

# **Анализ мощности**

## **Математические методы в зоологии с использованием R**

Марина Варфоломеева

## Экономим силы с помощью анализа мощности

- Тестирование гипотез (двухвыборочный t-критерий)
- Статистические ошибки при проверке гипотез
- Мощность статистического теста
- *A priori* анализ мощности, оценка величины эффекта
- Как влиять на мощность тестов

### Вы сможете

- сравнивать средние значения при помощи t-критерия, интерпретировать и описывать результаты
- дать определение ошибок I и II рода, и графически изобразить их отношение к мощности теста
- оценивать величину эффекта и необходимый объем выборки по данным пилотного исследования
- загружать данные из .xlsx в R
- строить графики средних значений со стандартными отклонениями с помощью ggplot2

# Тестирование гипотез

## Тест Стьюдента (t-критерий)

Гипотезы:  $H_0 : \mu_1 - \mu_2 = 0$ ,  $H_A : \mu_1 - \mu_2 \neq 0$

Двухвыборочный тест Стьюдента (Student, 1908) используется для проверки значимости различий между средними значениями двух величин.

$$t = \frac{\bar{x}_1 - \bar{x}_2}{SE_{\bar{x}_1 - \bar{x}_2}}$$

Условия применимости:

- Наблюдения случайны и независимы друг от друга
- Выборки случайны и независимы друг от друга
- Величины нормально распределены или большая выборка (> 30 наблюдений в группе)
- **Дисперсии в группах одинаковы**

$$SE = \sqrt{\frac{s_1^2(n_1 - 1) + s_2^2(n_2 - 1)}{n_1 + n_2 - 2} \left( \frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2} \right)}$$

$$df = (n_1 - 1) + (n_2 - 1) = n_1 + n_2 - 2$$

## t-тест Уэлча — это модификация теста Стьюдента для случая разных дисперсий

$$t = \frac{\bar{x}_1 - \bar{x}_2}{SE_{\bar{x}_1 - \bar{x}_2}}$$

Условия применимости:

- Наблюдения случайны и независимы друг от друга
- Выборки случайны и независимы друг от друга
- Величины нормально распределены или большая выборка (> 30 наблюдений в группе)

$$SE = \sqrt{s_1^2/n_1 + s_2^2/n_2}$$

Приблизительное число степеней свободы рассчитывается по уравнению Уэлча-Саттертуэйта

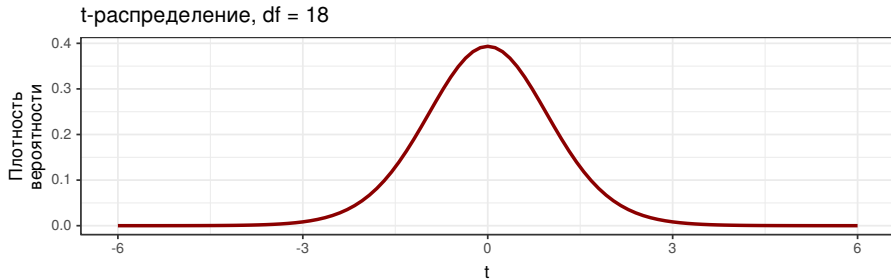
$$df_{Welch-Satterthwaite} \approx \frac{(s_1^2/n_1 + s_2^2/n_2)^2}{\frac{1}{n_1 - 1} \left( \frac{s_1^2}{n_1} \right)^2 + \frac{1}{n_2 - 1} \left( \frac{s_2^2}{n_2} \right)^2}$$

## t-распределение — распределение разницы средних для выборок из одной совокупности

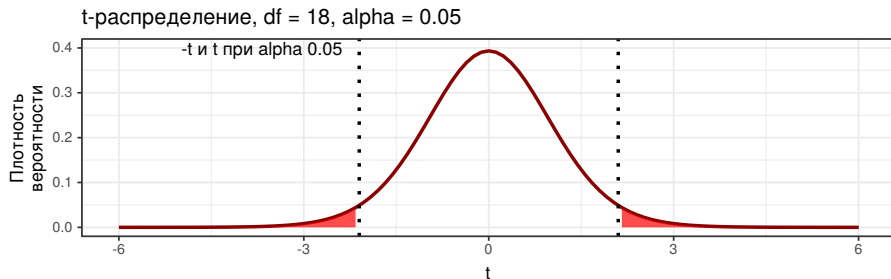
t-статистика подчиняется t-распределению.

