



ME613 - Análise de Regressão

Parte 3

Samara F. Kiihl - IMECC - UNICAMP

Diagnóstico do Modelo

George Box

"All models are wrong but some are useful."



[By DavidMCEddy at en.wikipedia, CC BY-SA 3.0](#)

Introdução

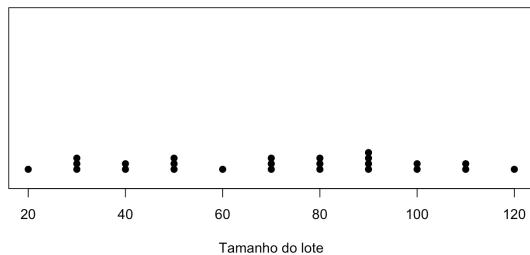
Como saber se a função de regressão é adequada para explicar a relação entre as variáveis observadas?

- Gráficos
- Testes

Caso a função de regressão não seja adequada, o que fazer?

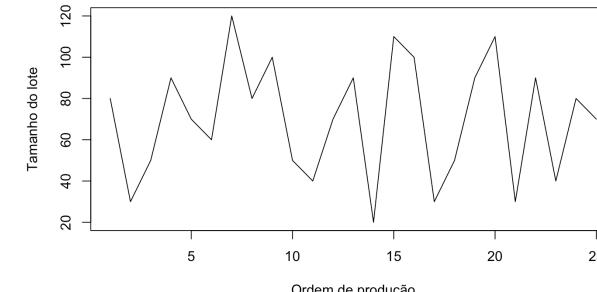
- Transformação de variáveis.
- Outro tipo de modelo.

Diagnósticos para a variável preditora



- Quantas observações em cada valor diferente de X ?
- Amplitude dos valores de X .

Diagnósticos para a variável preditora



Se as observações são feitas ao longo do tempo, há correlação entre seus valores e o tempo de observação?

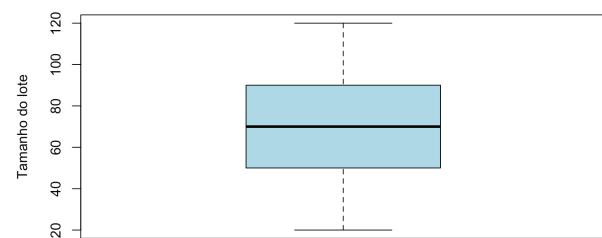
5/59

5/59

6/59

6/59

Diagnósticos para a variável preditora



Resíduos

Gráficos de diagnósticos para Y não são úteis em análise de regressão, pois a variável resposta é uma função da preditora.

Os gráficos de diagnósticos são feitos para os resíduos.

- Resíduos:

$$e_i = Y_i - \hat{Y}_i$$

- Erros:

$$\varepsilon_i = Y_i - E(Y_i)$$

Se assumirmos $e_i \sim_{iid} \mathcal{N}(0, \sigma^2)$, esperamos que e_i 's, os resíduos observados, refletem as propriedades assumidas para e_i 's.

7/59

7/59

8/59

Propriedades dos resíduos

- Média dos resíduos:

$$\bar{e} = \frac{\sum_{i=1}^n e_i}{n} = 0$$

Como \bar{e} é sempre nula, não fornece informação sobre $E(e_i)$.

- Variância dos resíduos:

$$s^2 = \frac{\sum_{i=1}^n (e_i - \bar{e})^2}{n - 2} = \frac{SQErro}{n - 2} = QMErro$$

Se o modelo é apropriado, s^2 é um estimador não viesado para σ^2 .

Propriedades dos resíduos

- Independência: e_i 's não são variáveis aleatórias independentes, pois dependem de \hat{Y}_i , que por sua vez dependem das mesmas estimativas para os parâmetros β_0 e β_1 .

Quanto maior o número de observações com relação ao número de parâmetros estimados, menor é a dependência dos resíduos (pode ser ignorada).

9/59

10/59

Resíduos semi-studentizados

Para detectar outliers, muitas vezes é mais útil observar resíduos padronizados.

