## Inhaltsverzeichnis

L		fache Lineare Regression in R	1
	1.1	Vorbereitung	2
	1.2	lm()	2
	1.3	Modellzusammenfassung	4
	1.4	Residuen	6
	1.5	Vorhergesagte Werte	6
	1.6	Varianzzerlegung	7
		Korrelationen	
	1.8	Partialkorrelation	8
2			10
	2.1	Neue wichtige Konzepte	10
	2.2	Neue wichtige Befehle, Argumente, Operatoren	10

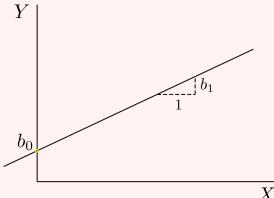
# 1 Einfache Lineare Regression in R

#### StatsReminder

Eine zentrale Aufgabe der psychologischen Forschung ist die Erklärung und Vorhersage von Zusammenhängen. Für diese Aufgabe wird die einfache lineare Regression häufig eingesetzt. Die einfache lineare Regression ist ein statistisches Verfahren, mit welchem man den Zusammenhang zweier Variablen durch eine Gerade beschreiben kann (deshalb **lineare** Regression). Vielleicht erinnern Sie sich noch an die Formel einer Geraden Y = mX + c. Diese Formel ist auch die Grundlage für die einfache lineare Regression, wobei die Parameter der Formel neue Symbole erhalten:

$$\widehat{Y} = b_0 + b_1 X$$

Hierbei stehen  $b_0$  und  $b_1$  für Zahlen, die die lineare Beziehung zwischen Y und X beschreiben. Y wird als  $abh \ddot{a}ngige\ Variable\$ und X als  $unabh \ddot{a}ngige\ Variable\$ bezeichnet. Die abhängige Variable ist die Zielgröße, die es durch die unabhängige Variable zu erklären gilt. Diese Formel lässt sich in einem Koordinatensystem grafisch darstellen, indem man die Werte der abhängigen Variable auf der Y-Achse und die Werte der unabhängigen Variable auf der X-Achse abträgt. Aus der Grafik kann man leicht die Funktion von  $b_0$  (Y-Achsenabschnitt der Gerade oder Intercept) und  $b_1$  (Steigung der Gerade oder Slope) ablesen.



Im nächsten Kapitel werden diese Konzepte auf die multiple Regression erweitert. Mit dieser können mehr als nur eine unabhängige Variable mit in das Modell aufgenommen werden.

## 1.1 Vorbereitung

Wir laden erneut den erstis-Datensatz:

```
load("dat/erstis_neu.RData")
```

Es soll nun eine einfache lineare Regression zur Vorhersage von lz.1 (Lebenszufriedenheit) durch die gs.1 (habituelle gute Stimmung) bestimmt werden.

```
sub <- na.omit(erstis[, c("lz.1", "gs.1", "wm.1")])</pre>
```

- Der Datensatz wird hier auf die Fälle reduziert, die gültige Werte haben (das dient der Verkürzung der kommenden Befehle)
  - die wm.1 Variable fließt später in die Analyse ein

Eine kurze Exploration des Datensatzes:

nrow(sub)

Γ1 189

• Der Datensatz enthält 189 Personen

```
round(cor(sub), digits = 2)
```

```
lz.1 gs.1 wm.1
lz.1 1.00 0.63 0.16
gs.1 0.63 1.00 0.43
wm.1 0.16 0.43 1.00
```

• Aus der Korrelationsmatrix lässt sich ein starker positiver linearer Zusammenhang zwischen 1z.1 und gs.1 ablesen  $(\rho_{lz.1,gs.1} = 0.63)$ 

#### 1.2 lm()

Um ein einfaches lineares Regressionsmodell in R anzufordern, kann die lm()-Funktion (engl., linear model) verwendet werden. Die lm()-Funktion kann vielseitig eingesetzt werden und daher ist deren Hilfeseite lang und komplex. Im Augenblick genügt es, die Argumente formula und data kennenzulernen. Um eine einfache lineare Regression zu rechnen, müssen lm() lediglich die Formel (formula) und die dazugehörigen Daten (data) übergeben werden. Die Formel definiert die Beziehung zwischen den Variablen (hier wird die abhängige und unabhängige Variable zugewiesen).

```
mod <- lm(formula = lz.1 ~ gs.1, data = sub)</pre>
```

