за кучи разных причин высота растений может различаться

Кроме того, нужно учесть, что в разных парках и на разных участках растения будут расти сходным образом в разные годы. У нас есть иерархические факторы парк и участок в парке



#### Модель

Вспомним главный вопрос исследования и подберем модель

Как в разные годы высота растительного покрова зависит от выпаса скота, экспозиции склона и проективного покрытия местных растений?

Нам нужно учесть, что в разные годы из-за кучи разных причин высота растений может различаться

Кроме того, нужно учесть, что в разных парках и на разных участках растения будут расти сходным образом в разные годы. У нас есть иерархические факторы парк и участок в парке

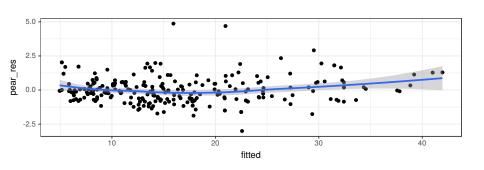
#### Анализ остатков

```
# Данные для анализа остатков
MN1_diag <- data.frame(
  graz,
  pear_res = residuals(MN1, type = "pearson"),
  fitted = fitted(MN1, type = "response"))</pre>
```



## График остатков

```
library(ggplot2)
gg_res <- ggplot(data = MNl_diag, aes(y = pear_res))
gg_res + geom_point(aes(x = fitted)) +
  geom smooth(aes(x = fitted))</pre>
```



## Графики остатков от переменных в модели

nativecov sa

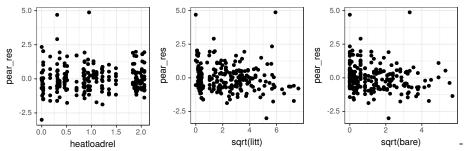
```
library(gridExtra)
grid.arrange(gg res + geom boxplot(aes(x = graze f)),
gg res + geom boxplot(aes(x = AspectCat)),
qq res + geom boxplot(aes(x = year f)),
gg res + geom point(aes(x = nativecov sq)),
gg res + geom_point(aes(x = slope)),
ncol = 3)
   5.0
pear_res
                                pear_res
                                                                pear_res
   2.5
                                   2.5
                                                                   2.5
   0.0
                                   0.0
  -25
                                  -2.5
                                                                   -2.5
              graze f
                                             AspectCat
                                                                               year f
bear res
                                pear_res
                                   2.5
                                   0.0
  -2.5
                                   -2.5
                                           20
                                                       60
```

 Паттерн на графике nativecov\_sq. Возможно, здесь нужно использовать GAMM.

slope

## Графики остатков от переменных не в модели

```
grid.arrange(
  gg_res + geom_point(aes(x = heatloadrel)),
  gg_res + geom_point(aes(x = sqrt(litt))),
  gg_res + geom_point(aes(x = sqrt(bare))),
  ncol = 3)
```



Паттерн на графике heatloadrel - Возможно, есть тренд на графике sqrt(litt)

## Тесты отношения правдоподобий для полной модели

Модель MN1 была подобрана при помощи ML, поэтому можно применять тесты отношения правдоподобий прямо к ней

```
# Analysis of Deviance Table (Type II tests)
#
# Response: height
#
                     Chisq Df Pr(>Chisq)
# graze f
                   66.8805 1 2.885e-16 ***
# AspectCat
                    1.8787 1 0.1704852
# year f
                130.9568 7 < 2.2e-16 ***
# nativecov sq 2.3403 1 0.1260658
                  0.5090 1 0.4755690
# slope
# graze f:AspectCat 11.5895 1 0.0006632 ***
# Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
```

### Высота растительного покрова:

library(car)
Anova(MN1)

 на склонах разной экспозиции по-разному зависит от выпаса скота (достоверное взаимодействие)



## Задание 3

#### Рассчитайте внутриклассовую корреляцию

- ▶ Для наблюдений на одном и том же участке
- ▶ Для наблюдений в одном и том же парке