Resíduo semi-studentizado:

$$e_i^* = \frac{e_i}{\sqrt{QME}}$$

Suposições do modelo estudadas através da análise de resíduos

Podemos utilizar análise de resíduos para verificar se:

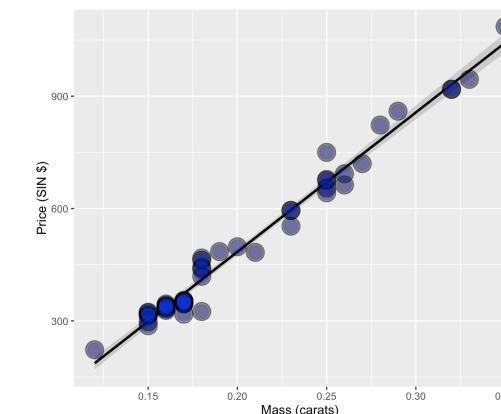
1. a função de regressão não é linear
2. erros não possuem variância constante (heterocedasticidade)
3. erros não são independentes
4. o modelo ajustado é adequado, com exceção de algumas observações outliers
5. erros não seguem distribuição normal
6. uma ou mais variáveis preditoras foram omitidas no modelo

Análise de Resíduos: gráficos

- Resíduos x Variável preditora
- Resíduos absolutos x Variável preditora
- Resíduos x Valores ajustados (\hat{Y})
- Resíduos ao longo do tempo/em sequência
- Resíduos X Variável preditora não incluída no modelo
- Boxplot dos resíduos
- Gráfico de probabilidade normal dos resíduos

Exemplo: Preço do diamante

Preços de diamantes (dólares de Singapura) e peso em quilates (1 quilate = 0.2g).



13/59

13/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

14/59

14/59

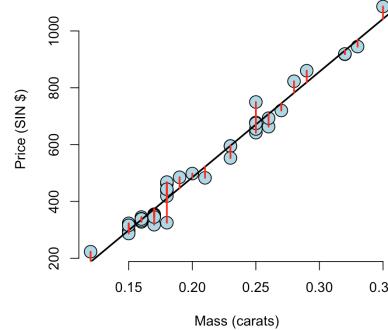
file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

Exemplo: Preço do diamante

Resíduos: comprimento das linhas vermelhas, mantendo o sinal.

Exemplo: Preço do diamante

Resíduos X Variável preditora



15/59

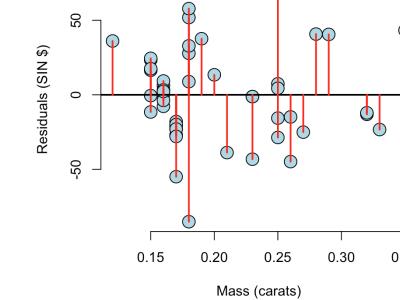
15/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

16/59

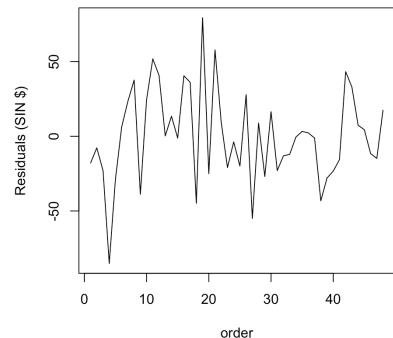
16/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1



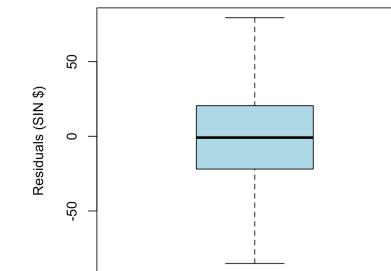
Exemplo: Preço do diamante

Resíduos X ordem



Exemplo: Preço do diamante

Boxplot dos resíduos



17/59

17/59

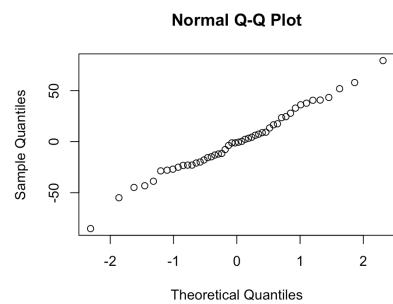
file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