- Dem formula-Argument wird ein Objekt übergeben, welches die von uns zu untersuchende Beziehung zwischen den Variablen beschreiben soll
  - -links des Tilde-Zeichens (~) steht die abhängige Variable, während rechts die unabhängige Variable abgetragen wird
  - 1z.1 entspricht der abhängigen Variable; gs.1 entspricht der unabhängigen Variable
  - gelesen wird die gesamte Formel als: Lebenszufriedenheit (lz.1) in Abhängigkeit (~) von guter Stimmung (gs.1)
- Mit data = sub werden die zur Berechnung der Regression benötigten Daten übergeben bzw. die Variablennamen aus der Formel werden mit den Spalten des Data Frames sub verglichen und zugeordnet (falls diese vorhanden sind, falls nicht erscheint eine Fehlermeldung)
- Auch hier kann das resultierende Objekt abgespeichert werden (mod)
  - oft nennt man das resultierende Objekt Modellobjekt

Wie bei einem Datensatz/Datenobjekt kann auch bei einem sogenannten Modellobjekt die Struktur mit str() genauer unter die Lupe genommen werden.

#### str(mod)

• Auf einzelne Elemente der Liste kann mit der Schreibweise objekt\$Element zugegriffen werden (hier nicht ausgegeben, da der Output sehr lang ist)

Wenn man sich lediglich für die Koeffizienten ( $b_0$  und  $b_1$ ) des Regressionsmodells interessiert, dann reicht es, wenn man das Objekt, in welchem die Resultate der lm()-Funktion abgespeichert sind, in der *Console* ausführt. In unserem Fall führen wir die Zeile mit dem Objektnamen mod einfach aus:

mod

#### Call:

```
lm(formula = lz.1 ~ gs.1, data = sub)
```

#### Coefficients:

(Intercept) gs.1 2.284 5.730

- Der Output ist in zwei Teile untergliedert:
  - der sogennante call zeigt, was den Argumenten der lm()-Funktion vor dem Ausführen übergeben wurde
  - der zweite Teil besteht aus den Regressionskoeffizienten (coefficients)
- Der Intercept 2.28 entspricht  $b_0$  in der obigen Regressionsgleichung
  - der Intercept entspricht der geschätzten Lebenszufriedenheitswert (1z.1) für Personen mit einem Wert von 0 auf guter Stimmung (gs.1)
  - Achtung: die Interpretation des Intercepts macht nicht automatisch Sinn! 0 ist kein Wert, den die Variable gs.1 annehmen kann
- Der Wert 5.73 entspricht  $b_1$  in der Regressionsgleichung
  - $-b_1$  entspricht dem Steigungsparameter und ist daher definiert als der Unterschied in der erwarteten/vorhergesagten Lebenszufriedenheit zwischen zwei Personen, die sich um eine Einheit in der guten Stimmung unterscheiden

Alternativ können die Koeffizienten mit den Befehlen coef (mod) oder mod\$coef ausgegeben werden:

Mithilfe der geschätzten Koeffizienten kann man die daraus resultierende Regressionsgleichung erstellen:

$$\hat{Y} = 2.28 + 5.73X$$

 $\hat{Y} = \text{die geschätzte Lebenszufriedenheit 1z1}$ X = die habituelle gute Stimmung gs.1

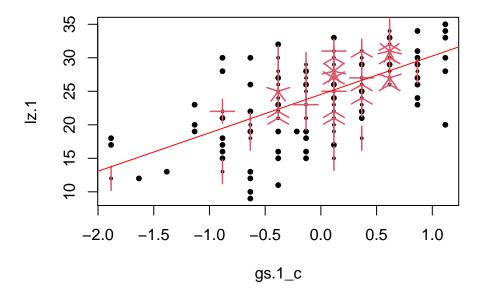
## 1.2.1 Einfache lineare Regression mit zentrierter unabhängiger Variable

Um eine bessere inhaltliche Interpretation von  $b_0$  zu ermöglichen, kann man die unabhängige Variable gs.1 zentrieren. Beim Zentrieren subtrahiert man von jedem individuellem Wert in gs.1 den Mittelwert von gs.1. Die Transformation der unabhängigen Variable führt zu einem anderen Intercept  $b_0$  in der Regressionsgleichung und daher auch zu einer anderen Interpretation dieses Koeffizienten.

