

Прикладной статистический анализ данных. 5. Анализ зависимостей.

Ольга Кравцова
Юлиан Сердюк

07.03.2024

Задача исследования взаимосвязи между признаками

Дано: значения признаков X_1, X_2 измерены на объектах $1, \dots, n$.

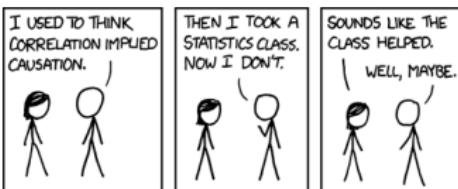
Эквивалентная формулировка: имеются связанные выборки

$X_1^n = (X_{11}, \dots, X_{1n})$ и $X_2^n = (X_{21}, \dots, X_{2n})$.

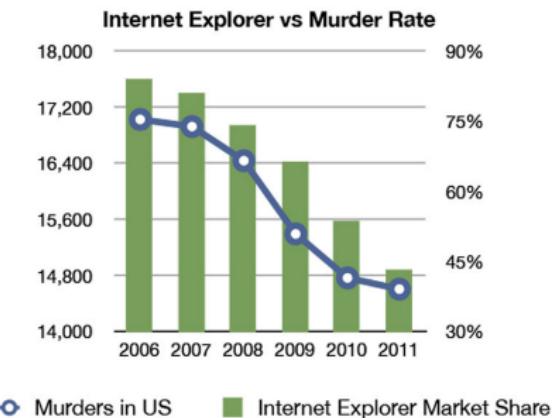
Насколько сильно признаки X_1, X_2 связаны между собой?

Статистическая взаимосвязь между случайными величинами —
корреляция.

Корреляция и причинность



Корреляция — статистическая взаимосвязь между случайными величинами; не является достаточным условием причинно-следственной:



Другие примеры: <http://www.tylervigen.com/>

Корреляция Пирсона

Коэффициент корреляции Пирсона $r_{X_1 X_2}$ случайных величин X_1 и X_2 — мера силы линейной корреляции между ними:

$$r_{X_1 X_2} = \frac{\mathbb{E}((X_1 - \mathbb{E}X_1)(X_2 - \mathbb{E}X_2))}{\sqrt{\mathbb{D}X_1 \mathbb{D}X_2}}.$$

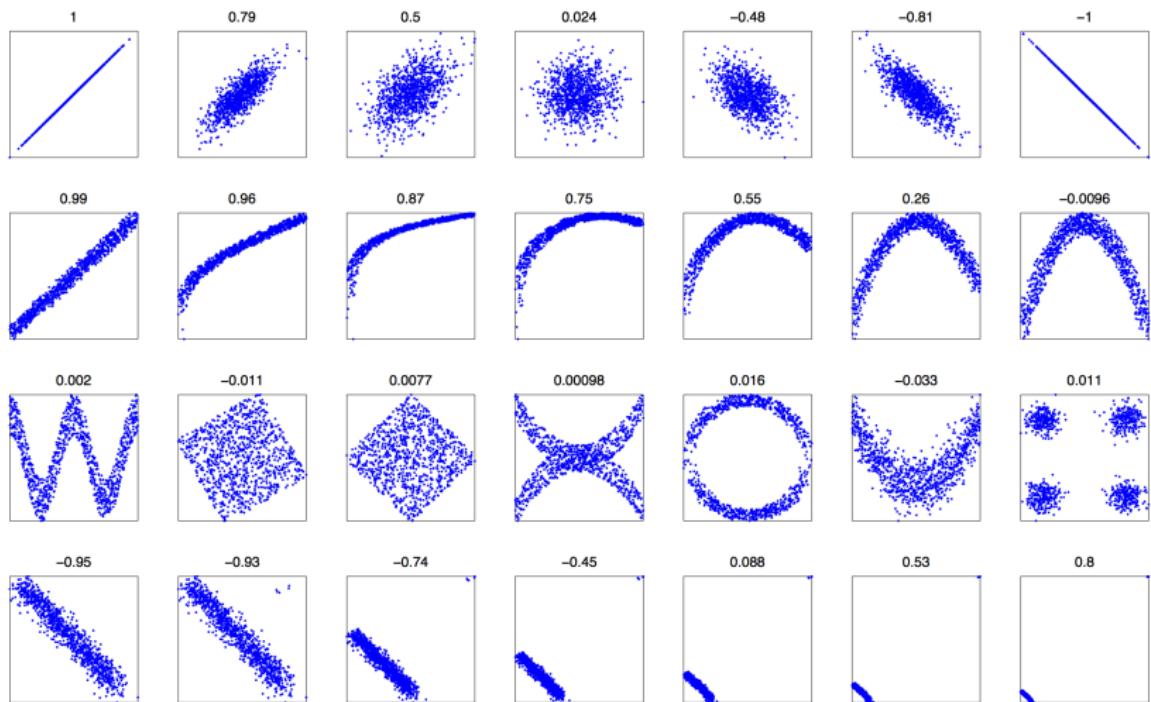
$$r_{X_1 X_2} \in [-1, 1].$$

Пусть имеется простая выборка пар (X_{1i}, X_{2i}) , $i = 1, \dots, n$.

Выборочный коэффициент корреляции Пирсона:

$$\hat{r}_{X_1 X_2} = \frac{\sum_{i=1}^n (X_{1i} - \bar{X}_1)(X_{2i} - \bar{X}_2)}{\sqrt{\sum_{i=1}^n (X_{1i} - \bar{X}_1)^2 \sum_{i=1}^n (X_{2i} - \bar{X}_2)^2}}.$$

Корреляция Пирсона

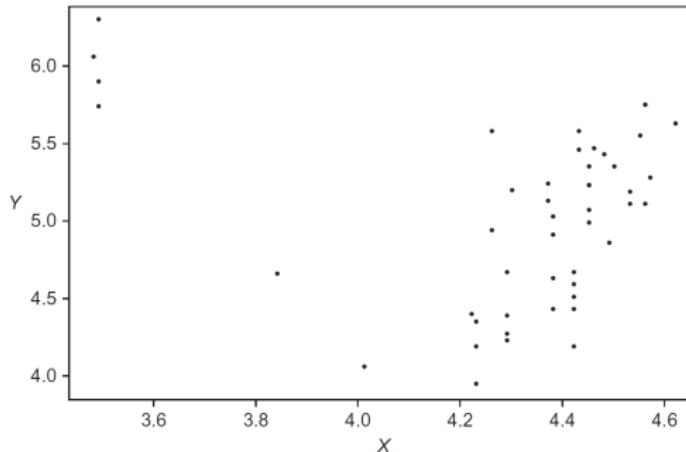


<http://guessthecorrelation.com/>

Корреляция Пирсона

Недостатки выборочного коэффициента Пирсона:

- для распределений, отличных от нормального, перестаёт быть эффективной оценкой популяционного коэффициента корреляции;
- служит мерой только линейной взаимосвязи;
- неустойчив к выбросам.



Корреляция между логарифмами эффективной температуры на поверхности звезды (X) и интенсивности её света (Y) получается отрицательной ($\hat{r}_{XY} = -0.21$) из-за наличия в выборке красных гигантов.