18/59

18/59

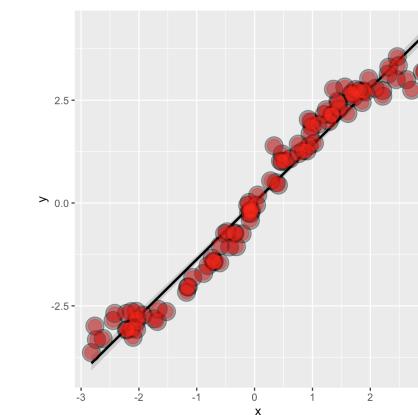
Exemplo: Preço do diamante

Gráfico de normalidade dos resíduos



(ver Kutner pag 110)

Exemplo: não-linearidade



19/59

19/59

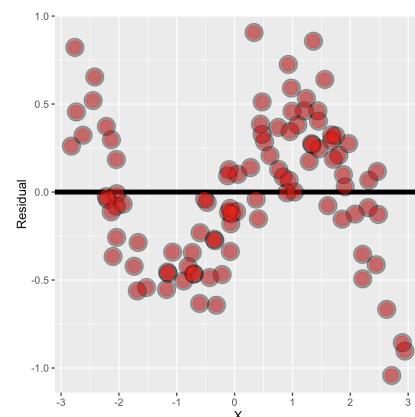
file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

20/59

20/59

Exemplo: não-linearidade

Resíduos X Variável preditora

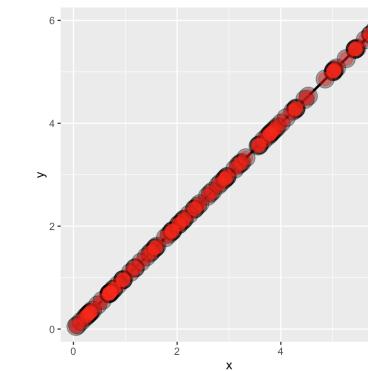


21/59

<file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1>

21/59

Exemplo: heterocedasticidade

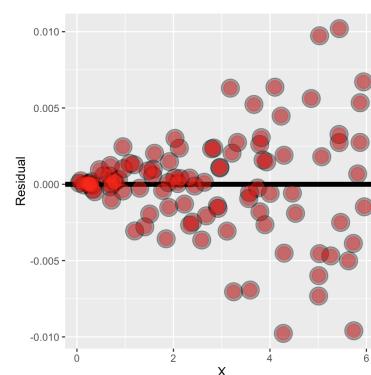


22/59

<file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1>

22/59

Exemplo: heterocedasticidade



23/59

<file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1>

23/59

Análise de Resíduos: testes de hipóteses

Além de gráficos, podemos também utilizar testes de hipóteses estatísticos para avaliar algumas suposições do modelo.

24/59

24/59

Teste de correlação para normalidade

Calcular coeficiente de correlação entre e_i e seus valores esperados, segundo a distribuição normal

Quanto maior a correlação, maior o índice de normalidade dos resíduos.

Detalhes sobre o teste: [Looney & Gulledge \(1985\) - Use of the Correlation Coefficient with Normal Probability Plots](#)

Teste de correlação para normalidade

Calcular a correlação entre os resíduos ordenados e

$$r = \{r_1, r_2, \dots, r_k \dots, r_n\}$$

em que r_k é o valor esperado do k -ésimo resíduo, segundo a suposição de normalidades.

$$r_k \approx \sqrt{QME} \left[z \left(\frac{k - 0.375}{n + 0.25} \right) \right]$$

$z(A)$ é o $A \times 100$ percentil da distribuição normal padrão.

Obs: Outro teste conhecido: [Teste de Shapiro-Wilks](#).

