**Лекция №8 Корреляционный анализ**

**Цель лекции:**

* Познакомиться с понятием корреляции
* Научиться рассчитывать и интерпретировать коэффициент корреляции Пирсона.
* Изучить ковариацию
* Рассчитать и интерпретируем коэффициент корреляции Спирмена.
* Рассмотреть реальный пример применения коэффициента корреляции Спирмена.

**Материал прошлого урока:**

На прошлых занятиях мы рассматривали тестирования гипотез и построение доверительных интервалов. На этом уроке и следующем уроках мы познакомимся с корреляционным и регрессионным анализами, которые позволяют оценить тесноту линейной связи и показать, как изменяется зависимая переменная при изменении независимой переменной.

План урока:

1. Корреляция
2. Интерпретация коэффициента корреляции
3. Слабые стороны корреляционного анализа
4. Ковариация
5. Коэффициент корреляции Спирмена

Корреляция

В реальной жизни перед нами часто встает задача, где надо понять, а есть ли взаимосвязь между двумя и более случайными величинами (СВ). И здесь на помощь приходит корреляционный и регрессионный анализы. Начнем изучение с корреляционного анализа. Так что же такое корреляция?

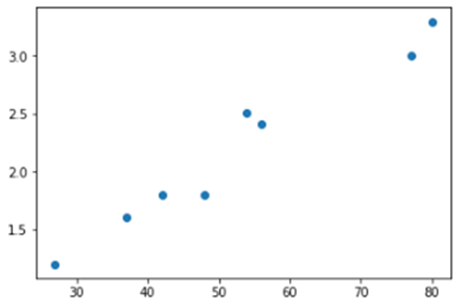
**Корреляция – это математический показатель, по которому можно судить о наличии статистической взаимосвязи между двумя и более случайными величинами.**

Но чтобы нам оценить в цифрах, насколько тесна линейная взаимосвязь, мы используем для расчета коэффициент корреляции. Иными словами, коэффициент корреляции – это коэффициент, который показывает, насколько велика линейная зависимость между случайными величинами.

Давайте взглянем на таблицу ниже:

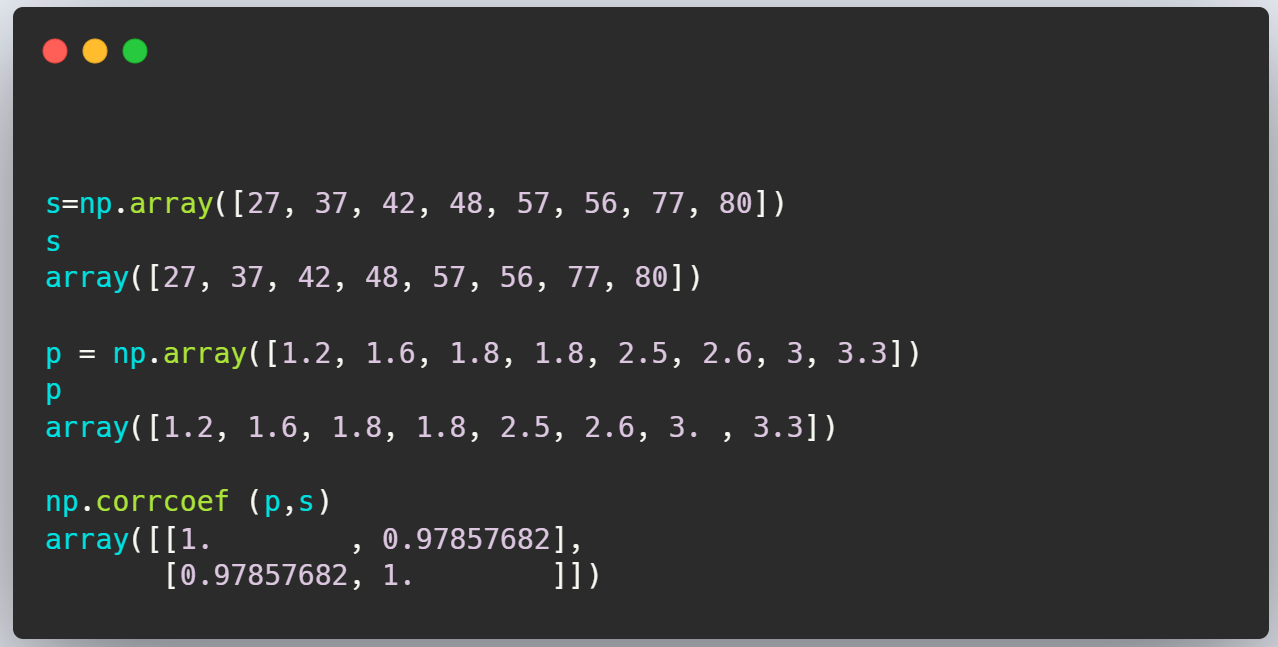


Здесь видим две переменные, площадь и цена квартиры. Мы расположили площадь по возрастанию и видим, что с ростом этой СВ в целом растет и цена. Лучше всего оценивать с помощью графика, который позволяет взглянуть на СВ целиком.



