

Correlação Linear

Associação de duas amostras (quantitativa)

Felipe Figueiredo

Instituto Nacional de Traumatologia e Ortopedia

- 1 Discussão da aula passada
 - Discussão da aula passada
- 2 Introdução
 - Introdução
- 3 Correlação
 - Associação entre duas variáveis contínuas
 - Coeficiente de correlação de Pearson
 - Interpretação
- 4 Resumo
 - Causalidade
 - Resumo
- 5 Aprofundamento
 - Aprofundamento

Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Introdução

Correlação

Resumo

Aprofundamento

- 1 Discussão da aula passada
 - Discussão da aula passada
- 2 Introdução
 - Introdução
- 3 Correlação
 - Associação entre duas variáveis contínuas
 - Coeficiente de correlação de Pearson
 - Interpretação
- 4 Resumo
 - Causalidade
 - Resumo
- 5 Aprofundamento
 - Aprofundamento

Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Discussão da aula
passada

Introdução

Correlação

Resumo

Aprofundamento

Discussão da aula passada



Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Discussão da aula
passada

Introdução

Correlação

Resumo

Aprofundamento

Discussão da leitura obrigatória da aula passada

- 1 Discussão da aula passada
 - Discussão da aula passada
- 2 Introdução
 - Introdução
- 3 Correlação
 - Associação entre duas variáveis contínuas
 - Coeficiente de correlação de Pearson
 - Interpretação
- 4 Resumo
 - Causalidade
 - Resumo
- 5 Aprofundamento
 - Aprofundamento

Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Introdução
Intro

Correlação

Resumo

Aprofundamento

- A variância (assim como o DP) é uma medida da dispersão da amostra
- P: o quanto os dados se desviam da média?
- Medida sumária: um único número para a amostra

Interpretação

Quanto maior a variância...

... maior a dispersão em relação ao centro.

Visualização - Dispersão “pequena”



Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

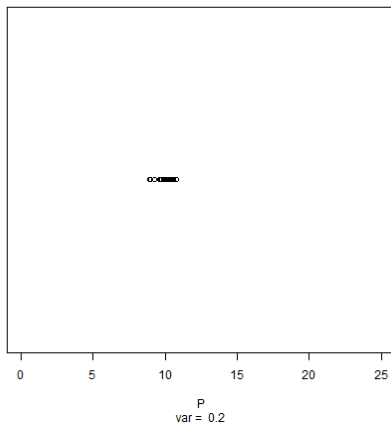
Introdução

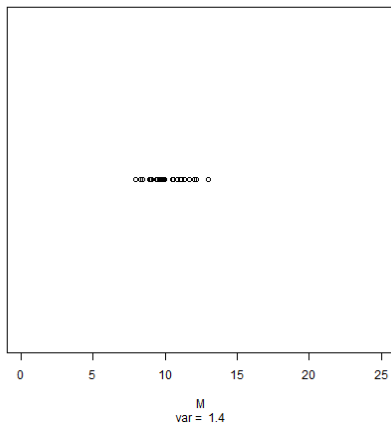
Intro

Correlação

Resumo

Aprofundamento





Visualização - Dispersão “grande”



Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

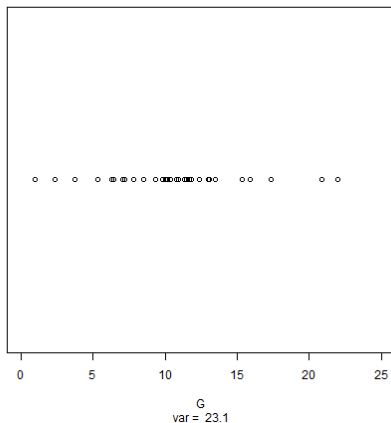
Discussão da
aula passada

Introdução
Intro

Correlação

Resumo

Aprofundamento



Dispersão em cada eixo



Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Introdução
Intro

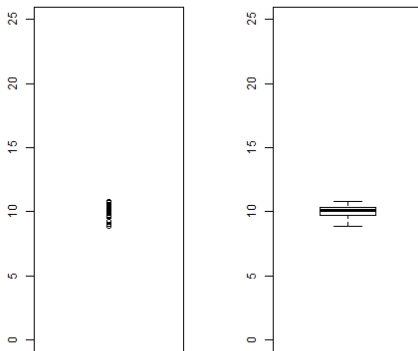
Correlação

Resumo

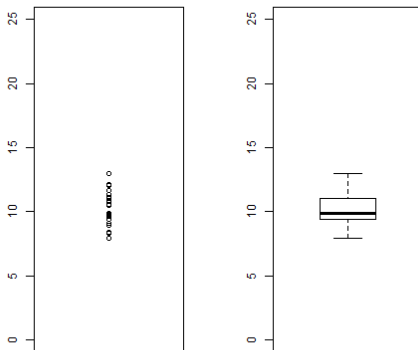
Aprofundamento

- Para medir a associação **entre** duas variáveis contínuas, devemos considerar a dispersão de cada uma delas
- Exemplos anteriores: dispersão no eixo horizontal
- Vejamos agora no eixo vertical
- (e aproveitar para incrementar a visualização de **uma** variância)