Критерий Стьюдента

выборки: $X_1^n = (X_{11}, \dots, X_{1n})$

$$X_2^n = (X_{21}, \dots, X_{2n})$$

выборки связанные

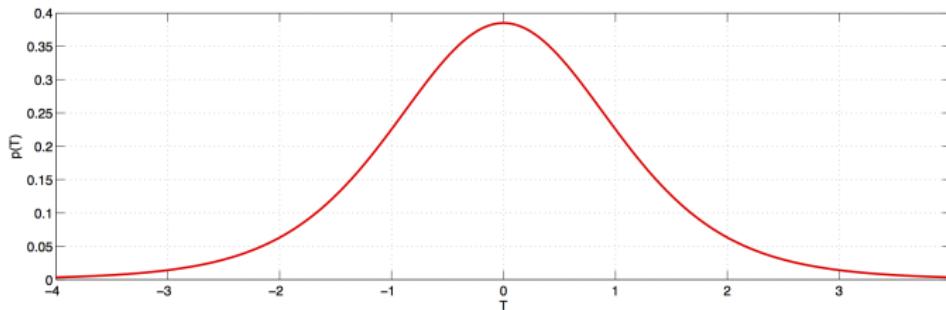
$$(X_1, X_2) \sim N(\mu, \Sigma)$$

нулевая гипотеза: $H_0: r_{X_1 X_2} = 0$

альтернатива: $H_1: r_{X_1 X_2} \neq 0$

$$\text{статистика: } T(X_1^n, X_2^n) = \frac{\hat{r}_{X_1 X_2} \sqrt{n-2}}{\sqrt{1-\hat{r}_{X_1 X_2}^2}}$$

нулевое распределение: $St(n - 2)$



Критерий Стьюдента

Доверительный интервал для коэффициента корреляции Пирсона:

$$\left[\hat{r}_{X_1 X_2} + \frac{t_{n-2,\alpha/2} (1 - \hat{r}_{X_1 X_2}^2)}{\sqrt{n}}, \hat{r}_{X_1 X_2} - \frac{t_{n-2,\alpha/2} (1 - \hat{r}_{X_1 X_2}^2)}{\sqrt{n}} \right].$$

С использованием преобразования Фишера:

$$\left[\tanh \left(\operatorname{arctanh} \hat{r}_{X_1 X_2} + \frac{z_{\alpha/2}}{\sqrt{n-3}} \right), \tanh \left(\operatorname{arctanh} \hat{r}_{X_1 X_2} - \frac{z_{\alpha/2}}{\sqrt{n-3}} \right) \right].$$

Критерий Стьюдента

Пример (Kanji, критерий 12): для двух марок зубной пасты, одна из которых рекламируется по телевизору, а другая нет, участники опроса (30 человек) выставляют оценки в баллах от 1 до 20 в соответствии со своими предпочтениями. Коэффициент корреляции Пирсона между оценками двух марок составляет 0.32, значимо ли эта величина отличается от нуля?

$$H_0: r_{X_1 X_2} = 0$$

$$H_1: r_{X_1 X_2} \neq 0$$

Критерий Стьюдента: $p = 0.0847$.

Доверительный интервал: $[-0.0157, 0.6557]$.

С использованием преобразования Фишера: $[-0.0455, 0.6100]$.

Перестановочный критерий

выборки: $X_1^n = (X_{11}, \dots, X_{1n})$

$X_2^n = (X_{21}, \dots, X_{2n})$

выборки связанные

нулевая гипотеза: $H_0: r_{X_1 X_2} = 0$

альтернатива: $H_1: r_{X_1 X_2} < \neq > 0$

статистика: $T(X_1^n, X_2^n) = \hat{r}_{X_1 X_2}$

нулевое распределение: порождается перебором $n!$ перестановок
индексов одной из выборок

Достигаемый уровень значимости — доля перестановок, на которых
получилось такое же или ещё более экстремальное значение статистики.

Перестановочный критерий

Пример: в предыдущем примере

$$\hat{r}_{X_1 X_2} = 0.32$$

$$H_0: r_{X_1 X_2} = 0$$

$$H_1: r_{X_1 X_2} \neq 0$$

Критерий Стьюдента: $p = 0.0847$.

Перестановочный критерий: $p = 0.0564$.

Корреляция Спирмена

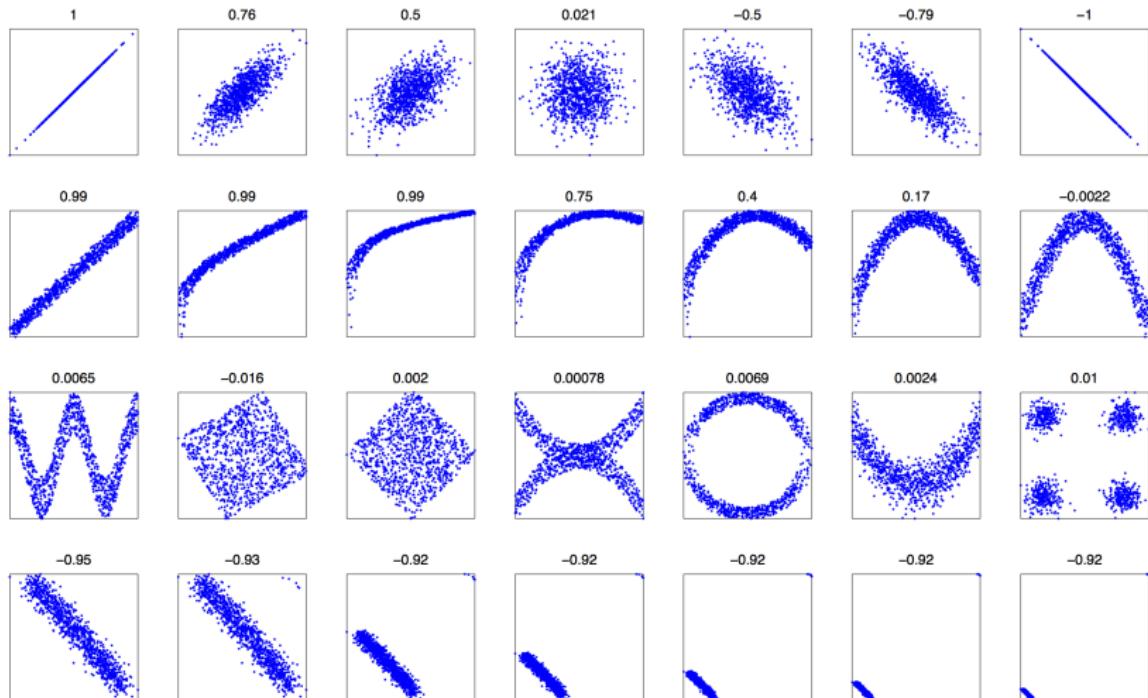
Коэффициент корреляции Спирмена $\rho_{X_1 X_2}$ случайных величин X_1 и X_2 — мера силы **монотонной** корреляции между ними; равен коэффициенту корреляции Пирсона между рангами наблюдений.

Выборочный коэффициент корреляции Спирмена:

$$\hat{\rho}_{X_1 X_2} = \frac{\sum_{i=1}^n (\text{rank}(X_{1i}) - \frac{n+1}{2})(\text{rank}(X_{2i}) - \frac{n+1}{2})}{\frac{1}{12}(n^3 - n)} = \\ = 1 - \frac{6}{n^3 - n} \sum_{i=1}^n (\text{rank}(X_{1i}) - \text{rank}(X_{2i}))^2,$$

$\text{rank}(X_{1i}), \text{rank}(X_{2i})$ — ранги i -х наблюдений в соответствующих выборках.