25/59

26/59

Teste de homocedasticidade: Brown-Forsythe

- Não depende da suposição de normalidade
- Aplicável no caso de regressão linear simples quando a variância do erro aumenta ou decresce com a variável preditora X .
- Tamanho amostral grande o suficiente para que possamos assumir que os resíduos são independentes.
- Idéia parecida com um teste-t para duas amostras.

Teste de homocedasticidade: Brown-Forsythe

- X é dividida em X_1 (valores mais baixos de X) e X_2 (valores mais altos de X). Isto é, temos dois grupos.
- e_{i1} é o i -ésimo resíduo para o grupo 1 e e_{i2} é o i -ésimo resíduo para o grupo 2.
- n_j é o número de observações no grupo j
- $n = n_1 + n_2$.
- \tilde{e}_j é a mediana dos resíduos do grupo j .
- $d_{i1} = |e_{i1} - \tilde{e}_1| \quad d_{i2} = |e_{i2} - \tilde{e}_2|$

27/59

28/59

Teste de homocedasticidade: Brown-Forsythe

Estatística do teste:

$$t_{BF}^* = \frac{\bar{d}_1 - \bar{d}_2}{s \sqrt{\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}}}$$

$$s^2 = \frac{\sum(d_{i1} - \bar{d}_1)^2 + \sum(d_{i2} - \bar{d}_2)^2}{n - 2}$$

Se a variância é constante e n_1 e n_2 grandes o suficiente, então t_{BF}^* segue distribuição t com $n - 2$ graus de liberdade.

Valores altos de t_{BF}^* indicam heterocedasticidade.

Exemplo: Toluca

```
data <- read.table("./dados/CH01TA01.txt")
x = data[,1]
y = data[,2]
ind1 = which(x<80)
ind2 = which(x>=80)
fit = lm(y~x)
resi = fit$resi
resil1 = resi[ind1]
resil2 = resi[ind2]
d1 = abs(resil1-median(resil1))
d2 = abs(resil2-median(resil2))
t.test(d1,d2)
```

29/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

29/59

30/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

30/59

Exemplo: Toluca

```
## Welch Two Sample t-test
##
## data: d1 and d2
## t = 1.3215, df = 22.999, p-value = 0.1993
## alternative hypothesis: true difference in means is not equal to 0
## 95 percent confidence interval:
## -9.253335 41.982809
## sample estimates:
## mean of x mean of y
## 44.81507 28.45034
```

Não rejeitamos H_0 , isto é, não obtemos evidências para rejeitar a hipótese de homocedasticidade dos erros.

Teste de homocedasticidade: Breusch-Pagan

Assume que $\varepsilon_i \sim \mathcal{N}(0, \sigma_i^2)$.

O seguinte modelo é assumido:

$$\log_e \sigma_i^2 = \gamma_0 + \gamma_1 X_i$$

Se $\gamma_1 = 0$ temos homocedasticidade.

$$H_0: \gamma_1 = 0 \text{ vs } H_1: \gamma_1 \neq 0.$$

31/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

31/59

32/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

32/59

Teste de homocedasticidade: Breusch-Pagan

Estatística do teste:

$$X_{BP}^2 = \frac{\frac{SQRq}{2}}{\left(\frac{SQE}{n}\right)^2}$$

em que $SQRq$ é a soma de quadrados da regressão de e_i^2 em X e SQE é a soma de quadrados do erro da regressão de Y em X .

Sob H_0 , $X_{BP}^2 \sim \chi_1^2$.

