

Pravděpodobnostní metody ve strojírenství

F.1 - Regresní analýza



F.1 - Regresní analýza

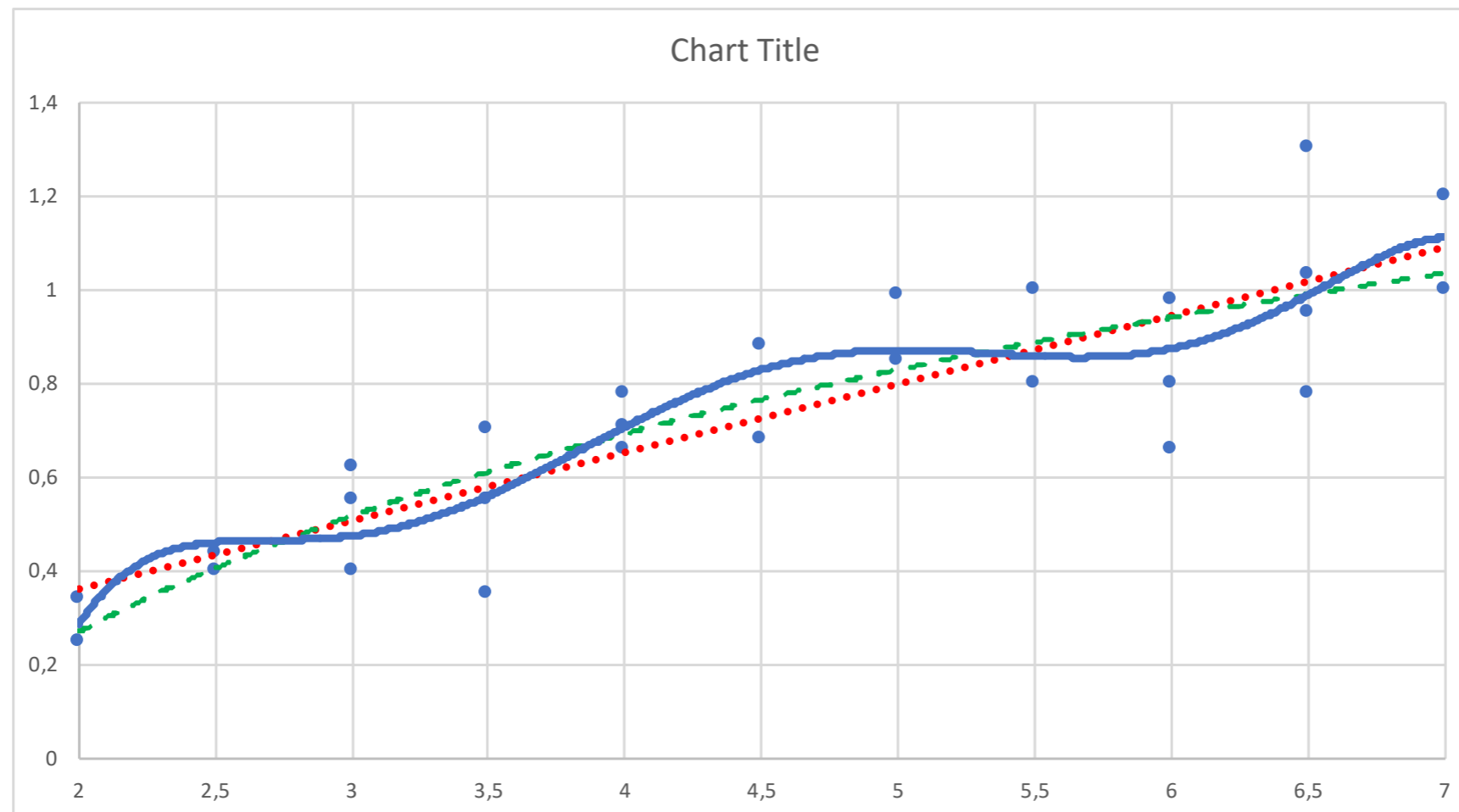
- Klíčové pojmy:**
- Lineární model
 - Metoda nejmenších čtverců
 - Rezidua

- Klíčové vztahy:**
- Testy významnosti regresních koeficientů
 - Test významnosti regresního modelu
 - Pásy spolehlivosti
 - Analýza reziduí
 - Linearizace modelu