По графику также видим, что расположение данных напоминает прямую, что свидетельствует о наличии линейной зависимости. Но как же понять, насколько велика эта линейная взаимосвязь. И вот здесь приходит на помощь коэффициент корреляции.

С помощью функции corrcoef () из пакета numpy рассчитаем коэффициент корреляции между ценой(p) и площадью (s).



Коэффициент корреляции 0.978. Единицы в этом массиве показывают корреляцию величины с самой собой.

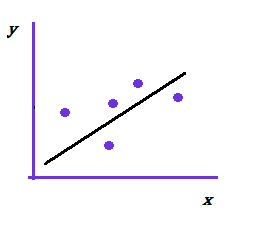
**Интерпретация коэффициента корреляции**

Коэффициент корреляции обозначается r или R и принимает значения [-1, 1]. Теснота линейной взаимосвязи определяется по модулю, чем ближе по модулю к 1, тем сильнее линейная взаимосвязь. Знак показывает прямая или обратная взаимосвязь между случайными величинами.

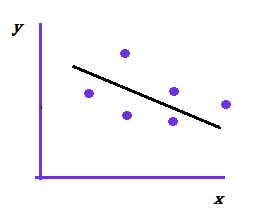
|  |  |
| --- | --- |
| Значение r | Интерпретация линейной зависимости |
| 0 - 0.1 | нет линейной зависимости |
| * 1. - 0.3 | очень слабая |
| 0.3 - 0.5 | слабая |
| 0.5 - 0.7 | средняя (заметная) |
| 0.7 - 0.9 | сильная |
| 0.9 – 1 | очень сильная |
|  |  |

Т.е. коэффициент корреляции -1 и 1 показывают одинаково сильную линейную зависимость. Только одна из них будет обратная (-1), а другая прямая зависимость (1).

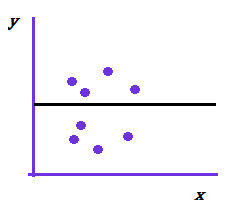
Прямая зависимость означает, что рост одной случайной величины сопровождается ростом другой случайной величины. Например, с увеличением расстояния возрастает стоимость билета.



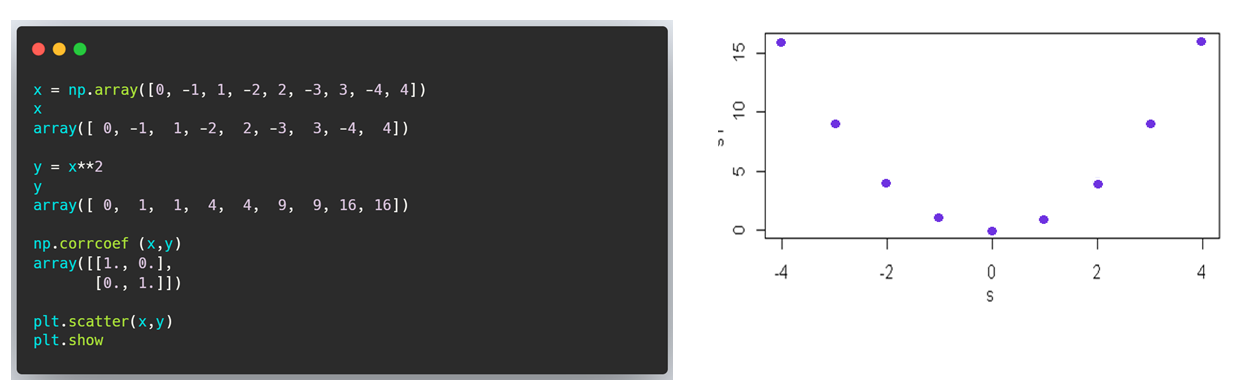
Обратная зависимость означает, что с увеличением одной случайной величины уменьшается другая случайная величина. Например, выше температура, меньше времени занимает растопить лед.