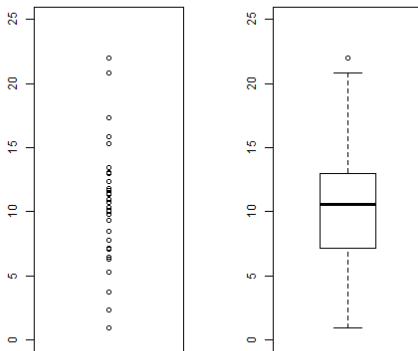
Visualização - Dispersão “pequena” - boxplot



Visualização - Dispersão “média” - boxplot



Visualização - Dispersão “grande” - boxplot



Dispersão “conjunta” entre duas variáveis



Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Introdução
Intro

Correlação

Resumo

Aprofundamento

- Podemos usar um raciocínio análogo para comparar quanto uma amostra se desvia **em relação à outra**
- Pareando duas amostras, podemos tentar observar:
 - a dispersão no eixo horizontal (difícil)
 - a dispersão no eixo vertical (difícil)
 - a “dispersão conjunta” entre ambas (fácil)

Visualização - Dispersão “pequena”



Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

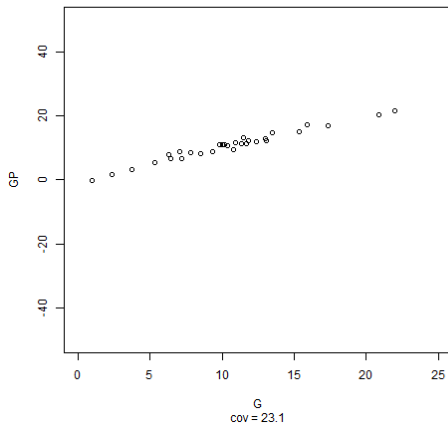
Introdução

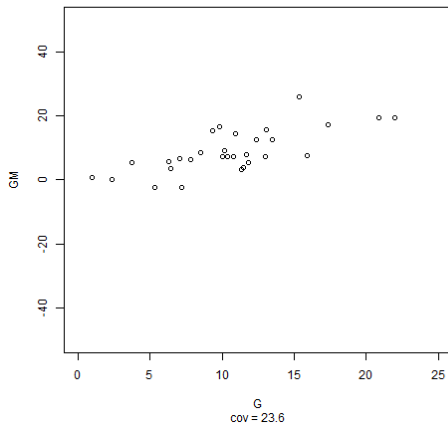
Intro

Correlação

Resumo

Aprofundamento





Visualização - Dispersão “grande”



Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

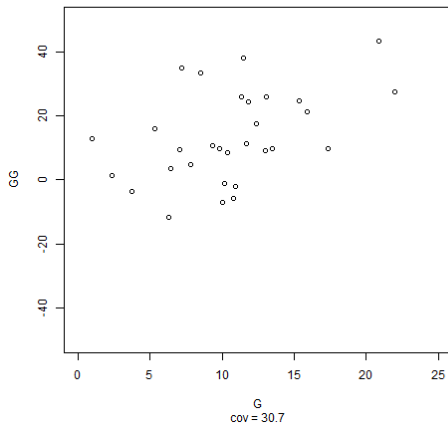
Introdução

Intro

Correlação

Resumo

Aprofundamento



Luz.. Câmera... Ação!



Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Introdução

Intro

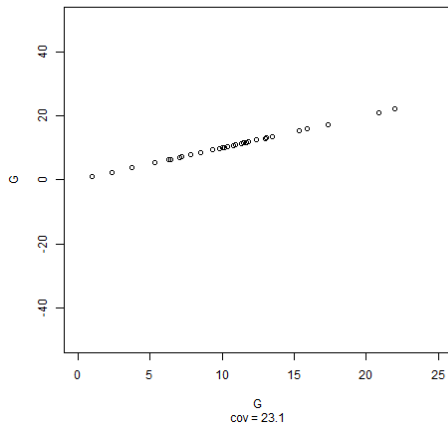
Correlação

Resumo

Aprofundamento

- Esta dispersão conjunta é a base para entender a associação
- Nos dois casos extremos temos:
 - duas variáveis perfeitamente associadas
 - duas variáveis não associadas

Visualização - Dispersão conjunta “inexistente”



Visualização - Dispersão amostras independentes



Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

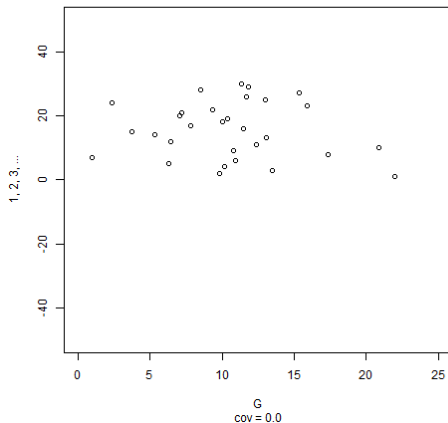
Introdução

Intro

Correlação

Resumo

Aprofundamento



- O DP é uma medida a dispersão de uma variável contínua.
- Existe um análogo para duas variáveis, simultaneamente.

O nome desta solução é **coeficiente de correlação r** .

- 1 Discussão da aula passada
 - Discussão da aula passada
- 2 Introdução
 - Introdução
- 3 **Correlação**
 - **Associação entre duas variáveis contínuas**
 - Coeficiente de correlação de Pearson
 - Interpretação
- 4 Resumo
 - Causalidade
 - Resumo
- 5 Aprofundamento
 - Aprofundamento

Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Introdução

Correlação

Associação
Pearson
Interpretação

Resumo

Aprofundamento

Tipos de variáveis envolvidas



Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Introdução

Correlação

Associação
Pearson
Interpretação

Resumo

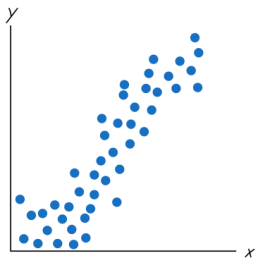
Aprofundamento

- Considere duas amostras X e Y , de dados numéricos contínuos.
- Vamos representar os dados em pares ordenados (x,y) onde:
 - X : variável independente (ou variável explanatória)
 - Y : variável dependente (ou variável resposta)

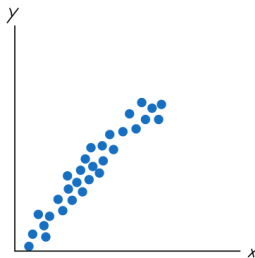
- Como definir (e mensurar!) o grau de associação entre duas amostras?
- Se uma amostra é dependente de outra, é razoável assumir que isso possa ser observável por estatísticas sumárias
- Como resumir esta informação em uma única grandeza numérica?

- Quando uma associação é forte, podemos identificá-la subjetivamente
- Para isto, analisamos o gráfico de dispersão dos pares (x,y)
- Um gráfico deste tipo é feito simplesmente plotando os pontos no plano cartesiano

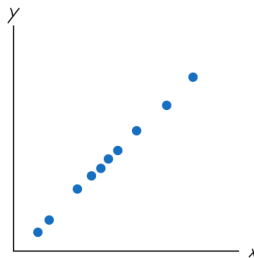
Exemplo



(a) Positive correlation between x and y



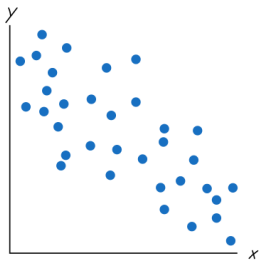
(b) Strong positive correlation between x and y



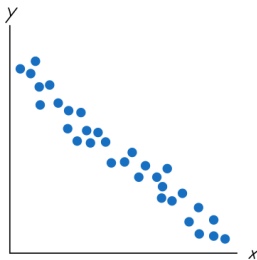
(c) Perfect positive correlation between x and y

(Fonte: Triola)

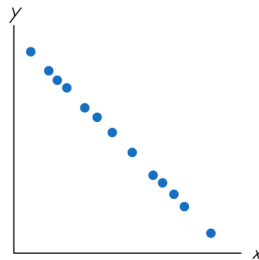
Exemplo



(d) Negative correlation
between x and y



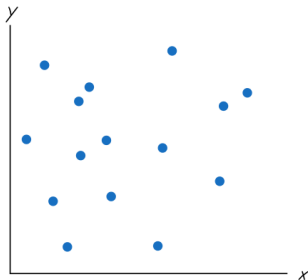
(e) Strong negative
correlation between
 x and y