- scale() wird scale = FALSE übergeben, da gs.1 zentriert aber nicht skaliert werden soll
   durch das Zentrieren hat die gute Stimmung gs.1\_c nun einen Mittelwert von 0
- mod\_c ist das neue Regressionsmodell, das mit dem zentrierten gs.1\_c berechnet wurde
- $b_1$  hat sich im Vergleich zum ersten Modell nicht verändert, da sich an der Skalierung der unabhängigen Variablen nichts geändert hat
- $b_0$  ist nun der geschätzte Lebenszufriedenheitswert für Personen mit einem mittleren Wert auf guter Stimmung

#### 1.2.2 Grafische Veranschaulichung der Regressionsgleichung

```
sunflowerplot(lz.1 ~ gs.1_c, data = sub)
abline(reg = mod_c, col = "red")
```



- Mit abline() lassen sich Geraden in eine bestehende Grafik einzeichnen
  - Argument reg nutzt die Regressionskoeffizienten aus dem zuvor erstellten Modellobjekt als Y-Achsenabschnitt und Steigung.
- $\bullet$  Die rote Gerade nutzt die Regressionskoeffizienten aus dem zuvor erstellten Modellobjekt als Y-Achsenabschnitt und Steigung

## 1.3 Modellzusammenfassung

Mit dem summary() Befehl lassen sich auch statistische Modelle und damit Modellobjekte in R zusammenfassen. Auch hier enthält der Output wieder einige Informationen, die Sie zu diesem Zeitpunkt vermutlich noch nicht verstehen können. Wir fokussieren uns daher auf die Elemente, die Sie bereits gelernt haben und interpretieren können.

```
summary(mod_c)
```

## Call:

lm(formula = lz.1 ~ gs.1\_c, data = sub)

```
Residuals:
```

```
Min 1Q Median 3Q Max
-11.9064 -2.6364 0.3636 2.9311 10.5261
```

#### Coefficients:

Residual standard error: 4.394 on 187 degrees of freedom Multiple R-squared: 0.3914, Adjusted R-squared: 0.3881 F-statistic: 120.2 on 1 and 187 DF, p-value: < 2.2e-16

- Der Output ist nun deutlich länger im Vergleich zum Output des Modellobjekts ohne summary()-Funktion:
  - hier wird auch die Sektion Call als Erstes angezeigt (mit welchen Argumenten lm() ausgeführt wurde)
  - unter Residuals erhält man Informationen über die Verteilung der Residuen
  - unter Coefficients werden die bereits bekannten geschätzten Koeffizienten (Estimates) dargestellt. Die anderen Spalten werden Sie im nächsten Semester kennenlernen
  - den Determinationskoeffizienten finden Sie unter Multiple R-squared in der vorletzten Zeile. Dieser beträgt hier  $R^2=0.39$
  - der Residual standard error ist der Standardschätzfehler der Residuen

Falls Sie sich lediglich für den Determinationskoeffizienten interessieren, können Sie sich diesen direkt ausgeben lassen:

```
summary(mod_c)$r.squared
```

## [1] 0.3913531

Alternativ kann man den Determinationskoeffizienten  $h\ddot{a}ndisch$  ausrechnen, indem man die bivariate Korrelation quadriert (nur für den Fall der einfachen linearen Regression):

```
cor(sub$lz.1, sub$gs.1_c)^2
```

[,1] [1,] 0.3913531

#### 1.3.1 Einfache lineare Regression mit standardisierten Variablen

Im Gegensatz zum vorherigen Beispiel, in welchem nur die unabhängige Variable zentriert wurde, sollen nun beide Variablen zentriert und skaliert (das entspricht der z-Transformation/Standardisierung) werden. Im Anschluss wird eine einfache lineare Regression mit den standardisierten Variablen angefordert.

```
std1 <- data.frame(scale(sub))</pre>
```

• Alle Variablen im Datensatz sub werden standardisiert

```
update(mod, data = std1)
```

```
Call:
```

-1.939e-16

6.256e-01

- Mit dem Befehl update() kann man das Regressionsmodell berechnen, ohne die Formel erneut bestimmen zu müssen
  - update() nutzt die in mod bestimmte Formel und übergibt lm() den neuen Datensatz std1
  - daraufhin erhalten wir neue Regressionskoeffizienten, da die einfach lineare Regression mit den standardisierten Versionen von lz.1 und gs.1 berechnet wurde

