Смешанные линейные модели (вложенные случайные факторы)

Линейные модели...

Марина Варфоломеева, Вадим Хайтов

Кафедра Зоологии беспозвоночных, Биологический факультет, СПбГУ



Вы узнаете

Что такое вложенные случайные факторы и в каких случаях они применяются

Вы сможете

- Объяснить, что такое вложенные случайные факторы
- Привести примеры иерархических случайных факторов
- Вычислить коэффициент внутриклассовой корреляции для случая с двумя вложенными случайными факторами
- Подобрать смешанную линейную модель со вложенными случайными факторами



Смешанные модели со вложенными случайными факторами





Факторы образуют иерархическую последовательность вложенности

лес -> дерево в лесу -> ветка на дереве -> наблюдение (личинки насекомых)



Факторы образуют иерархическую последовательность вложенности

лес -> дерево в лесу -> ветка на дереве -> наблюдение (личинки насекомых)

Внутри каждого уровня главного фактора будут разные (нестрого сопоставимые) уровни вложенного фактора

Деревья, с которых собирали личинок, будут разные в разных лесах (разные экземпляры).



Факторы образуют иерархическую последовательность вложенности

лес -> дерево в лесу -> ветка на дереве -> наблюдение (личинки насекомых)

Внутри каждого уровня главного фактора будут разные (нестрого сопоставимые) уровни вложенного фактора

Деревья, с которых собирали личинок, будут разные в разных лесах (разные экземпляры).

Уровни вложенных факторов описывают иерархию взаимного сходства наблюдений

Личинки с разных деревьев из одного леса имеют право быть похожими друг на друга больше, чем на личинок из другого леса

Личинки на одном дереве имеют право быть похожими друг на друга больше, чем на личинок с другого дерева И т.п.



Другие примеры вложенных факторов

- регион -> город -> больница -> наблюдение (пациент)
- самка -> выводок -> наблюдение (особь)
- лес -> дерево в лесу -> гнездо на дереве -> наблюдение (птенец)
- улитка -> спороциста в улитке -> наблюдение (редия)



Пример: Высота растений и выпас скота

Вообще-то, статья Gennet et al. 2017 о птицах, но чтобы про них что-то лучше понять, нужно разобраться с их местообитанием.

Как в разные годы высота растительного покрова зависит от выпаса скота, экспозиции склона и проективного покрытия местных растений?

Зависимая переменная:

▶ height - высота растительного покрова

Предикторы:

- graze выпас коров (0, 1)
- AspectCat экспозиция (S, N)
- nativecov покрытие местной флоры %
- slope наклон
- vear год наблюдений
- Park парк
- plotID уникальный идентификатор участка

Данные: Gennet, S., Spotswood, E., Hammond, M. and Bartolome, J.W., 2017. Livestock grazing supports native plants and songbirds in a California annual grassland. PloS one, 12(6), p.e0176367.

Открываем данные

Исходные данные не опрятны (this data is not tidy)! Каждый участок в каждом году фигурирует два раза (т.к. информация о присутствии-отсутствии каких-то видов на участке записана в разных строчках). Откроем и переформатируем данные так, чтобы не было дублирования и каждому участку соответствовала одна строчка.

```
library(readxl)
library(tidyr)
gr <- read_excel("data/Grazing_native_plants_Gennet_et_al._2017_S1.xlsx")
graz <- gr %>% spread(Species, presence)
```

Знакомство с данными

Есть ли пропущенные значения?

```
sum(is.na(graz))
# [1] 0
Сколько участков было в каждом парке в каждый год?
with(graz, table(Park, year))
      year
  Park 2004 2005 2006 2007 2008 2009 2010 2011
    MT
          6
              10
                    10
                         10
                              10
                                    10
                                         10
                                               10
    PR
          6
               6
                     6
                          6
                               6
                                     6
                                          6
                                     9
    SU
          0
                               9
    VC
         10
               10
                    10
                         10
                               11
                                    11
                                         11
                                               11
```

Как закодированы переменные?