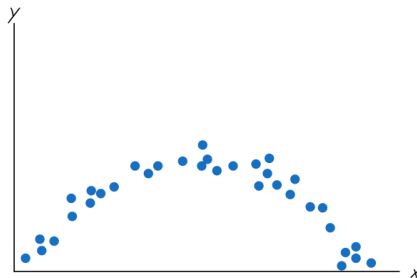
(f) Perfect negative
correlation between
 x and y

(Fonte: Triola)

Exemplo



(g) No correlation
between x and y



(h) Nonlinear relationship
between x and y

(Fonte: Triola)

- 1 Discussão da aula passada
 - Discussão da aula passada
- 2 Introdução
 - Introdução
- 3 **Correlação**
 - Associação entre duas variáveis contínuas
 - **Coeficiente de correlação de Pearson**
 - Interpretação
- 4 Resumo
 - Causalidade
 - Resumo
- 5 Aprofundamento
 - Aprofundamento

Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Introdução

Correlação

Associação

Pearson

Interpretação

Resumo

Aprofundamento

Definition

O coeficiente de correlação r é a medida da direção e força da associação entre duas variáveis.

Propriedades:

- É um número entre -1 e 1 .
- Mede a associação **linear** entre duas variáveis.
 - Diretamente proporcional, inversamente proporcional, ou ausência de proporcionalidade.

- Uma forte associação positiva corresponde a uma correlação próxima de 1.
- Uma forte associação negativa corresponde a uma correlação próxima de -1.
- A ausência de associação corresponde a uma correlação próxima de 0.

- Uma forte associação **positiva** corresponde a uma correlação próxima de 1.
- Uma forte associação negativa corresponde a uma correlação próxima de -1.
- A ausência de associação corresponde a uma correlação próxima de 0.

- Uma forte associação positiva corresponde a uma correlação próxima de 1.
- Uma forte associação **negativa** corresponde a uma correlação próxima de -1.
- A ausência de associação corresponde a uma correlação próxima de 0.

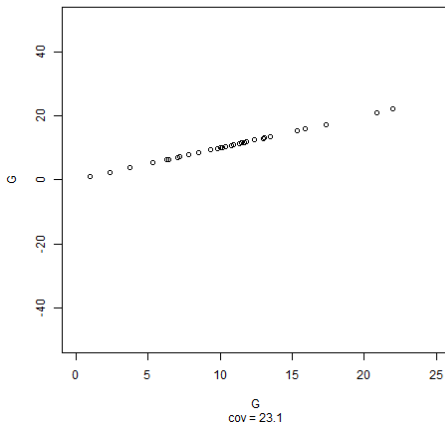
- Uma forte associação positiva corresponde a uma correlação próxima de 1.
- Uma forte associação negativa corresponde a uma correlação próxima de -1.
- A **ausência** de associação corresponde a uma correlação próxima de 0.

- Se tivéssemos os dados de toda a **população**, poderíamos calcular o **parâmetro** ρ
- Na prática, só podemos calcular a estatística r da amostra
- Utilizamos r como estimador para ρ , e testamos a significância estatística da forma usual

- Se tivéssemos os dados de toda a população, poderíamos calcular o parâmetro ρ
- Na prática, só podemos calcular a **estatística r da amostra**
- Utilizamos r como estimador para ρ , e testamos a significância estatística da forma usual

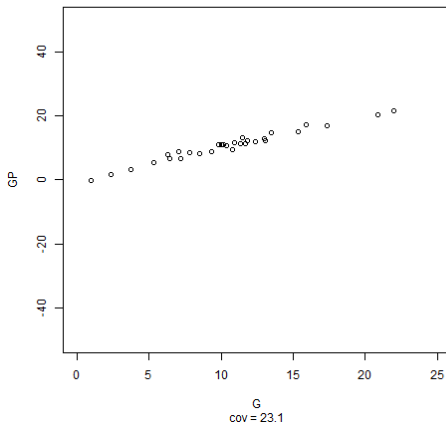
Exemplo

Pearson's product-moment correlation
data: G and G
 $t = 355110000$, $df = 28$, $p\text{-value} < 2.2e-16$
alternative hypothesis: true correlation is not equal to 0
95 percent confidence interval:
1 1
sample estimates:
cor
1