Lineární regresní model

Závislost mezi nezávisle proměnnou a závisle proměnnou: $y=f(x)$

- funkční závislost: x a y jsou nenáhodné, pro jedno x je nejvýše jedna hodnota y
- regresní závislost: y je realizace náhodné veličiny Y při konkrétním x ; pro jedno x můžeme pozorovat různé hodnoty Y



Lineární regresní model

$$Y = \beta_0 + \beta_1 X_1 + \beta_2 X_2 + \cdots + \beta_k X_k + \epsilon$$

$$\mathbf{Y} = \mathbf{X} \cdot \vec{\beta} + \vec{\epsilon}$$

$$\vec{\beta} = \begin{pmatrix} \beta_0 \\ \beta_0 \\ \vdots \\ \beta_k \end{pmatrix} \quad \mathbf{Y} = \begin{pmatrix} Y_1 \\ Y_2 \\ \vdots \\ Y_n \end{pmatrix} \quad \mathbf{X} = \begin{pmatrix} 1 & X_{11} & X_{12} & \cdots & X_{1k} \\ 1 & X_{21} & X_{22} & \cdots & X_{2k} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \\ 1 & X_{n1} & X_{n2} & \cdots & X_{nk} \end{pmatrix} \quad \vec{\epsilon} = \begin{pmatrix} e_1 \\ \vdots \\ e_n \end{pmatrix}$$

Příklad: Přímková regrese: $Y = \alpha + \beta X + \epsilon$

$$\vec{\beta} = \begin{pmatrix} \alpha \\ \beta \end{pmatrix}, \quad X = \begin{pmatrix} 1 & x_1 \\ \vdots & \vdots \\ 1 & x_n \end{pmatrix}, \quad \vec{\epsilon} = \begin{pmatrix} \epsilon_1 \\ \vdots \\ \epsilon_n \end{pmatrix}.$$

Příklad: Kvadratická regrese: $Y = \beta_0 + \beta_1 X + \beta_2 x^2 + \epsilon$

$$\vec{\beta} = \begin{pmatrix} \beta_0 \\ \beta_1 \\ \beta_2 \end{pmatrix}, \quad X = \begin{pmatrix} 1 & x_1 & x_1^2 \\ \vdots & \vdots & \vdots \\ 1 & x_2 & x_2^2 \end{pmatrix}, \quad \vec{\epsilon} = \begin{pmatrix} \epsilon_1 \\ \vdots \\ \epsilon_n \end{pmatrix}.$$



Lineární regresní model

$$Y = \beta_0 + \beta_1 X_1 + \beta_2 X_2 + \cdots + \beta_k X_k + \epsilon$$

$$\mathbf{Y} = \mathbf{X} \cdot \vec{\beta} + \vec{\epsilon}$$

$$\vec{\beta} = \begin{pmatrix} \beta_0 \\ \beta_0 \\ \vdots \\ \beta_k \end{pmatrix} \quad \mathbf{Y} = \begin{pmatrix} Y_1 \\ Y_2 \\ \vdots \\ Y_n \end{pmatrix} \quad \mathbf{X} = \begin{pmatrix} 1 & X_{11} & X_{12} & \cdots & X_{1k} \\ 1 & X_{21} & X_{22} & \cdots & X_{2k} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \\ 1 & X_{n1} & X_{n2} & \cdots & X_{nk} \end{pmatrix} \quad \vec{\epsilon} = \begin{pmatrix} e_1 \\ \vdots \\ e_n \end{pmatrix}$$

Odhad parametrů: (metodou nejmenších čtverců)

Zvolíme ztrátovou funkci: $S(\vec{\beta}) = \sum_{i=1}^n (y_i - \beta_0 - \beta_1 x_{i1} - \cdots - \beta_k x_{ik})^2$, kterou minimalizujeme.

$$S = (\mathbf{Y} - \mathbf{X}\vec{\beta})'(\mathbf{Y} - \mathbf{X}\vec{\beta})$$

To vede obecně k řešení $\vec{b} = (\mathbf{X}'\mathbf{X})^{-1}\mathbf{X}\mathbf{Y}$.