И если коэффициент корреляции равен или близок к нулю, то это говорит лишь о том, что между СВ нет линейной зависимости, но возможна какая - то другая зависимость, поэтому в таком случае рекомендуется построить график.



Одним из самых распространенных примеров из книг по статистики, который иллюстрирует справедливость вышеупомянутого факта, является квадратичная зависимость . На графике четко видна параболла, но коэффициент корреляции показывает ноль.

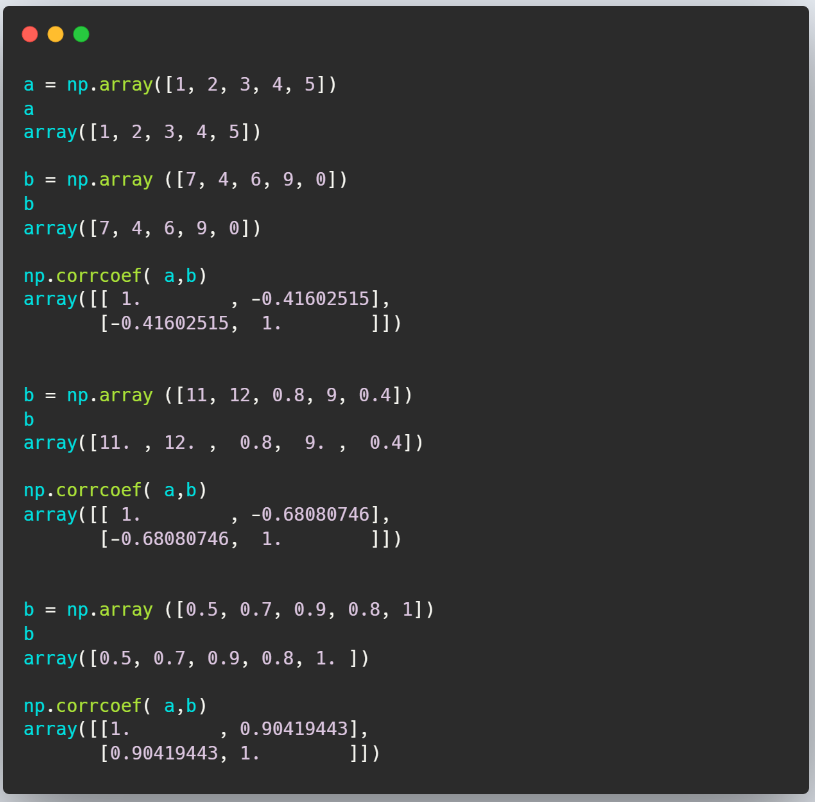


**Слабые стороны корреляционного анализа**

1. То, что коэффициент корреляции показывает ноль при наличии, например, квадратичной зависимости можно уже отнести к недостаткам корреляционного анализа.
2. Еще одним недостатком может служить то, что случайные величины могут коррелировать по случайности. Проиллюстрируем это.

Мы возьмем одинаковой длины массив и массив и будем случайным образом изменять только массив . Посмотрим, что показывает коэффициент корреляции.

В первом случае коэффициент – слабая обратная зависимость, во втором случае – заметная обратная зависимость. А последний вариант массива был набран неслучайным образом. Случайная величина росла и случайную величину я набрала таким образом, что почти все значения тоже растут. И получили коэффициент корреляции 0.9 – сильная прямая линейная взаимосвязь. Но тем не менее и в предыдущих СВ линейная зависимость прослеживалась, хотя это были абсолютно случайные СВ.



1. Высокая корреляции двух величин может свидетельствовать о том, что есть третья скрытая переменная. Например, с увеличением, числа кафе в городе, растет и число больниц. На самом же деле между СВ нет никакой зависимости, но есть третья скрытая переменная, плотность населения. Чем больше город, тем больше кафе и больниц.
2. И к последнему недостатку можно отнести то, что можно перепутать причинно- следственную связи, т.е. что является причиной, а что следствием. Т.к. мы не всегда работаем с такими очевидными переменными, как, к примеру, температура и скорость таяния льда, то подобный недостаток тоже нужно держать в памяти.

