

Folien für das Modul 'Praxis der Datenanalyse'

FOM – WS17

Grobgliederung

- Vorwort
- Organisatorisches
- Rahmen
- Daten einlesen
- Datenjudo
- Daten visualisieren
- Grundlagen des Modellierens
- Der p-Wert
- Lineare Regression
- Klassifizierende (logistische) Regression
- Clusteranalyse
- Dimensionsreduktion
- Textmining
- Anhang

Vorwort

- ▶ Diese Folien vermitteln *nicht* den Stoff. Sie visualisieren nur einige zentrale Ideen.
- ▶ Der Stoff wird vom Skript vermittelt. Nutzen Sie das Skript zum eigentlichen Arbeiten.

Organisatorisches

Die Studierenden können nach erfolgreichem Abschluss des Moduls:

- ▶ den Ablauf eines Projekts aus der Datenanalyse in wesentlichen Schritten nachvollziehen,
- ▶ Daten aufbereiten und ansprechend visualisieren,
- ▶ Inferenzstatistik anwenden und kritisch hinterfragen,
- ▶ klassische Vorhersagemethoden (Regression) anwenden,
- ▶ moderne Methoden der angewandten Datenanalyse anwenden (z.B. Textmining),
- ▶ betriebswirtschaftliche Fragestellungen mittels datengetriebener Vorhersagemodellen beantworten.

2. Organisatorisches Themen pro Termin (insgesamt 44UE Lehre)

Termin	Thema / Kapitel
1	Organisatorisches
1	Einführung
1	Rahmen
1	Daten einlesen
2	Datenjudo
3	Daten visualisieren
4	Fallstudie (z.B. zu 'movies')
5	Daten modellieren
5	Der p-Wert
6	Lineare Regression - metrisch
7	Lineare Regression - kategorial
8	Fallstudie (z.B. zu 'titanic' und 'affairs')
9	Vertiefung 1: Textmining oder Clusteranalyse
10	Vertiefung 2: Dimensionsreduktion
11	Wiederholung

2. Organisatorisches Prüfung - Allgemeine Hinweise

- ▶ Die Prüfung besteht aus zwei Teilen
 - ▶ einer Klausur (50% der Teilnote)
 - ▶ einer Datenanalyse (50% der Teilnote).

Prüfungsrelevant ist der gesamte Stoff aus dem Skript und dem Unterricht mit **einigen Ausnahmen**

Alle Hinweise zur Prüfung gelten nur insoweit nicht anders vom Dozenten festgelegt.

2. Organisatorisches Klausur und Datenanalyse

Klausur

- ▶ Hinweise zur Klausur finden Sie [hier](#).
- ▶ Im Skript finden Sie eine [Probeklausur](#).
- ▶ Lernaufgaben finden sich im Skript am Ende jedes Kapitels.

Datenanalyse

- ▶ Hinweise zur Datenanalyse finden Sie [hier](#).
- ▶ Die Datenanalyse wird (in fast jeder Stunde) praktisch eingeübt.
- ▶ Beispiele für gute Datenanalysen von Studierenden finden Sie [hier](#) (im OC).

Rahmen

- ▶ Einen Überblick über die fünf wesentliche Schritte der Datenanalyse gewinnen.
- ▶ R und RStudio installieren können.
- ▶ Einige häufige technische Probleme zu lösen wissen.
- ▶ R-Pakete installieren können.
- ▶ Einige grundlegende R-Funktionalitäten verstehen.
- ▶ Auf die Frage “Was ist Statistik?” eine Antwort geben können.

3. Rahmen

Prozess der Datenanalyse - Überblick über das Modul

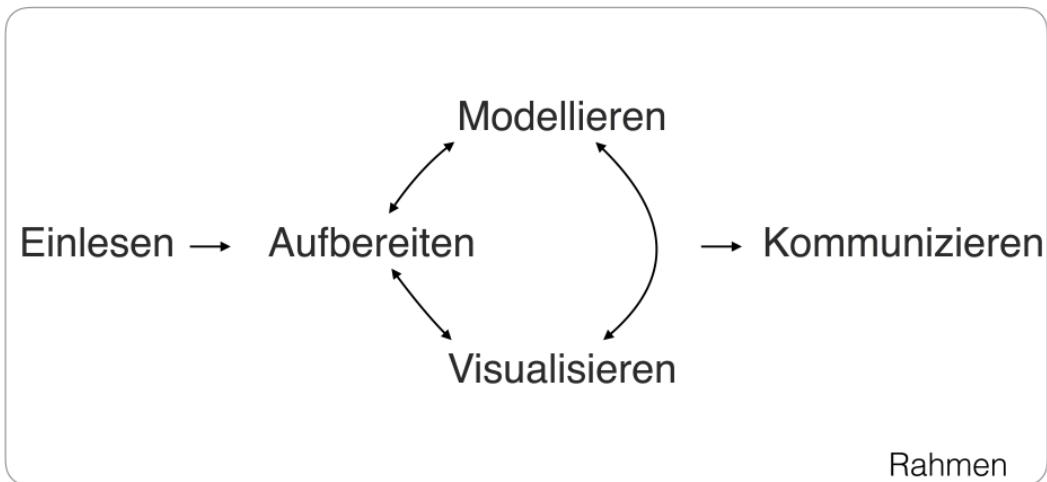


Abbildung 1: Der Prozess der Datenanalyse

3. Rahmen

R und RStudio installieren

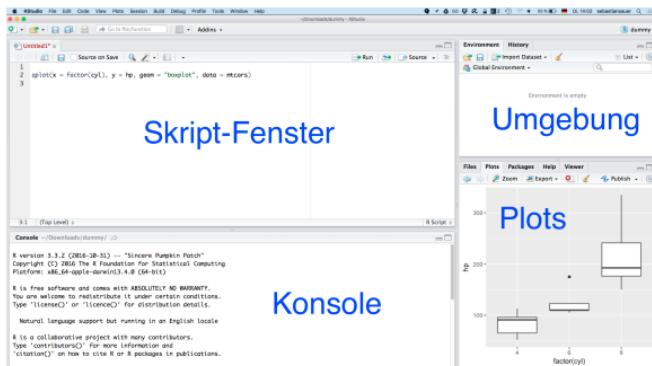


Abbildung 2: RStudio

Bitte laden Sie sich diesen Ordner [Github-Repositorium](#) herunter. Dazu klicken Sie auf den grünen Button "Clone or Download", wählen Sie dann "Download Zip". Daraufhin wird dieser Ordner heruntergeladen.

Beliebte Fehler beim Installieren von Paketen:

- `install.packages(dplyr)`
- `install.packages("dliar")`
- `install.packages("derpyler")`
- `install.packages("dplyr") # dependencies vergessen`
- Keine Internet-Verbindung
- `library(dplyr) # ohne vorher zu installieren`

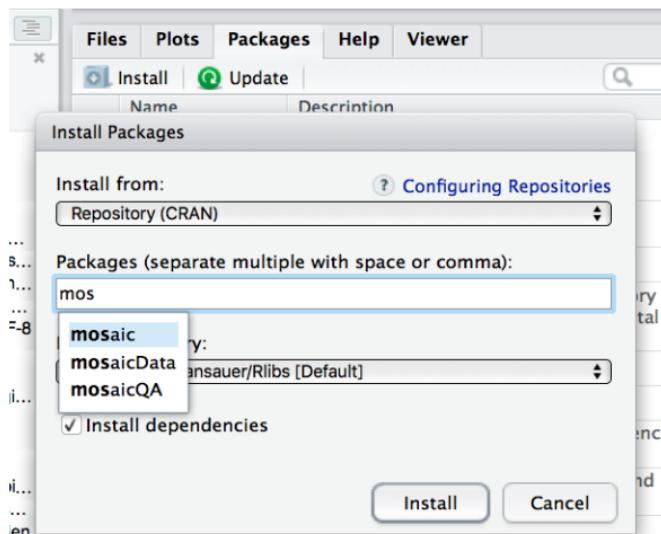


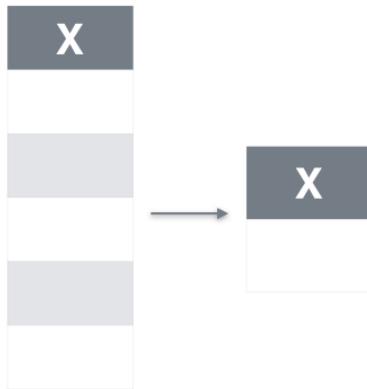
Abbildung 3: So installiert man Pakete in RStudio

3. Rahmen Datensätze

Alle Datensätze liegen im Ordner data/, den Sie vom [Github-Repositorium](#) herunterladen können.

Eine Antwort dazu ist, dass Statistik die Wissenschaft von Sammlung, Analyse, Interpretation und Kommunikation von Daten ist mithilfe mathematischer Verfahren ist und zur Entscheidungshilfe beitragen soll.

Deskriptivstatistik



Inferenzstatistik

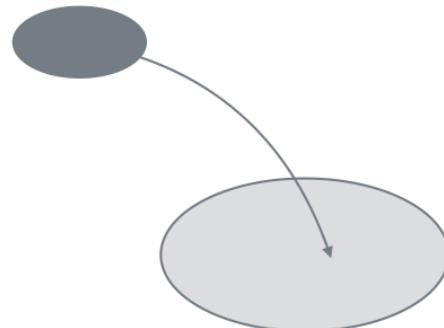


Abbildung 4: Sinnbild für die Deskriptiv- und die Inferenzstatistik

Prämissse 1: Wenn Modell M wahr ist,
dann sollten die Daten das Muster D aufweisen.

Prämissse 2: Die Daten weisen das Muster D auf.

Konklusion: Daher muss das Modell M wahr sein.

Die Konklusion ist *nicht* zwangsläufig richtig.

Daten einlesen

- ▶ Wissen, was eine CSV-Datei ist.
- ▶ Wissen, was UTF-8 bedeutet.
- ▶ Erläutern können, was R unter dem "working directory" versteht.
- ▶ Erkennen können, ob eine Tabelle in Normalform vorliegt.
- ▶ Daten aus R hinauskriegen (exportieren).

Dieses Kapitel beantwortet eine Frage: "Wie kriege ich Daten in vernünftiger Form in R hinein?".

4. Daten einlesen

Prozess der Datenanalyse – Einlesen

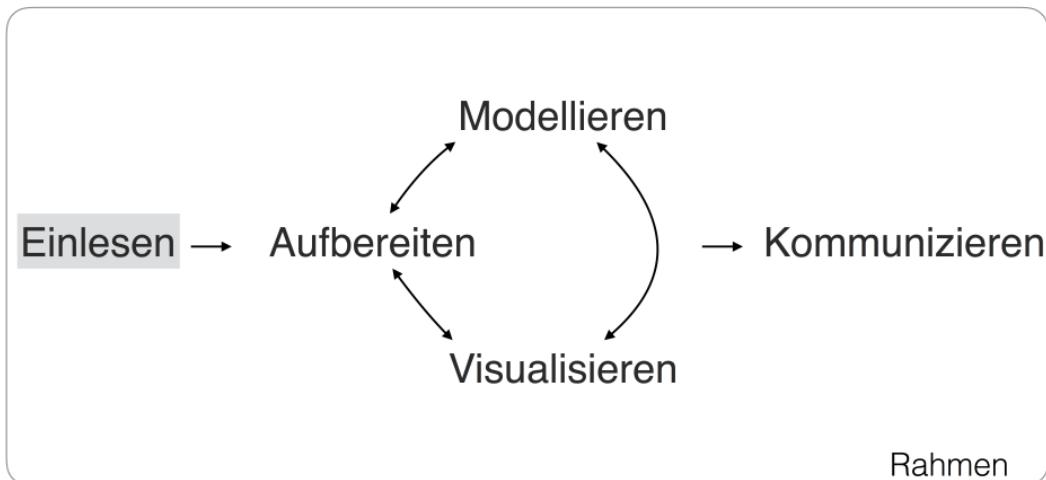


Abbildung 5: Daten sauber einlesen

4. Daten einlesen

Daten (CSV, XLS,...) mit RStudio importieren

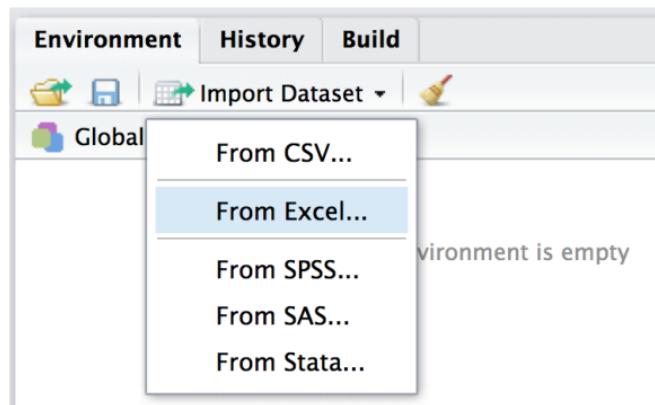


Abbildung 6: Daten einlesen (importieren) mit RStudio

4. Daten einlesen

CSV-Dateien sind einer der wichtigsten Daten-Formate

```
row_number,date_time,study_time,self_eval,interest,score
1,05.01.2017 13:57:01,5,8,5,29
2,05.01.2017 21:07:56,3,7,3,29
3,05.01.2017 23:33:47,5,10,6,40
4,06.01.2017 09:58:05,2,3,2,18
5,06.01.2017 14:13:08,4,8,6,34
6,06.01.2017 14:21:18,NA,NA,NA,39
```

4. Daten einlesen

Das Arbeitsverzeichnis mit RStudio wählen

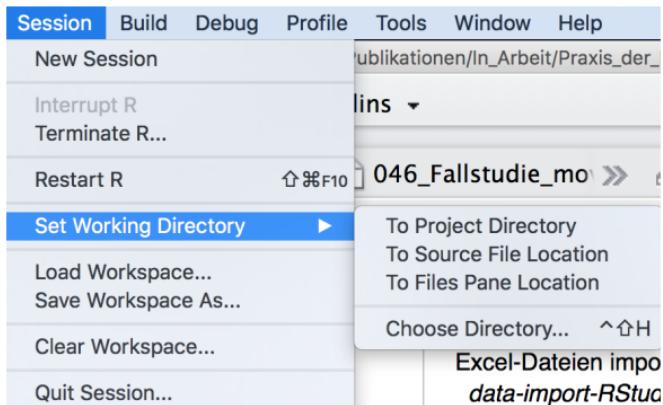


Abbildung 7: Das Arbeitsverzeichnis mit RStudio auswählen

4. Daten einlesen

Normalform einer Tabelle

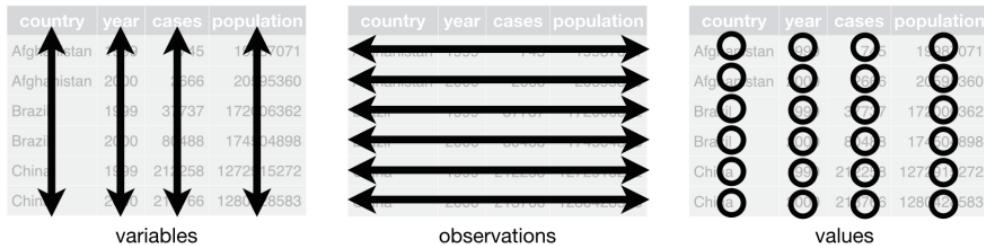


Abbildung 8: Schematische Darstellung eines Dataframes in Normalform

4. Daten einlesen Breit vs. Lang

Breit					Lang		
ID	Q1	Q2	Q3	Q4	ID	Quartal	Umsatz
1	123	342	431	675	1	Q1	342
2	324	342	234	345	2	Q2	342
3	343	124	456	465	3	...	124
...					...	Q1	342
						Q2	342
						Q3	124
						...	