Exemplo: Toluca

```
fit = lm(y~x)
resi = fit$resi
fit2 = lm(resi^2~x)
a1 <- anova(fit)
a2 <- anova(fit2)
estatistica <- (a2$`Sum Sq`[1]/2)/((a1$`Sum Sq`[2]/length(y))^2)
```

Exemplo: Toluca

```
## Analysis of Variance Table
##
## Response: y
##             Df Sum Sq Mean Sq F value    Pr(>F)
## x           1 252378  252378  105.88 4.449e-10 ***
## Residuals 23  54825   2384
## ---
## Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' '
```



```
## Analysis of Variance Table
##
## Response: resi^2
##             Df Sum Sq Mean Sq F value Pr(>F)
## x           1 7896142 7896142  1.0914  0.307
## Residuals 23 166395896 7234604
## 
```



```
## [1] 0.8209192
```

Teste de homocedasticidade: Breusch-Pagan

Diretamente pelo R:

```
library('car')
ncvTest(fit)

## Non-constant Variance Score Test
## Variance formula: ~ fitted.values
## Chisquare = 0.8209192   Df = 1     p = 0.3649116
```

Teste F para falta de ajuste

Queremos testar se a função de regressão proposta é adequada para os dados.

Suposições: as observações de $Y|X$ são

- independentes
- seguem distribuição normal
- variância constante σ^2

É preciso que tenhamos mais de uma observação para cada nível de X (replicações).

Teste F para falta de ajuste

Suponha que tenhamos m valores distintos para X

Para cada valor diferente de X , x_j , temos n_j observações.

- $Y_{11}, Y_{12}, \dots, Y_{1n_1}$ são n_1 repetições para $X = x_1$.
- $Y_{21}, Y_{22}, \dots, Y_{2n_2}$ são n_2 repetições para $X = x_2$.
- $Y_{m1}, Y_{m2}, \dots, Y_{mn_m}$ são n_m repetições para $X = x_m$.

$$n = \sum_{j=1}^m \sum_{u=1}^{n_j} 1 = \sum_{j=1}^m n_j$$

37/59

38/59

Teste F para falta de ajuste

Com replicações para cada $X = x_k$, temos um estimador para $Var(Y|X = x_k) = \sigma^2$ para todo k .

Por exemplo, quando $X = x_1$, podemos usar $Y_{11}, Y_{12}, \dots, Y_{1n_1}$ e o seguinte estimador para $Var(Y|X = x_1)$:

$$\frac{1}{n_1 - 1} \sum_{j=1}^{n_1} (Y_{1j} - \bar{Y}_1)^2$$

Combinando todas as observações (não apenas as replicações para um dado nível de X), temos o seguinte estimador para σ^2 :

$$s_p^2 = \frac{\sum_{j=1}^m \sum_{u=1}^{n_j} (Y_{ju} - \bar{Y}_j)^2}{\sum_{j=1}^m (n_j - 1)}$$

Teste F para falta de ajuste

$$SQE_p = \sum_{j=1}^m \sum_{u=1}^{n_j} (Y_{ju} - \bar{Y}_j)^2$$

com graus de liberdade $n_p = \sum_{j=1}^m (n_j - 1) = \sum_{j=1}^m n_j - m$.

$$QME_{puro} = s_p^2 = \frac{\sum_{j=1}^m \sum_{u=1}^{n_j} (Y_{ju} - \bar{Y}_j)^2}{\sum_{j=1}^m n_j - m}$$

39/59

40/59

Teste F para falta de ajuste

Relembrando:

$$SQE = \sum_{j=1}^m \sum_{u=1}^{n_j} (Y_{ju} - \hat{Y}_j)^2$$

Mostre¹ que a SQE pode ser particionada da seguinte forma:

$$\sum_{j=1}^m \sum_{u=1}^{n_j} (Y_{ju} - \hat{Y}_j)^2 = \sum_{j=1}^m \sum_{u=1}^{n_j} (Y_{ju} - \bar{Y}_j)^2 + \sum_{j=1}^m n_j (\hat{Y}_j - \bar{Y}_j)^2$$

Teste F para falta de ajuste

$$\underbrace{\sum_{j=1}^m \sum_{u=1}^{n_j} (Y_{ju} - \hat{Y}_j)^2}_{SQE} = \underbrace{\sum_{j=1}^m \sum_{u=1}^{n_j} (Y_{ju} - \bar{Y}_j)^2}_{SQE_p} + \underbrace{\sum_{j=1}^m n_j (\hat{Y}_j - \bar{Y}_j)^2}_{SQF_a}$$

SQE é a soma de quadrados dos resíduos, representando a variação em torno da reta.