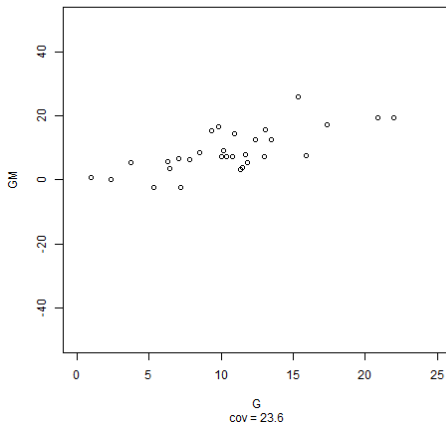
Exemplo

Pearson's product-moment correlation
data: G and GP
 $t = 28.803$, $df = 28$, $p\text{-value} < 2.2e-16$
alternative hypothesis: true correlation is not equal to 0
95 percent confidence interval:
0.9653236 0.992e2253
sample estimates:
cor
0.9835406



Exemplo

Pearson's product-moment correlation
data: G and GM
 $t = 5.6488$, $df = 28$, $p\text{-value} = 4.727e-06$
alternative hypothesis: true correlation is not equal to 0
95 percent confidence interval:
0.5013686 0.8631382
sample estimates:
cor
0.7298133



Exemplo

Pearson's product-moment correlation

data: G and GG

$t = 2.6943$, $df = 28$, $p\text{-value} = 0.01179$

alternative hypothesis: true correlation is not equal to 0

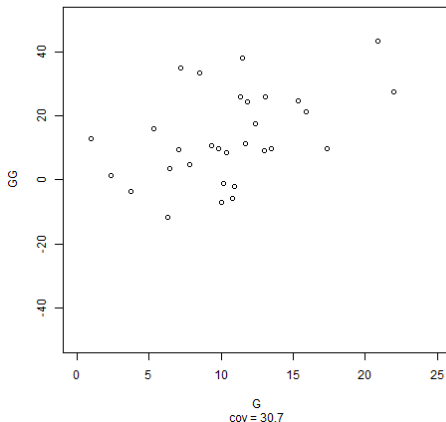
95 percent confidence interval:

0.1117472 0.6996458

sample estimates:

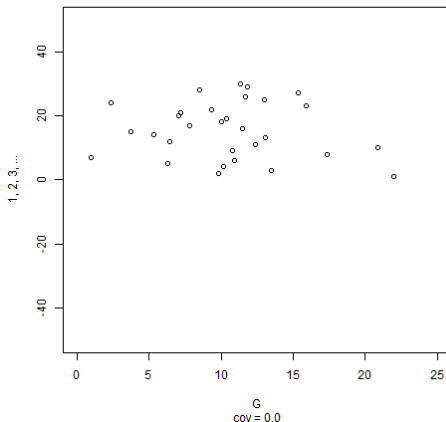
cor

0.4537489



Exemplo - amostras independentes

Pearson's product-moment correlation
data: G and seq(1, 30)
 $t = -0.64301$, $df = 28$, $p\text{-value} = 0.5254$
alternative hypothesis: true correlation is not equal to 0
95 percent confidence interval:
-0.4608704 0.2505266
sample estimates:
cor
-0.1206304



Example

Pesquisadores queriam entender por que a insulina varia tanto entre indivíduos. Imaginaram que a composição lipídica das células do músculo afetam a sensibilidade do músculo para a insulina. Para isto, eles injetaram insulina em 13 jovens adultos, e determinaram quanta glicose eles precisariam injetar nos sujeitos para manter o nível de glicose sanguínea constante. A quantidade de glicose injetada para manter o nível sanguíneo constante é, então, uma medida da sensibilidade à insulina.

(Fonte: Motulsky, 1995)

Example

Pesquisadores queriam entender por que a insulina varia tanto entre indivíduos. Imaginaram que a **composição lipídica** das células do músculo afetam a sensibilidade do músculo para a insulina. Para isto, eles injetaram insulina em 13 jovens adultos, e determinaram quanta glicose eles precisariam injetar nos sujeitos para manter o nível de glicose sanguínea constante. A quantidade de glicose injetada para manter o nível sanguíneo constante é, então, uma medida da sensibilidade à insulina.

(Fonte: Motulsky, 1995)

Example

Pesquisadores queriam entender por que a insulina varia tanto entre indivíduos. Imaginaram que a composição lipídica das células do músculo afetam a **sensibilidade do músculo para a insulina**. Para isto, eles injetaram insulina em 13 jovens adultos, e determinaram quanta glicose eles precisariam injetar nos sujeitos para manter o nível de glicose sanguínea constante. A quantidade de glicose injetada para manter o nível sanguíneo constante é, então, uma medida da sensibilidade à insulina.