Abbildung 9: Dieselben Daten - einmal breit, einmal lang

4. Daten einlesen

Ein Dataframe in Normalform - Beispiel

Datensatz (Normalform)

in Zeilen: Fall/ Beobachtung
(häufig Personen)

ID	age	sex	n_FB_friends
Anna	21	female	212
Berta	24	female	235
Carla	20	male	312
Dora	20	female	21435

in Spalten:
Merkmal/ Variable

Wert/ Ausprägung

The diagram illustrates a dataset in normal form. It shows a table with four columns: ID, age, sex, and n_FB_friends. The rows represent individual observations (falls/beobachtungen) for four people: Anna, Berta, Carla, and Dora. The text 'in Zeilen: Fall/ Beobachtung (häufig Personen)' is associated with the row for Berta. The text 'Wert/ Ausprägung' is associated with the value '312' in the sex column for Carla. Arrows point from the explanatory text to their respective elements in the table.

Abbildung 10: Illustration eines Datensatzes in Normalform

4. Daten einlesen

Tabelle in Normalform bringen

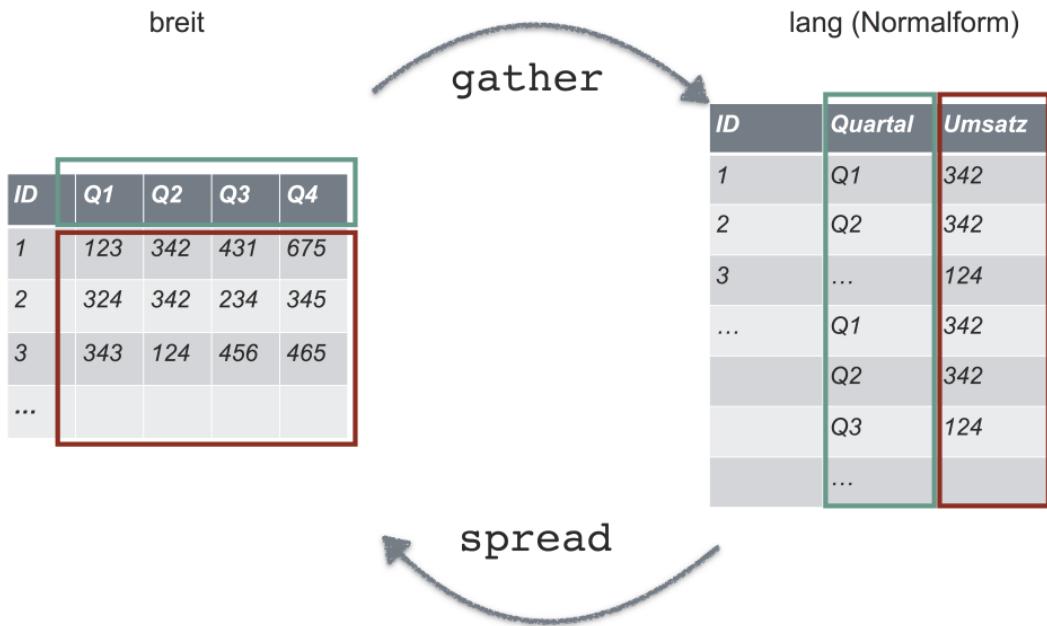


Abbildung 11: Mit 'gather' und 'spread' wechselt man von der breiten Form zur langen Form

4. Daten einlesen

Beispiel für die Normalisierung einer Tabelle

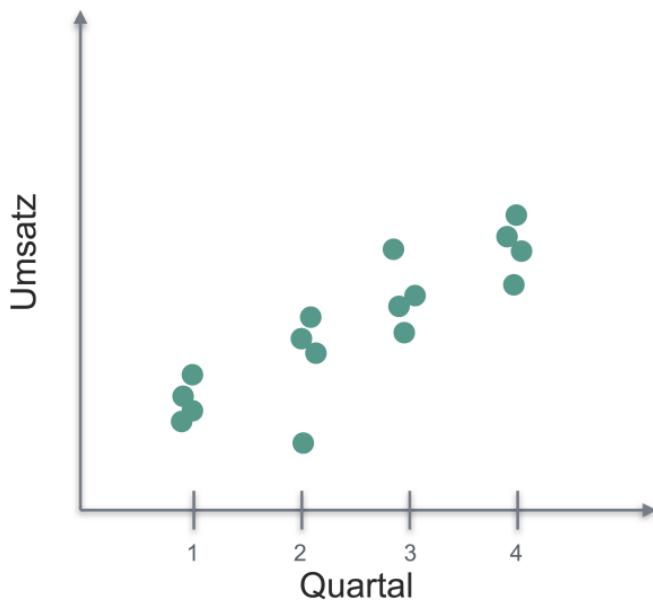


Abbildung 12: Ein Beispiel für eine Abbildung zu einer Normalform-Tabelle

4. Daten einlesen

`gather` und `spread`

```
df_lang <- gather(df_breit, key = "Quartal", value = "Umsatz")  
  
df_breit <- spread(df_lang, Quartal, Umsatz)  
  
df_lang <- gather(df_breit, key = "Quartal", value = "Umsatz", -ID)
```

4. Daten einlesen

Textkodierung und Daten exportieren

Speichern Sie R-Textdateien wie Skripte stets mit UTF-8-Kodierung ab.

```
write.csv(name_der_tabelle, "Dateiname.csv")
```

Datenjudo

- ▶ Die zentralen Ideen der Datenanalyse mit dplyr verstehen.
- ▶ Typische Probleme der Datenanalyse schildern können.
- ▶ Zentrale dplyr-Befehle anwenden können.
- ▶ dplyr-Befehle kombinieren können.
- ▶ Die Pfeife anwenden können.
- ▶ Werte umkodieren und “binnen” können.

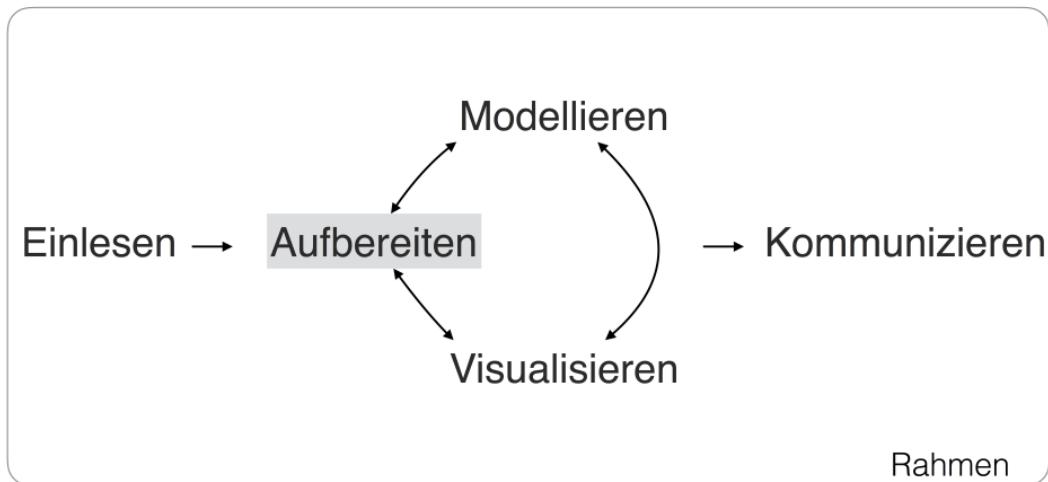


Abbildung 13: Daten aufbereiten

Typische Probleme, die immer wieder auftreten, sind:

- ▶ *Fehlende Werte*
- ▶ *Unerwartete Daten*
- ▶ *Daten müssen umgeformt werden*
- ▶ *Neue Variablen (Spalten) berechnen:*
- ▶ ...

5. Datenjudo Daten aufbereiten mit dplyr



Abbildung 14: Lego-Prinzip: Zerlege eine komplexe Struktur in einfache Bausteine

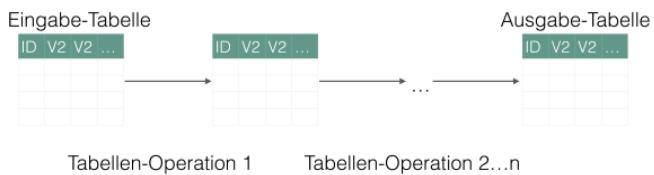


Abbildung 15: Durchpfeifen: Ein Dataframe wird von Operation zu Operation weitergereicht

5. Datenjudo Zeilen filtern mit filter

ID	Name	Note1
1	Anna	1
2	Anna	1
3	Berta	2
4	Carla	2
5	Carla	2

→

ID	Name	Note1
1	Anna	1
2	Anna	1

Abbildung 16: Zeilen filtern

vorher					nachher		
ID	Name	N1	N2	N3	ID	Name	N1
1	Anna	1	2	3	1	Anna	1
2	Berta	1	1	1	2	Berta	1
3	Carla	2	3	4	3	Carla	2
...

Abbildung 17: Spalten auswählen

ID	Name	Note1
1	Anna	1
2	Anna	5
3	Berta	2
4	Carla	4
5	Carla	3

→

ID	Name	Note1
1	Anna	1
3	Berta	2
5	Carla	3
4	Carla	4
2	Anna	5

Abbildung 18: Spalten sortieren

5. Datenjudo

Datensatz gruppieren mit group_by

The diagram illustrates the process of grouping data by subject ('Fach'). On the left, a main dataset is shown with columns: ID, Name, Note, and Fach. The data includes rows for Anna (Note 1, Fach A), Berta (Note 1, Fach A), Carla (Note 2, Fach B), and three ellipsis rows. An arrow points from this main dataset to the right, where four separate subgroups are shown, each corresponding to a different subject (Fach). Each subgroup has its own header row and contains all the rows from the main dataset where 'Fach' is that specific subject. The subgroups are labeled 'Fächer A-D' vertically on the right.

ID	Name	Note	Fach
1	Anna	1	A
2	Berta	1	A
3	Carla	2	B
...

→

ID	Name	Note	Fach
1	Anna	1	D
ID	Name	Note	Fach
1	Anna	1	C
ID	Name	Note	Fach
1	Anna	1	B
ID	Name	Note	Fach
1	Anna	1	A
2	Berta	1	A
...

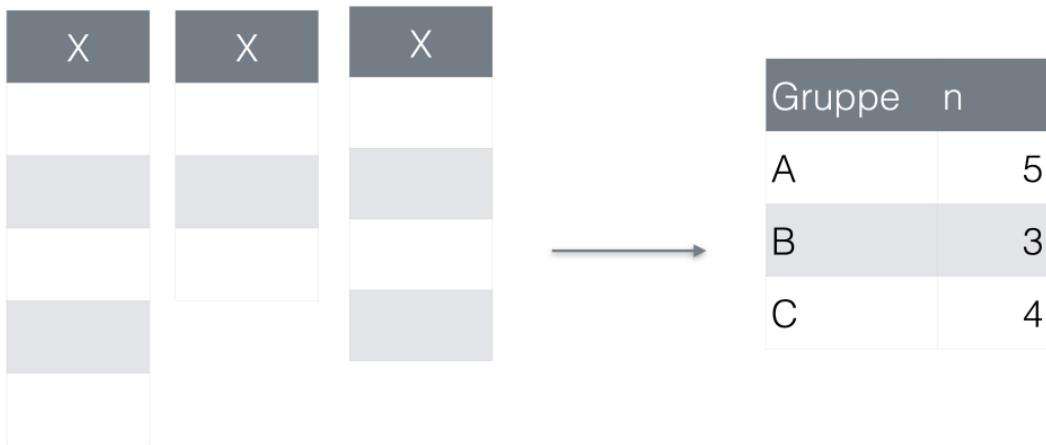
Fächer A-D

Abbildung 19: Datensätze nach Subgruppen aufteilen



Abbildung 20: Spalten zu einer Zahl zusammenfassen

Gruppe A Gruppe B Gruppe C



5

3

4

Abbildung 21: Sinnbild für 'count'



Abbildung 22: Das ist keine Pfeife

5. Datenjudo

Befehle hintereinander reihen mit der Pfeife

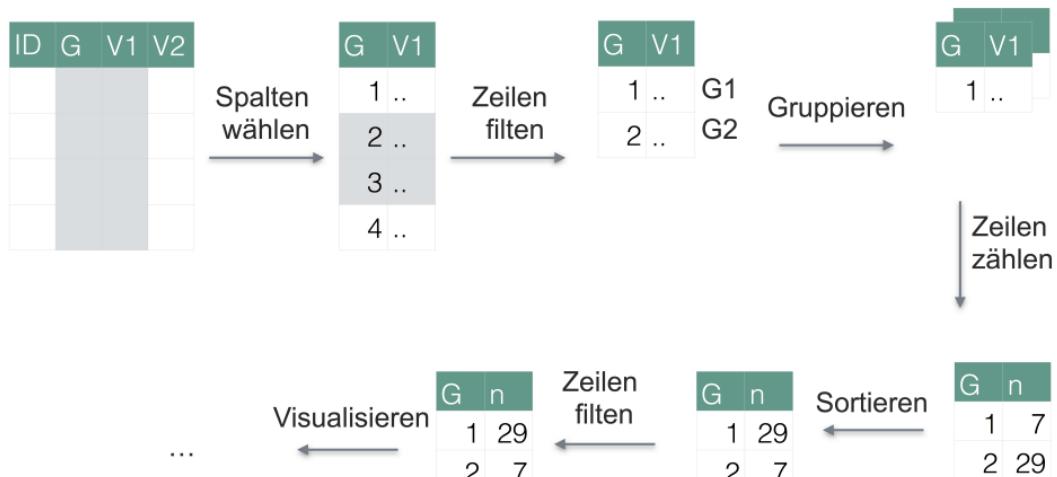


Abbildung 23: Das 'Durchpeifen'

Vergleichen Sie mal diese Syntax

```
filter(summarise(group_by(filter(stats_test, !is.na(score))), interest), mw = mean(score),  
       mw > 30)
```

mit dieser

```
stats_test %>% filter(!is.na(score)) %>% group_by(interest) %>% summarise(mw = mean(score),  
       filter(mw > 30))
```

Tipp: In RStudio gibt es einen Shortcut für die Pfeife: Strg-Shift-M (auf allen Betriebssystemen).