\$ WEME

```
str(graz)
 tibble [271 x 18] (S3: tbl df/tbl/data.frame)
   $ plotID
                : chr [1:271] "MT1" "MT2" "MT3" "MT4" ...
   $ Plot
                : num [1:271] 1 2 3 4 5 6 4 5 6 7 ...
   $ Park
                : chr [1:271] "MT" "MT" "MT" "MT"
   $ vear
                : num [1:271] 2004 2004 2004 2004 2004 ...
   $ graze
                : num [1:271] 0 0 0 1 1 1 1 1 1 1 ...
   $ Aspect
                : num [1:271] 146 250 262 190 274 ...
                  chr [1:271] "S" "S" "S" "S"
   $ AspectCat
  $ heatloadrel: num [1:271] 0.03 1.35 2.06 0.31 1.83 0.95 0.03 2.06 0.7 1.22 ...
   $ slope
                : num [1:271] 37.8 41.1 35.4 28 58.9 ...
                : num [1:271] 0 0.36 1.43 0 1.07 ...
   $ nativecov
   $ litt
                  num [1:271] 28.21 31.43 11.07 8.93 18.57 ...
   $ bare
                  num [1:271] 0 0.357 9.286 4.643 7.857 ...
   $ height
                  num [1:271] 29.2 26.2 23.2 11.9 19.3 ...
   $ htstdev
                  num [1:271] 16.14 15.41 15.47 8.25 10.45 ...
                : num [1:271] 0.553 0.587 0.666 0.695 0.541 ...
   $ cov
   $ GRSP
                : num [1:271] 0 0 0 0 1 0 1 1 0 0 ...
   $ HOLA
                  num [1:271] 0 0 0 1 1 1 1 1 0 0 ...
```

: num [1:271] 0 1 0 1 1 0 0 1 0 1 ...



Наводим порядок

```
Сделаем факторами переменные, которые понадобятся для модели
graz$graze_f <- factor(graz$graze)
graz$AspectCat <- factor(graz$AspectCat)
graz$year_f <- factor(graz$year)

Извлечем корень из обилия местных видов
graz$nativecov_sq <- sqrt(graz$nativecov)
```



Модель

Вспомним главный вопрос исследования и подберем модель

Как в разные годы высота растительного покрова зависит от выпаса скота, экспозиции склона и проективного покрытия местных растений?



Модель

Вспомним главный вопрос исследования и подберем модель

Как в разные годы высота растительного покрова зависит от выпаса скота, экспозиции склона и проективного покрытия местных растений?

Нам нужно учесть, что в разные годы из-за кучи разных причин высота растений может различаться

Кроме того, нужно учесть, что в разных парках и на разных участках растения будут расти сходным образом в разные годы. У нас есть иерархические факторы парк и участок в парке

Подбираем модель методом максимального правдоподобия, т.к. она нам понадобится, чтобы проверить значимость фиксированных эффектов при помощи теста отношения правдоподобий.

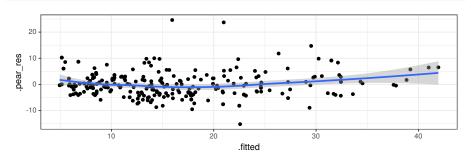
Анализ остатков

```
# Данные для анализа остатков
ML1_diag <- data.frame(
  graz,
  .pear_res = residuals(ML1, type = "pearson"),
  .fitted = fitted(ML1, type = "response"))</pre>
```



График остатков

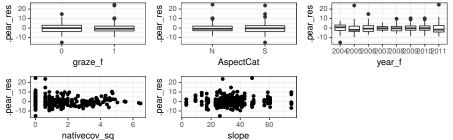
```
library(ggplot2); library(cowplot); theme_set(theme_bw())
gg_res <- ggplot(data = ML1_diag, aes(y = .pear_res))
gg_res + geom_point(aes(x = .fitted)) +
    geom_smooth(aes(x = .fitted))</pre>
```





Графики остатков от переменных в модели

```
plot_grid(gg_res + geom_boxplot(aes(x = graze_f)),
gg_res + geom_boxplot(aes(x = AspectCat)),
gg_res + geom_boxplot(aes(x = year_f)),
gg_res + geom_point(aes(x = nativecov_sq)),
gg_res + geom_point(aes(x = slope)),
ncol = 3)
```



▶ Паттерн на графике nativecov_sq. Возможно, здесь нужно использовать GAMM.