(Fonte: Motulsky, 1995)

Example

Os pesquisadores fizeram uma pequena biópsia nos músculos para aferir a fração de ácidos graxos poli-insaturados que tem entre 20 e 22 carbonos (%C20-22). Como variável resposta, mediram o índice de sensibilidade à insulina.

Quais são as variáveis?

- Qual é a variável independente (X)?
- Qual é a variável dependente (Y)?

Quais são as variáveis?



Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Introdução

Correlação

Associação

Pearson

Interpretação

Resumo

Aprofundamento

- Dependente: insulina (contínua)
- Independente: conteúdo lipídico (contínua)

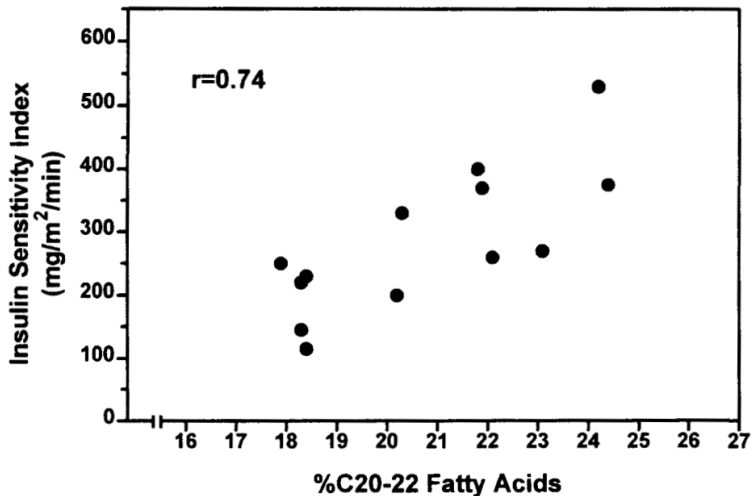
Esta relação pode ser expressa como

insulina \sim conteúdo lipídico

Table 17.1. Correlation Between %C20–22 and Insulin Sensitivity

% C20–22 Polyunsaturated Fatty Acids	Insulin Sensitivity (mg/m ² /min)
17.9	250
18.3	220
18.3	145
18.4	115
18.4	230
20.2	200
20.3	330
21.8	400
21.9	370
22.1	260
23.1	270
24.2	530
24.4	375

Exemplo: Diagrama de dispersão dos dados



Obs: na verdade, $r = 0.77$.

Exemplo

- O tamanho da amostra foi $n = 13$
- (Antigamente) consultávia-se o valor crítico de r na tabela
- H_0 : não há relação entre as variáveis na população ($H_0 : \rho = 0$).
- Observe: Quais são as informações necessárias para se consultar a tabela?

TABLE A-6		Critical Values of the Pearson Correlation Coefficient r	
n	$\alpha = .05$	$\alpha = .01$	
4	.950	.999	
5	.878	.959	
6	.811	.917	
7	.754	.875	
8	.707	.834	
9	.666	.798	
10	.632	.765	
11	.602	.735	
12	.576	.708	
13	.553	.684	
14	.532	.661	
15	.514	.641	
16	.497	.623	
17	.482	.606	
18	.468	.590	

- O valor crítico da tabela para uma amostra de tamanho 13 é $r_c = 0.553$
- A correlação calculada para esta amostra foi $r = 0.77$
- Como a correlação é maior que o valor crítico, a relação é estatisticamente significativa
- Conclusão: há evidências para rejeitar a H_0 que não há relação entre as variáveis.

- Pode-se também calcular o p-valor para o coeficiente de correlação r .
- Para este exemplo, teríamos $p = 0.0021$.
- Interpretação: se não houver relação entre as variáveis (H_0), existe apenas 0.21% de chance de observarmos uma correlação tão (ou mais) forte com um estudo deste tamanho

Por que as duas variáveis são tão correlacionadas?
Considere 4 possibilidades:

- 1 o conteúdo lipídico das membranas **determina** a sensibilidade à insulina
- 2 A sensibilidade à insulina de alguma forma afeta o conteúdo lipídico
- 3 tanto o conteúdo lipídico quanto a sensibilidade à insulina estão sob o efeito de algum outro fator (talvez algum hormônio)
- 4 as duas variáveis não são correlacionados na população, e a estimativa observada nessa amostra é mera coincidência

Por que as duas variáveis são tão correlacionadas?
Considere 4 possibilidades:

- 1 o conteúdo lipídico das membranas determina a sensibilidade à insulina
- 2 A sensibilidade à insulina de alguma forma **afeta** o conteúdo lipídico
- 3 tanto o conteúdo lipídico quanto a sensibilidade à insulina estão sob o efeito de algum outro fator (talvez algum hormônio)
- 4 as duas variáveis não são correlacionados na população, e a estimativa observada nessa amostra é mera coincidência

Por que as duas variáveis são tão correlacionadas?