Иными словами, если много раз взять выборки **из одной** совокупности (т.е. при условии, что  $H_0$  верна) и посчитать между ними разницу, то она будет подчиняться t-распределению.

Форма t-распределения зависит только от одного параметра — числа степеней свободы  $df$



## В хвостах этого распределения находятся редкие значения

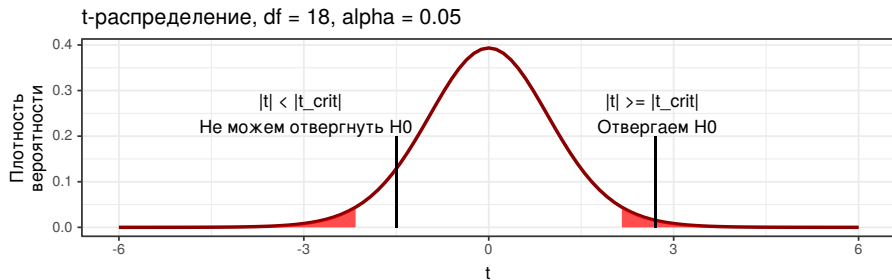


Обычно используется уровень значимости  $\alpha$  0.05 или 0.01.

**Уровень значимости  $\alpha$  — это вероятность ошибочно отвергнуть справедливую нулевую гипотезу.** Т.е. это вероятность найти различия там, где их нет (**вероятность ошибки I рода**).

Для t-теста  $\alpha$  — это вероятность ошибочно сделать вывод о том, что средние выборки различаются **при условии, что эти выборки получены из одной генеральной совокупности.**

# Тестирование гипотезы о равенстве двух средних при помощи t-теста



- 1 Для конкретных данных считаем значение t-критерия
- 2 Сравниваем его с теоретическим распределением t (распределением при условии, что  $H_0$  верна)
- 3 Принимаем решение, отвергнуть ли  $H_0$



## Пример: Снотворное

В датасете `sleep` содержатся данные об увеличении продолжительности сна по сравнению с контролем после применения двух снотворных препаратов (Cushny, Peebles, 1905, Student, 1908)

```
data(sleep)  
# View(sleep)
```

## Двухвыборочный t-критерий в R рассчитывает функция `t.test()`

О параметрах функции `t.test()` можно прочесть в справке `?t.test`

Формат вызова функции, если в данных две группы

`t.test(formula = зависимая_переменная ~ группирующая_переменная, data = данные,`

Если групп больше двух — другой формат

`t.test(x = одна_группа, y = другая_группа, ...)`

## Различается ли изменение продолжительности сна при применении этих двух снотворных?

```
tt <- t.test(formula = extra ~ group, data = sleep)
tt

#
#   Welch Two Sample t-test
#
# data:  extra by group
# t = -1.8608, df = 17.776, p-value = 0.07939
# alternative hypothesis: true difference in means is not equal to 0
# 95 percent confidence interval:
#  -3.3654832  0.2054832
# sample estimates:
# mean in group 1 mean in group 2
#           0.75           2.33
```

## Различается ли изменение продолжительности сна при применении этих двух снотворных?

```
tt <- t.test(formula = extra ~ group, data = sleep)
tt

#
# Welch Two Sample t-test
#
# data:  extra by group
# t = -1.8608, df = 17.776, p-value = 0.07939
# alternative hypothesis: true difference in means is not equal to 0
# 95 percent confidence interval:
#  -3.3654832  0.2054832
# sample estimates:
# mean in group 1 mean in group 2
#           0.75           2.33
```

Результаты можно описать, например, так:

- Различия изменения продолжительности сна при применении двух препаратов были недостоверны ( $t_{17.78} = -1.86$ ,  $p = 0.079394$ )