Корреляция Спирмена



Критерий Стьюдента

выборки: $X_1^n = (X_{11}, \dots, X_{1n})$

$X_2^n = (X_{21}, \dots, X_{2n})$

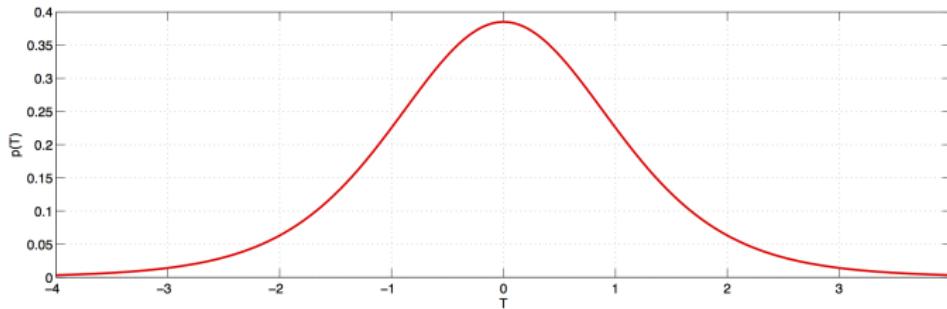
выборки связанные

нулевая гипотеза: $H_0: \rho_{X_1 X_2} = 0$

альтернатива: $H_1: \rho_{X_1 X_2} < \neq > 0$

статистика: $T(X_1^n, X_2^n) = \frac{\hat{\rho}_{X_1 X_2} \sqrt{n-2}}{\sqrt{1-\hat{\rho}_{X_1 X_2}^2}}$

нулевое распределение: $St(n - 2)$



Критерий Стьюдента

Пример (Kanji, критерий 58): выборка из 11 потребителей вегетариантских сосисок оценивает качество двух брендов. Если целевая аудитория двух брендов совпадает, то их рекламу можно давать совместно. Корреляция Спирмена оценок потребителей равна -0.854

$$H_0: \rho_{X_1 X_2} = 0$$

$$H_1: \rho_{X_1 X_2} \neq 0$$

Критерий Стьюдента: $p = 0.0024$.

Корреляция Кендалла

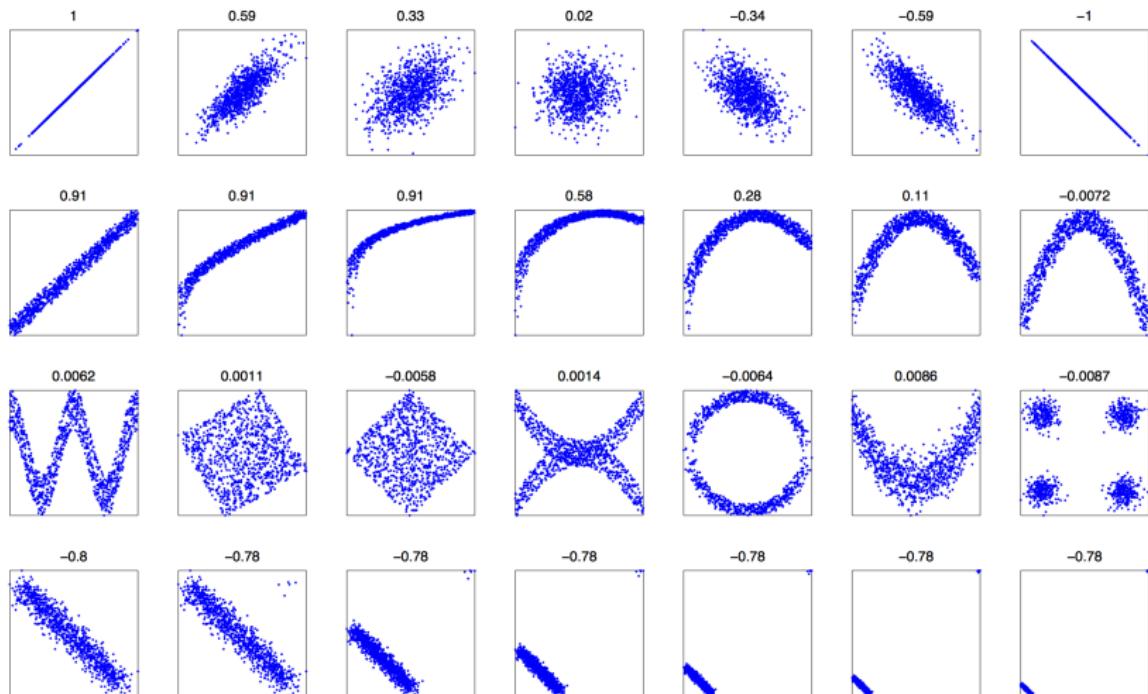
Коэффициент корреляции Кендалла $\tau_{X_1 X_2}$ случайных величин X_1 и X_2 — мера их взаимной неупорядоченности; также оценивает силу **монотонной** корреляции между величинами.

Выборочный коэффициент корреляции Кендалла:

$$\hat{\tau}_{X_1 X_2} = 1 - \frac{4}{n(n-1)} \sum_{i=1}^{n-1} \sum_{j=1}^n [[X_{1i} < X_{1j}] \neq [X_{2i} < X_{2j}]] = \frac{C - D}{C + D},$$

где C — число согласованных пар, D — число несогласованных пар.

Корреляция Кендалла



Критерий без названия

выборки: $X_1^n = (X_{11}, \dots, X_{1n})$

$X_2^n = (X_{21}, \dots, X_{2n})$

выборки связанные

нулевая гипотеза: $H_0: \tau_{X_1 X_2} = 0$

альтернатива: $H_1: \tau_{X_1 X_2} < \neq > 0$

статистика: $\hat{\tau}_{X_1 X_2}$

нулевое распределение: табличное

При справедливости H_0

$$\mathbb{E}\hat{\tau}_{X_1 X_2} = 0, \quad \mathbb{D}\hat{\tau}_{X_1 X_2} = \frac{2(2n+5)}{9n(n-1)}.$$

Для $n > 10$ справедлива аппроксимация нормальным распределением.

Критерий без названия

Пример (Kanji, критерий 59): налоговый инспектор хочет проверить наличие взаимосвязи между величинами общего дохода от инвестиций и общего объёма дополнительных доходов. На выборке из 10 налоговых деклараций он получил $D = 5$, $C = 38$, $\hat{\tau}_{X_1 X_2} = 0.7821$.