Графики остатков от переменных не в модели

-10

-10

0.0

0.5 1.0 1.5 2.0

heatloadrel

```
plot_grid(
    gg_res + geom_point(aes(x = heatloadrel)),
    gg_res + geom_point(aes(x = sqrt(litt))),
    gg_res + geom_point(aes(x = sqrt(bare))),
    ncol = 3)
```

- Паттерн на графике heatloadrel - Возможно, есть тренд на графике sqrt(litt)

sqrt(litt)

sqrt(bare)

Тесты отношения правдоподобий для полной модели

Модель ML1 была подобрана при помощи ML, поэтому можно применять тесты отношения правдоподобий прямо к ней

```
# Single term deletions
# Model:
# height ~ graze f * AspectCat + year f + nativecov sq + slope +
     (1 | Park/plotID)
                        AIC
                               LRT
                                     Pr(Chi)
                   Df
# <none>
                     1729.4
                  7 1819.8 104.405 < 2.2e-16 ***
# year f
# nativecov sq 1 1728.9 1.478 0.224030
# slope
                 1 1727.8 0.450 0.502530
# graze f:AspectCat 1 1736.3 8.956 0.002765 **
# Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
```

Высота растительного покрова:

drop1(ML1, test = 'Chi')

- на склонах разной экспозиции по-разному зависит от выпаса скота (достоверное взаимодействие)
- различается в разные годы
- не зависит от покрытия местных растений и крутизны склона



Задание 1

Рассчитайте внутриклассовую корреляцию

- Для наблюдений на одном и том же участке
- Для наблюдений в одном и том же парке



Внутриклассовая корреляция

```
Для расчета внутриклассовой корреляции нужна модель, подобранная при помощи
REML
```

```
REML1 <- lmer(height ~ graze f*AspectCat + year f +
                nativecov sq + slope + (1|Park/plotID),
           data = graz, REML = TRUE)
```

```
summary (REML1)
```

```
# Linear mixed model fit by REML ['lmerMod']
# Formula:
# height ~ graze f * AspectCat + year f + nativecov sg + slope +
     (1 | Park/plotID)
    Data: graz
# REML criterion at convergence: 1677.9
# Scaled residuals:
     Min 10 Median
                              30
                                    Max
 -2.9236 -0.6372 -0.0822 0.4329 4.7964
# Random effects:
# Groups
              Name
                      Variance Std.Dev.
  plotID:Park (Intercept) 11.358 3.370
  Park
              (Intercept) 2.478 1.574
  Residual
                          26.351
                                  5.133
# Number of obs: 271, groups: plotID:Park, 36; Park, 4
```

Estimate Std. Error t value

18.44905

Fixed effects:

(Intercept)



Внутриклассовая корреляция

```
Для наблюдений на одном и том же участке \sigma_{plotID}^2/(\sigma_{plotID}^2+\sigma_{Park}^2+\sigma^2) 3.370^2 / (1.574^2 + 3.370^2 + 5.133^2) # [1] 0.282636 Для наблюдений в одном и том же парке \sigma_{Park}^2/(\sigma_{plotID}^2+\sigma_{Park}^2+\sigma^2) 1.574^2 / (1.574^2 + 3.370^2 + 5.133^2)
```

```
В результатах summary(REML1)
```

[1] 0.06165626

```
Random effects:
Groups Name Variance Std.Dev.
plotID:Park (Intercept) 11.358 3.370
Park (Intercept) 2.478 1.574
Residual 26.351 5.133
Number of obs: 271. groups: plotID:Park, 36: Park, 4
```

 Значения высоты травяного покрова похожи внутри участка. Сходство наблюдений внутри одного парка слабее.