## Что спрятано в результатах?

Как называются отдельные элементы результатов можно узнать посмотрев их структуру при помощи функции `str()`

```
str(tt)
```

```
# List of 9
# $ statistic : Named num -1.86
# ..- attr(*, "names")= chr "t"
# $ parameter : Named num 17.8
# ..- attr(*, "names")= chr "df"
# $ p.value : num 0.0794
# $ conf.int : num [1:2] -3.365 0.205
# ..- attr(*, "conf.level")= num 0.95
# $ estimate : Named num [1:2] 0.75 2.33
# ..- attr(*, "names")= chr [1:2] "mean in group 1" "mean in group 2"
# $ null.value : Named num 0
# ..- attr(*, "names")= chr "difference in means"
# $ alternative: chr "two.sided"
# $ method : chr "Welch Two Sample t-test"
# $ data.name : chr "extra by group"
# - attr(*, "class")= chr "htest"
```

## Можно получить элементы результатов в виде отдельных цифр

```
tt$parameter # степени свободы
```

```
#          df
```

```
# 17.77647
```

```
tt$p.value # уровень значимости
```

```
# [1] 0.07939414
```

```
tt$statistic # значение t-критерия
```

```
#          t
```

```
# -1.860813
```

# Статистические ошибки при проверке гипотез

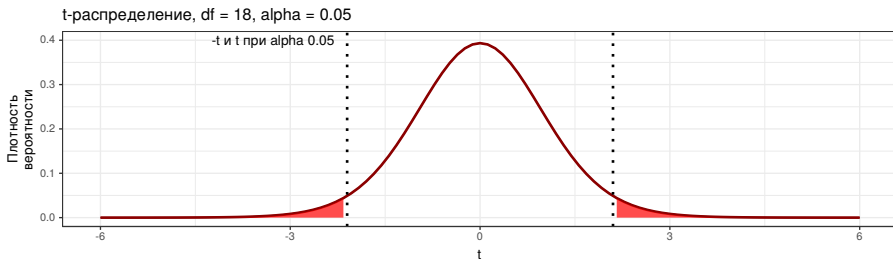
# Типы ошибок при проверке гипотез

	$H_0 == TRUE$	$H_0 == FALSE$
Отклонить $H_0$	Ошибка I рода	Верно
Сохранить $H_0$	Верно	Ошибка II рода



# Ошибка I рода

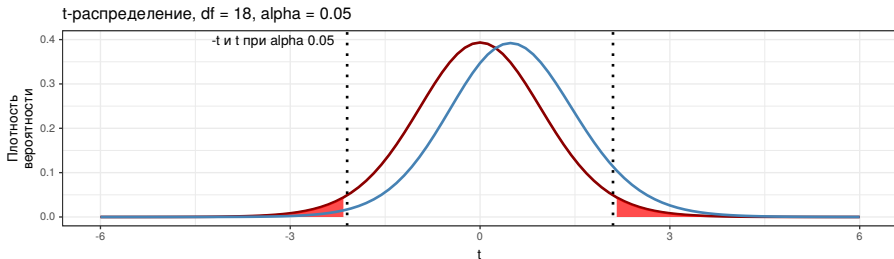
	$H_0 == TRUE$	$H_0 == FALSE$
Отклонить $H_0$	Ошибка I рода	Верно
Сохранить $H_0$	Верно	Ошибка II рода



**Ошибка I рода — вероятность отвергнуть  $H_0$ , когда верна  $H_0$**

# Мы этого не знаем, но может быть верна $H_A$ ...

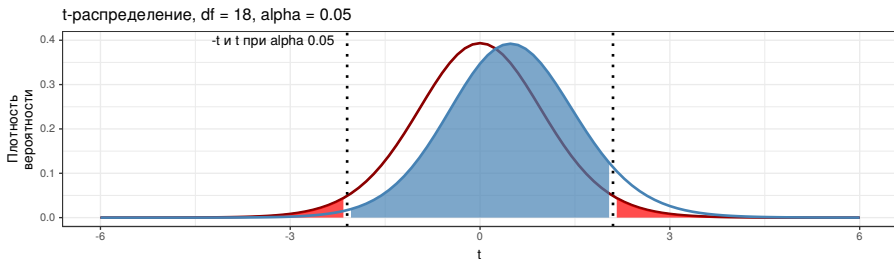
	$H_0 == TRUE$	$H_0 == FALSE$
Отклонить $H_0$	Ошибка I рода	Верно
Сохранить $H_0$	Верно	Ошибка II рода