Die neue Regressionsgleichung laut den Ergebnissen des neuen Modells:

$$\widehat{Y} = 0 + 0.63X$$

- $b_{0s} = 0$  ist der geschätzte Lebenszufriedenheits-z-Wert für Personen mit mittlerer guter Stimmung (mittlere Lebenszufriedenheit)
- $b_{1s} = 0.63$  ist der Unterschied in den geschätzten z-Werten der Lebenszufriedenheit zwischen zwei Personen, die sich um eine Standardabweichung in der guten Stimmung unterscheiden. Wir erwarten einen Unterschied von 0.63 Standaradbweichungen in der Lebenszufiredenheit zwischen zwei Personen, die sich um eine Standardabweichung in ihrer guten Stimmung voneinander unterscheiden.

#### 1.4 Residuen

Das Residuum ist die Differenz zwischen des tatsächlich beobachteten und auf Basis des Modells vorhergesagten Werts. Es lässt sich also für jede Person im Datensatz ein Residuum berechnen.

```
sub$E <- resid(mod_c) # alternativ: mod_c$residuals</pre>
```

- Mit resid() lassen sich die geschätzten Residuen aller Personen ausgeben
- Aufgrund der Länge des Outputs wurde dieser nicht mitgedruckt

Da es 189 Personen im Datensatz gibt, gibt es auch 189 Residuen und dementsprechend kann man sich Deskriptivstatistiken zu den Residuen mit summary() ausgeben lassen:

```
summary(sub$E)
```

```
Min. 1st Qu. Median Mean 3rd Qu. Max.
-11.9064 -2.6364 0.3636 0.0000 2.9311 10.5261
```

- Der Mittelwert der Residuen ist immer 0; das folgt aus dem benutzten Schätzverfahren für die Regression (Kleinste-Quadrate-Schätzer)
- Die Deskriptivstatistik der Residuen ist auch im summary()-Output unter Residuals wiederzufinden sd(sub\$E)

#### [1] 4.382702

- Die Standardabweichung der Residuen entspricht dem Standardschätzfehler (Residual standard error in der Modellzusammenfassung)
  - der Standardschätzfehler ist ein Maß für die Streuung der Residuen und stellt dar, wie präzise die Schätzung ist

## 1.5 Vorhergesagte Werte

Mit predict() lassen sich die vorhergesagten Werte des Regressionsmodells ausgeben:

```
sub$yDach <- predict(mod_c)
round(head(sub, n = 4), digits = 2)</pre>
```

```
    1z.1
    gs.1
    wm.1
    gs.1_c
    E yDach

    1
    22
    3.5
    2.25
    -0.38
    -0.34
    22.34

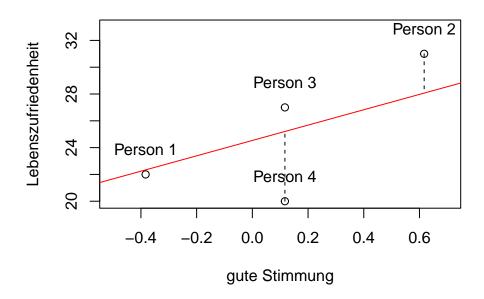
    2
    31
    4.5
    2.50
    0.62
    2.93
    28.07

    3
    27
    4.0
    3.50
    0.12
    1.80
    25.20

    4
    20
    4.0
    2.50
    0.12
    -5.20
    25.20
```

- yDach ist eine extra Spalte, die wir im Data Frame sub für die vorhergesagten Werte der Personen anlegen
  - die Personen in Zeilen 3 und 4 haben denselben Wert auf der unabhängigen Variable gs.1\_c und daher auch denselben vorhergesagten Wert yDach (die geschätzten Werte werden in der Abbildung durch die rote Gerade dargestellt)
  - der beobachtete 1z.1-Wert von Person 3 wird vom Modell unterschätzt (positives Residuum E), von Person 4 überschätzt (negatives Residuum E)
  - das Residuum der ersten Person ist klein und damit liegt der geschätzte Wert yDach sehr nah am beobachteten Wert