**Ковариация**

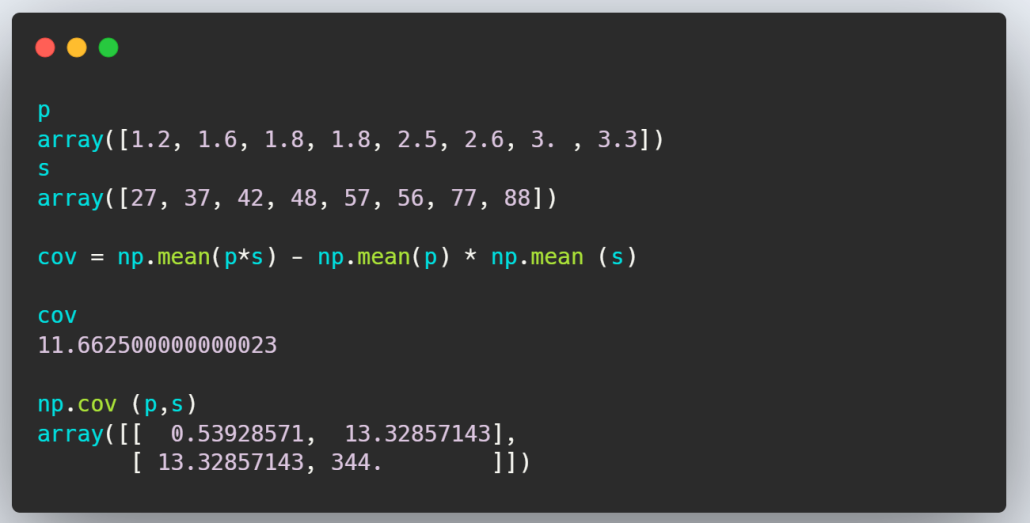
**Ковариация – это величина, определяющая зависимость двух случайных величин.**

Найти ее можно по формуле:

*где М - математическое ожидание*

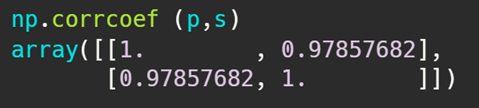
Масштаб ковариации зависит от дисперсии, поэтому по ковариации нельзя судить о силе взаимосвязи СВ, но ее можно нормировать, поместив значения в [-1; 1]. Таким образом, мы получим коэффициент корреляции Пирсона, который мы уже сегодня рассчитывали с помощью функции corrcoef().

Давайте рассчитаем ковариацию для цены и площади – случайных величин, с которыми мы сегодня уже работали.

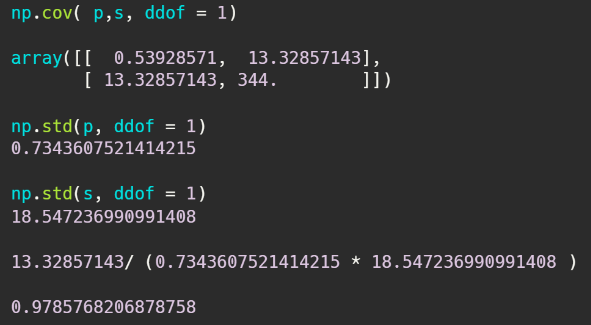


Ковариация, рассчитанная функцией отличается от значения ковариации, рассчитанной по формуле (11.66 и 13.28). Дело в том, что ковариация может быть как смещенная, так и несмещенная.

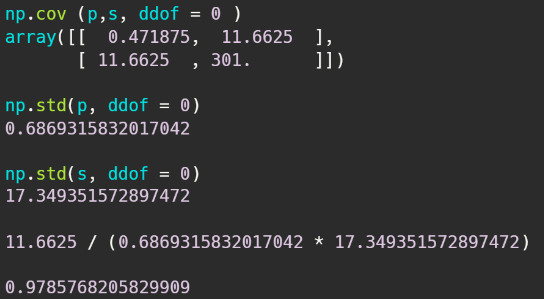
Давайте рассчитаем коэффициент корреляции Пирсона через смещенную и несмещенную ковариацию. Мы должны получить коэффициент корреляции Пирсона 0.978



Согласно формуле для расчета коэффициента корреляции мы должны ковариацию разделить на произведение стандартных отклонений. Т.е. если мы рассчитаем несмещенную ковариацию, то и делить мы должны на произведение несмещенных стандартных отклонений.



Если же мы используем смещенную ковариацию, то и делить ее будем на произведение смещенных стандартных отклонений.