Можно построить еще одно распределение статистики — распределение, при условии того, что верна  $H_A$

# Ошибка II рода

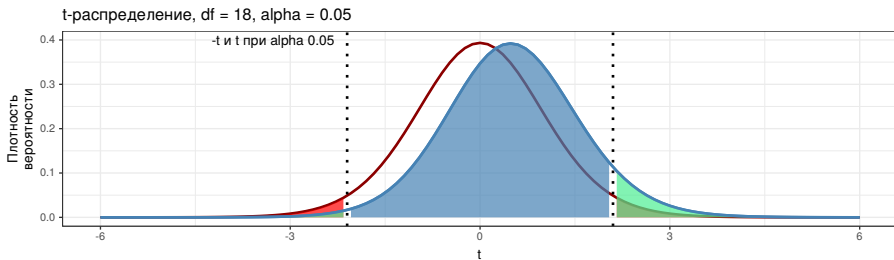
	$H_0 == TRUE$	$H_0 == FALSE$
Отклонить $H_0$	Ошибка I рода	Верно
Сохранить $H_0$	Верно	Ошибка II рода



**Ошибка II рода — вероятность принять  $H_0$ , когда верна  $H_A$**

# Мощность теста — способность выявлять различия

	$H_0 == TRUE$	$H_0 == FALSE$
Отклонить $H_0$	Ошибка I рода	Верно
Сохранить $H_0$	Верно	Ошибка II рода



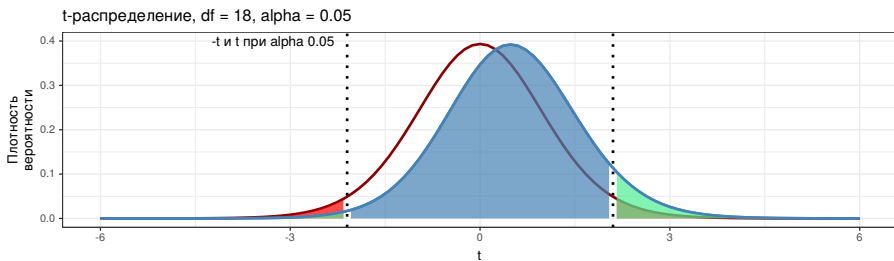
**Мощность теста - вероятность отвергнуть  $H_0$ , когда верна  $H_A$**

# Мощность теста

$$Power = 1 - \beta$$

Обычно считается, что хорошо, когда мощность не меньше 0.8

Т.е. что в 80% случаев мы можем найти различия заданной величины, если они есть.



## Анализ мощности

### *A priori*

- какой нужен объем выборки, чтобы найти различия с разумной долей уверенности?
- различия какой величины мы можем найти, если известен объем выборки?

### *Post hoc*

- смогли бы мы найти различия при помощи нашего эксперимента ( $\alpha$ ,  $n$ ), если бы величина эффекта была  $X$ ?

# A priori анализ мощности

# A priori анализ мощности

Что нужно

- тест
- уровень значимости
- желаемая мощность теста
- ожидаемая величина эффекта



# A priori анализ мощности

## Что нужно

- тест
- уровень значимости
- желаемая мощность теста
- ожидаемая величина эффекта

## Что есть

- $t$ -критерий
- $\alpha = 0.05$
- $Power = 0.8$
- ?

# Величина эффекта

$d$  Коэна (Cohen's  $d$ )

$$d = \frac{\bar{x}_1 - \bar{x}_2}{SD_{pooled}}$$

где  $SD_{pooled}$  — обобщенное стандартное отклонение

$$SD_{pooled} = \sqrt{\frac{(n_1-1)s_1^2 + (n_2-1)s_2^2}{n_1+n_2-2}}$$

## Величина эффекта

Яков Коэн предложил делить эффекты на сильные, умеренные и слабые (Cohen, 1982)

```
library(pwr)  
cohen.ES(test = 't', size = 'large')
```

```
#  
#   Conventional effect size from Cohen (1982)  
#  
#       test = t  
#       size = large  
#   effect.size = 0.8
```