Die Syntax von oben auf Deutsch:

- ▶ Nimm die Tabelle "stats_test" UND DANN
- ▶ filtere alle nicht-fehlenden Werte UND DANN
- ▶ gruppiere die verbleibenden Werte nach "interest" UND DANN
- ▶ bilde den Mittelwert (pro Gruppe) für "score" UND DANN
- ▶ liefere nur die Werte größer als 30 zurück.

Sinnbild

ID	N1	N2	N3
1	1	2	3
2	1	1	1
3	2	3	4
...



Will Durchschnittsnote pro Student wissen!

ID	N1	N2	N3	MW
1	1	2	3	2
2	1	1	1	1
3	2	3	4	3
...

Abbildung 24: Sinnbild für `mutate`

5. Datenjudo Beispiel für mutate

```
stats_test %>% mutate(Streber = score > 38) %>% head()
```

```
stats_test2 <- select(stats_test, -date_time)
desctable(stats_test2)
```

Daten visualisieren

6. Daten visualisieren

Lernziele für das Kapitel ‘Daten visualisieren’

- ▶ An einem Beispiel erläutern können, warum/ wann ein Bild mehr sagt, als 1000 Worte.
- ▶ Häufige Arten von Diagrammen erstellen können.
- ▶ Diagramme bestimmten Zwecken zuordnen können.

6. Daten visualisieren

Statistik ist wie ein Bikini...

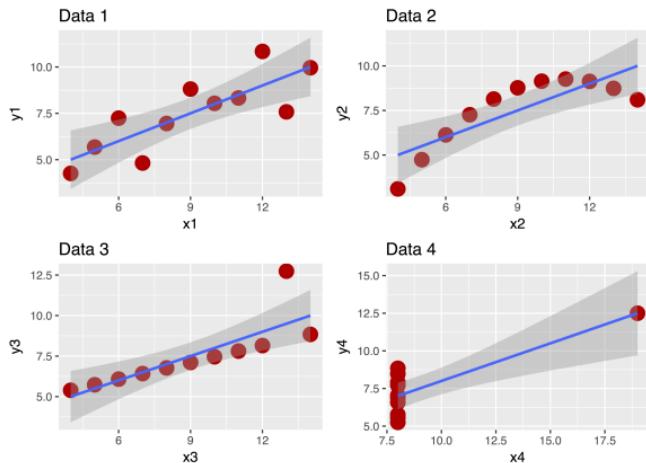


Abbildung 25: Das Anscombe-Quartett

Dinosaurier-Video

6. Daten visualisieren

Die Anatomie eines Diagramms

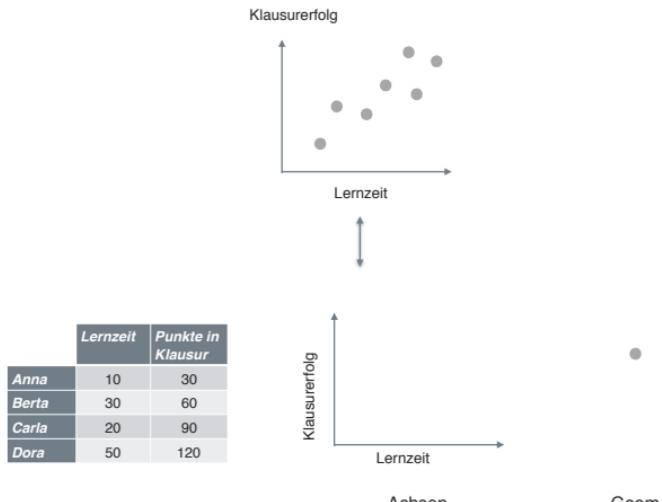


Abbildung 26: Anatomie eines Diagramms

6. Daten visualisieren

Beispiel für ein Diagramm mit `ggplot2::qplot`

```
qplot(x = year, y = budget, geom = "point", data = movies)
```

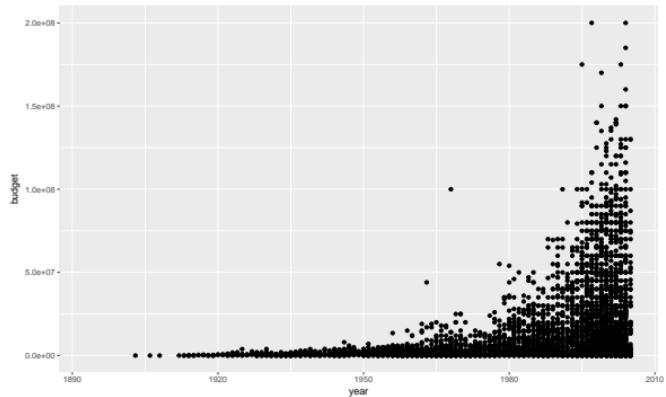


Abbildung 27: Mittleres Budget pro Jahr

Anatomiestunde mit qplot

- ▶ qplot: Erstelle schnell (q wie quick in qplot) mal einen Plot (engl. "plot": Diagramm).
- ▶ x: Der X-Achse soll die Variable "year" zugeordnet werden.
- ▶ y: Der Y-Achse soll die Variable "budget" zugeordnet werden.
- ▶ geom: ("geometrisches Objekt") Gemalt werden sollen Punkte und zwar pro Beobachtung (hier: Film) ein Punkt; nicht etwa Linien oder Boxplots.
- ▶ data: Als Datensatz bitte movies verwenden.

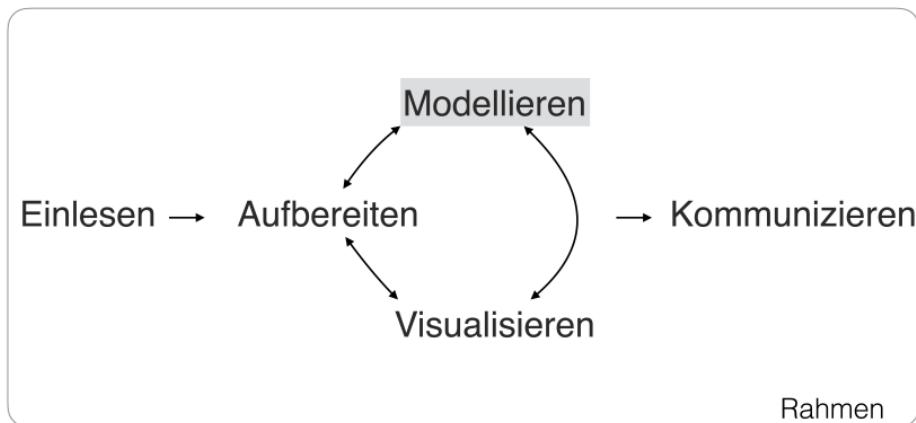
Diese Syntax des letzten Beispiels ist recht einfach, nämlich:

```
qplot(x = X_Achse, y = Y_Achse, data = mein_dataframe, geom = "ein_geom")
```

s. Skript

- ▶ Histogramm, Dichtediagramm
- ▶ Punkte, Schachbrett-Diagramme
- ▶ Balkendiagramm
- ▶ Mosaicplot (Fliesen-Diagramm)
- ▶ Punktediagramm für Zusammenfassungen
- ▶ Boxplots

Grundlagen des Modellierens



7. Grundlagen des Modellierens

Was ist ein Modell



Abbildung 28: Modell eines VW-Käfers

7. Grundlagen des Modellierens

Die Beziehung von Gegenstandsbereich und Modell

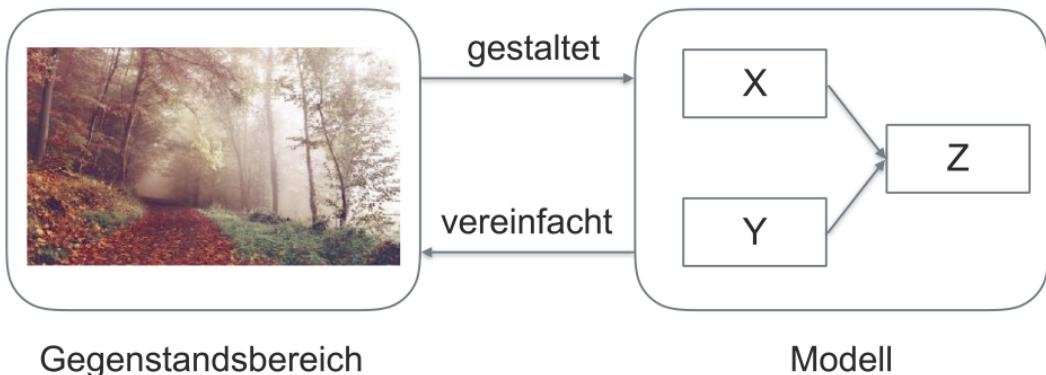


Abbildung 29: Modellieren

7. Grundlagen des Modellierens

Modelle spiegeln empirische Relationen in numerischen Relationen

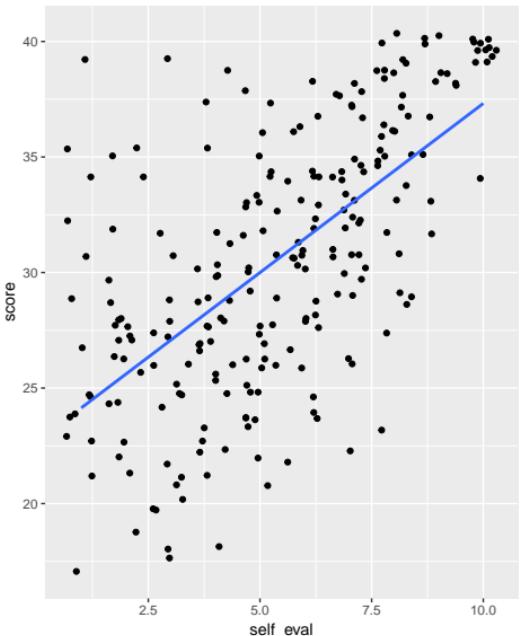
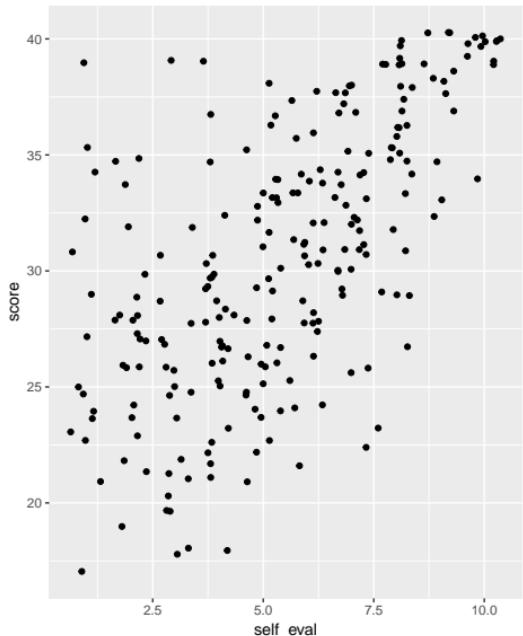
Modellieren bedeutet ein Verfahren zu erstellen, welches empirische Sachverhalte adäquat in numerische Sachverhalte umsetzt.



Abbildung 30: Formaleres Modell des Modellierens

7. Grundlagen des Modellierens

Ein Beispiel zum Modellieren aus der Datenanalyse



Die blaue Gerade ist ein Modell für den Datensatz (sie versucht es zumindest).

7. Grundlagen des Modellierens

Modelle umfassen drei Aspekte

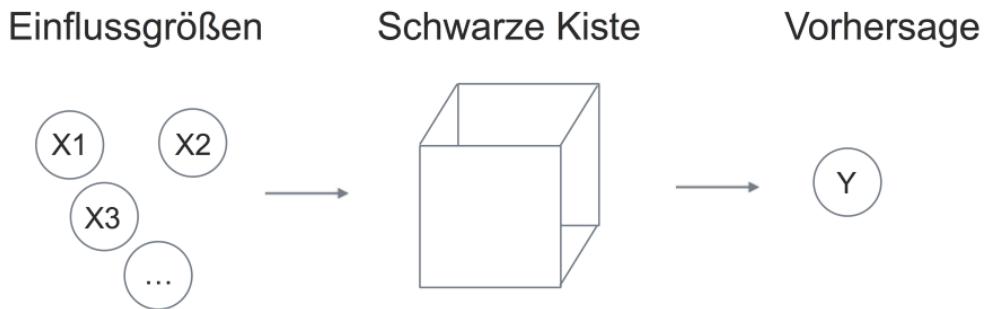
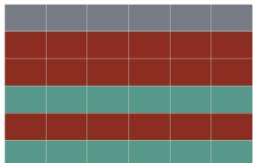


Abbildung 31: Modelle mit schwarzer Kiste

- ▶ Geleitetes Modellieren
 - ▶ Prädiktives Modellieren
 - ▶ Explikatives Modellieren
- ▶ Ungeleitetes Modellieren
 - ▶ Dimensionsreduzierendes Modellieren
 - ▶ Fallreduzierendes Modellieren

Fallreduzierendes
Modellieren



Dimensionsreduzierendes
Modellieren

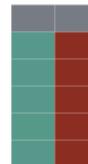
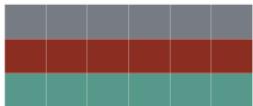
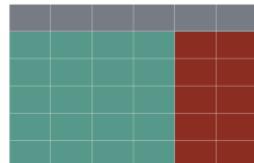


Abbildung 32: Die zwei Arten des ungeleiteten Modellierens

1. Man wählt eines der vier Ziele des Modellierens (z.B. ein prädiktives Modell).
2. Man wählt ein Modell aus (genauer: eine Modelfamilie), z.B. postuliert man, dass die Körpergröße einen linearen Einfluss auf die Schuhgröße habe.
3. Man bestimmt (berechnet) die Details des Modells anhand der Daten: Wie groß ist die Steigung der Geraden und wo ist der Achsenabschnitt? Man sagt auch, dass man die *Modellparameter* anhand der Daten schätzt ("Modellinstantiierung" oder "Modellanpassung", engl. "model fitting").
4. Dann prüft man, wie gut das Modell zu den Daten passt (Modellgüte, engl. "model fit"); wie gut lässt sich die Schuhgröße anhand der Körpergröße vorhersagen bzw. wie groß ist der Vorhersagefehler?