Considere 4 possibilidades:

- 1 o conteúdo lipídico das membranas determina a sensibilidade à insulina
- 2 A sensibilidade à insulina de alguma forma afeta o conteúdo lipídico
- 3 tanto o conteúdo lipídico quanto a sensibilidade à insulina estão sob o efeito de **algum outro** fator (talvez algum hormônio)
- 4 as duas variáveis não são correlacionados na população, e a estimativa observada nessa amostra é mera coincidência

Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Introdução

Correlação

Associação

Pearson

Interpretação

Resumo

Aprofundamento

Por que as duas variáveis são tão correlacionadas?
Considere 4 possibilidades:

- 1 o conteúdo lipídico das membranas determina a sensibilidade à insulina
- 2 A sensibilidade à insulina de alguma forma afeta o conteúdo lipídico
- 3 tanto o conteúdo lipídico quanto a sensibilidade à insulina estão sob o efeito de algum outro fator (talvez algum hormônio)
- 4 as duas variáveis não são correlacionados na população, e a estimativa observada nessa amostra é **mera coincidência**

Repita várias vezes mentalmente

Correlação não implica causalidade

- Nunca devemos ignorar a última possibilidade (erro tipo I)!
- o p-valor indica quão rara é essa coincidência
- neste caso, em apenas 0.21% dos experimentos não haveria uma correlação real, e estaríamos cometendo um erro de interpretação

- 1 Discussão da aula passada
 - Discussão da aula passada
- 2 Introdução
 - Introdução
- 3 **Correlação**
 - Associação entre duas variáveis contínuas
 - Coeficiente de correlação de Pearson
 - **Interpretação**
- 4 Resumo
 - Causalidade
 - Resumo
- 5 Aprofundamento
 - Aprofundamento

Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Introdução

Correlação

Associação

Pearson

Interpretação

Resumo

Aprofundamento

- Se a correlação é 0, então X e Y não variam juntos (independentes)
- Se a correlação é positiva, então quando uma aumenta, a outra aumenta em proporção direta (linear)
- Se a correlação é negativa, então quando uma aumenta, a outra diminui em proporção inversa (linear)

- Duas variáveis podem **parecer** correlacionadas pois são influenciadas por uma terceira variável
- Ex: em alguns países a mortalidade infantil é negativamente correlacionada com o número de telefones per capita
- Mas comprar mais telefones não vai salvar crianças!
- Explicação alternativa: a melhoria da condições financeiras pode afetar ambas as variáveis

- 1 Discussão da aula passada
 - Discussão da aula passada
- 2 Introdução
 - Introdução
- 3 Correlação
 - Associação entre duas variáveis contínuas
 - Coeficiente de correlação de Pearson
 - Interpretação
- 4 **Resumo**
 - Causalidade
 - Resumo
- 5 Aprofundamento
 - Aprofundamento

Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Introdução

Correlação

Resumo

Causalidade
Resumo

Aprofundamento

- Se há uma relação de causalidade entre as duas variáveis, a correlação será não nula (positiva ou negativa)
- Quanto maior for a relação de dependência entre as variáveis, maior será o módulo da correlação.
- Se as variáveis não são relacionadas, a correlação será nula.

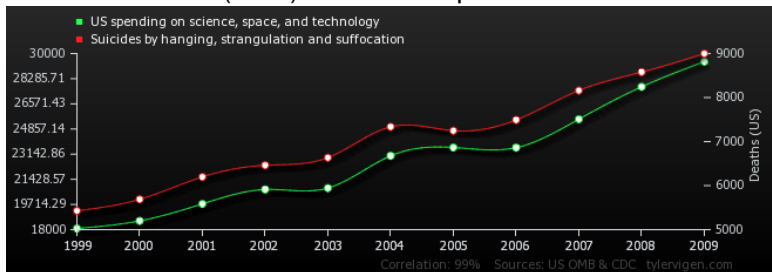
- Mas não podemos inverter a afirmativa lógica do slide anterior!
- Isto é, ao observar uma forte correlação, gostaríamos de concluir que uma variável **causa** este efeito na outra
- Infelizmente isto não é possível!
- Lembre-se: a significância do teste indica a probabilidade de se cometer um erro do tipo I (falso positivo).