Результаты полной модели

summary(REML1)

vear f2009

```
# Linear mixed model fit by REML ['lmerMod']
# Formula:
# height ~ graze f * AspectCat + year f + nativecov sq + slope +
     (1 | Park/plotID)
    Data: graz
# REML criterion at convergence: 1677.9
# Scaled residuals:
     Min
              10 Median
                             30
                                   Max
 -2.9236 -0.6372 -0.0822 0.4329 4.7964
# Random effects:
  Groups
              Name
                        Variance Std.Dev.
  plotID:Park (Intercept) 11.358 3.370
  Park
              (Intercept) 2.478 1.574
                         26.351
  Residual
                                 5.133
# Number of obs: 271, groups: plotID:Park, 36; Park, 4
# Fixed effects:
                    Estimate Std. Error t value
# (Intercept)
                    18.44905 3.09232
                                         5.966
# graze f1
                    -5.25429 2.71311 -1.937
# AspectCatS
                     8.57170 2.75561 3.111
# year f2005
                     6.80750 1.42386 4.781
                   4.07972 1.41616 2.881
# year_f2006
                  -0.58734 1.42261 -0.413
# year_f2007
                   -2.70376 1.40999 -1.918
# vear f2008
```

1.40996

-1.909

-2.69192

Данные для графика предсказаний фиксированной части модели

Используем для визуализации модель, подобранную при помощи REML

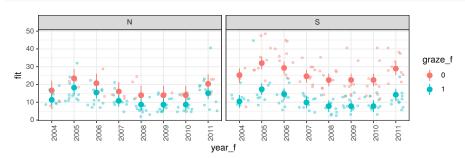
```
# Исходные данные
NewData_REML1 <- expand.grid(graze_f = levels(graz$graze_f),</pre>
            AspectCat = levels(graz$AspectCat),
            year f = levels(graz$year f))
NewData REML1$nativecov sq <- mean(graz$nativecov sq)
NewData REML1$slope <- mean(graz$slope)</pre>
# Предсказанные значения при помощи матриц
X <- model.matrix(~ graze f * AspectCat + year f + nativecov sq + slope,
                  data = NewData REML1)
betas = fixef(REML1)
NewData REML1sfit <- X %*% betas
# Стандартные ошибки и дов. интервалы
NewData REML1$se <- sqrt( diag(X %*% vcov(REML1) %*% t(X)) )</pre>
NewData REML1$lwr <- NewData REML1$fit - 2 * NewData REML1$se
NewData REML1$upr <- NewData REML1$fit + 2 * NewData REML1$se
```



График предсказаний фиксированной части модели

На южных склонах высота травы выше там, где не пасут скот, а на северных нет. (Строго говоря, нужен еще пост хок тест, чтобы это утверждать.)

```
ggplot(data = NewData_REML1, aes(x = year_f, y = fit, colour = graze_f)) +
    geom_pointrange(aes(ymin = lwr, ymax = upr)) +
    facet_wrap(~ AspectCat) +
    geom_jitter(data = graz, aes(y = height), alpha = 0.35, size = 1) +
    theme(axis.text.x = element_text(angle = 90))
```



Вариант решения с подбором оптимальной модели (самостоятельно)



Задание 2

Оптимизируйте модель с предыдущего шага

Сделайте анализ остатков

Опишите и визуализируйте финальную модель



Решение: Подбор оптимальной модели (1)

Для подбора оптимальной модели воспользуемся тестами отношения правдоподобий. Для него нужно использовать модели, подобранные при помощи ML dropl(ML1, test = "Chi")

```
# Single term deletions
# Model:
# height ~ graze f * AspectCat + year f + nativecov sq + slope +
     (1 | Park/plotID)
                        AIC
                                LRT
                                      Pr(Chi)
                   Df
# <none>
                      1729.4
# year f
                   7 1819.8 104.405 < 2.2e-16 ***
# nativecov sq
                    1 1728.9
                            1.478 0.224030
# slope
                   1 1727.8 0.450 0.502530
# graze f:AspectCat 1 1736.3 8.956 0.002765 **
# Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
```



Решение: Подбор оптимальной модели (2)

```
ML1.1 <- update(ML1, .~.-slope)
drop1(ML1.1, test = "Chi")
# Single term deletions
# Model:
# height ~ graze_f + AspectCat + year_f + nativecov_sq + (1 | Park/plotID) +
     graze f:AspectCat
                  Df
                        AIC
                            LRT
                                    Pr(Chi)
# <none>
                     1727.8
                 7 1818.1 104.277 < 2.2e-16 ***
# year f
# nativecov sq 1 1727.5 1.681 0.194802
# graze f:AspectCat 1 1734.4 8.535 0.003484 **
# Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
```