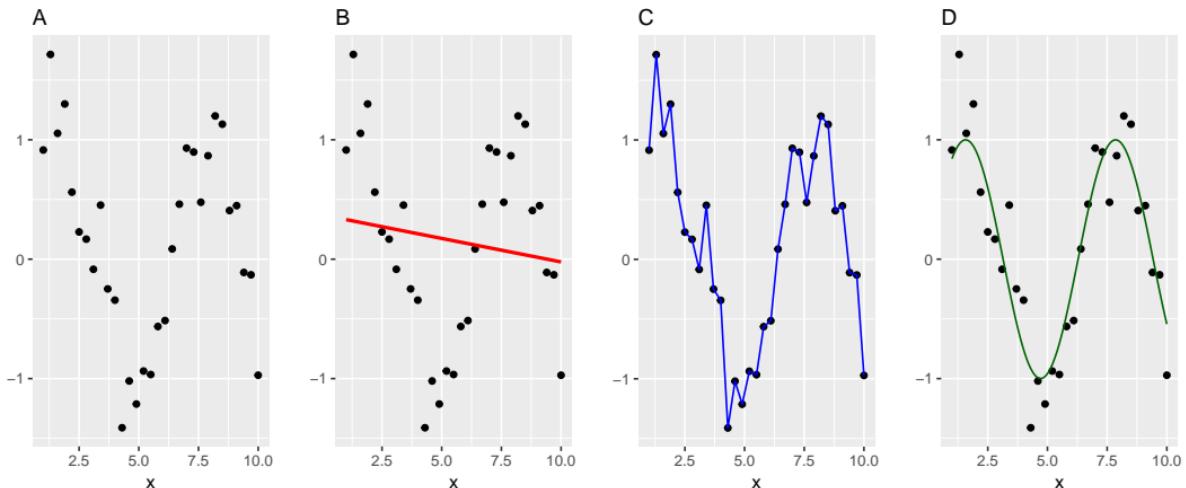


Abbildung 33: Welches Modell (Teil B-D; rot, grün, blau) passt am besten zu den Daten (Teil A) ?

Beschreibt ein Modell (wie das blaue Modell hier) eine Stichprobe sehr gut, heißt das noch *nicht*, dass es auch zukünftige (und vergleichbare) Stichproben gut beschreiben wird. Die Güte (Vorhersagegenauigkeit) eines Modells sollte sich daher stets auf eine neue Stichprobe beziehen (Test-Stichprobe), die nicht in der Stichprobe beim Anpassen des Modells (Trainings-Stichprobe) enthalten war.

7. Grundlagen des Modellierens

Overfitting

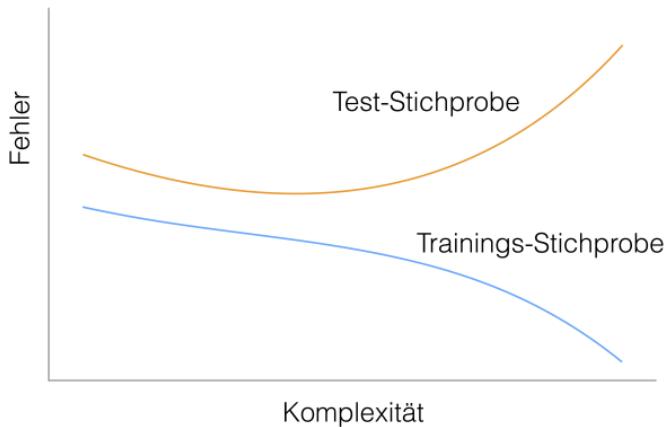


Abbildung 34: 'Mittlere' Komplexität hat die beste Vorhersagegenauigkeit (am wenigsten Fehler) in der Test-Stichprobe

7. Grundlagen des Modellierens Bias-Varianz-Abwägung

Einfache Modelle: Viel Bias, wenig Varianz. Komplexe Modelle: Wenig Bias, viel Varianz.

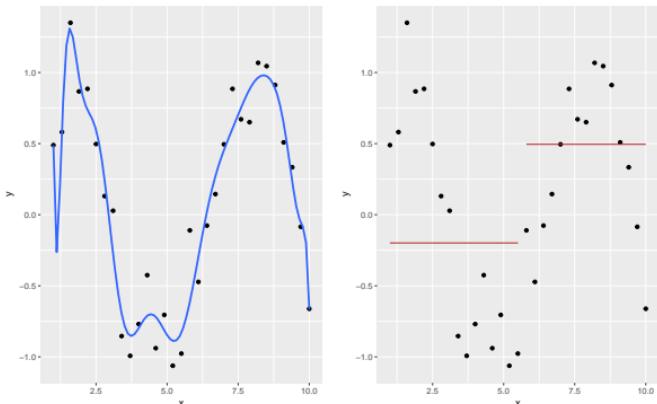


Abbildung 35: Der Spagat zwischen Verzerrung und Varianz

Der p-Wert

- ▶ Den p-Wert erläutern können.
- ▶ Den p-Wert kritisieren können.
- ▶ Alternativen zum p-Wert kennen.
- ▶ Inferenzstatistische Verfahren für häufige Fragestellungen kennen.

8. Der p-Wert

Sir Ronald Fisher, Erfinder des Nullhypothesen Testens

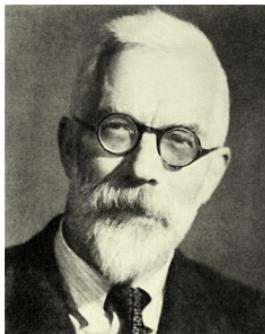


Abbildung 36: Der größte Statistiker des 20. Jahrhunderts ($p < .05$)

8. Der p-Wert

Der p-Wert ist die heilige Kuh der Forscher

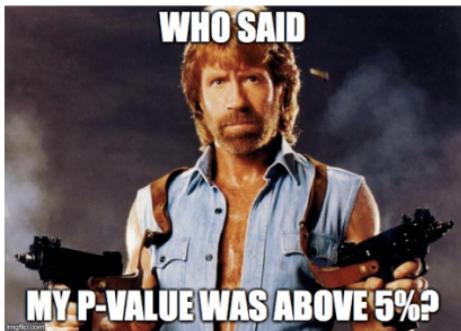


Abbildung 37: Der p-Wert wird oft als wichtig erachtet

Der p-Wert sagt, wie gut die Daten zur Nullhypothese passen.

8. Der p-Wert

Von Männern und Päpsten

$$P(M|P) \neq P(P|M)$$

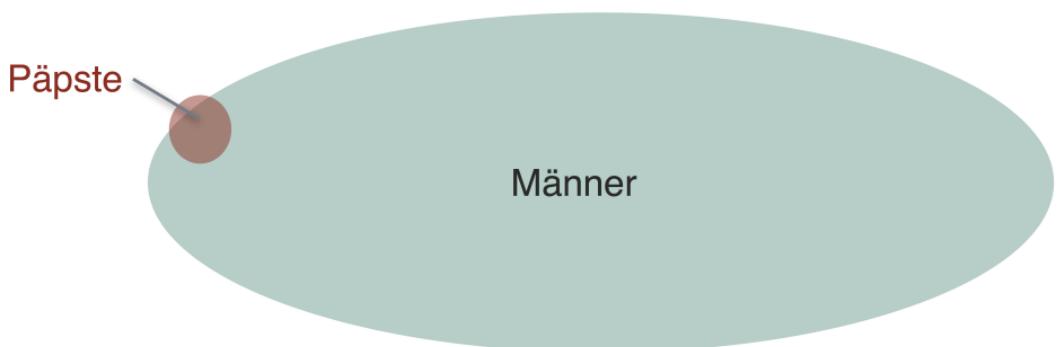


Abbildung 38: Mann und Papst zu sein, ist nicht das gleiche.

8. Der p-Wert

Der p-Wert ist eine Funktion der Stichprobengröße

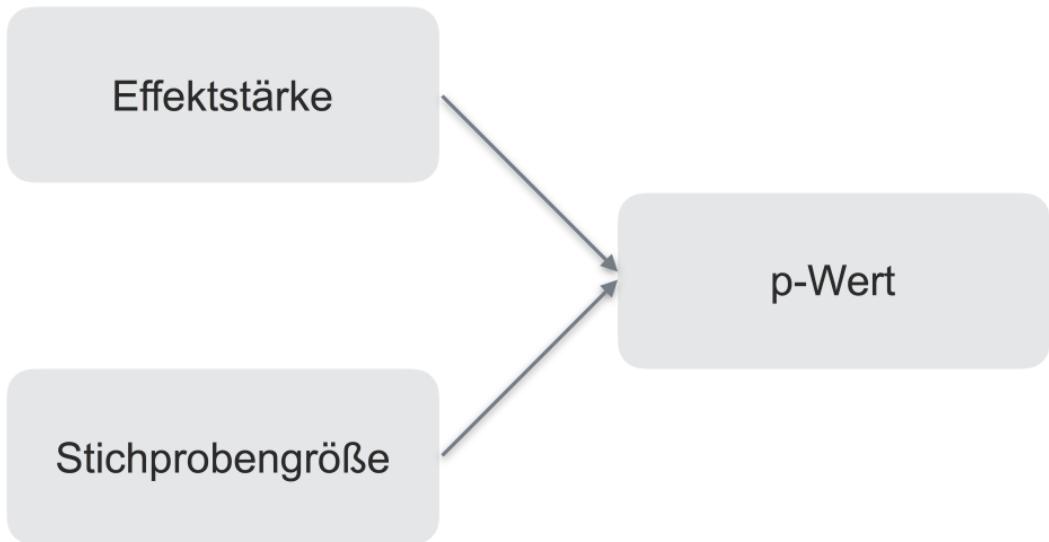


Abbildung 39: Zwei Haupteinflüsse auf den p-Wert

8. Der p-Wert

Zur Philosophie des p-Werts: Frequentismus

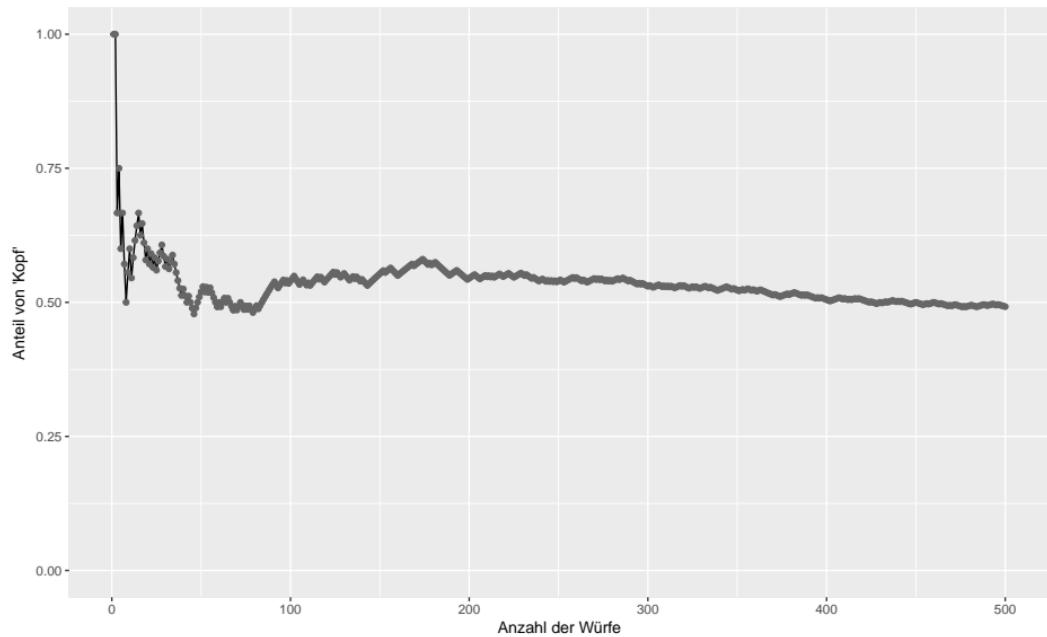


Abbildung 40: Anteil von 'Kopf' bei wiederholtem Münzwurf

8. Der p-Wert

Alternativen zum p-Wert - Konfidenzintervalle

Das 95%-Konfidenzintervall ist der Bereich, in dem der Parameter in 95% der Fälle fallen würde bei sehr häufiger Wiederholung des Versuchs.

Visualisierung zum Konfidenzintervall

8. Der p-Wert

Alternativen zum p-Wert - Effektstärken

19. Tabelle im Skript

8. Der p-Wert

Alternativen zum p-Wert - Bayes-Statistik

Bayes liefert $p(D|H)$.

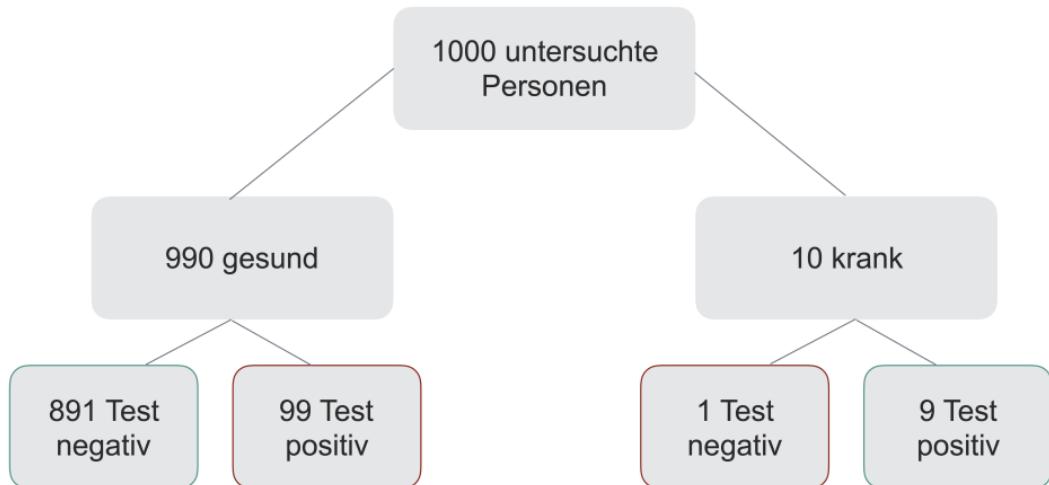


Abbildung 41: Die zwei Stufen der Bayes-Statistik in einem einfachen Beispiel

Lineare Regression

- ▶ Wissen, was man unter Regression versteht.
- ▶ Die Annahmen der Regression überprüfen können.
- ▶ Regression mit kategorialen Prädiktoren durchführen können.
- ▶ Die Modellgüte bei der Regression bestimmen können.
- ▶ Interaktionen erkennen und ihre Stärke einschätzen können.