Pokud je regresor \mathbf{X} nenáhodný, potom je tento odhad nestranným odhadem $\vec{\beta}$.

$$E\vec{b} = \vec{\beta}, \quad \text{Var}\vec{b} = \sigma^2(\mathbf{X}'\mathbf{X})^{-1}.$$

$$S_R = (\mathbf{Y} - \mathbf{X}\vec{b})'(\mathbf{Y} - \mathbf{X}\vec{b}) = \mathbf{Y}'\mathbf{Y} - \vec{b}'\mathbf{X}'\mathbf{X}$$

$$s^2 = \frac{1}{n-k} S_R$$

reziduální součet čtverců

reziduální rozptyl



Lineární regresní model

Příklad: Přímková regrese: $Y = \alpha + \beta X + \epsilon$

$$\vec{\beta} = \begin{pmatrix} \alpha \\ \beta \end{pmatrix}, \quad X = \begin{pmatrix} 1 & x_1 \\ \vdots & \vdots \\ 1 & x_n \end{pmatrix}, \quad \vec{\epsilon} = \begin{pmatrix} \epsilon_1 \\ \vdots \\ \epsilon_n \end{pmatrix}.$$

Odhad parametrů: (metodou nejmenších čtverců) $S(\alpha, \beta) = \sum_{i=1}^n (y_i - \alpha - \beta x_i)^2$

$$\frac{\partial S}{\partial \alpha} = -2 \sum_{i=1}^n (y_i - \alpha - \beta x_i) = 0$$

$$\frac{\partial S}{\partial \beta} = -2 \sum_{i=1}^n (y_i - \alpha - \beta x_i) x_i = 0$$

$$n\alpha + \beta \sum_{i=1}^n x_i = \sum_{i=1}^n y_i$$

$$\alpha \sum_{i=1}^n x_i + \beta \sum_{i=1}^n x_i^2 = \sum_{i=1}^n x_i y_i$$

normální soustava rovnic

a její řešení:

$$b = \frac{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x}) y_i}{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2}$$
$$a = \bar{y} - b\bar{x}$$

rovnice regresní přímky: $y = a + bx$



Lineární regresní model

Příklad: Kvadratická regrese: $Y = \alpha + \beta X + \gamma X^2 + \epsilon$

$$\vec{\beta} = \begin{pmatrix} \alpha \\ \beta \\ \gamma \end{pmatrix}, \quad X = \begin{pmatrix} 1 & x_1 & x_1^2 \\ \vdots & \vdots & \vdots \\ 1 & x_n & x_n^2 \end{pmatrix}, \quad \vec{\epsilon} = \begin{pmatrix} \epsilon_1 \\ \vdots \\ \epsilon_n \end{pmatrix}.$$

Odhad parametrů: (metodou nejmenších čtverců) $S(\alpha, \beta, \gamma) = \sum_{i=1}^n (y_i - \alpha - \beta x_i - \gamma x_i^2)^2$

$$\frac{\partial S}{\partial \alpha} = -2 \sum_{i=1}^n (y_i - \alpha - \beta x_i - \gamma x_i^2) = 0$$

$$\frac{\partial S}{\partial \beta} = -2 \sum_{i=1}^n (y_i - \alpha - \beta x_i - \gamma x_i^2) x_i = 0$$

$$\frac{\partial S}{\partial \gamma} = -2 \sum_{i=1}^n (y_i - \alpha - \beta x_i - \gamma x_i^2) x_i^2 = 0$$

$$\begin{pmatrix} n & \sum_{i=1}^n x_i & \sum_{i=1}^n x_i^2 \\ \sum_{i=1}^n x_i & \sum_{i=1}^n x_i^2 & \sum_{i=1}^n x_i^3 \\ \sum_{i=1}^n x_i^2 & \sum_{i=1}^n x_i^3 & \sum_{i=1}^n x_i^4 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \alpha \\ \beta \\ \gamma \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \sum_{i=1}^n y_i \\ \sum_{i=1}^n y_i x_i \\ \sum_{i=1}^n y_i x_i^2 \end{pmatrix} \Rightarrow \begin{pmatrix} a \\ b \\ c \end{pmatrix}$$

$$\Rightarrow y = a + bx + cx^2$$



Lineární regresní model

$$\mathbf{Y} = \mathbf{X}\vec{\beta} + \vec{e}$$

$$S = (\mathbf{Y} - \mathbf{X}\vec{\beta})'(\mathbf{Y} - \mathbf{X}\vec{\beta})$$

$$\vec{b} = (\mathbf{X}'\mathbf{X})^{-1}\mathbf{X}'\mathbf{Y}$$

$$E\vec{b} = \vec{\beta}$$

$$\text{Var}\vec{b} = \sigma^2(\mathbf{X}'\mathbf{X})^{-1}$$

$$S_e = (\mathbf{Y} - \mathbf{X}\vec{b})'(\mathbf{Y} - \mathbf{X}\vec{b}) = \mathbf{Y}'\mathbf{Y} - \vec{b}'\mathbf{X}'\mathbf{Y}$$