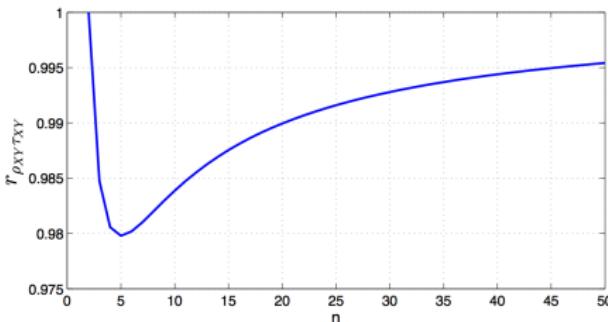
$$H_0: \tau_{X_1 X_2} = 0.$$

$$H_1: \tau_{X_1 X_2} \neq 0 \Rightarrow p = 0.0027.$$

Связь между коэффициентами корреляции

При справедливости H_0 (отсутствии монотонной зависимости):

$$r_{\rho_{X_1 X_2} \tau_{X_1 X_2}} = \frac{2n+2}{\sqrt{4n^2+10n}}$$



<http://youtu.be/D56dvoVrBBE>: по сравнению с корреляцией Спирмена, корреляция Кендалла

- менее чувствительна к большим различиям между рангами наблюдений;
- точнее оценивается по выборке небольших объёмов;
- обычно меньше по модулю.

$$(X_1, X_2) \sim N(\mu, \Sigma) \Rightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} \mathbb{E} \tau_{X_1 X_2} = \lim_{n \rightarrow \infty} \mathbb{E} \rho_{X_1 X_2} = \frac{2}{\pi} \arcsin r_{X_1 X_2}.$$

Частная корреляция

Если мы подозреваем, что наблюдаемая линейная взаимосвязь между признаками X_1 и X_2 вызвана влиянием третьего признака X_3 , можно попытаться его снять.

Частная корреляция:

$$r_{X_1 X_2 | X_3} = \frac{r_{X_1 X_2} - r_{X_1 X_3} r_{X_2 X_3}}{\sqrt{(1 - r_{X_1 X_3}^2) (1 - r_{X_2 X_3}^2)}}.$$

Если нужно снять влияние нескольких признаков, можно пользоваться рекуррентной формулой:

$$r_{X_1 X_2 | X_3 X_4} = \frac{r_{X_1 X_2 | X_4} - r_{X_1 X_3 | X_4} r_{X_2 X_3 | X_4}}{\sqrt{(1 - r_{X_1 X_3 | X_4}^2) (1 - r_{X_2 X_3 | X_4}^2)}}.$$

Другой вариант: если M — множество признаков, Ω — обратимая матрица их выборочных корреляций, $R = \Omega^{-1}$, то

$$r_{X_i X_j | M \setminus \{X_i, X_j\}} = -\frac{r_{ij}}{\sqrt{r_{ii} r_{jj}}}.$$

Критерий Стьюдента

выборки: $X_1^n = (X_{11}, \dots, X_{1n})$

$X_2^n = (X_{21}, \dots, X_{2n})$

$X_3^n = (X_{31}, \dots, X_{3n}), X_3 \in \mathbb{R}^M$

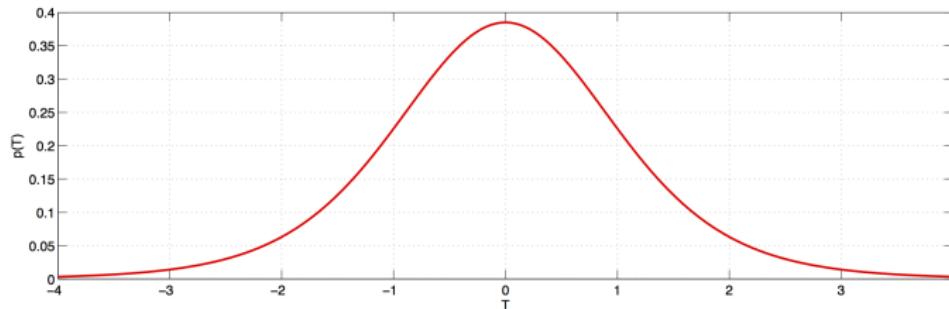
$(X_1, X_2, X_3) \sim N(\mu, \Sigma)$

нулевая гипотеза: $H_0: r_{X_1 X_2 | X_3} = 0$

альтернатива: $H_1: r_{X_1 X_2 | X_3} < \neq > 0$

статистика: $T(X_1^n, X_2^n, X_3^n) = \frac{\hat{r}_{X_1 X_2 | X_3} \sqrt{n-M-2}}{\sqrt{1-\hat{r}_{X_1 X_2 | X_3}^2}}$

нулевое распределение: $St(n - M - 2)$



Множественная корреляция

Для того, чтобы оценить силу линейной взаимосвязи одной переменной (X_1) с несколькими другими (X_2, X_3), используется множественная корреляция:

$$r_{X_1, X_2, X_3} = \frac{r_{X_1 X_2}^2 + r_{X_1 X_3}^2 - 2r_{X_1 X_2} r_{X_1 X_3} r_{X_2 X_3}}{1 - r_{X_2 X_3}^2}.$$

Для большего числа признаков: пусть M — множество дополнительных признаков, Ω — обратимая матрица их выборочных корреляций, $R = \Omega^{-1}$, c — вектор корреляций основного признака X с дополнительными; тогда

$$r_{X, M}^2 = c^T R c.$$

Находится такая линейная комбинация признаков из M , что корреляция X с ней максимальна.

$$r_{X, M} \in [0, 1].$$

Критерий Фишера

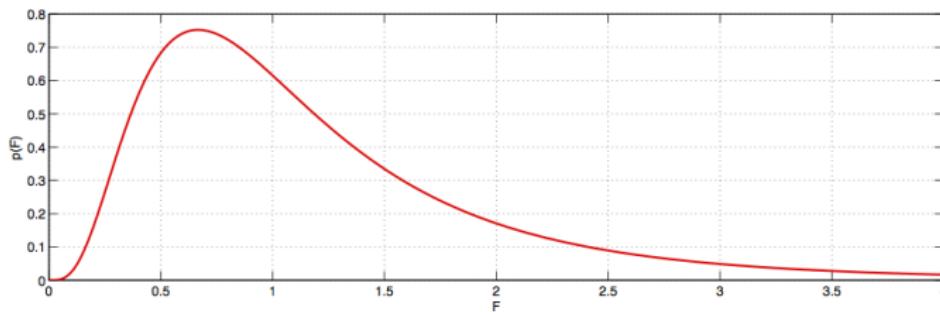
выборки: $X_1^n = (X_{11}, \dots, X_{1n})$
 $X_2^n = (X_{21}, \dots, X_{2n}), X_2 \in \mathbb{R}^M$
 $(X_1, X_2) \sim N(\mu, \Sigma)$

нулевая гипотеза: $H_0: r_{X_1, X_2} = 0$

альтернатива: $H_1: r_{X_1, X_2} > 0$

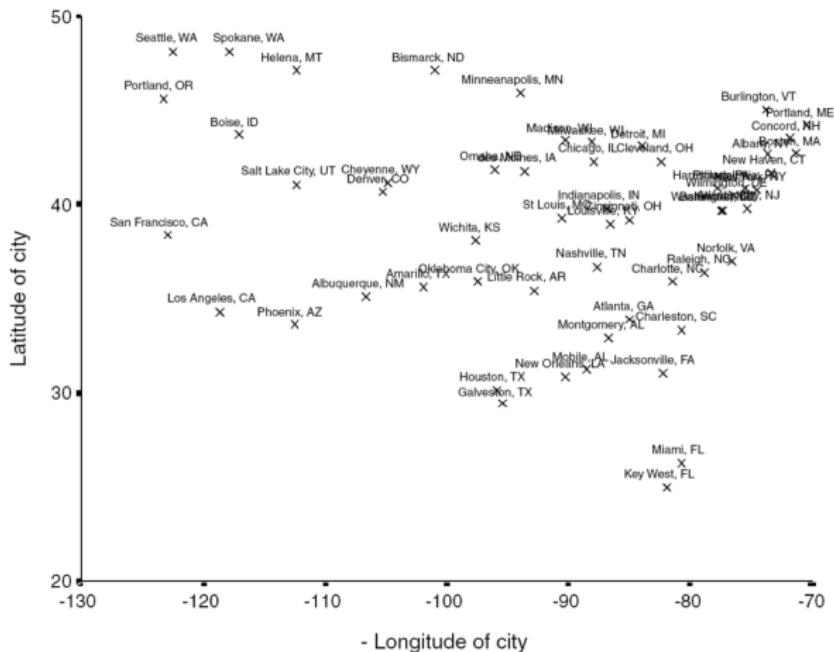
статистика: $F(X_1^n, X_2^n) = \frac{\hat{r}_{X_1, X_2}^2}{1 - \hat{r}_{X_1, X_2}^2} \frac{n - M - 1}{M - 2}$