9. Lineare Regression

Beispiel für eine lineare Regression

```
score = achsenabschnitt + steigung*study_time
```

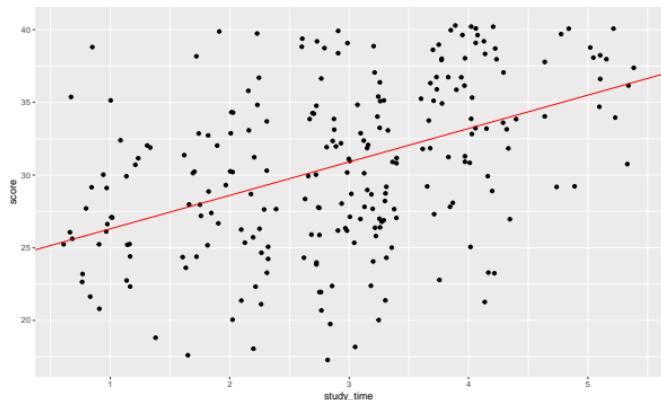


Abbildung 42: Beispiel für eine Regression

```
score = achsenabschnitt + steigung*study_time
```

9. Lineare Regression

Vorhersagegüte - Veranschaulichung

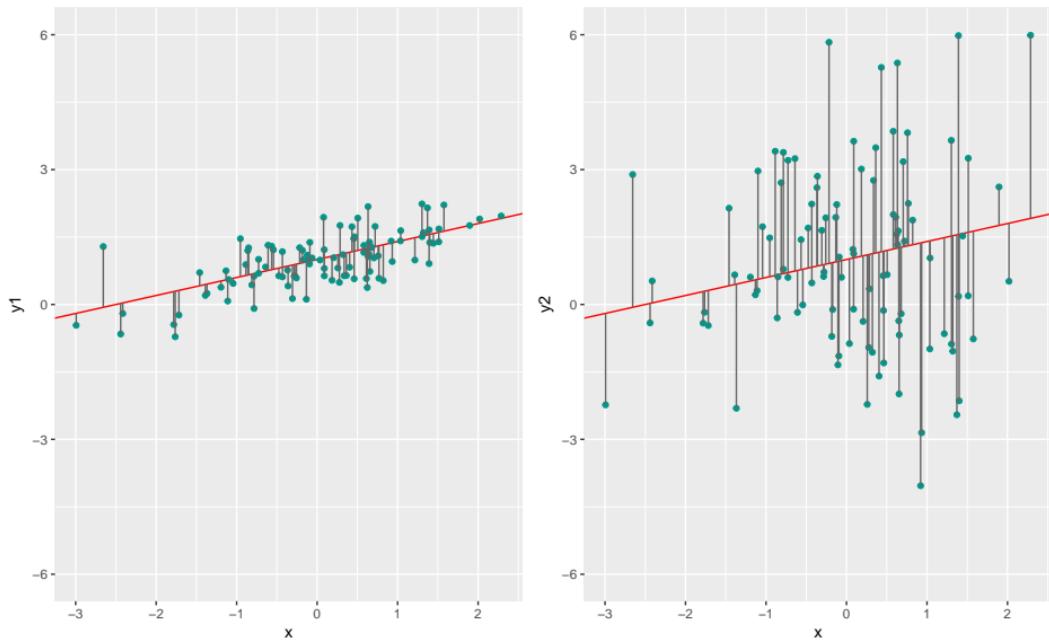


Abbildung 43: Geringer (links) vs. hoher (rechts) Vorhersagefehler

$$\text{MSE} = \frac{1}{n} \sum (\text{pred} - \text{obs})^2$$

$$R^2 = 1 - \left(\frac{SS_T - SS_M}{SS_T} \right)$$

- ▶ Linearität des Zusammenhangs
- ▶ Normalverteilung der Residuen
- ▶ Konstante Varianz
- ▶ Extreme Ausreißer
- ▶ Unabhängigkeit der Beobachtungen

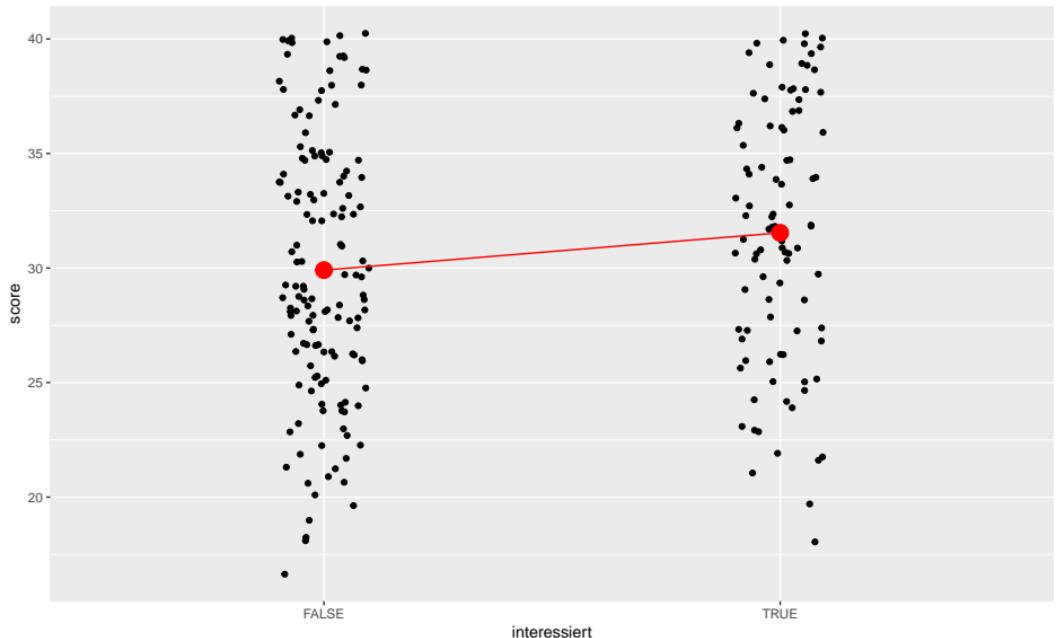
9. Lineare Regression

Unterscheiden sich Interessierten von Nicht-I. im Klausurerfolg?

interessiert	score
FALSE	29.90909
TRUE	31.53684
NA	33.08824

9. Lineare Regression Kategoriale Prädiktoren

```
stats_test %>% na.omit %>% ggplot() + aes(x = interessiert, y = score) + geom_jitter()  
  geom_point(data = score_interesse, color = "red", size = 5) + geom_line(data = score_interesse,  
group = 1, color = "red")
```



9. Lineare Regression Multiple Regression

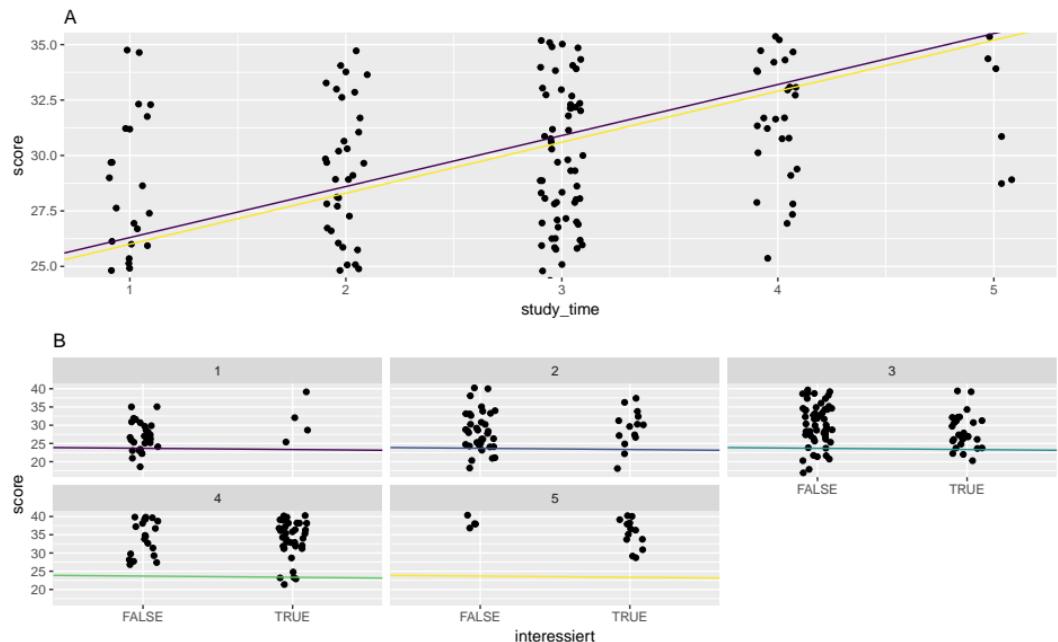


Abbildung 44: Eine multivariate Analyse fördert Einsichten zu Tage, die bei einfacheren Analysen verborgen bleiben

*Die multivariate Analyse zeigt ein anderes Bild, ein genaueres Bild als die einf�here Analyse.
Ein Sachverhalt, der für den ganzen Datensatz gilt, kann in Subgruppen anders sein.*

Erlaubt man der Regression, dass die Regressionsgeraden nicht parallel sein müssen, spricht man von einer *Interaktion*.

9. Lineare Regression

Ein Beispiel für einen Interaktionseffekt

Die Linien sind *nicht* (ganz) parallel: ein kleiner Interaktionseffekt.

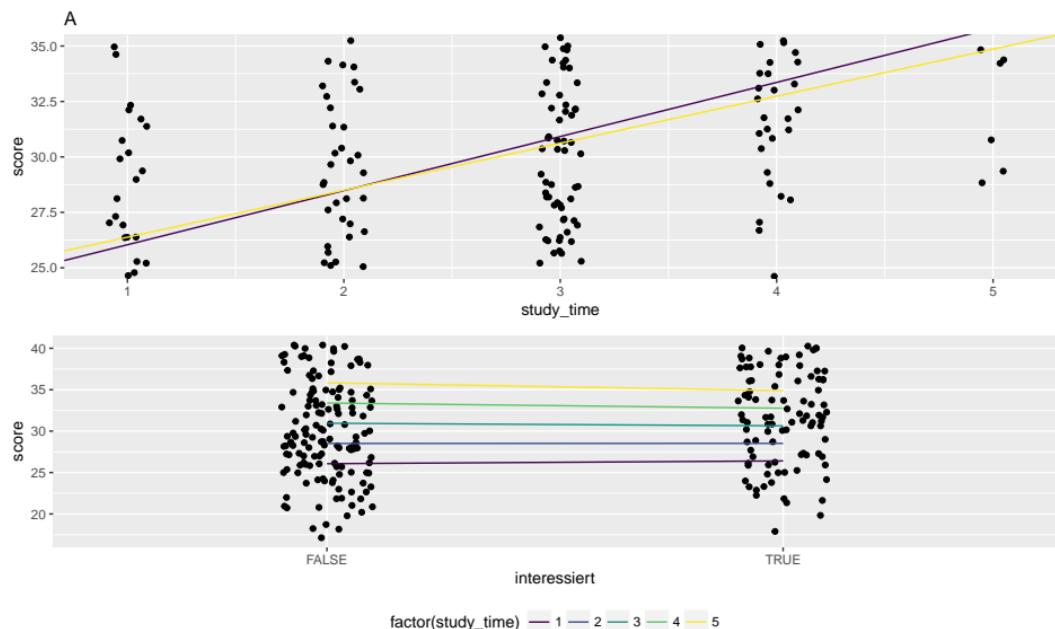


Abbildung 45: Eine Regressionsanalyse mit Interaktionseffekten

9. Lineare Regression Fallstudie zu Overfitting

```
caret::postResample(pred = lm2_predict, obs = test$score)
```

```
##      RMSE Rsquared
## 4.433257 0.271658
```

Die Modellgüte im in der Test-Stichprobe ist meist schlechter als in der Trainings-Stichprobe. Das warnt uns vor Befunden, die naiv nur die Werte aus der Trainings-Stichprobe berichten.

Klassifizierende (logistische) Regression

- ▶ Die Idee der logistischen Regression verstehen.
- ▶ Die Koeffizienten der logistischen Regression interpretieren können.
- ▶ Die Modellgüte einer logistischen Regression einschätzen können.
- ▶ Klassifikatorische Kennzahlen kennen und beurteilen können.

10. Klassifizierende (logistische) Regression

Problemstellung

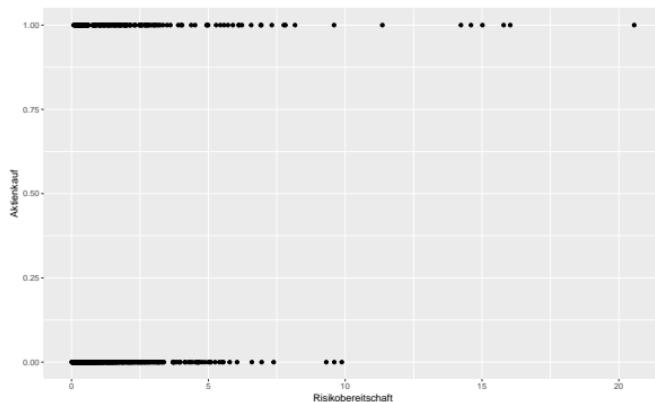


Abbildung 46: Streudiagramm von Risikobereitschaft und Aktienkauf

10. Klassifizierende (logistische) Regression

R-Befehl

Die Funktion `glm` führt die logistische Regression durch.

```
glm1 <- glm(Aktienkauf ~ Risikobereitschaft, family = binomial("logit"), data = Aktie)
```