$$s^2 = \frac{1}{n - k} S_e$$

Podmínky pro použití lineárního modelu

- Nezávislost pozorování: náhodné veličiny Y_i jsou navzájem stochasticky nezávislé
- Stejné rozptyly (homoskedasticita): rozptyl vysvětlované náhodné veličiny Y nezávisí na hodnotách vysvětlující veličiny X
- Normalita dat: vysvětlovaná náhodná veličina Y má normální rozdělení



Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

```
> library(datasets)
```

```
> cars
```

	speed	dist		speed	dist		speed	dist		speed	dist
1	4	2	14	12	24	27	16	32	40	20	48
2	4	10	15	12	28	28	16	40	41	20	52
3	7	4	16	13	26	29	17	32	42	20	56
4	7	22	17	13	34	30	17	40	43	20	64
5	8	16	18	13	34	31	17	50	44	22	66
6	9	10	19	13	46	32	18	42	45	23	54
7	10	18	20	14	26	33	18	56	46	24	70
8	10	26	21	14	36	34	18	76	47	24	92
9	10	34	22	14	60	35	18	84	48	24	93
10	11	17	23	14	80	36	19	36	49	24	120
11	11	28	24	15	20	37	19	46	50	25	85
12	12	14	25	15	26	38	19	68			
13	12	20	26	15	54	39	20	32			

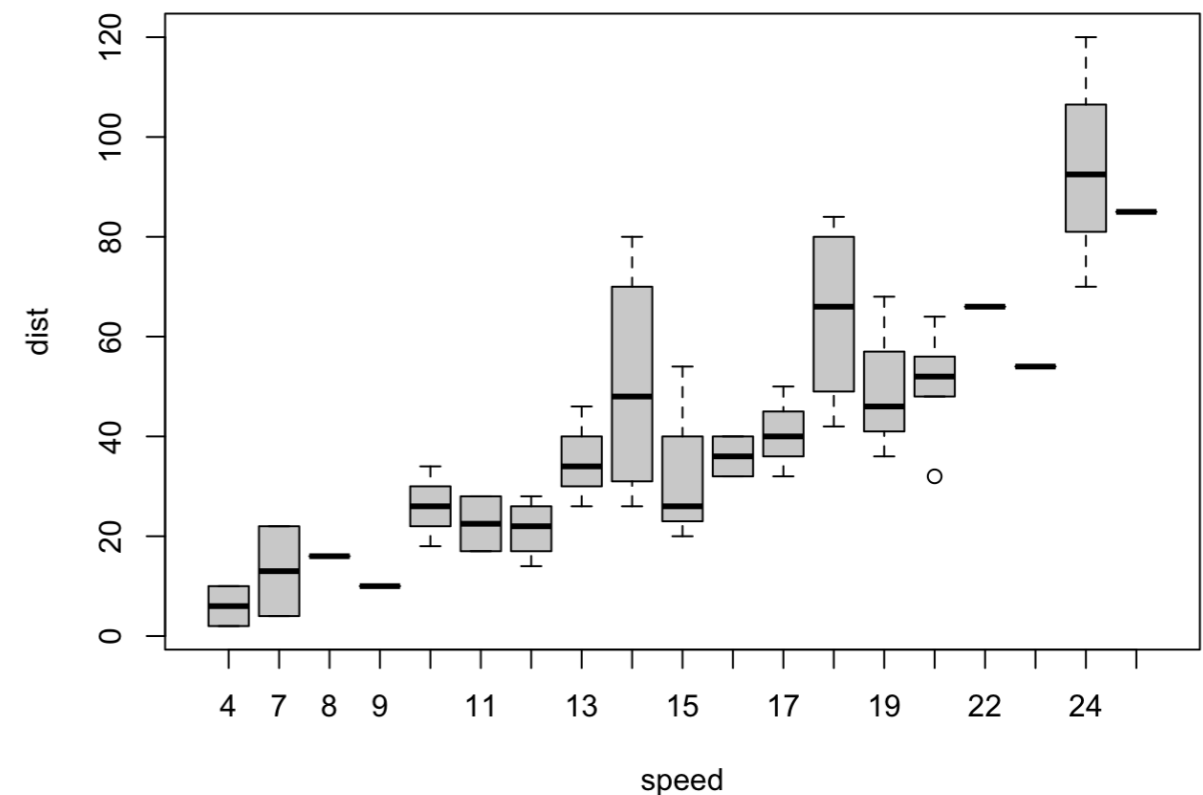
Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