## Внутриклассовая корреляция

Для расчета внутриклассовой корреляции нужна модель, подобранная при помощи REML

MN1 fin <- lme(height ~ graze f\*AspectCat + year f + nativecov sq + slope,

```
random = ~ 1|Park/plotID.
                data = graz, method = "REML")
MN1 fin
# Linear mixed-effects model fit by REML
   Data: graz
   Log-restricted-likelihood: -838.9555
   Fixed: height ~ graze f * AspectCat + year f + nativecov sg + slope
         (Intercept)
                              graze f1
                                               AspectCatS
         18.44908400
                      -5.25432888
                                               8.57164897
                          year f2006
         year f2005
                                               year f2007
         6.80750075
                         4.07972009
                                              -0.58734178
         year f2008
                          year f2009
                                             year f2010
                       -2.69191822
         -2.70376064
                                              -2.69191822
         year f2011
                          nativecov sq
                                                    slope
          3.72904015
                          -0.53116130
                                              -0.02821586
 graze f1:AspectCatS
         -9.44492743
# Random effects:
  Formula: ~1 | Park
         (Intercept)
 StdDev: 1.574143
  Formula: ~1 | plotID %in% Park
         (Intercept) Residual
             3.3702 5.133291
# Number of Observations: 271
# Number of Groups:
             Park plotID %in% Park
```

## Внутриклассовая корреляция

Для наблюдений на одном и том же участке  $\sigma_{\it plotID}^2/(\sigma_{\it plotID}^2+\sigma_{\it park}^2+\sigma^2)$ 

 $3.3702^2 / (1.574143^2 + 3.3702^2 + 5.133291^2)$ 

```
# [1] 0.2826359
```

Для наблюдений в одном и том же парке  $\sigma_{\it Park}^2/(\sigma_{\it plotID}^2+\sigma_{\it Park}^2+\sigma^2)$ 

```
1.574143^2 / (1.574143^2 + 3.3702^2 + 5.133291^2)
```

```
# [1] 0.06166012
```

B результатах Random effects: Formula: ~1 | Park (Intercept) StdDev: 1.574143

Formula: ~1 | plotID %in% Park

(Intercept) Residual StdDev: 3.3702 5.133291

 Значения высоты травяного покрова похожи внутри участка. Сходство наблюдений внутри одного парка слабее.

## Результаты полной модели

summary(MN1\_fin)

```
# Linear mixed-effects model fit by REML
   Data: graz
        AIC
                 BIC
                         loaLik
    1709.911 1766.758 -838.9555
# Random effects:
  Formula: ~1 | Park
          (Intercept)
# StdDev:
            1.574143
  Formula: ~1 | plotID %in% Park
          (Intercept) Residual
# StdDev:
              3.3702 5.133291
# Fixed effects: height ~ graze f * AspectCat + year f + nativecov sg + slope
                         Value Std.Error DF
                                              t-value p-value
# (Intercept)
                     18.449084 3.092327 227 5.966084 0.0000
                     -5.254329 2.713106 28 -1.936647 0.0629
# graze fl
# AspectCatS
                      8.571649 2.755614 28 3.110613 0.0043
# year f2005
                      6.807501 1.423865 227
                                             4.781003 0.0000
                      4.079720 1.416165 227 2.880822
# year f2006
# year f2007
                     -0.587342 1.422606 227 -0.412863
                                                        0.6801
# year f2008
                     -2.703761 1.409993 227 -1.917570
                                                       0.0564
# year f2009
                     -2.691918 1.409963 227 -1.909211
                                                        0.0575
# year f2010
                     -2.691918 1.409963 227 -1.909211
                                                        0.0575
# year f2011
                     3.729040 1.418901 227
                                             2.628118
                                                        0.0092
                     -0.531161 0.378467 227 -1.403456
# nativecov sq
                                                        0.1618
                                         28 -0.537844
# slope
                     -0.028216 0.052461
                                                       0.5949
# graze f1:AspectCatS -9.444927 3.217544
                                         28 -2.935447
  Correlation:
                     (Intr) grz fl AspcCS y 2005 y 2006 y 2007 y 2008
# graze f1
                     -0.529
# AspectCatS
                     -0.680 0.756
# year f2005
                     -0.258 0.002 -0.025
# year f2006
                     -0.283 -0.010 -0.010
                                          0.620
# year f2007
                     -0.299 -0.018 0.000
                                                  0.623
# year f2008
                     -0.276 -0.009 -0.021
                                          0.625
                                                  0.627
                                                         0.623
# year f2009
                     -0.277 -0.010 -0.021
                                          0.625
                                                  0.627
                                                         0.623 0.632
# year f2010
                     -0.277 -0.010 -0.021
                                          0.625
                                                  0.627
                                                         0.623
# year f2011
                     -0.301 -0.022 -0.005
                                          0.608
                                                  0.625
                                                         0.631
# nativecov sq
                     -0.202 -0.100
                                    0.125 -0.105
                                                  0.012
                                                         0.096
# slone
                     -0.423 -0.261 -0.032 0.007
                                                  0.004 0.001
# graze f1:AspectCatS 0.500 -0.815 -0.839 0.011
                                                  0.013 0.014 0.018
```