нулевое распределение: $F(M - 2, n - M - 1)$

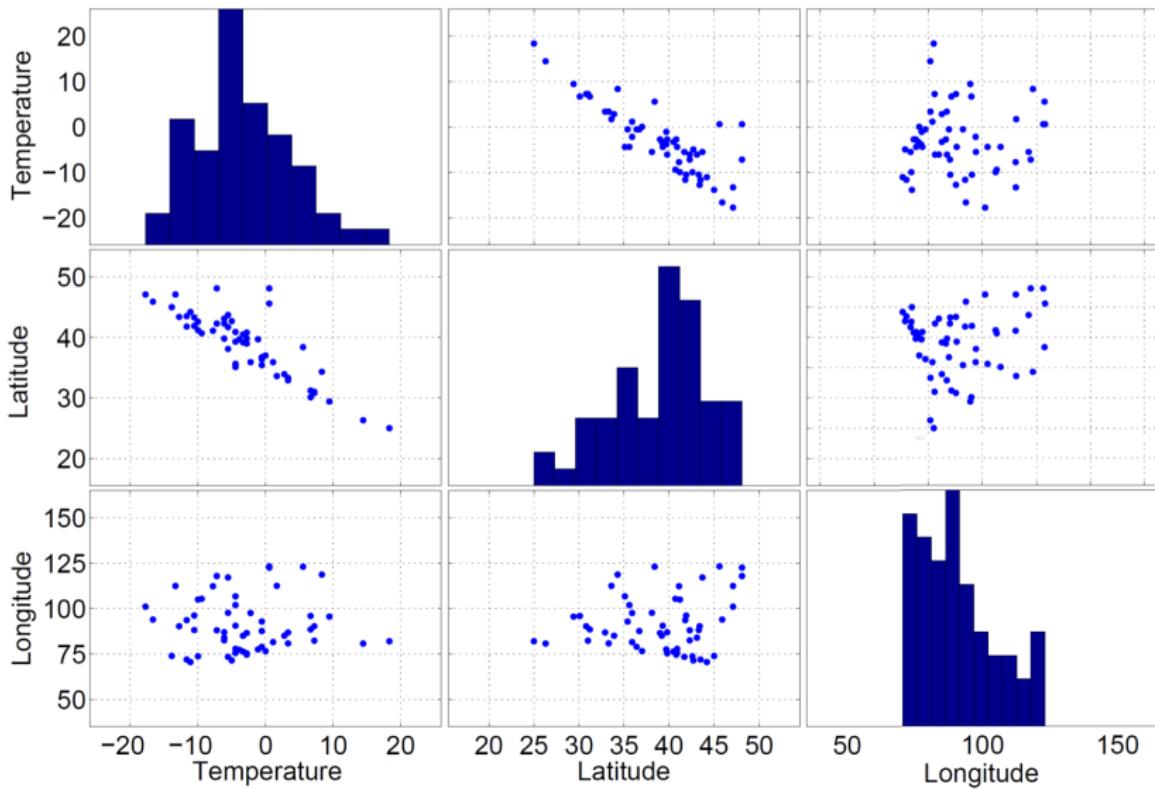


Температура воздуха и географическое положение

По 56 городам США известны средняя минимальная температура января и географические координаты (широта, долгота). Требуется исследовать характер зависимости между переменными.



Температура воздуха и географическое положение



Температура воздуха и географическое положение

T — температура, λ — долгота, ϕ — широта;

r — корреляция Пирсона, ρ — Спирмена, τ — Кендалла.

Коэффициенты корреляции:

| r | T | ϕ | λ |
|-----------|---------------|---------------|-----------|
| T | — | -0.848 | 0.024 |
| ϕ | -0.848 | — | 0.145 |
| λ | 0.024 | 0.145 | — |

| τ | T | ϕ | λ |
|-----------|---------------|---------------|-----------|
| T | — | -0.683 | 0.030 |
| ϕ | -0.683 | — | -0.011 |
| λ | 0.030 | -0.011 | — |

| ρ | T | ϕ | λ |
|-----------|---------------|---------------|-----------|
| T | — | -0.815 | 0.030 |
| ϕ | -0.815 | — | 0.023 |
| λ | 0.030 | 0.023 | — |

Достигаемые уровни значимости:

| r | T | ϕ | λ |
|-----------|--------------|--------------|-----------|
| T | — | 0.000 | 0.861 |
| ϕ | 0.000 | — | 0.287 |
| λ | 0.861 | 0.287 | — |

| τ | T | ϕ | λ |
|-----------|--------------|--------------|-----------|
| T | — | 0.000 | 0.756 |
| ϕ | 0.000 | — | 0.910 |
| λ | 0.756 | 0.910 | — |

| ρ | T | ϕ | λ |
|-----------|--------------|--------------|-----------|
| T | — | 0.000 | 0.829 |
| ϕ | 0.000 | — | 0.865 |
| λ | 0.829 | 0.865 | — |

Температура воздуха и географическое положение

T — температура, λ — долгота, ϕ — широта;
 r — частная корреляция Пирсона, ρ — Спирмена.

Коэффициенты частной корреляции:

| r | T | ϕ | λ |
|-----------|---------------|---------------|---------------|
| T | — | -0.861 | 0.280 |
| ϕ | -0.861 | — | -0.312 |
| λ | 0.280 | 0.312 | — |

| ρ | T | ϕ | λ |
|-----------|---------------|---------------|-----------|
| T | — | -0.817 | 0.084 |
| ϕ | -0.817 | — | 0.082 |
| λ | 0.084 | 0.082 | — |

Достигаемые уровни значимости:

| r | T | ϕ | λ |
|-----------|--------------|--------------|---------------|
| T | — | 0.000 | 0.039 |
| ϕ | 0.000 | — | -0.021 |
| λ | 0.039 | 0.021 | — |

| ρ | T | ϕ | λ |
|-----------|--------------|--------------|-----------|
| T | — | 0.000 | 0.543 |
| ϕ | 0.000 | — | -0.552 |
| λ | 0.543 | 0.552 | — |

Температура воздуха и географическое положение

T — температура, λ — долгота, ϕ — широта;

R — множественная корреляция.