SQE_p é a soma de quadrados do erro puro, representando a variação de Y , para X fixo, independente do modelo (pois utilizamos as replicações).

SQF_a é a soma de quadrados da falta de ajuste, representando a falta de ajuste do modelo.

41/59

42/59

Teste F para falta de ajuste

SQE é o numerador de s^2 e SQE_p é o numerador de s_p^2 .

Valores relativamente altos de SQF_a indicam discrepância entre esses dois estimadores e, consequentemente, indicam evidência contra a adequação do modelo de regressão linear simples.

Quanto mais alto o valor de SQF_a , pior é o ajuste do modelo, pois, se o modelo fosse perfeito, teríamos que $SQF_a = 0$.

Teste F para falta de ajuste

H_0 : o MRLS é adequado

H_1 : o MRLS não é adequado

Estatística do teste:

$$F^* = \frac{SQF_a/(m-2)}{SQE_p/(n-m)} \text{ sob } H_0 \sim F_{m-2, n-m}$$

43/59

44/59

Teste F para falta de ajuste

Fonte de Variação	gl	SQ
Regressão	1	$SQ_{Reg} = \sum_{i=1}^n (\hat{Y}_i - \bar{Y})^2$
Erro	$n - 2$	$SQE = \sum_{i=1}^n (Y_i - \hat{Y})^2$
(Falta de ajuste)	$m - 2$	$SQ_{Fa} = \sum_{j=1}^m n_j (\hat{Y}_j - \bar{Y}_j)^2$
(Erro puro)	$n - m$	$SQE_p = \sum_{j=1}^m \sum_{i=1}^{n_j} (Y_{ji} - \bar{Y}_j)^2$
Total (ajustada)	$n - 1$	$SQT = \sum_{i=1}^n (Y_i - \bar{Y})^2$

Exemplo: Agências bancárias

11 agências de um certo banco ofereceram brindes para novos clientes.

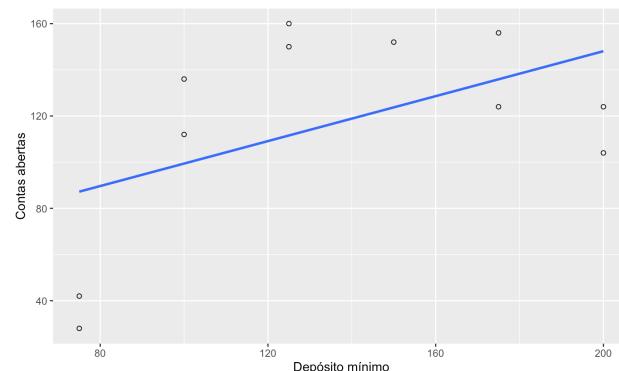
Um depósito inicial mínimo era necessário para qualificar para o brinde.

Cada agência especificou o valor do depósito mínimo.

Interesse: valor do depósito mínimo inicial e número de contas que foram abertas na agência.



Exemplo: Agências bancárias



Exemplo: Agências bancárias

Modelo completo:

$$Y_{ij} = \mu_j + \varepsilon_{ij}$$

Temos que $E(Y_{ij}) = \mu_j$, isto é, temos esperança diferente para cada X_j .



Exemplo: Agências bancárias

```
Full=lm(y~as.factor(x)-1)
summary(Full)

##
## Call:
## lm(formula = y ~ as.factor(x) - 1)
##
## Residuals:
##   1   2   3   4   5   6   7   8   9   10  11
##  5 -12  10  -7   0  16   7 -16  -5 -10  12
##
## Coefficients:
##             Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
## as.factor(x)75     35.00    10.71   3.267 0.022282 *
## as.factor(x)100    124.00    10.71  11.573 8.45e-05 ***
## as.factor(x)125    155.00    10.71  14.466 2.85e-05 ***
## as.factor(x)150    152.00    15.15  10.031 0.000168 ***
## as.factor(x)175    140.00    10.71  13.066 4.68e-05 ***
## as.factor(x)200    114.00    10.71  10.640 0.000127 ***
##
## ---
## Signif. codes:  0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
##
## Residual standard error: 15.15 on 5 degrees of freedom
## Multiple R-squared:  0.9933, Adjusted R-squared:  0.9852
## F-statistic: 123.1 on 6 and 5 DF,  p-value: 2.893e-05
```