## Данные для графика предсказаний фиксированной части модели

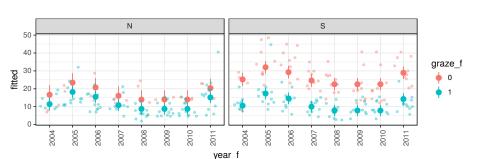
Используем для визуализации модель, подобранную при помощи REML

```
# Исходные данные
NewData MN1 fin <- expand.grid(graze f = levels(graz$graze f),
            AspectCat = levels(graz$AspectCat),
            year f = levels(graz$year f))
NewData MN1 fin$nativecov sq <- mean(graz$nativecov sq)</pre>
NewData MN1 fin$slope <- mean(graz$slope)</pre>
# Предсказанные значения при помощи матриц
X <- model.matrix(~ graze f * AspectCat + year f + nativecov sq + slope,
                  data = NewData MN1 fin)
betas = fixef(MN1 fin)
NewData MN1 fin$fitted <- X %*% betas
# Стандартные ошибки и дов. интервалы
NewData MN1 fin$se <- sqrt( diag(X %*% vcov(MN1 fin) %*% t(X)) )
NewData MN1 fin$lwr <- NewData MN1 fin$fit - 1.96 * NewData MN1 fin$se
NewData MN1 fin$upr <- NewData MN1 fin$fit + 1.96 * NewData MN1 fin$se
```

## График предсказаний фиксированной части модели

На южных склонах высота травы выше там, где не пасут скот, а на северных нет. (Строго говоря, нужен еще пост хок тест, чтобы это утверждать.)

```
ggplot(data = NewData_MNl_fin, aes(x = year_f, y = fitted, colour = graze_f))
geom_pointrange(aes(ymin = lwr, ymax = upr)) +
facet_wrap(~ AspectCat) +
geom_jitter(data = graz, aes(y = height), alpha = 0.35, size = 1) +
theme(axis.text.x = element_text(angle = 90))
```





# Вариант решения с подбором оптимальной модели (самостоятельно)



#### Задание 4

Оптимизируйте модель с предыдущего шага

Сделайте анализ остатков

Опишите и визуализируйте финальную модель

## Решение: Подбор оптимальной модели (1)

drop1(MN1, test = "Chi")

Для подбора оптимальной модели воспользуемся тестами отношения правдоподобий. Для него нужно использовать модели, подобранные при помощи ML

```
# Single term deletions
# Model:
 height ~ graze f * AspectCat + year f + nativecov sq + slope
#
                  Df
                        AIC
                               LRT Pr(>Chi)
                     1729.4
# <none>
# year f
                 7 1819.8 104.405 < 2.2e-16 ***
# nativecov_sq 1 1728.9 1.478 0.224030
# slope
                 1 1727.8 0.450 0.502531
# graze f:AspectCat 1 1736.3 8.956 0.002765 **
# ---
# Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
```

## Решение: Подбор оптимальной модели (2)

```
MN1.1 <- update(MN1, .~.-slope)
drop1(MN1.1, test = "Chi")
# Single term deletions
# Model:
# height ~ graze f + AspectCat + year f + nativecov sq + graze f:AspectCat
                        AIC LRT Pr(>Chi)
#
                   Df
                      1727.8
# <none>
                 7 1818.1 104.277 < 2.2e-16 ***
# year f
# nativecov sq 1 1727.5 1.681 0.194802
# graze f:AspectCat 1 1734.4 8.535 0.003484 **
# Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
```

## Решение: Подбор оптимальной модели (3)

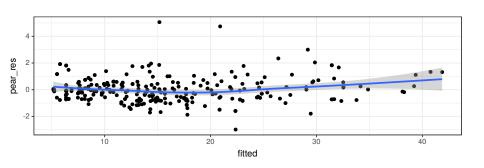
```
MN1.2 <- update(MN1.1, .~.-nativecov sq)
drop1(MN1.2, test = "Chi")
# Single term deletions
# Model:
# height ~ graze f + AspectCat + year f + graze f:AspectCat
                   Df AIC LRT Pr(>Chi)
#
                      1727.5
# <none>
# year f
                 7 1818.7 105.152 < 2.2e-16 ***
# graze f:AspectCat 1 1733.6 8.087 0.004458 **
# ---
# Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
```