Repita várias vezes mentalmente

Correlação não implica causalidade

Exemplo

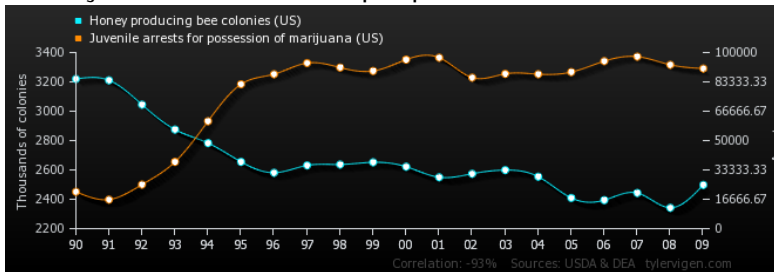
Gasto com C&T (EUA) x Suicídios por enforcamento



Correlação: 0.992082
(Fonte: Spurious correlations)

Exemplo

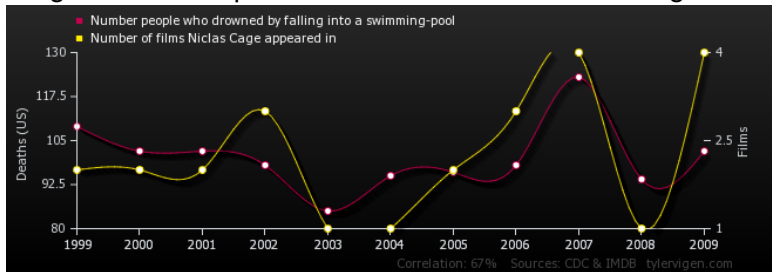
Produção de mel x Prisões por posse de maconha



Correlação: -0.933389
(Fonte: Spurious correlations)

Exemplo

Afogamentos em piscina x Filmes com Nicholas Cage



Correlação: 0.666004
(Fonte: Spurious correlations)

Repita várias vezes mentalmente

Correlação não implica causalidade

Causa e efeito

Ao encontrar uma forte correlação, deve-se sempre se perguntar:



- 1 Há uma relação direta de causa e efeito entre as variáveis? (X causa Y?)
- 2 Há uma relação inversa de causa e efeito entre as variáveis? (Y causa X?)
- 3 É possível que a relação entre as variáveis possa ser causada por uma terceira variável (ou mais) que não foi analisada?
- 4 É possível que a relação entre duas variáveis seja uma coincidência?

Estas perguntas estão fora do escopo da Bioestatística!

Cabe ao pesquisador investigar (e discutir) as possibilidades.

Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Introdução

Correlação

Resumo

Causalidade
Resumo

Aprofundamento

- 1 Discussão da aula passada
 - Discussão da aula passada
- 2 Introdução
 - Introdução
- 3 Correlação
 - Associação entre duas variáveis contínuas
 - Coeficiente de correlação de Pearson
 - Interpretação
- 4 **Resumo**
 - Causalidade
 - **Resumo**
- 5 Aprofundamento
 - Aprofundamento

Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Introdução

Correlação

Resumo

Causalidade
Resumo

Aprofundamento

- É necessário investigar a relação entre as variáveis!
- O que pode explicar a relação observada?

- 1 Discussão da aula passada
 - Discussão da aula passada
- 2 Introdução
 - Introdução
- 3 Correlação
 - Associação entre duas variáveis contínuas
 - Coeficiente de correlação de Pearson
 - Interpretação
- 4 Resumo
 - Causalidade
 - Resumo
- 5 Aprofundamento
 - Aprofundamento

Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Introdução

Correlação

Resumo

Aprofundamento

Aprofundamento

Leitura obrigatória

- Capítulo 17, pular as seções:
 - cálculo do r , do IC, do p -valor
 - correlação de Spearman, e seu cálculo
 - Interpretação do r^2

Exercícios selecionados

Capítulo 17, problemas **1**, **3** e **5**.

Problema **6**, usar:

$$r = 0.8868, IC_{95\%} = [0.4856, 0.9794], p = 0.0033. \textcolor{red}{r^2} = ?$$

Leitura recomendada

Capítulo 17: Interpretação do r^2 e Correlação de Spearman

Correlação
Linear

Felipe
Figueiredo

Discussão da
aula passada

Introdução

Correlação

Resumo

Aprofundamento

Aprofundamento