49/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

49/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

50/59

50/59

Exemplo: Agências bancárias

```
Reduced=lm(y~x)
Full=lm(y~as.factor(x)-1)
anova(Reduced, Full)

##
## Analysis of Variance Table
##
## Model 1: y ~ x
## Model 2: y ~ as.factor(x) - 1
##   Res.Df   RSS Df Sum of Sq   F   Pr(>F)
## 1      9 14742
## 2      5 1148   4  13594 14.801 0.005594 **
##
## ---
## Signif. codes:  0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
```

Estatística do teste:

$$F^* = \frac{SQE_d/(m-2)}{SQE_p/(n-m)} \text{ sob } H_0 \quad F_{m-2,n-m} = F_{4,5}$$

51/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

51/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

52/59

52/59

Exemplo: Agências bancárias

Modelo reduzido: reta de regressão.

```
Reduced=lm(y~x)
summary(Reduced)

##
## Call:
## lm(formula = y ~ x)
##
## Residuals:
##   Min     1Q Median     3Q    Max
## -59.23 -34.06  12.61  32.44  48.44
##
## Coefficients:
##             Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
## (Intercept) 50.7225   39.3979  1.287   0.23
## x            0.4867    0.2747  1.772   0.11
##
## Residual standard error: 40.47 on 9 degrees of freedom
## Multiple R-squared:  0.2586, Adjusted R-squared:  0.1762
## F-statistic: 3.139 on 1 and 9 DF,  p-value: 0.1102
```

$s = 40.47$ enquanto que, usando o modelo anterior, temos que $s_e = 15.15$.

49/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

49/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

50/59

50/59

Exemplo: Agências bancárias

$$F_{obs}^* = \frac{[SQE(Reduced) - SQE(Full)]/4}{SQE(Full)/5} = \frac{1.3593571 \times 10^4 / 4}{1148/5} = 14.8$$

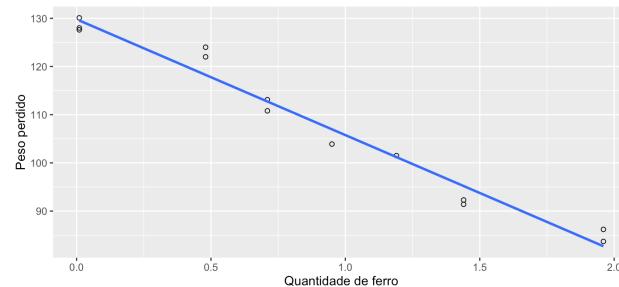
valor de $p: 0.0055938$.

Valor crítico para $\alpha = 0.05: 5.19$

Exemplo: Ligas de cobre e níquel

13 ligas de cobre e níquel, mas quantidades diferentes de ferro.

As ligas foram submersas em água do mar por 60 dias e a perda de peso devido à corrosão foi anotada em miligramas por decímetro quadrado por dia.