#### Решение: Анализ остатков

```
# Данные для анализа остатков
MN1.2_diag <- data.frame(
   graz,
   pear_res = residuals(MN1.2, type = "pearson"),
   fitted = fitted(MN1.2, type = "response"))</pre>
```

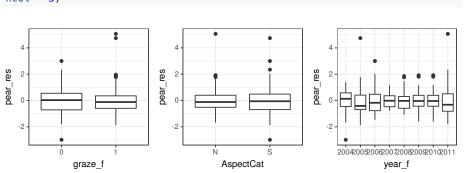
## Решение: График остатков

```
gg_res <- ggplot(data = MN1.2_diag, aes(y = pear_res))
gg_res + geom_point(aes(x = fitted)) +
  geom_smooth(aes(x = fitted))</pre>
```



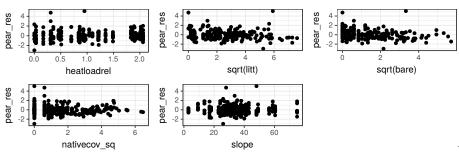
## Решение: Графики остатков от переменных в модели

```
grid.arrange(gg_res + geom_boxplot(aes(x = graze_f)),
gg_res + geom_boxplot(aes(x = AspectCat)),
gg_res + geom_boxplot(aes(x = year_f)),
ncol = 3)
```



## Решение: Графики остатков от переменных не в модели

```
grid.arrange(
    gg_res + geom_point(aes(x = heatloadrel)),
    gg_res + geom_point(aes(x = sqrt(litt))),
    gg_res + geom_point(aes(x = sqrt(bare))),
    gg_res + geom_point(aes(x = nativecov_sq)),
    gg_res + geom_point(aes(x = slope)),
    ncol = 3)
```



Паттерн на графике heatloadrel, nativecov\_sq



## Решение: Тестируем влияние факторов в финальной модели

Для тестов отношения правдоподобий используем финальную модель, подобранную при помощи  $\mathsf{ML}$ 

#### Anova (MN1.2)

#### Высота растительного покрова:

- на склонах разной экспозиции по-разному зависит от выпаса скота (достоверное взаимодействие)
- различается в разные годы
- не зависит от покрытия местных растений и крутизны склона



## Решение: Описываем результаты

Для описания результатов используем модель, подобранную при помощи REML, т.к. он дает больее точные оценки случайных эффектов

```
MN1.2_fin <- update(MN1.2, method = "REML")</pre>
```

## Решение: Результаты

```
summary(MN1.2_fin)
```

```
# Linear mixed-effects model fit by REML
   Data: graz
        ΔTC
                 BIC
                        loaLik
   1703 635 1753 485 -837 8177
# Random effects:
  Formula: ~1 | Park
         (Intercept)
# StdDev:
            1.176709
  Formula: ~1 | plotID %in% Park
         (Intercept) Residual
# StdDev:
            3.709642 5.090746
# Fixed effects: height ~ graze f + AspectCat + year f + graze f:AspectCat
                         Value Std.Error DF
                                             t-value p-value
# (Intercept)
                     16.407668 2.776747 228 5.908952 0.0000
                     -5.678094 2.760273 29 -2.057077 0.0488
# graze fl
# AspectCatS
                      9.440473 2.875011 29 3.283630 0.0027
# year f2005
                      6.626295 1.404286 228 4.718622 0.0000
                      4.131443 1.404286 228 2.942024 0.0036
# year f2006
# year f2007
                     -0.368337 1.404286 228 -0.262295 0.7933
# year f2008
                     -2.704054 1.398243 228 -1.933894 0.0544
# year f2009
                     -2.689610 1.398243 228 -1.923564
                                                       0.0557
# year f2010
                     -2.689610 1.398243 228 -1.923564 0.0557
# year f2011
                      3.987275 1.398243 228 2.851633
                                                       0.0047
# graze f1:AspectCatS -9.642549 3.372692 29 -2.859007
                                                       0.0078
# Correlation:
                     (Intr) grz fl AspcCS y 2005 y 2006 y 2007 y 2008
# graze f1
                     -0.807
# AspectCatS
                     -0.787 0.795
# year f2005
                     -0.306 -0.011 -0.015
# year f2006
                     -0.306 -0.011 -0.015 0.625
# year f2007
                     -0.306 -0.011 -0.015 0.625
                                                  0.625
# year f2008
                     -0.305 -0.012 -0.021
                                          0.627
                                                  0.627
                                                         0.627
# year f2009
                     -0.305 -0.012 -0.021
                                          0.627
                                                  0.627 0.627
                                                               0.632
# year f2010
                     -0.305 -0.012 -0.021 0.627
                                                  0.627
                                                         0.627
                                                               0.632
# year f2011
                     -0.305 -0.012 -0.021 0.627
                                                 0.627 0.627
                                                               0.632
# graze f1:AspectCatS 0.654 -0.825 -0.849 0.016 0.016 0.016 0.021
                     y 2009 y 2010 y 2011
# graze f1
# AspectCatS
# vear f2005
```