10. Klassifizierende (logistische) Regression

Visualisierung der logistischen Regression

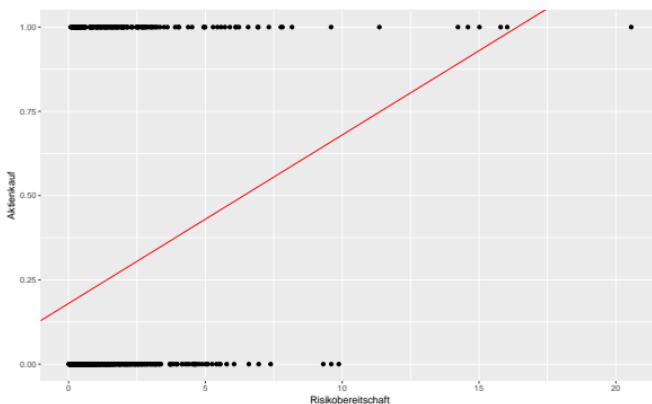


Abbildung 47: Regressionsgerade für Aktien-Modell

10. Klassifizierende (logistische) Regression

Formel der logistischen Regression

Die e-Funktion: $p(y=1) = \frac{e^x}{1+e^x}$

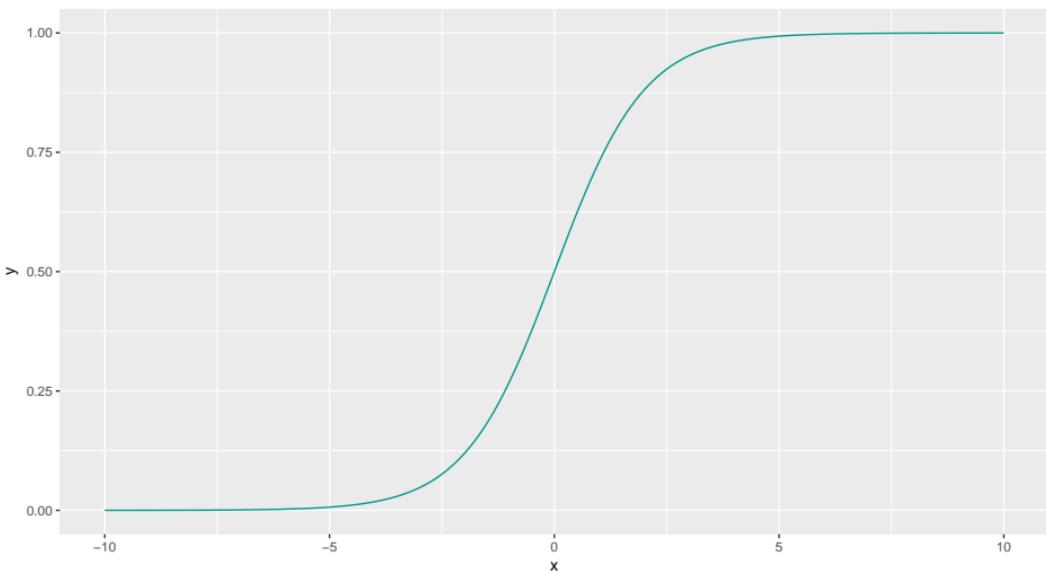


Abbildung 48: Die logistische Regression beschreibt eine 's-förmige' Kurve

10. Klassifizierende (logistische) Regression

Die logistische Regression für die Aktien-Daten

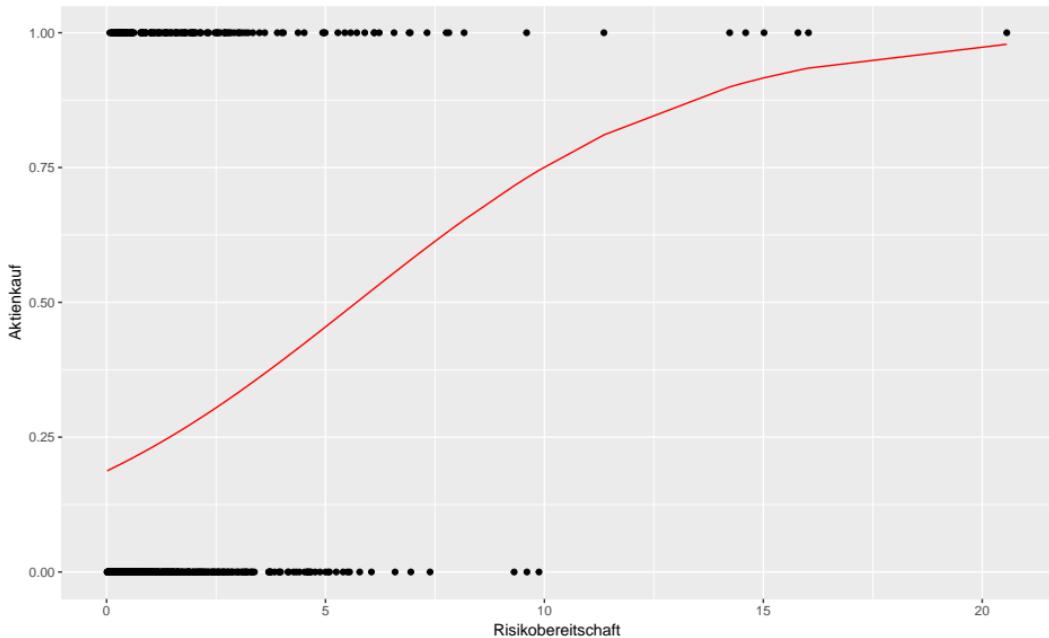


Abbildung 49: Modelldiagramm für den Aktien-Datensatz

Ist ein Logit \mathfrak{L} größer als 0, so ist die zugehörige Wahrscheinlichkeit größer als 50% (und umgekehrt.)

$$\text{Logits } \mathfrak{L} = \ln\left(\frac{p}{1-p}\right)$$

$y = \text{intercept} + 3 * \text{Risikobereitschaft}$, also

```
(y <- -1.469 + 3 * 0.257)
```

```
## [1] -0.698
```

Also $y = -0.698$ Logits (\mathfrak{L}).

10. Klassifizierende (logistische) Regression

Vorhersage individueller Wahrscheinlichkeiten

```
predict(glm1, data.frame(Risikobereitschaft = 1), type = "response")
```

```
##           1
## 0.2294028
```

```
str(stats_test$bestanden)
stats_test$bestanden <- factor(stats_test$bestanden, levels = c("nein", "ja"))
log_stats <- glm(bestanden ~ interessiert, family = binomial("logit"), data = stats_t
summary(log_stats)
```

10. Klassifizierende (logistische) Regression

Vier Arten von Ergebnisse von Klassifikationen

Tabelle 3: Vier Arten von Ergebnisse von Klassifikationen (continued below)

Wahrheit	Als.negativ.vorhergesagt
In Wahrheit negativ (-)	Richtig negativ (RN)
In Wahrheit positiv (+)	Falsch negativ (FN)
Summe	N*

Als.positiv.vorhergesagt	Summe
Falsch positiv (FP)	N
Richtig positiv (RN)	P
P*	N+P

10. Klassifizierende (logistische) Regression

Konfusionsmatrix

```
##      obs
## pred  0   1
##      0 509 163
##      1   8  20
## attr(,"class")
## [1] "confusion.matrix"

## [1] 0.1092896

## [1] 0.9845261
```

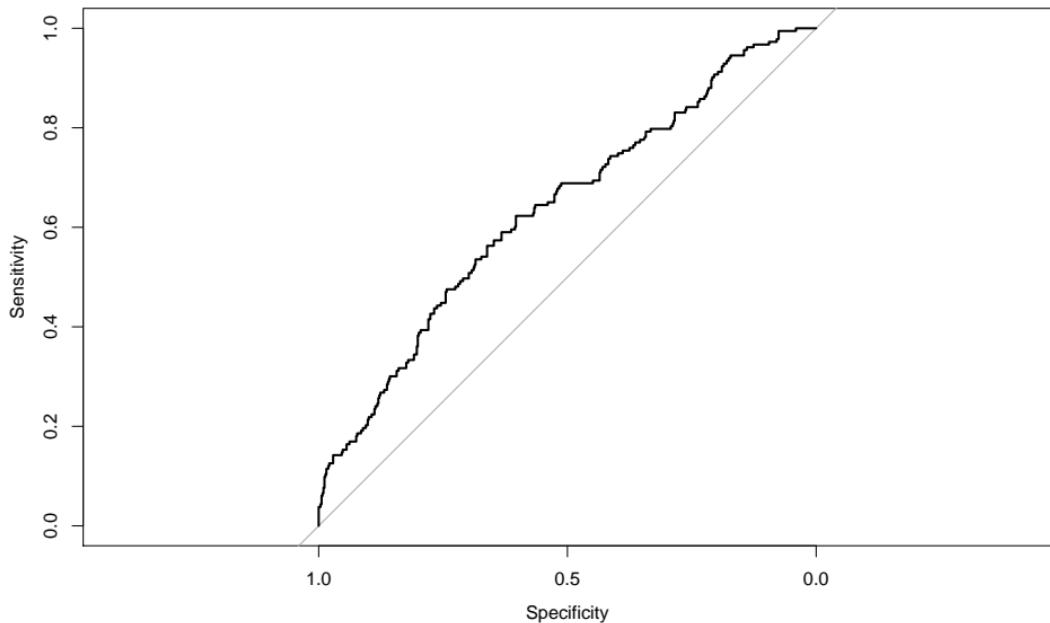
Tabelle 5: Geläufige Kennwerte der Klassifikation

Name	Definition
Falsch-Positiv-Rate (FP-Rate)	FP/N
Richtig-Positiv-Rate (RP-Rate)	RP/N
Falsch-Negativ-Rate (FN-Rate)	FN/N
Richtig-Negativ-Rate (RN-Rate)	RN/N
Positiver Vorhersagewert	RP/P*
Negativer Vorhersagewert	RN/N*
Gesamtgenauigkeitsrate	(RP+RN) / (N+P)

10. Klassifizierende (logistische) Regression

ROC-Kurven

```
lets_roc <- roc(Aktien$Aktienkauf, glm1$fitted.values)  
plot(lets_roc)
```



10. Klassifizierende (logistische) Regression

Beispiele für ROC-Kurven

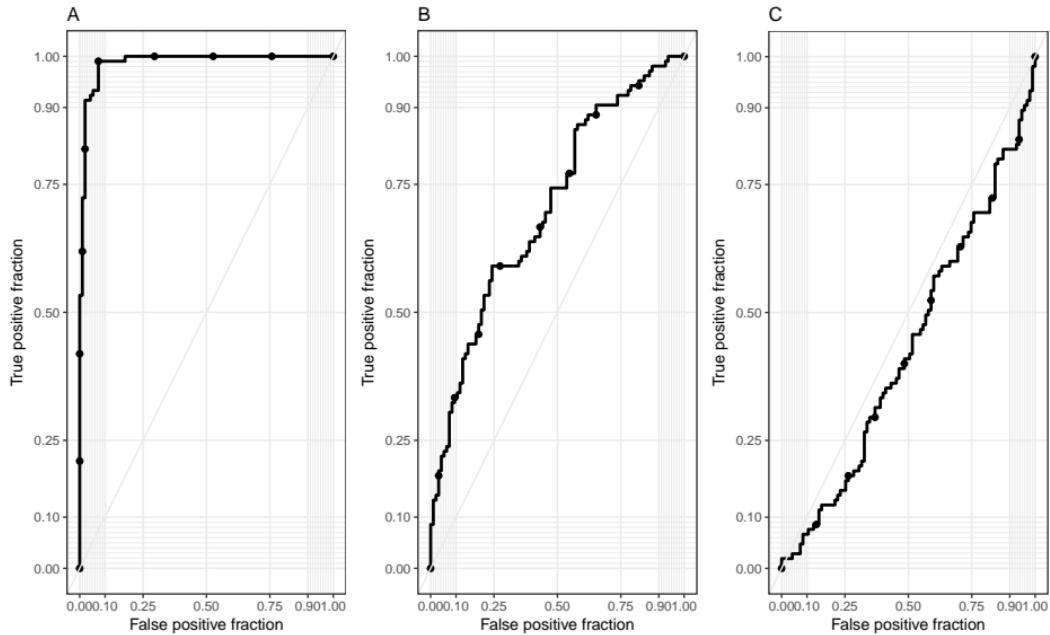


Abbildung 50: Beispiel für eine sehr gute (A), gute (B) und schlechte (C) Klassifikation

Clusteranalyse

- ▶ Das Ziel einer Clusteranalyse erläutern können.
- ▶ Das Konzept der euklidischen Abstände verstehen.
- ▶ Eine k-Means-Clusteranalyse berechnen und interpretieren können.

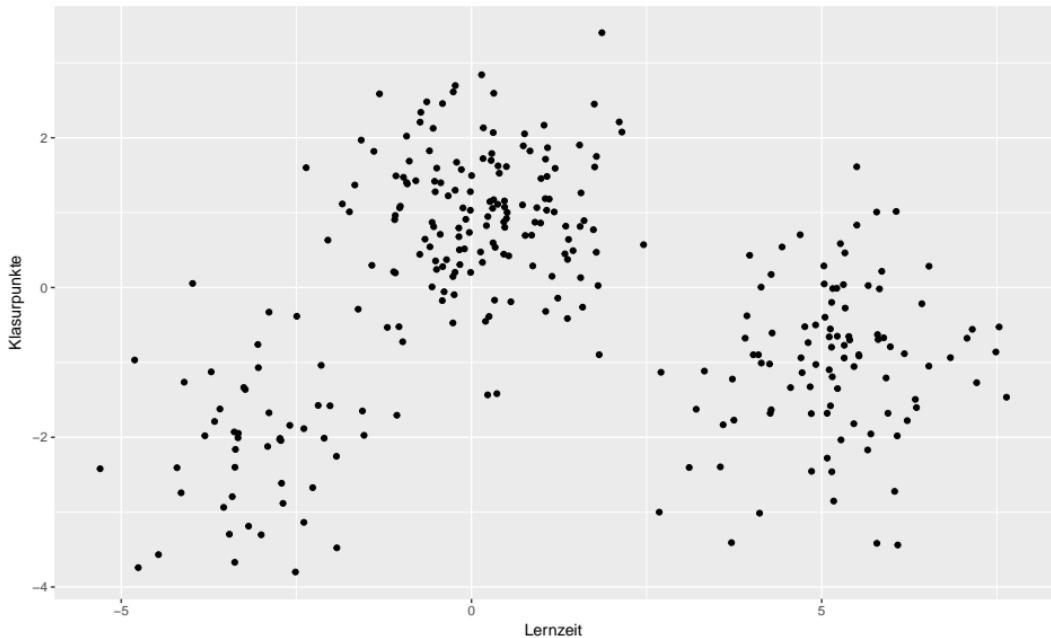


Abbildung 51: Ein Streudiagramm - sehen Sie Gruppen (Cluster) ?