Exemplo: Ligas de cobre e níquel

```
## 
## Call:
## lm(formula = loss ~ Fe, data = corrosion)
## 
## Residuals:
##   Min     1Q Median     3Q    Max 
## -3.7980 -1.9464  0.2971  0.9924  5.7429 
## 
## Coefficients:
##             Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)    
## (Intercept) 129.787     1.403   92.52 < 2e-16 ***
## Fe          -24.020     1.280  -18.77 1.06e-09 ***  
## ---        
## Signif. codes:  0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
## 
## Residual standard error: 3.058 on 11 degrees of freedom
## Multiple R-squared:  0.9697, Adjusted R-squared:  0.967 
## F-statistic: 352.3 on 1 and 11 DF,  p-value: 1.055e-09
```

53/59

53/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

54/59

54/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

Exemplo: Ligas de cobre e níquel

```
## 
## Call:
## lm(formula = loss ~ factor(Fe) - 1, data = corrosion)
## 
## Residuals:
##   Min     1Q Median     3Q    Max 
## -1.2500 -0.9667  0.0000  1.0000  1.5333 
## 
## Coefficients:
##             Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)    
## factor(Fe)0.01 128.5667  0.8090 158.91 4.19e-12 ***
## factor(Fe)0.48 123.0000  0.9909 124.13 1.84e-11 ***  
## factor(Fe)0.71 111.9500  0.9909 112.98 3.24e-11 ***  
## factor(Fe)0.95 103.9000  1.4013  74.15 4.05e-10 ***  
## factor(Fe)1.19 101.5000  1.4013  72.43 4.66e-10 ***  
## factor(Fe)1.44  91.8500  0.9909  92.70 1.06e-10 ***  
## factor(Fe)1.96  84.9500  0.9909  85.73 1.70e-10 ***  
## ---        
## Signif. codes:  0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
## 
## Residual standard error: 1.401 on 6 degrees of freedom
## Multiple R-squared:  0.9999, Adjusted R-squared:  0.9998 
## F-statistic: 1.145e+04 on 7 and 6 DF,  p-value: 6.062e-12
```

$s_e = 1.4$ enquanto que, usando o modelo anterior, temos que $s = 3.06$.

Exemplo: Ligas de cobre e níquel

```
anova(modeloreduzido,modeloCompleto)

## Analysis of Variance Table
## 
## Model 1: loss ~ Fe
## Model 2: loss ~ factor(Fe) - 1
##   Res.Df   RSS Df Sum of Sq   F   Pr(>F)    
## 1      11 102.850                        
## 2       6 11.782  5    91.069 9.2756 0.008623 ** 
## ---        
## Signif. codes:  0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
```

Estatística do teste:

$$F^* = \frac{SQF_a/(m-2)}{SQE_p/(n-m)} = \frac{91.069/5}{11.782/6} = 9.28$$

55/59

55/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

56/59

56/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

Exemplo: Ligas de cobre e níquel

```
library(alr3)
pureErrorAnova(modeloreduzido)

## Analysis of Variance Table
##
## Response: loss
##          Df Sum Sq Mean Sq   F value    Pr(>F)
## Fe        1 3293.8 3293.8 1677.4028 1.417e-08 ***
## Residuals 11 102.9     9.4
## Lack of fit 5  91.1    18.2    9.2756  0.008623 **
## Pure Error  6  11.8     2.0
## ---
## Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
```

Como melhorar o modelo

Se nos testes e/ou gráficos de diagnóstico do modelo determinarmos que o mesmo não é adequado, o que fazer?

- Abandonar o modelo e procurar outro mais adequado: regressão logística, regressão não-paramétrica, regressão robusta...
- Aplicar alguma transformação nos dados, de maneira que a regressão linear simples fique adequada.

57/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

57/59

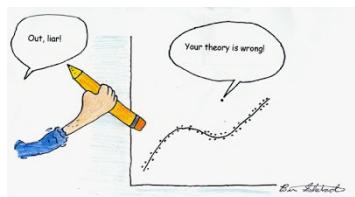
file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

58/59

58/59

Leitura

- Applied Linear Statistical Models: 3.1-3.7.
- Caffo - [Regression Models for Data Science in R](#): Residuals.
- Draper & Smith - [Applied Regression Analysis](#): Capítulo 2.
- Weisberg - [Applied Linear Regression](#): Capítulo 2.
- Faraway - [Linear Models with R](#): 8.3.



59/59

file:///Users/imac/Documents/GitHub/ME613-UNICAMP/ME613-UNICAMP.github.io/aulas/slides/parte03/parte03.html#1

59/59