# Vorhergesagte Werte vs. Gemessene Werte



## 1.6 Varianzzerlegung

Wie in der Vorlesung besprochen, lässt sich die gesamte Streuung der Daten "zerlegen" in die erklärte Varianz, welche auf die Modellvorhersage zurückzuführen ist und in die nicht erklärte Varianz (oft auch Residualvarianz genannt).

$$s_Y^2 = s_{\widehat{Y}}^2 + s_E^2$$

var(sub\$yDach) + var(sub\$E)

## [1] 31.55865

• erklärte Varianz + Residualvarianz

var(sub\$lz.1)

## [1] 31.55865

• Gesamtvarianz in lz.1

## 1.7 Korrelationen

Lassen wir uns einmal die Korrelationsmatrix für die Variablen und der Residuen sowie der vorhergesagten Werte des Regressionsmodells ausgeben:

```
round(cor(sub), digits = 2)
```

```
lz.1 gs.1 wm.1 gs.1_c
                                 E yDach
lz.1
      1.00 0.63
                 0.16
                        0.63 0.78 0.63
gs.1
      0.63 1.00
                 0.43
                        1.00 0.00 1.00
wm.1
      0.16 0.43
                 1.00
                        0.43 - 0.14
                                    0.43
gs.1_c 0.63 1.00
                 0.43
                        1.00
                              0.00
                                    1.00
      0.78 0.00 -0.14
                        0.00
                              1.00
                                    0.00
yDach 0.63 1.00
                        1.00
                 0.43
                              0.00 1.00
```

Wir können folgende Beobachtungen machen:

- Unzentrierter und zentrierter Prädiktor korrelieren perfekt
  - die Zentrierung einer Variable ändert nichts an den Korrelationen (invariant gegenüber linearen Transformationen)
  - siehe gs.1\_c und gs.1
- Prädiktor und vorhergesagte Werte korrelieren perfekt
- Prädiktor und Residuum sind unkorreliert
- Die Korrelation zwischen Kriterium und vorhergesagten Werten entspricht der Korrelation zwischen Kriterium und Prädiktor
- Kriterium und Residuen korrelieren hoch (zu  $1-R^2$ )

Gleichen Sie diese Beobachtungen doch einmal mit den theoretischen Überlegungen zur linearen Regression in den Vorlesungsfolien ab.

#### 1.8 Partialkorrelation

#### StatsReminder

Die partielle Korrelation bietet eine Möglichkeit, den Zusammenhang zwischen zwei Variablen, X und Y, zu bereinigen. Bereinigen heißt, dass der Einfluss einer Drittvariable Z kontrolliert wird. Dafür werden die Residuen der Regressionen von X auf Z und Y auf Z berechnet. Die Korrelation dieser Residuen entspricht der um Z bereinigten Korrelation zwischen X und Y. Man sagt auch, dass Z herauspartialisiert wurde.

Mithilfe des Pakets ppcor lassen sich Partialkorrelationen berechnen:

```
# install.packages("ppcor")
library(ppcor)
```

Angenommen, wir interessieren uns für den Zusammenhang von Lebenszufriedenheit (1z.1) und wacher-müder Stimmung (wm.1) unter Berücksichtigung des Einflusses der Variable gute-schlechte Stimmung (gs.1), dann können wir dafür die Funktion pcor() aus dem Paket ppcor nutzen. Achtung! Die Funktion pcor() kann mit Datensätzen, die fehlende Werte enthalten, nicht umgehen. Da wir die fehlende Werte im Datensatz sub bereits entfernt haben, können wir diesen pcor() übergeben.

```
pcor(sub[, c("lz.1", "gs.1", "wm.1")])$estimate
```

```
lz.1 gs.1 wm.1
lz.1 1.0000000 0.6248441 -0.1540567
gs.1 0.6248441 1.0000000 0.4260447
wm.1 -0.1540567 0.4260447 1.0000000
```

• Als Argument werden die entsprechenden Variablen im Data Frame-Format übergeben