Коэффициенты множественной корреляции:

| | T | ϕ | λ |
|------|--|---------------------------------------|------------------------------------|
| R | 0.659 | 0.667 | 0.312 |
| p | 6.0347×10^{-8} | 3.6481×10^{-8} | 0.0216 |
| with | $0.235 \cdot \lambda - 0.638 \cdot \phi$ | $0.397 \cdot \lambda - 0.678 \cdot T$ | $1.542 \cdot T + 2.450 \cdot \phi$ |

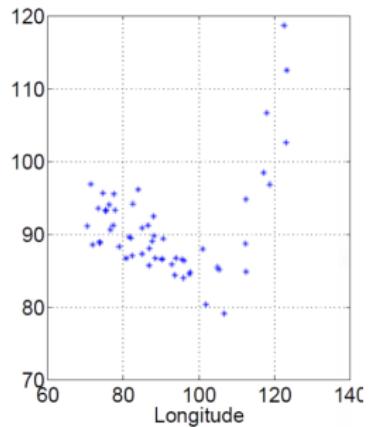
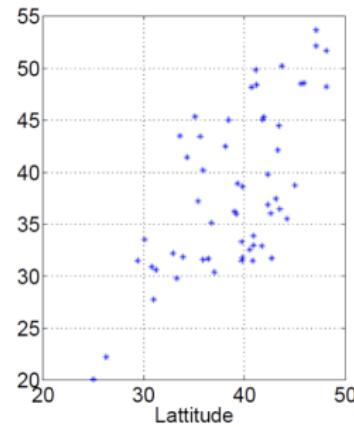
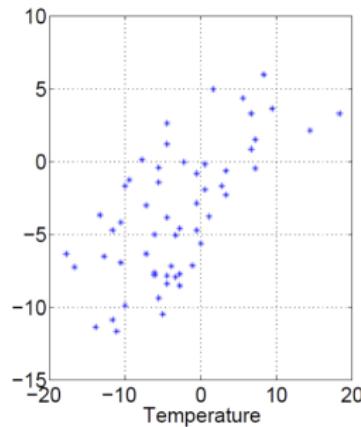


Таблица сопряжённости $K_1 \times K_2$

Имеются связанные выборки $X_1^n = (X_{11}, \dots, X_{1n})$ и $X_2^n = (X_{21}, \dots, X_{2n})$,
 $X_1 \in \{1, \dots, K_1\}$, $X_2 \in \{1, \dots, K_2\}$.

Таблица сопряжённости:

| X_1 | X_2 | 1 | \dots | j | \dots | K_2 | \sum |
|----------|-------|---|---------|----------|---------|-------|----------|
| 1 | | | | | | | |
| \vdots | | | | | | | |
| i | | | | n_{ij} | | | n_{i+} |
| \vdots | | | | | | | |
| K_1 | | | | | | | |
| \sum | | | | n_{+j} | | | n |

Два случайных признака

Пусть π_{ij} — вероятность реализации пары (X_1, X_2) в ячейке (i, j) .
 $\{\pi_{ij}\}$ — совместное распределение (X_1, X_2) ;
 $\{\pi_{i+}\}, \{\pi_{+j}\}$ — маргинальные распределения.

X_1 и X_2 независимы, если

$$\pi_{ij} = \pi_{i+}\pi_{+j} \quad \forall i = 1, \dots, K_1, j = 1, \dots, K_2.$$

Один случайный признак

Пусть X_1 — не случайная величина, а фиксированный признак. Тогда $\{\pi_{ij}\}$ не имеет смысла, вместо него рассматриваются $\{\pi_{1|i}, \dots, \pi_{K_1|i}\}$ — условные распределения X_2 при $X_1 = i$.

X_1 и X_2 независимы, если

$$\pi_{j|1} = \dots = \pi_{j|K_1} \quad \forall j = 1, \dots, K_2.$$

Порождающие модели

- 1 Если все ячейки таблицы случайны, то распределение n_{ij} может быть, например, пуассоновским со средними μ_{ij} ; совместная функция вероятности таблицы:

$$\prod_i \prod_j \frac{e^{-\mu_{ij}} \mu_{ij}^{n_{ij}}}{n_{ij}!}.$$

- 2 Если суммарный объём выборки n фиксирован, данные описываются мультиномиальной моделью:

$$\frac{n!}{n_{11}! \cdot \dots \cdot n_{K_1 K_2}!} \prod_i \prod_j \pi_{ij}^{n_{ij}}.$$

- 3 Если X_1 не случайна, то фиксированы суммы по строкам n_{i+} , и каждая строка i порождается отдельной мультиномиальной моделью:

$$\frac{n_{i+}!}{\prod_j n_{ij}!} \prod_j \pi_{i|j}^{n_{ij}}.$$

Порождающие модели

Исследование: как исход автомобильной аварии на заданной магистрали X_1 (смертельный, несмертельный) зависит от использования ремня безопасности X_2 (был использован, не был использован)?

| Ремень | | | |
|---------------|-------------|----------------|--|
| Исход | использован | не использован | |
| смертельный | | | |
| несмертельный | | | |

- 1 Исследователи собираются учесть все автомобильные аварии, которые произойдут на магистрали в течение года.
- 2 Исследователи запросят 200 случайных полицейских рапортов об авариях за последние годы.
- 3 Исследователи запросят 200 случайных полицейских рапортов об авариях за последние годы: 100 об авариях со смертельным исходом и 100 об авариях без смертельного исхода.

Таблица сопряжённости 2×2

Пусть X_1 и X_2 принимают значения 0 и 1.

| $X_1 \backslash X_2$ | 0 | 1 | Σ |
|----------------------|---------|---------|----------|
| 0 | a | b | $a + b$ |
| 1 | c | d | $c + d$ |
| Σ | $a + c$ | $b + d$ | n |

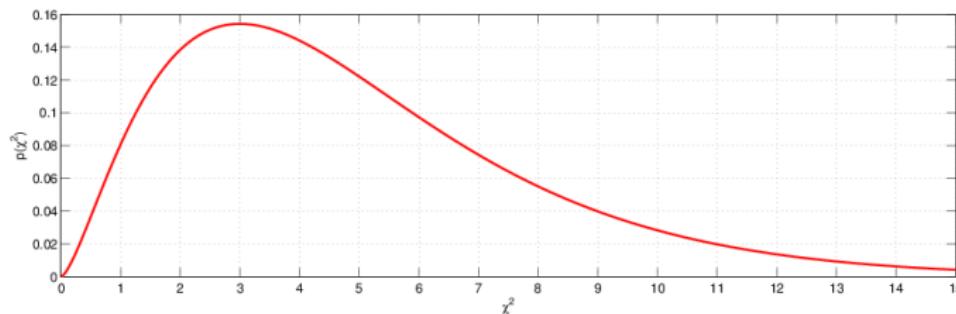
Критерий хи-квадрат

выборки: $X_1^n = (X_{11}, \dots, X_{1n}), X_1 \in \{1, \dots, K_1\}$
 $X_2^n = (X_{21}, \dots, X_{2n}), X_2 \in \{1, \dots, K_2\}$
 выборки связанные

нулевая гипотеза: $H_0: X_1 \text{ и } X_2 \text{ независимы}$
 альтернатива: $H_1: H_0 \text{ неверна}$

статистика: $\chi^2(X_1^n, X_2^n) = \sum_{i=1}^{K_1} \sum_{j=1}^{K_2} \frac{\left(n_{ij} - \frac{n_{i+} n_{+j}}{n}\right)^2}{\frac{n_{i+} n_{+j}}{n}} = n \left(\sum_{i=1}^{K_1} \sum_{j=1}^{K_2} \frac{n_{ij}^2}{n_{i+} n_{+j}} - 1 \right)$

нулевое распределение: $\chi^2_{(K_1-1)(K_2-1)}$



Условия применимости критерия:

- $n \geq 40$;
- $\frac{n_{i+} n_{+j}}{n} < 5$ не более, чем в 20% ячеек.