## Решение: Внутриклассовая корреляция

Для расчета нужна модель, подобранная при помощи REML

```
MN1.2_fin
```

Для наблюдений на одном и том же участке  $\sigma_{plotID}^2/(\sigma_{plotID}^2+\sigma_{Park}^2+\sigma^2)$  3.709642^2 / (1.176709^2 + 3.709642^2 + 5.090746^2)

Для наблюдений в одном и том же парке  $\sigma_{Park}^2/(\sigma_{plotID}^2+\sigma_{Park}^2+\sigma^2)$  1.176709^2 / (1.176709^2 + 3.709642^2 + 5.090746^2)

B результатах Random effects: Formula: ~1 | Park (Intercept) StdDev: 1.176709

Formula: ~1 | plotID %in% Park (Intercept) Residual StdDev: 3.709642 5.090746

# Решение: Данные для графика предсказаний фиксированной части модели

Используем для визуализации модель, подобранную при помощи REML

```
# Исходные данные
NewData MN1.2 fin <- expand.grid(graze f = levels(graz$graze f),
            AspectCat = levels(graz$AspectCat),
            year f = levels(graz$year f))
NewData MN1.2 fin$nativecov sq <- mean(graz$nativecov sq)</pre>
NewData MN1.2 fin$slope <- mean(graz$slope)</pre>
# Предсказанные значения при помощи матриц
X <- model.matrix(~ graze f * AspectCat + year f, data = NewData MN1.2 fin)</pre>
betas = fixef(MN1.2 fin)
NewData MN1.2 fin$fitted <- X %*% betas
# Стандартные ошибки и дов. интервалы
NewData MN1.2 fin$se <- sqrt(diag(X %*% vcov(MN1.2 fin<math>) %*% t(X)))
NewData MN1.2 fin$\text{lwr} <- NewData MN1.2 fin$fit - 1.96 * NewData MN1.2 fin$se
```

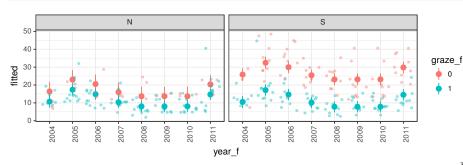
NewData MN1.2 fin\$upr <- NewData MN1.2 fin\$fit + 1.96 \* NewData MN1.2 fin\$se

# Решение: График предсказаний фиксированной части модели

На южных склонах высота травы выше там, где не пасут скот, а на северных нет. (Строго говоря, нужен еще пост хок тест, чтобы это утверждать)

Не удивляйтесь тому, что график похож на предыдущий, т.к. те факторы, которые мы удалили из модели и так не влияли.

```
ggplot(data = NewData_MN1.2_fin, aes(x = year_f, y = fitted, colour = graze_f
  geom_pointrange(aes(ymin = lwr, ymax = upr)) +
  facet_wrap(~ AspectCat) +
  geom_jitter(data = graz, aes(y = height), alpha = 0.35, size = 1) +
  theme(axis.text.x = element_text(angle = 90))
```



## Take-home messages

- Случайные факторы в смешанных моделях могут быть вложены друг в друга
- Есть два способа подбора коэффициентов в смешанных моделях: МL и REML. Для разных этапов анализа важно, каким именно способом подобрана модель.

## Дополнительные ресурсы

- Crawley, M.J. (2007). The R Book (Wiley).
- Zuur, A. F., Hilbe, J., & Ieno, E. N. (2013). A Beginner's Guide to GLM and GLMM with R: A Frequentist and Bayesian Perspective for Ecologists. Highland Statistics.
- Zuur, A.F., Ieno, E.N., Walker, N., Saveliev, A.A., and Smith, G.M. (2009).
   Mixed Effects Models and Extensions in Ecology With R (Springer)
- Pinheiro, J., Bates, D. (2000). Mixed-Effects Models in S and S-PLUS. Springer