## Расчет объема выборки для обнаружения эффекта известной величины

Функции для анализа мощности t-критерия:

- при одинаковых объемах групп `pwr.t.test()`
- при разных объемах групп `pwr.t2n.test()`

Какая нужна выборка, чтобы обнаружить *сильный эффект* с вероятностью 0.8 при уровне значимости 0.05?

```
pwr.t.test(n = NULL, d = 0.8, power = 0.8, sig.level = 0.01,
           type = 'two.sample', alternative = 'two.sided')
```

```
#
#       Two-sample t test power calculation
#
#               n = 38.18831
#               d = 0.8
#       sig.level = 0.01
#               power = 0.8
#       alternative = two.sided
#
# NOTE: n is number in *each* group
```

## Задание

Какая нужна выборка, чтобы обнаружить *слабый эффект* с вероятностью 0.8 при уровне значимости 0.05?

Вам понадобятся функции `cohen.ES()` и `pwr.t.test()`

## Решение

```
cohen.ES(test = 't', size = 'small') # величина слабого эффекта по Коэну
```

```
#
#   Conventional effect size from Cohen (1982)
#
#       test = t
#       size = small
#   effect.size = 0.2
```

```
# Какой нужен объем выборки?
```

```
pwr.t.test(n = NULL, d = 0.2, power = 0.8, sig.level = 0.05,
           type = 'two.sample', alternative = 'two.sided')
```

```
#
#   Two-sample t test power calculation
#
#       n = 393.4057
#       d = 0.2
#   sig.level = 0.05
#       power = 0.8
#   alternative = two.sided
#
# NOTE: n is number in *each* group
```

Для того, чтобы при помощи t-теста обнаружить слабый эффект ( $d = 0.2$ ) с вероятностью 0.8 и при уровне значимости 0.05, нужно собрать выборку не меньше 394 наблюдений **в каждой** группе.

# **A priori анализ мощности по данным пилотного исследования**

## Пример: Морфометрия жуков-листоедов

Измерения 43 самцов жуков-листоедов двух видов жуков из подсемейства козявок (Galerucinae) в семействе листоедов (Chrysomelidae): *Chaetocnema concinna*, *Ch. heptapotamica*.

Переменные

- `fjft` — ширина первого членика первой лапки в микронах (сумма измерений для обеих лапок)
- `species` — вид жуков (1=*Ch. concinna*, 2= *Ch. heptapotamica*)

Есть ли морфологические различия между видами?

```
library(readxl)
flea <- read_excel(path = 'data/fleabeetles-subset.xlsx', sheet = 'dat')
```

Фрагмент данных из работы Lubischew, A.A., 1962. On the use of discriminant functions in taxonomy. Biometrics, pp.455-477.



## Все ли правильно открылось?

```
str(flea) # Структура данных
```

```
# Classes 'tbl_df', 'tbl' and 'data.frame': 43 obs. of  2 variables:
# $ fjft    : num  191 185 200 173 171 160 188 186 174 163 ...
# $ species: num   1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 ...
```

```
head(flea) # Первые несколько строк файла
```

```
# # A tibble: 6 x 2
#   fjft species
#   <dbl>   <dbl>
# 1   191       1
# 2   185       1
# 3   200       1
# 4   173       1
# 5   171       1
# 6   160       1
```

## Делаем фактором переменную, где записан вид

```
flea$species <- factor(flea$species,  
                        levels = c(1, 2),  
                        labels = c('cocin', 'hept'))
```

## Знакомимся с данными

Есть ли пропущенные значения?

```
colSums(is.na(flea))
```

```
#    fjft species  
#      0      0
```

Каковы объемы выборок? Поскольку нет пропущенных значений, можно посчитать так

```
table(flea$species)
```

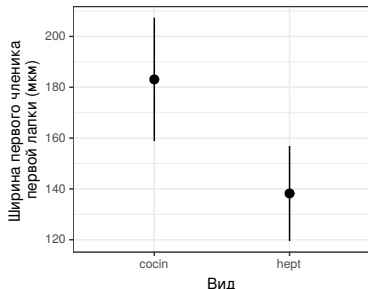
```
#  
# cocin  hept  
#    21    22
```