Критерий хи-квадрат

Пример: исследуется влияние препарата на некоторое заболевание. Часть испытуемых принимает препарат, часть — плацебо; по окончании курса определяется, произошло ли выздоровление.

| | Выздоровели | Нет |
|----------|-------------|-----|
| Препарат | 850 | 870 |
| Плацебо | 380 | 410 |

H_0 : препарат неотличим от плацебо.

H_1 : эффект препарата отличается от эффекта плацебо $\Rightarrow p = 0.5398$.

G-критерий

выборки: $X_1^n = (X_{11}, \dots, X_{1n}), X_1 \in \{1, \dots, K_1\}$

$X_2^n = (X_{21}, \dots, X_{2n}), X_2 \in \{1, \dots, K_2\}$

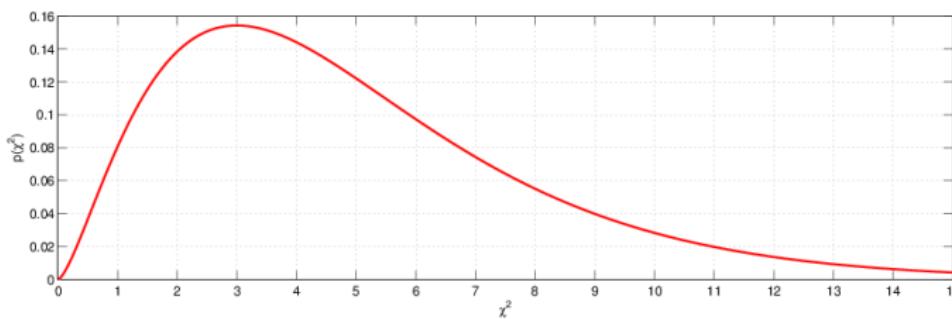
выборки связанные

нулевая гипотеза: $H_0: X_1$ и X_2 независимы

альтернатива: $H_1: H_0$ неверна

статистика: $G^2(X_1^n, X_2^n) = 2 \sum_{i=1}^{K_1} \sum_{j=1}^{K_2} n_{ij} \ln \frac{n_{ij} n}{n_{i+} n_{+j}}$

нулевое распределение: $\chi^2_{(K_1-1)(K_2-1)}$



Точный критерий Фишера

выборки: $X_1^n = (X_{11}, \dots, X_{1n}), X_1 \in \{0, 1\}$ $X_2^n = (X_{21}, \dots, X_{2n}), X_2 \in \{0, 1\}$

выборки связанные

нулевая гипотеза: $H_0: X_1$ и X_2 независимыальтернатива: $H_1: H_0$ неверна

Пусть в таблице сопряжённости суммы по строкам и столбцам фиксированы, тогда вероятность появления наблюдаемой таблицы равна

$$P(X_1^n, X_2^n) = \frac{(a+b)!(c+d)!(a+c)!(b+d)!}{a!b!c!d!n!}.$$

Достигаемый уровень значимости определяется как сумма по всем возможным вариантам таблицы с такими же суммами по строкам и столбцам, имеющим вероятность не более $P(X_1^n, X_2^n)$.

Для односторонней альтернативы ($ad \ll bc$) достигаемый уровень значимости можно определить через гипергеометрическое распределение:

$$p = \sum_{i=0}^a \frac{C_{a+b}^i C_{c+d}^{a+c-i}}{C_n^{a+c}}.$$

Точный критерий Фишера

Пример: для 26 опрошенных известен пол и сидят ли они на диете. Есть ли связь между этими признаками?

| | M | Ж |
|-------------|----|---|
| На диете | 1 | 9 |
| Не на диете | 13 | 3 |

H_0 : связи нет.

H_1 : признаки связаны.

Точный критерий Фишера: $p = 0.0008$.

Перестановочный критерий

Представим выборку в виде таблицы $n \times 2$:

| | Строка | Столбец |
|---|--------|---------|
| | 1 | 1 |
| | 1 | 2 |
| | ... | |
| | 1 | 2 |
| ⇒ | 2 | 1 |
| | ... | |
| | 2 | 1 |
| | 2 | 2 |
| | 2 | 2 |
| | 2 | 2 |

| | M | Ж |
|-------------|----|---|
| На диете | 1 | 9 |
| Не на диете | 13 | 3 |

Используем статистику критерия хи-квадрат, но её нулевое распределение будем оценивать по $n!$ перестановок второй колонки.

H_0 : связи нет.

H_1 : признаки связаны.

Точный критерий Фишера: $p = 0.0008$.

Критерий хи-квадрат: $p = 0.0004$.

Перестановочный критерий со статистикой хи-квадрат: $p = 0.0014$.

Коэффициент V Крамера

Мера взаимосвязи между двумя категориальными переменными — коэффициент V Крамера:

$$\phi_c(X_1^n, X_2^n) = \sqrt{\frac{\chi^2(X_1^n, X_2^n)}{n(\min(K_1, K_2) - 1)}}.$$

$\phi_c(X_1^n, X_2^n) \in [0, 1]$; 0 соответствует полному отсутствию взаимосвязи, 1 — совпадению переменных.

Корреляция между порядковыми переменными

Мера взаимосвязи между двумя порядковыми переменными — коэффициент γ :

$$\hat{\gamma} = \frac{p_C - p_D}{n^2 - p_t},$$

где $p_C = \frac{C}{n}$ — частота появления согласованных пар элементов выборки, т. е., таких, что $i_1 > i_2$, $j_1 > j_2$ или $i_1 < i_2$, $j_1 < j_2$;

$p_D = \frac{D}{n}$ — частота несогласованных пар;

$p_t = \frac{T}{n}$ — частота таких пар, что $i_1 = i_2$ или $j_1 = j_2$.

$\gamma \in [-1, 1]$; -1 соответствует полному отсутствию согласованных пар, 1 — отсутствию несогласованных.

| Политические взгляды | Счастье | | |
|----------------------|---------------------|-----------------|----------------|
| | Не слишком счастлив | Вполне счастлив | Очень счастлив |
| Либеральные | 13 | 29 | 15 |
| Умеренные | 23 | 59 | 47 |
| Консервативные | 14 | 67 | 54 |

$$\chi^2 = 7.07, p = 0.1322, \phi_c = 0.0742;$$

$$\hat{\gamma} = 0.185, \text{ 95\% доверительный интервал} — [0.032, 0.338].$$

Корреляция Мэтьюса

Мера взаимосвязи между двумя бинарными переменными — коэффициент корреляции Мэтьюса:

$$MCC = \frac{ad - bc}{\sqrt{(a + b)(a + c)(b + d)(c + d)}}.$$

$MCC \in [-1, 1]$; 0 соответствует полному отсутствию взаимосвязи, 1 — нулям на побочной диагонали, -1 — нулям на главной диагонали.

Пары переменных разных типов

Между категориальными и непрерывными признаками корреляции считать не нужно!