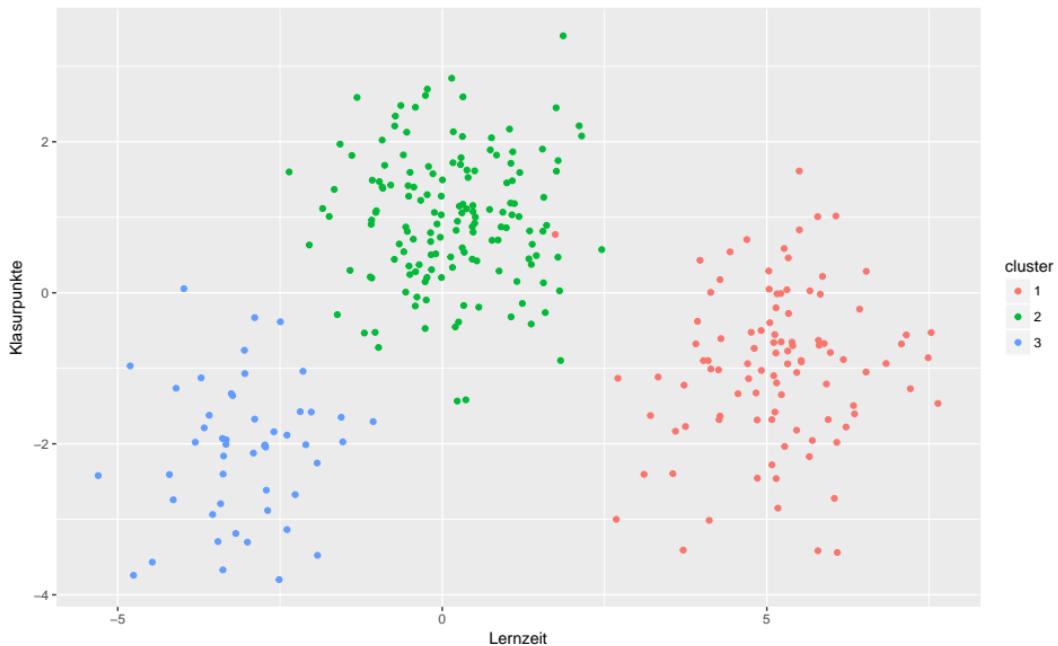


Abbildung 52: Ein Streudiagramm - mit drei Clustern

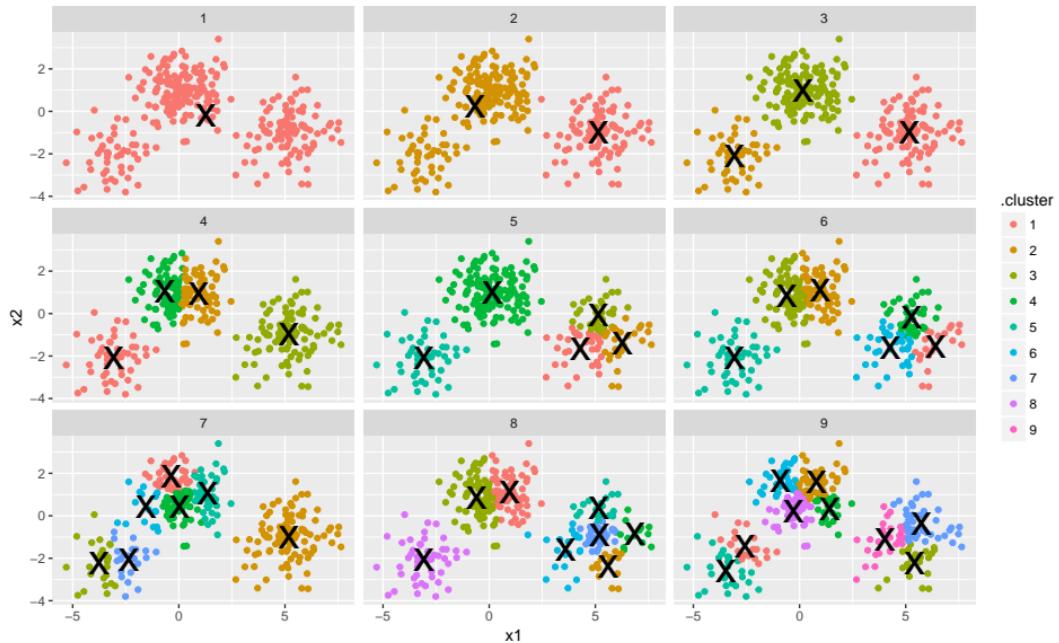


Abbildung 53: Unterschiedliche Anzahlen von Clustern im Vergleich

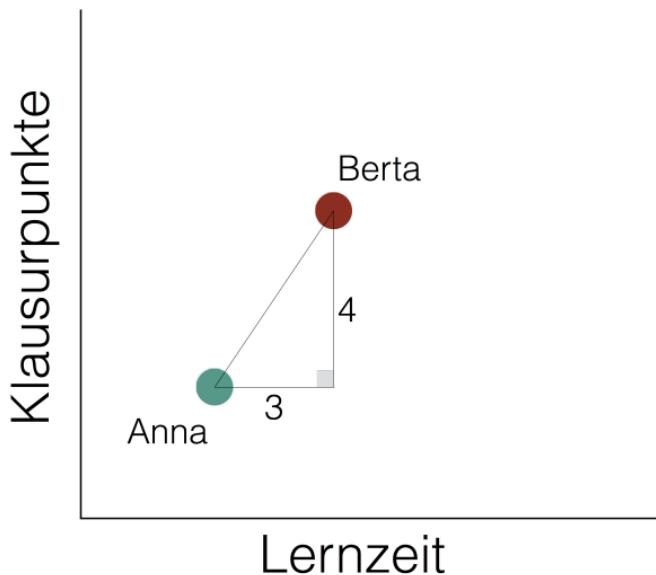


Abbildung 54: Distanz zwischen zwei Punkten in der Ebene

$$c^2 = a^2 + b^2$$

In unserem Beispiel heißt das $c^2 = 3^2 + 4^2 = 25$. Folglich ist $\sqrt{c^2} = \sqrt{25} = 5$. Der Abstand oder der Unterschied zwischen Anna und Berta beträgt also 5 - diese Art von "Abstand" nennt man den *euklidischen Abstand*.

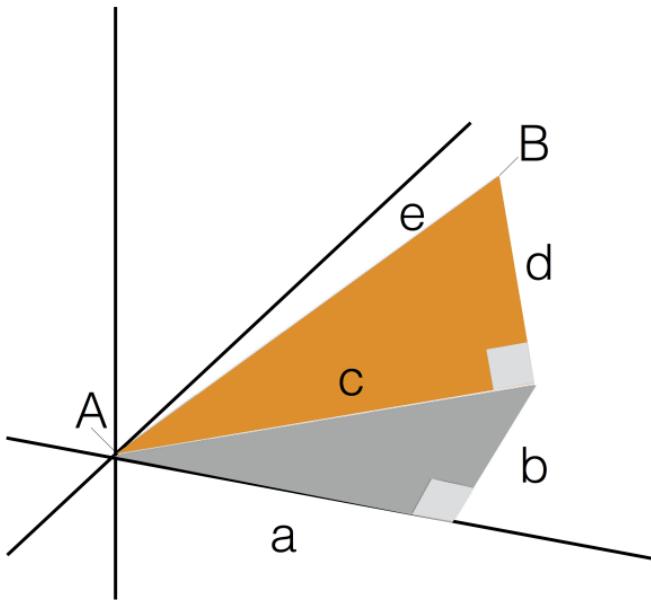


Abbildung 55: Pythagoras in 3D

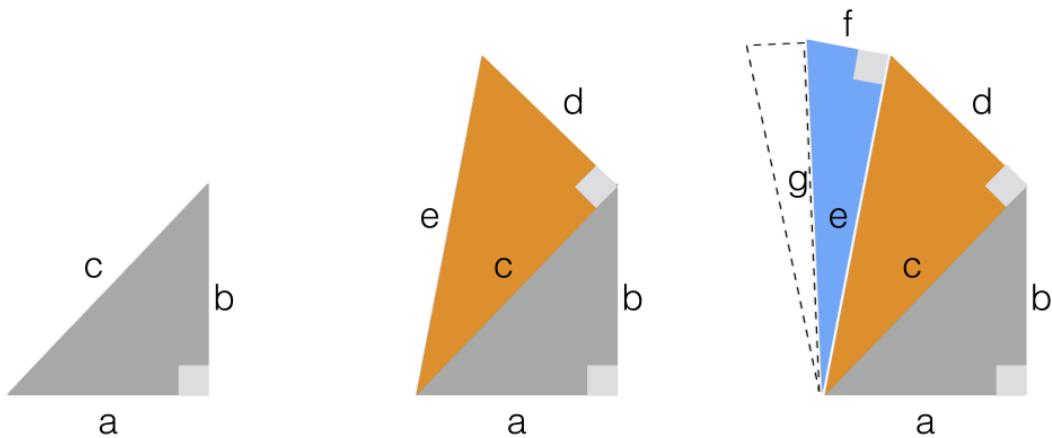


Abbildung 56: Pythagoras in Reihe geschaltet

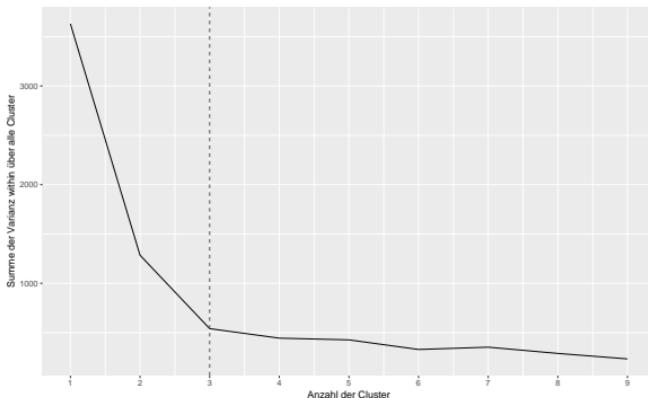
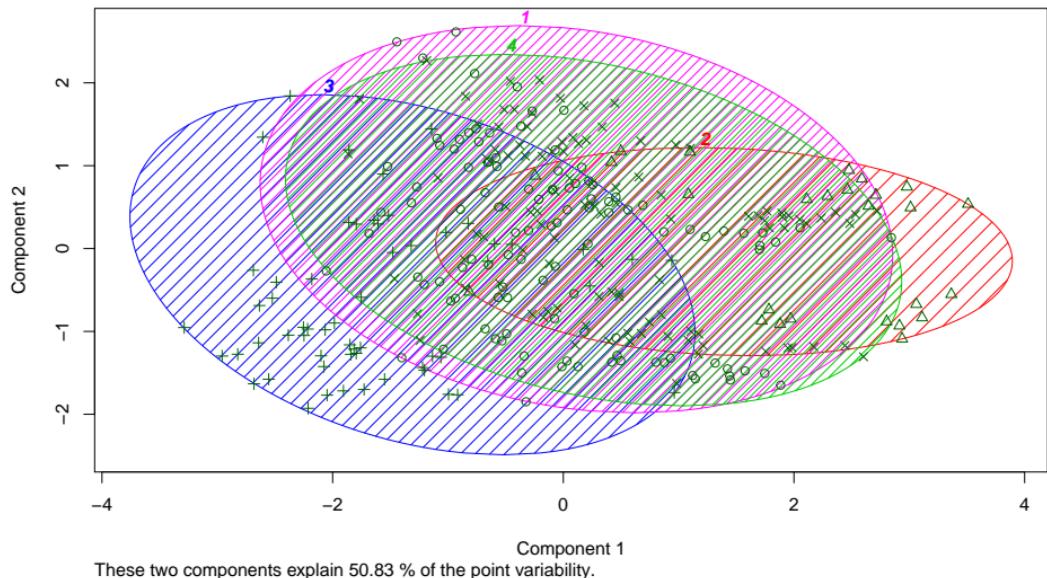


Abbildung 57: Die Summe der Varianz within in Abhängigkeit von der Anzahl von Clustern. Ein Screeplot.

CLUSPLOT(segment.num)



These two components explain 50.83 % of the point variability.

Dimensionsreduktion

- ▶ Den Unterschied zwischen einer Hauptkomponentenanalyse und einer Exploratorische Faktorenanalyse kennen
- ▶ Methoden kennen, um die Anzahl von Dimensionen zu bestimmen
- ▶ Methoden der Visualisierung anwenden können
- ▶ Umsetzungsmethoden in R anwenden können
- ▶ Ergebnisse interpretieren können.

- ▶ Die *Hauptkomponentenanalyse* (engl. principal component analysis, PCA)
 - ▶ reduziert Daten
 - ▶ erklärt die Gesamtvarianz
- ▶ Die *Exploratorische Faktorenanalyse* (EFA)
 - ▶ führt manifeste Variablen (Items) auf latente Faktoren zurück
 - ▶ erklärt nicht die komplette Varianz, sondern nur die Varianz, die durch die vorhandenen Variablen erklärt wird

- ▶ *Dimensionen reduzieren*
- ▶ *Unsicherheit verringern*
- ▶ *Aufwand verringern*

12. Dimensionsreduktion

Intuition zur Dimensionsreduktion

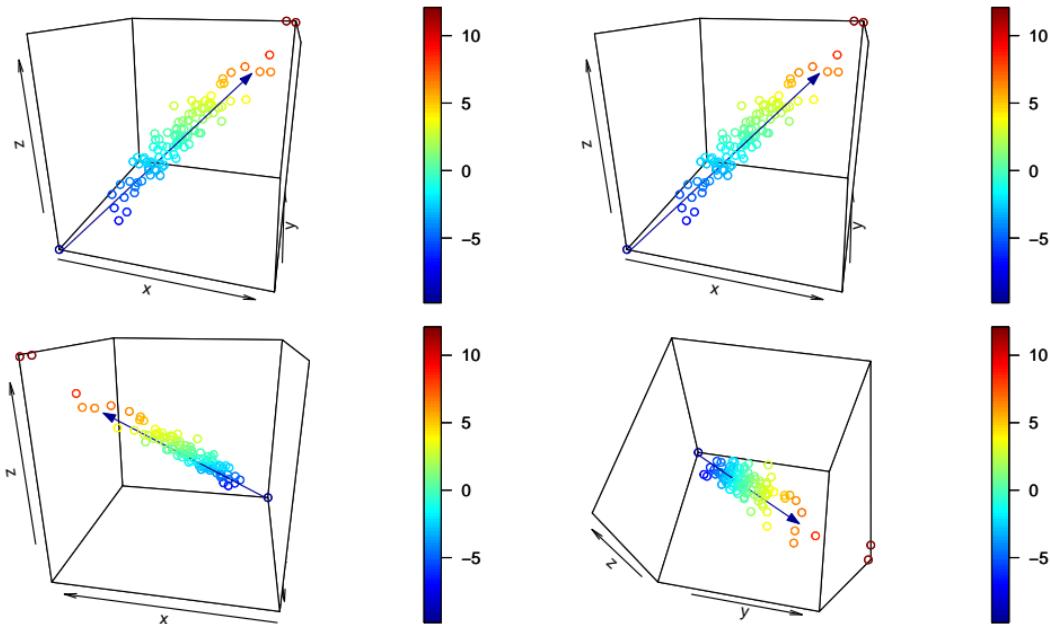
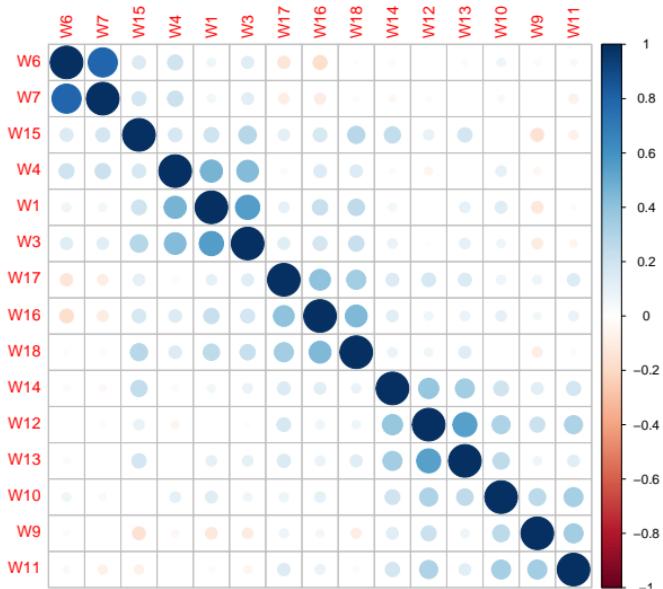