## Представим, что это данные пилотного исследования.

Мы хотим выяснить, сколько нужно жуков, чтобы показать, что ширина первого членика первой лапки различается у этих двух видов

График средних и стандартных отклонений

```
library(ggplot2)
theme_set(theme_bw())
ggplot(data = flea, aes(x = species, y = fjft)) +
  stat_summary(geom = 'pointrange', fun.data = mean_sdl) +
  labs(y = 'Ширина первого членика \nпервой лапки (мкм)', x = 'Вид')
```



## Величина эффекта по исходным данным

```
library(effsize)
eff_flea <- cohen.d(d = flea$fjft, f = flea$species)
eff_flea
```

```
#
# Cohen's d
#
# d estimate: 4.153819 (large)
# 95 percent confidence interval:
#      inf      sup
# 3.059340 5.248298
```

Вычислим модуль, поскольку для `pwr.t.test()` эффект должен быть положительным

```
effect_size_flea <- abs(eff_flea$estimate)
```

## Задание

Рассчитайте объем выборки, чтобы показать различия размеров с вероятностью 0.8 на уровне значимости 0.05

Используйте функцию `pwr.t.test()`

## Решение

```
pwr_flea <- pwr.t.test(n = NULL, d = effect_size_flea,  
                      power = 0.8, sig.level = 0.05,  
                      type = 'two.sample',  
                      alternative = 'two.sided')
```

```
pwr_flea
```

```
#  
#       Two-sample t test power calculation  
#  
#               n = 2.354027  
#               d = 4.153819  
#       sig.level = 0.05  
#       power     = 0.8  
#       alternative = two.sided  
#  
# NOTE: n is number in *each* group
```

## Решение

```
pwr_flea <- pwr.t.test(n = NULL, d = effect_size_flea,
                      power = 0.8, sig.level = 0.05,
                      type = 'two.sample',
                      alternative = 'two.sided')
```

```
pwr_flea
```

```
#
#       Two-sample t test power calculation
#
#               n = 2.354027
#               d = 4.153819
#       sig.level = 0.05
#           power = 0.8
#   alternative = two.sided
#
# NOTE: n is number in *each* group
```

- Нужна выборка из **3 жуков каждого вида**, чтобы с вероятностью 0.8 обнаружить различия размеров между видами.



## Задание

Представьте, что в датасете `sleep` содержатся данные пилотного исследования.

Оцените, какой объем выборки нужно взять, чтобы показать, что число часов дополнительного сна после применения двух препаратов различается?

## Решение

```
eff_sleep <- cohen.d(sleep$extra, sleep$group)
effect_sleep <- abs(eff_sleep$estimate)
pwr_sleep <- pwr.t.test(n = NULL, d = effect_sleep,
                        power = 0.8, sig.level = 0.05,
                        type = 'two.sample',
                        alternative = 'two.sided')

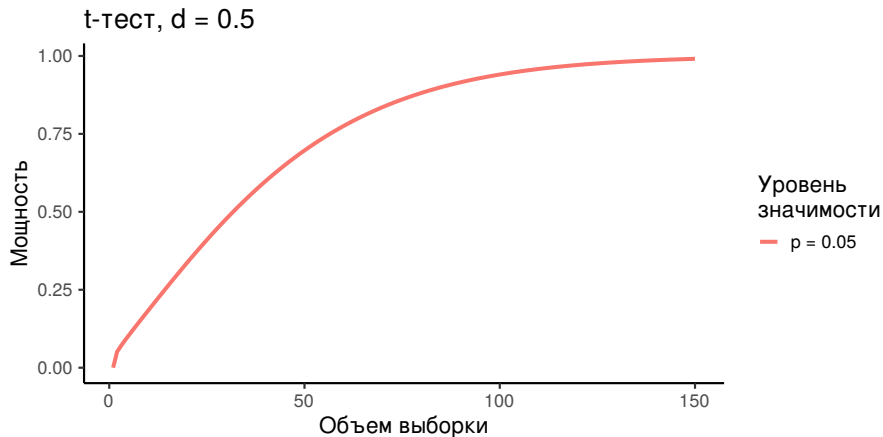
pwr_sleep
```

```
#
#       Two-sample t test power calculation
#
#               n = 23.6672
#               d = 0.8321811
#       sig.level = 0.05
#       power = 0.8
#       alternative = two.sided
#
# NOTE: n is number in *each* group
```