Пусть $X_1 \in \mathbb{R}, X_2 \in \{0, 1\}$;

X_1 и X_2 положительно коррелированы, если

$$\mathbb{E}(X_1 | X_2 = 1) > \mathbb{E}(X_1 | X_2 = 0).$$

Мера взаимосвязи X_1 и X_2 — разность $\mathbb{E}(X_1 | X_2 = 1) - \mathbb{E}(X_1 | X_2 = 0)$.

Парадокс хи-квадрат (Симпсона)

Эксперимент: пациенты принимают препарат или плацебо, по окончании курса определяется, выздоровели они или нет.

Есть ли связь между выздоровлением и приёмом препарата?

| Мужчины | Выздоровели | Нет |
|----------|-------------|-----|
| Препарат | 700 | 800 |
| Плацебо | 80 | 130 |

| Женщины | Выздоровели | Нет |
|----------|-------------|-----|
| Препарат | 150 | 70 |
| Плацебо | 300 | 280 |

Для мужчин: $\chi^2 = 5.456, p = 0.0195$.

Для женщин: $\chi^2 = 17.555, p = 2.8 \times 10^{-5}$.

| М+Ж | Выздоровели | Нет |
|----------|-------------|-----|
| Препарат | 850 | 870 |
| Плацебо | 380 | 410 |

Суммарно: $\chi^2 = 0.376, p = 0.5398$.

Парадокс хи-квадрат (Симпсона)

Причины несогласованности выводов — большие отличия в размерах групп пациентов, принимающих плацебо и препарат: основной вклад в выводы вносят женщины, принимавшие плацебо, и мужчины, принимавшие препарат.

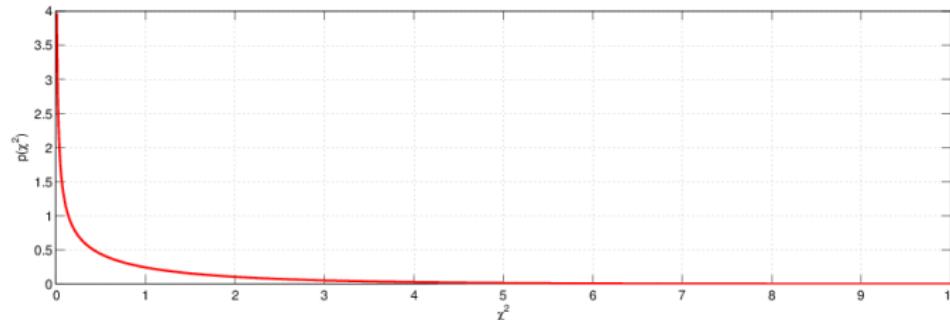
Чтобы такого не происходило, плацебо и препарат должны поровну распределяться по всем анализируемым подгруппам.

Парадокс хи-квадрат (Симпсона)

Пример (Bikel at el., 1975): в 1973 году на университет Беркли, Калифорния, подали в суд: доля поступивших абитуриентов мужского пола была выше, чем доля поступивших женского пола.

| | Не поступили | Поступили | Доля поступивших |
|---------|--------------|-----------|------------------|
| Мужчины | 4704 | 3738 | 44.3% |
| Женщины | 2827 | 1494 | 34.6% |

Парadox хи-квадрат (Симпсона)

Критерий хи-квадрат: $\chi^2 = 108.1$, $p \approx 0$.

| | Наблюдаемые | | Ожидаемые | | Разности | |
|---------|-------------|------|-----------|--------|----------|--------|
| | - | + | - | + | - | + |
| Мужчины | 4704 | 3738 | 4981.3 | 3460.7 | -227.3 | 227.3 |
| Женщины | 2827 | 1494 | 2549.7 | 1771.3 | 227.3 | -227.3 |

Парадокс хи-квадрат (Симпсона)

Будем искать виноватых: посмотрим детализированную статистику по 85 факультетам.

Значимо (при $\alpha = 0.05$) меньше женщин прошли отбор на 4 факультета, суммарный дефицит по ним — 26.

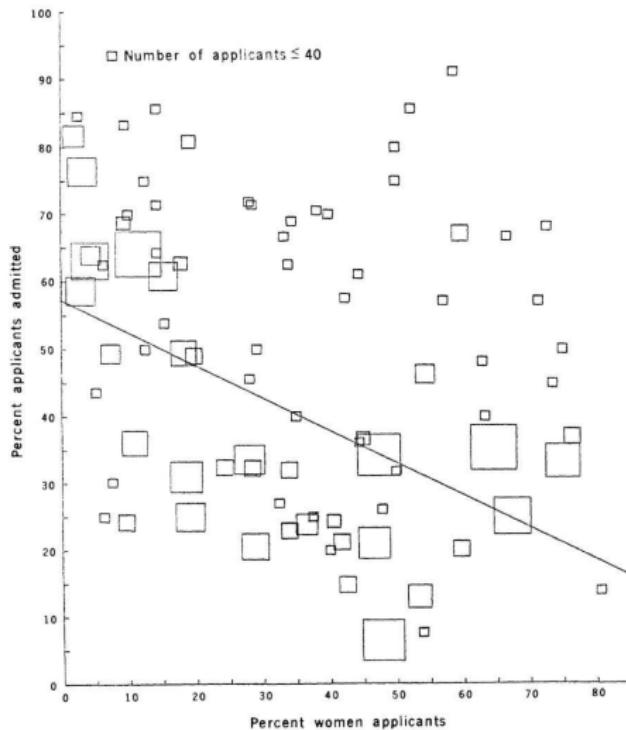
На 6 факультетов поступило значительно меньше мужчин, суммарный дефицит — 64.

Данные по 6 крупнейшим факультетам:

| | Мужчины | | Женщины | |
|---|---------|------------|---------|------------|
| | \sum | + | \sum | + |
| 1 | 825 | 62% | 108 | 82% |
| 2 | 560 | 63% | 25 | 68% |
| 3 | 325 | 37% | 593 | 34% |
| 4 | 417 | 33% | 375 | 35% |
| 5 | 191 | 28% | 393 | 24% |
| 6 | 272 | 6% | 341 | 7% |

Парadox хи-квадрат (Симпсона)

Ответ: женщины чаще пытались поступить на факультеты с большим конкурсом.



Парадокс хи-квадрат (Симпсона)

“Like fire, the chi-square statistic is an excellent servant and a bad master.”
(Austin Bradford Hill)

Литература

- непрерывные признаки — Лагутин, гл. 20;
- категориальные признаки — Agresti, гл. 2 и 3, Bilder, разделы 3.1, 3.2, 6.2.1, 6.2.2;
- значимость корреляции Пирсона — Kanji, №12, Good, 3.8;
- значимость корреляции Кендалла и Спирмена — Кобзарь, 5.2.2.2.1, 5.2.2.2.2;
- значимость частной и множественной корреляций — Кобзарь, 5.2.1.3.

Кобзарь А.И. *Прикладная математическая статистика*, 2006.

Лагутин М.Б. *Наглядная математическая статистика*, 2007.

Agresti A. *Categorical Data Analysis*, 2013.

Bickel P.J., Hammel E.A., O'connell J.W. (1975). *Sex bias in graduate admissions: data from Berkeley*. Science, 187(4175), 398–404.

Bilder C.R., Loughin T.M. *Analysis of Categorical Data with R*, 2013.

Good P. *Permutation, Parametric and Bootstrap Tests of Hypotheses: A Practical Guide to Resampling Methods for Testing Hypotheses*, 2005.

Kanji G.K. *100 statistical tests*, 2006.