Abbildung 58: Der Pfeil ist eindimensional; reduziert also die drei Dimensionen auf eine

W1	W3	W4	W6	W7
0.5149008	0.5961663	1.6629148	1.3261145	1.2935031
-1.4990528	1.2759455	-0.6949935	-1.4505072	-1.5356813
-2.1703707	1.2759455	-0.6949935	1.3261145	1.2935031
1.1862187	1.2759455	1.6629148	0.2154658	-0.4040075
-1.4990528	-0.7633920	-0.6949935	0.2154658	0.1618293

12. Dimensionsreduktion Korrelationsplot

```
corrplot::corrplot(cor(Werte.sc), order = "hclust")
```



12. Dimensionsreduktion PCA berechnen

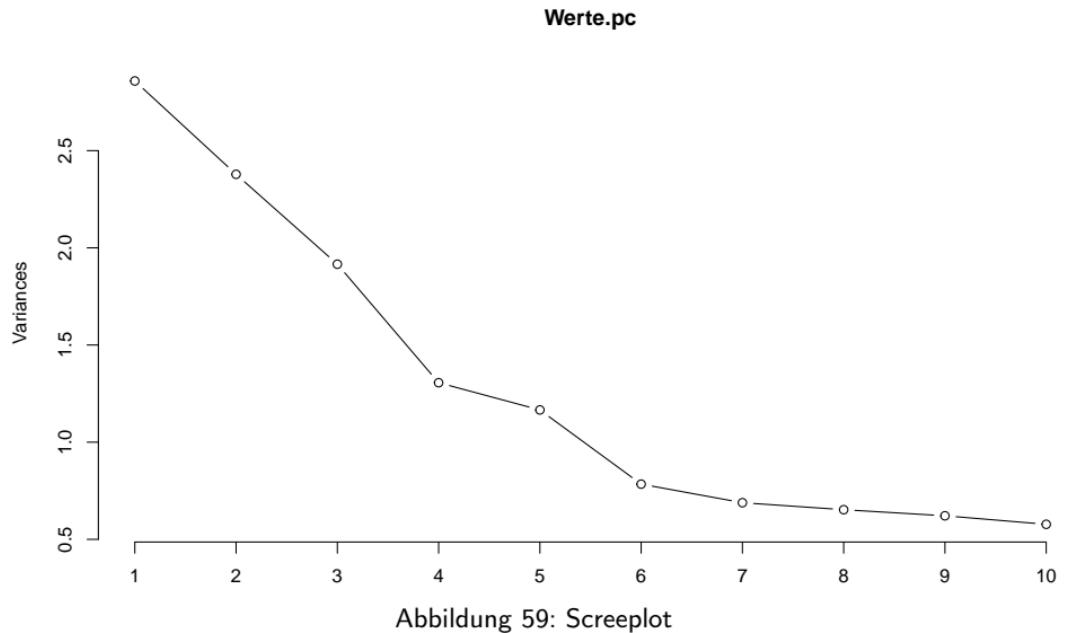
```
Werte.pc <- prcomp(Werte.sc) # Principal Components berechnen
summary(Werte.pc)

Gesamtvarianz <- sum(Werte.pc$sdev^2)

# Varianzanteil der ersten Hauptkomponente
Werte.pc$sdev[1]^2/Gesamtvarianz
```

12. Dimensionsreduktion Scree-Plot

```
plot(Werte.pc, type = "l")
```



Der *Eigenwert* ist eine Metrik für den Anteil der erklärten Varianz pro Hauptkomponente.

```
eigen(cor(Werte))
```

Laut dem Eigenwert-Kriterium sollen nur Faktoren mit einem *Eigenwert größer 1* extrahiert werden.

12. Dimensionsreduktion Screeplot

VSS.scree(Werte)

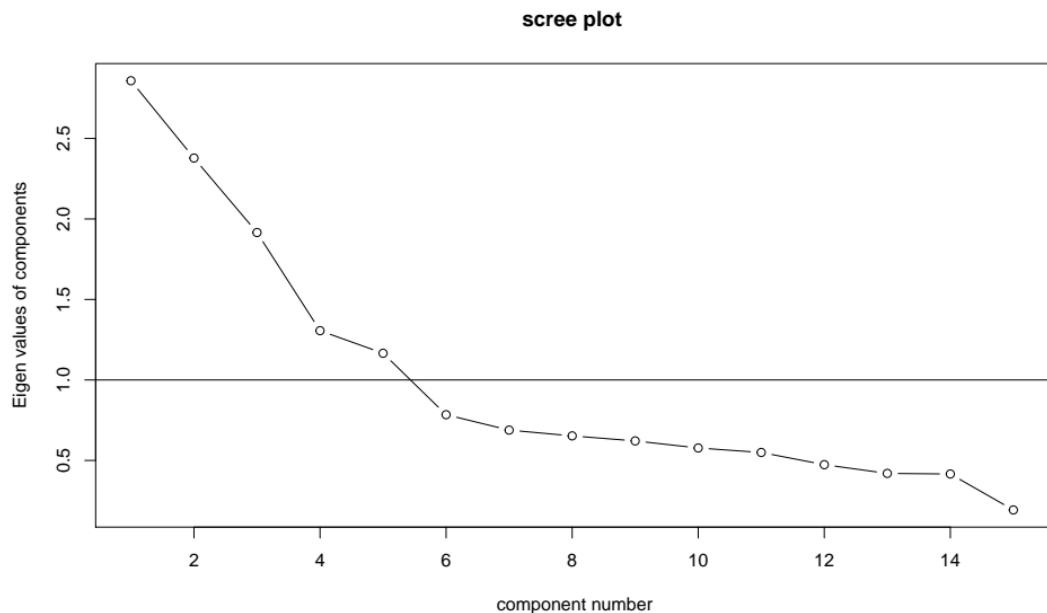
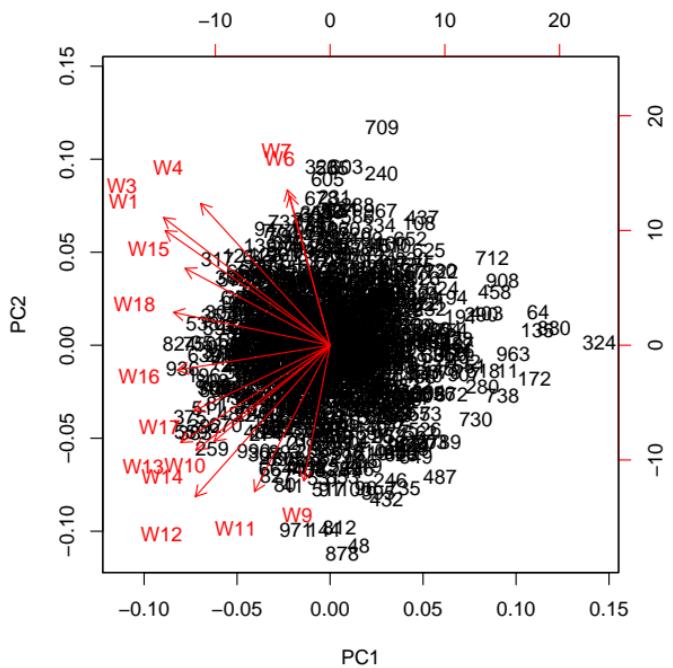


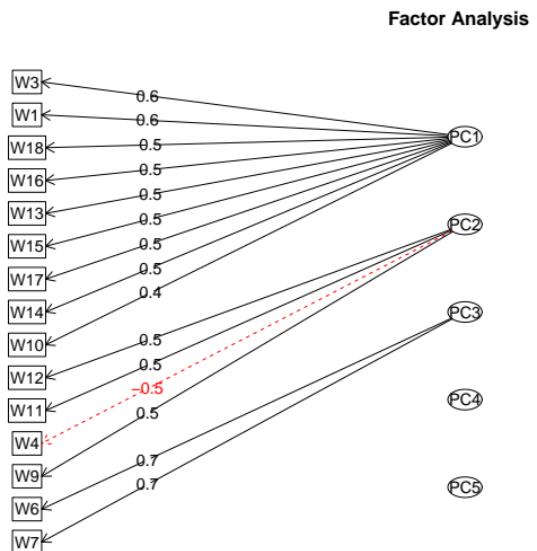
Abbildung 60: VSS-Screepplot

```
biplot(Werte.pc)
```



```
Werte.pca <- principal(Werte, nfactors = 5, rotate = "none")
```

```
fa.diagram(Werte.pca)
```



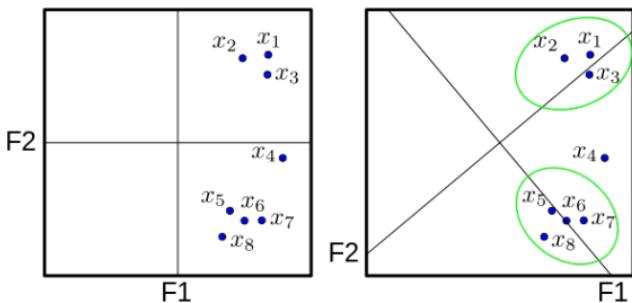


Abbildung 61: Beispiel für eine rechtwinklige Rotation

12. Dimensionsreduktion

Heatmap

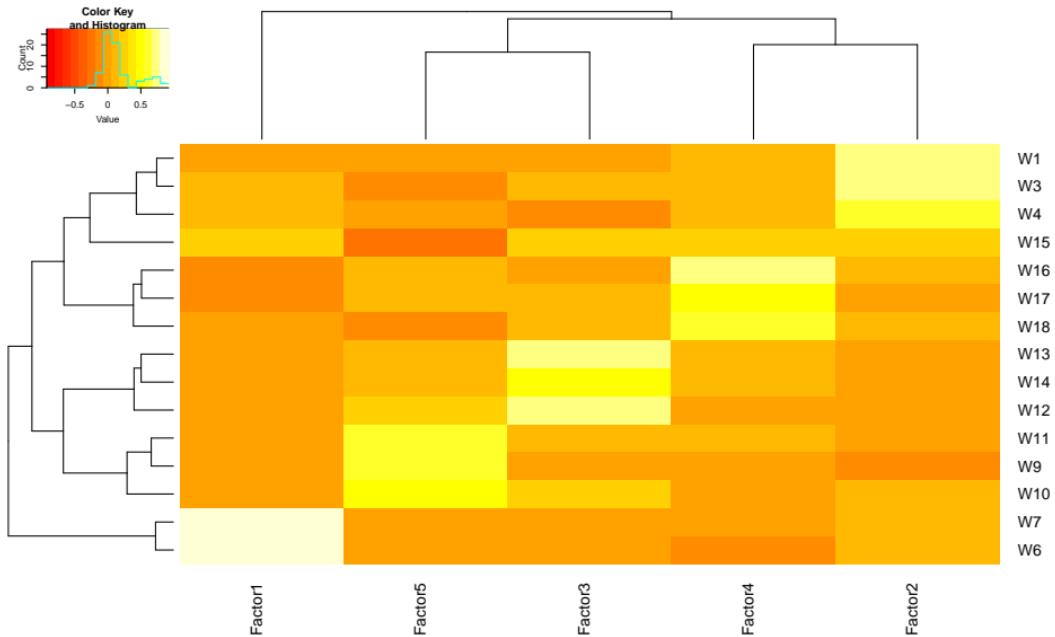


Abbildung 62: Heatmap einer EFA

```
Werte.ob <- factanal(Werte, factors = 5, scores = "Bartlett")
```

Inhaltlich ist Alpha eine Art mittlere Korrelation, die sich ergibt wenn man alle Items (paarweise) miteinander korreliert: I1-I2, I1-I3,...

```
df <- Werte %>% select(W12, W13, W14, W15)  
  
psych::alpha(df, check.keys = TRUE)
```

Alpha	Bedeutung
größer 0,9	exzellent
größer 0,8	gut
größer 0,7	akzeptabel
größer 0,6	fragwürdig
größer 0,5	schlecht

Textmining

- ▶ Sie kennen zentrale Ziele und Begriffe des Textminings.
- ▶ Sie wissen, was ein 'tidy text dataframe' ist.
- ▶ Sie können Worthäufigkeiten auszählen.
- ▶ Sie können Worthäufigkeiten anhand einer Wordcloud visualisieren.

- ▶ Ein *Corpus* bezeichnet die Menge der zu analysierenden Dokumente-
- ▶ Ein *Token (Term)* ist ein elementarer Baustein eines Texts, die kleinste Analyseeinheit, häufig ein Wort.
- ▶ Unter *tidy text* versteht man einen Dataframe, in dem pro Zeile nur ein Term steht.

```
text <- c("Wir haben die Frauen zu Bett gebracht,", "als die Männer in Frankreich sta  
    "Wir hatten uns das viel schöner gedacht.", "Wir waren nur Konfirmanden.")  
text_df <- data_frame(Zeile = 1:4, text = text)
```

Zeile	wort
1	wir
1	haben
1	die
1	frauen
1	zu
1	bett

In einem 'tidy text Dataframe' steht in jeder Zeile ein Wort (token) und die Häufigkeit des Worts im Dokument.

```
## # A tibble: 1 x 1
##       n
##   <int>
## 1 26396
```

```
afd_df %>%  
  na.omit() %>% # fehlende Werte löschen  
  dplyr::count(token, sort = TRUE) %>%  
  head
```

```
## # A tibble: 6 x 2  
##   token     n  
##   <chr> <int>  
## 1 die     1151  
## 2 und    1147  
## 3 der     870  
## 4 zu      435  
## 5 für     392  
## 6 in      392
```

13. Textmining

Stopwörter entfernen

13. Textmining word

ab
aber
abgesehen alle
allein
aller

token	n
deutschland	190
afd	171
programm	80
wollen	67
bürger	57

Tabelle 10: Die häufigsten Wörter im AfD-Parteiprogramm mit 'stemming'

token_stem	n
deutschland	219
afd	171
deutsch	119

```
wordcloud(words = afd_count$token_stem, freq = afd_count$n, max.words = 100,  
scale = c(2, 0.5), colors = brewer.pal(6, "Dark2"))
```



Anhang