Решение: Подбор оптимальной модели (3)

```
ML1.2 <- update(ML1.1, .~.-nativecov_sq)
drop1(ML1.2, test = "Chi")

# Single term deletions
# Model:
# height ~ graze_f + AspectCat + year_f + (1 | Park/plotID) + graze_f:AspectCat
# Df AIC LRT Pr(Chi)
# <none> 1727.5
# year_f 7 1818.7 105.152 < 2.2e-16 ***
# graze_f:AspectCat 1 1733.6 8.087 0.004458 **
# ---
# Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
```

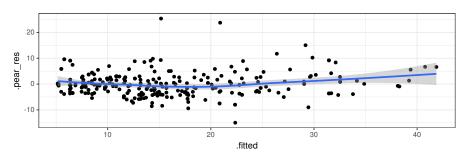
Решение: Анализ остатков

```
# Данные для анализа остатков
ML1.2_diag <- data.frame(
  graz,
  .pear_res = residuals(ML1.2, type = "pearson"),
  .fitted = fitted(ML1.2, type = "response"))</pre>
```



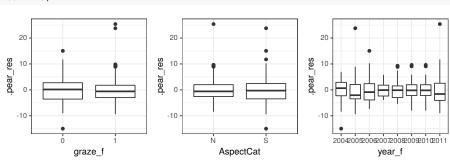
Решение: График остатков

```
gg_res <- ggplot(data = ML1.2_diag, aes(y = .pear_res))
gg_res + geom_point(aes(x = .fitted)) +
  geom_smooth(aes(x = .fitted))</pre>
```



Решение: Графики остатков от переменных в модели

```
plot_grid(gg_res + geom_boxplot(aes(x = graze_f)),
gg_res + geom_boxplot(aes(x = AspectCat)),
gg_res + geom_boxplot(aes(x = year_f)),
ncol = 3)
```





Решение: Графики остатков от переменных не в модели

```
plot grid(
  gg res + geom point(aes(x = heatloadrel)),
  gg res + geom point(aes(x = sqrt(litt))),
  gg res + geom point(aes(x = sqrt(bare))),
  gg res + geom point(aes(x = nativecov sq)),
  gg res + geom point(aes(x = slope)),
  ncol = 3)
                                                                 bear res
                                 pear_res
      0.0
            0.5
              heatloadrel
                                                sqrt(litt)
                                                                               sqrt(bare)
                                 pear_res
 pear res
                                    10
                                    0
                                            20
                                                         60
             nativecov sq
                                                slope
```

- Паттерн на графике heatloadrel, nativecov sq



Решение: Тестируем влияние факторов в финальной модели

Для тестов отношения правдоподобий используем финальную модель, подобранную при помощи ML

Высота растительного покрова:

drop1(ML1.2, test = 'Chi')

- на склонах разной экспозиции по-разному зависит от выпаса скота (достоверное взаимодействие)
- различается в разные годы
- не зависит от покрытия местных растений и крутизны склона

Решение: Описываем результаты

Для описания результатов используем модель, подобранную при помощи REML, т.к. он дает более точные оценки случайных эффектов

REML1.2 <- update(ML1.2, REML = TRUE)</pre>

Решение: Результаты

```
summarv(REML1.2)
```

" £2011

```
# Linear mixed model fit by REML ['lmerMod']
# Formula:
# height ~ graze f + AspectCat + year f + (1 | Park/plotID) + graze f:AspectCat
    Data: graz
# REML criterion at convergence: 1675.6
# Scaled residuals:
     Min
              10 Median
                             30
                                   Max
# -2.9168 -0.6306 -0.0791 0.4264 4.9848
# Random effects:
# Groups
             Name
                        Variance Std.Dev.
  plotID:Park (Intercept) 13.761 3.710
  Park
              (Intercept) 1.385 1.177
  Residual
                         25.916
                                 5.091
# Number of obs: 271, groups: plotID:Park, 36; Park, 4
# Fixed effects:
                    Estimate Std. Error t value
# (Intercept)
                     16.4077 2.7767 5.909
# graze_f1
                             2.7602 -2.057
                     -5.6782
# AspectCatS
                      9.4404
                             2.8750 3.284
# vear f2005
                    6.6263
                             1.4043 4.719
# year f2006
                   4.1314
                            1.4043 2.942
# year_f2007
                     -0.3683 1.4043 -0.262
                    -2.7041 1.3982 -1.934
# year_f2008
                    -2.6896 1.3982 -1.924
# vear f2009
# vear f2010
                     -2.6896
                                1.3982 -1.924
```