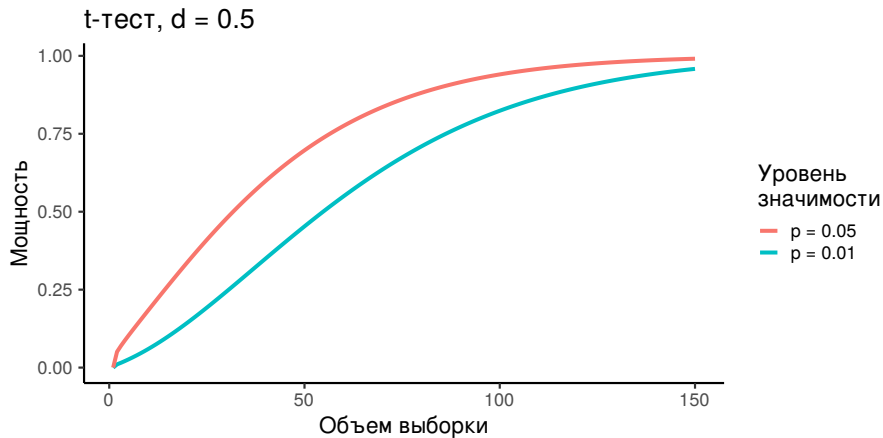
Нужна выборка **24 человека в каждой из групп**, чтобы с вероятностью 0.8 обнаружить различия числа часов дополнительного сна после применения двух препаратов.

## Как влиять на мощность теста?

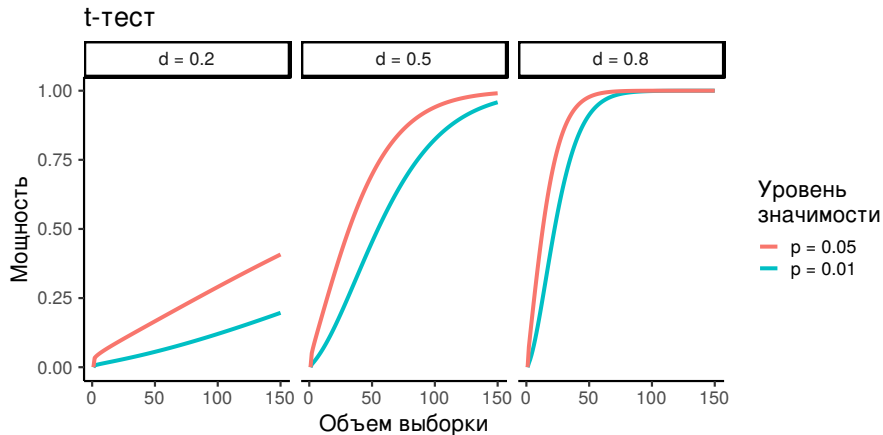
# Чем больше объем выборки — тем больше мощность



# Чем больше уровень значимости — тем больше мощность



# Чем больше величина различий — тем больше мощность



# Каким образом можно повлиять на мощность теста?

- Мощность теста можно регулировать, если
  - изменить число повторностей
  - выбрать другой уровень значимости ( $\alpha$ )
  - определиться, какие эффекты действительно важны ( $ES$ )

## Take-home messages

- Чтобы не находить несуществующих эффектов, фиксируем уровень значимости
- Чтобы не пропустить значимое, рассчитываем величину эффекта, объем выборки и мощность теста
- Способность выявлять различия зависит
  - от объема выборки,
  - от уровня значимости
  - от величины эффекта



## Дополнительные ресурсы

- Quinn, Keough, 2002, pp. 164-170
- OpenIntro: Statistics
- Sokal, Rohlf, 1995, pp. 167-169.
- Zar, 1999, p. 83.
- R Data Analysis Examples - Power Analysis for Two-group Independent sample t-test. UCLA: Statistical Consulting Group.
- R Data Analysis Examples - Power Analysis for One-sample t-test. UCLA: Statistical Consulting Group.
- FAQ - How is effect size used in power analysis? UCLA: Statistical Consulting Group.