- Die Indexierung \$estimate am Ende des Befehls beschränkt den Output auf die für uns relevanten Partialkorrelationen
- Der Wert -0.15 entspricht der gesuchten Partialkorrelation zwischen Lebenszufriedenheit und wachermüder Stimmung, wenn die gute-schlechte Stimmung herauspartialisiert wurde
  - verglichen mit der normalen Korrelation dreht sich das Vorzeichen um (siehe oben unter Abschnitt Korrelationen)
- Die resultierende Korrelationsmatrix ist symmetrisch, d. h., dass die Werte in der Matrix spiegelsymmetrisch im Bezug auf die Diagonale sind (Diagonale von links oben nach rechts unten)
  - -es spielt also keine Rolle, ob Sie bspw. den Wert-0.15aus der Zelle der 1. Spalte und 3. Zeile oder der 3. Spalte und 1. Zeile ablesen
- Allgemein lesen sich die Einträge der Korrelationsmatrix als Korrelation zwischen den Variablen der entsprechende Spalte bzw. Zeile, die aber um den Zusammenhang der dritten Variable bereinigt wurde

**Alternativ:** Dieselbe Partialkorrelation lässt sich *händisch* bestimmen, indem man sich die Korrelation der Residuen zwischen der Regression von Lebenszufriedenheit auf gute Stimmung und der Regression von wache-müde Stimmung auf gute Stimmung ausgeben lässt.

```
mod1 <- lm(lz.1 ~ gs.1_c, data = sub)
mod2 <- lm(wm.1 ~ gs.1_c, data = sub)
sub$mod1E <- resid(mod1)
sub$mod2E <- resid(mod2)
cor(sub$mod1E, sub$mod2E)</pre>
```

[1] -0.1540567

#### 1.8.1 Semipartialkorrelation

Wie groß ist der Zusammenhang, wenn der Einfluss von guter vs. schlechter Stimmung nur auf die Lebenszufriedenheit (aber nicht auf die wache vs. müde Stimmung) berücksichtigt wird? Um so eine Semipartialkorrelation zu berechnen nutzen wir spcor() (ebenfalls aus dem Paket ppcor).

```
spcor(sub[, c("lz.1", "gs.1", "wm.1")])$estimate
```

```
lz.1 gs.1 wm.1
lz.1 1.0000000 0.6169172 -0.1201886
gs.1 0.5648697 1.0000000 0.3323823
wm.1 -0.1392699 0.4206398 1.0000000
```

- Dieser Output unterscheidet sich ein wenig vom Output des pcor Befehls
  - die Korrelationsmatrix ist nun nicht mehr symmetrisch, da die Drittvariable nun nur aus einer der beiden Variablen auspartialisiert wird.
- Der Wert −0.14 ist hier die gesuchte Semipartialkorrelation (gute-schlechte Stimmung nur aus Lebenszufriedenheit herauspartialisert)
- Auch spcor() kann nur mit Datensätzen umgehen, die um ihre fehlenden Werte bereinigt wurden
- Im Gegensatz zur Partialkorrelation ist die resultierende Semipartialkorrelationsmatrix nicht mehr symmetrisch. Die Drittvariable wird immer aus der Variable, die in der entsprechenden Spalte angegeben ist, herauspartialisiert
  - die Semipartialkorrelation, in welcher die gute-schlechte Stimmung nur aus der wachen-müden Stimmung herauspartialisiert wurde, finden wir daher in der Zelle der ersten Zeile und dritten Spalte (hier ist wm.1 in der Spalte und 1z.1 in der Zeile abgetragen)

# 2 Übersicht

## 2.1 Neue wichtige Konzepte

- Einfache lineare Regression
- Vorhersagen durch die einfache lineare Regression
- Varianzzerlegung
- Partialkorrelation & Semipartialkorrelation

## 2.2 Neue wichtige Befehle, Argumente, Operatoren

Funktion	Verwendung
mod <- lm(Y ~ X, data = daten)	Legt das Ergebnis einer Regression zur Vorhersage von $Y$ durch $X$ in Objekt mod ab
coef(mod)	Ausgabe der Regressionskoeffizienten
<pre>scale(x, center = TRUE, scale = TRUE)</pre>	Je nach Einstellung: Zentriert oder standardisiert die
	Variablen $x$
<pre>summary(mod)</pre>	Gibt vollständigen Output der Regressionsanalyse aus
update(mod, data = neu)	Model mod wird erneut mit Datensatz neu geschätzt (gleiche
	Variablennamen erforderlich)
resid(mod)	Gibt Residuen aus
<pre>predict(mod)</pre>	Gibt vorhergesagte Werte aus
<pre>pcor() spcor()</pre>	Berechnet die Partialkorrelationen bzw. die
	Semipartialkorrelationen