2 0072

Решение: Внутриклассовая корреляция

Для расчета нужна модель, подобранная при помощи REML

```
Groups Name Variance Std.Dev. plotID:Park (Intercept) 13.761 3.710 Park (Intercept) 1.384 1.177 Residual 25.916 5.091 Number of obs: 271, groups: plotID:Park, 36; Park, 4 Для наблюдений на одном и том же участке \sigma^2_{plotID}/(\sigma^2_{plotID}+\sigma^2_{Park}+\sigma^2) 3.710^2 / (1.177^2 + 3.710^2 + 5.091^2) # [1] 0.3351563 Для наблюдений в одном и том же парке \sigma^2_{Park}/(\sigma^2_{plotID}+\sigma^2_{Park}+\sigma^2) 1.177^2 / (1.177^2 + 3.7010^2 + 5.091^2)
```

[1] 0.03378768

Random effects:

 Значения высоты травяного покрова похожи внутри участка. Сходство наблюдений внутри одного парка слабее.

Решение: Данные для графика предсказаний фиксированной части модели

Используем для визуализации модель, подобранную при помощи REML

```
# Исходные данные
NewData_REML1.2 <- expand.grid(graze_f = levels(graz$graze_f),</pre>
            AspectCat = levels(graz$AspectCat),
            year_f = levels(graz$year_f))
NewData REML1.2$nativecov sq <- mean(graz$nativecov sq)</pre>
NewData REML1.2$slope <- mean(graz$slope)</pre>
# Предсказанные значения при помощи матриц
X <- model.matrix(~ graze f * AspectCat + year f, data = NewData REML1.2)
betas = fixef(REML1.2)
NewData REML1.2$fit <- X %*% betas
# Стандартные ошибки и дов. интервалы
NewData REML1.2$se <- sqrt( diag(X %*% vcov(REML1.2) %*% t(X)) )
NewData REML1.2$lwr <- NewData REML1.2$fit - 2 * NewData REML1.2$se
NewData REML1.2supr <- NewData REML1.2sfit + 2 * NewData REML1.2sse
```

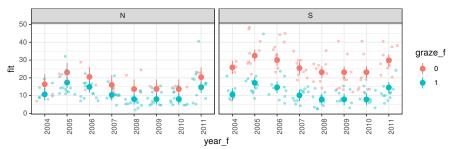


Решение: График предсказаний фиксированной части модели

На южных склонах высота травы выше там, где не пасут скот, а на северных нет. (Строго говоря, нужен еще пост хок тест, чтобы это утверждать)

Не удивляйтесь тому, что график похож на предыдущий, т.к. те факторы, которые мы удалили из модели и так не влияли.

```
ggplot(data = NewData_REML1.2, aes(x = year_f, y = fit, colour = graze_f)) +
    geom_pointrange(aes(ymin = lwr, ymax = upr)) +
    facet_wrap(~ AspectCat) +
    geom_jitter(data = graz, aes(y = height), alpha = 0.35, size = 1) +
    theme(axis.text.x = element_text(angle = 90))
```





Take-home messages

- Случайные факторы в смешанных моделях могут быть вложены друг в друга
- Есть два способа подбора коэффициентов в смешанных моделях: МL и REML. Для разных этапов анализа важно, каким именно способом подобрана модель.



Дополнительные ресурсы

- Crawley, M.J. (2007). The R Book (Wiley).
- Faraway, J. J. (2017). Extending the linear model with R: generalized linear, mixed effects and nonparametric regression models (Vol. 124). CRC press.
- Zuur, A. F., Hilbe, J., & Ieno, E. N. (2013). A Beginner's Guide to GLM and GLMM with R: A Frequentist and Bayesian Perspective for Ecologists. Highland Statistics.
- Zuur, A.F., Ieno, E.N., Walker, N., Saveliev, A.A., and Smith, G.M. (2009). Mixed Effects Models and Extensions in Ecology With R (Springer)
- ▶ Pinheiro, J., Bates, D. (2000). Mixed-Effects Models in S and S-PLUS. Springer