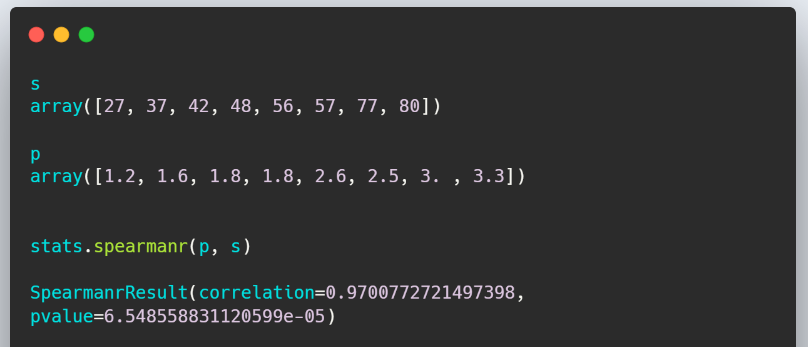


Мы видим, что значения коэффициента корреляции совпадают между собой и равны тому значению, которое мы получили через функцию corrcoef.

**Коэффициент корреляции Спирмена**

Коэффициент корреляции Спирмена называют ранговым коэффициентом корреляции. Он также показывает тесноту линейной связи, но в отличии от коэффициента корреляции Пирсона не требует нормальности распределений случайных величин и применяется для количественных и порядковых данных.

Рассчитаем коэффициент корреляции Спирмена в Python помощью функции spearmanr().



Коэффициент корреляции Спирмена 0.97 Сильная корреляция.

Как рассчитывается коэффициент корреляции Спирмена?

Возьмем уже знакомые нам СВ площадь и цену , а затем присвоим им ранги в порядке возрастания. Т.е. самая маленькая площадь 27 – ранг 1, а самой большой площади 80 – ранг 8.

Как присваивать ранги, если значения повторяются, как, например, в массиве p, где два раза встречается цена 1.8? Расположив цены по возрастанию, величины 1.8 стоят на 3 и 4 местах. Тогда присваиваем им среднее арифметическое номеров элементов. Т.е.(3+4)/2 =3.5 Для каждого значения 1.8 будет ранг 3.5. И назовем эти СВ (сами значения рангов) и . И уже к ним применим коэффициент корреляции Пирсона.

**Условия применимости коэффициентов корреляции**

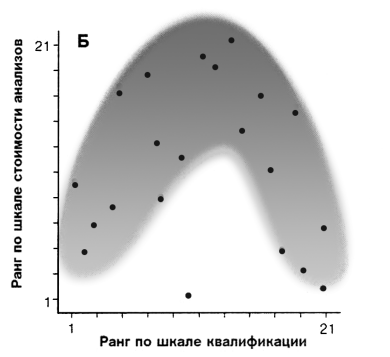
|  |  |
| --- | --- |
| **Коэффициент корреляции**  **Пирсона** | **Коэффициент корреляции Спирмена** |
| параметрический метод | непараметрический метод |
| нормальность | распределение может быть отличным от нормального |
| количественные данные | количественные и порядковые признаки |
| сделать проверку на U- образную кривую | сделать проверку на U- образную кривую |

**Рассмотрим интересный пример из книги Стентона Гланца «Медико- биологическая статистика».**

В качестве примера автор книги берет реальное исследование\*, в котором проводят корреляционный анализ между квалификацией врача и затратами на анализы, которые врач прописал при госпитализации пациента.

Врачи прошли аттестационную комиссию и получили оценки от 1 до 21 (ранги), где 21 – худшая квалификация. При анализе получился коэффициент корреляции Спирмена , что показывает очень слабую зависимости.

Но если мы посмотрим на график из этой книги, то увидим квадратичную зависимость. По графику видно, что меньше всего затрат на анализы у пациентов врачей с лучшей и худшей категорией, соответственно и количество назначаемых исследований этими врачами наименьшее.



Мы можем сделать выводы по графику, мы видим зависимость, но коэффициент корреляции Спирмена нам ничего не показал. Это говорит о том, что подобную U-образную зависимость никакой коэффициент корреляции не уловит.

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\* S. A. Schroeder, A. Schliftman, Т. Е. Piemine. Variation among physicians in use of laboratory tests: relation to quality of care. Med. Care, 12: 709–713, 1974

Есть еще один недостаток, который мы не обсудили. Посмотрите на схематичные рисунки.

На обоих графиках коэффициент корреляции равен 1, но на левом графике зависимая переменная растет быстрее, чем на правом. Т.е. коэффициент корреляции не показывает, как быстро изменяется зависимая переменная при изменении независимой переменной . Ответить на этот вопрос сможет нам регрессионный анализ, которым мы займемся на следующем уроке.