- > library(datasets)
- > cars
- > plot(cars)
- > boxplot(dist~speed, data=cars)



Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

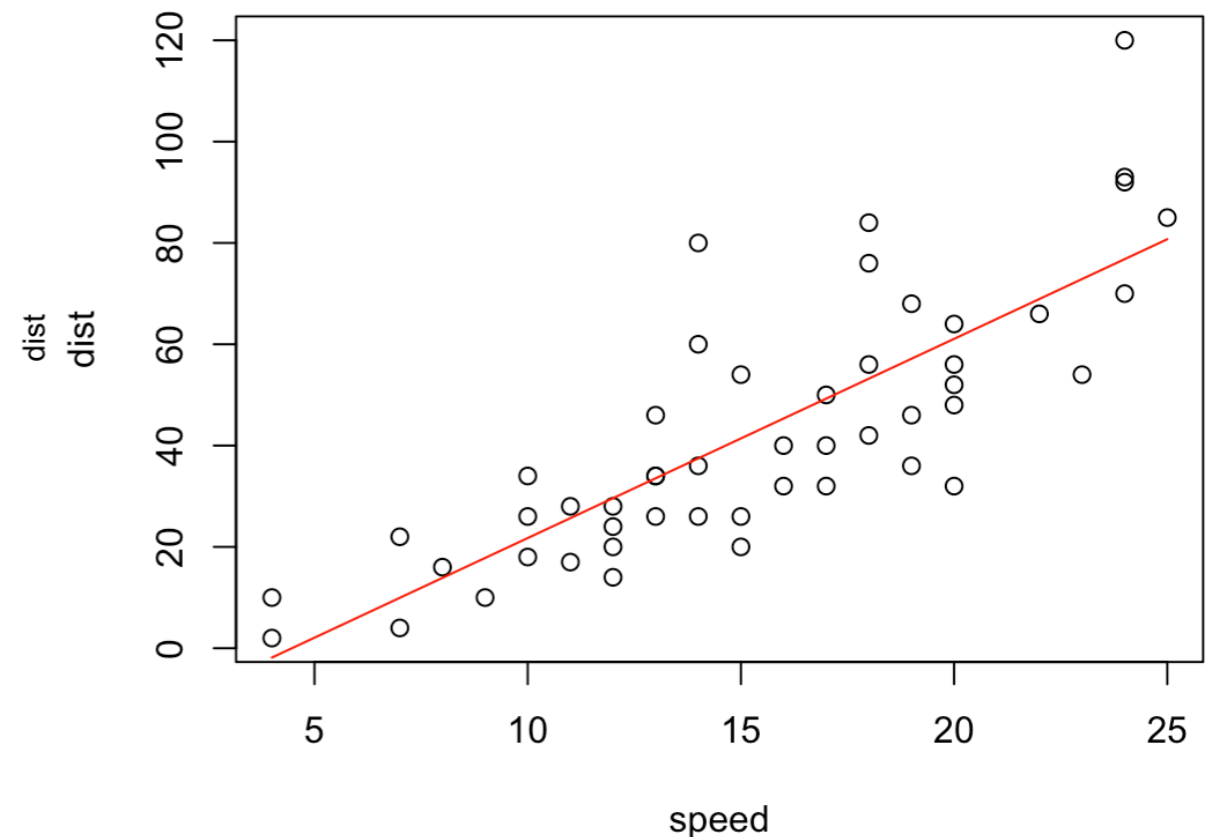
Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

```
> library(datasets)
> cars
> plot(cars)
> boxplot(dist~speed, data=cars)
> lrc <- lm(dist~speed, data=cars)
> lrc$coefficients
      (Intercept)      speed
      -17.579095    3.932409
```

Výsledkem je přímka: $y = -17,58 + 3,93x$

```
> a <- lrc$coefficients[1]
> b <- lrc$coefficients[2]
> lines(cars$speed, a+b*cars$speed, col = "red")
```

To je evidentně nesmysl, neboť při nulové rychlosti by byla brzdná dráha -17,58 m!



Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

regrese procházející počátkem: $Y = \beta * X + \epsilon$

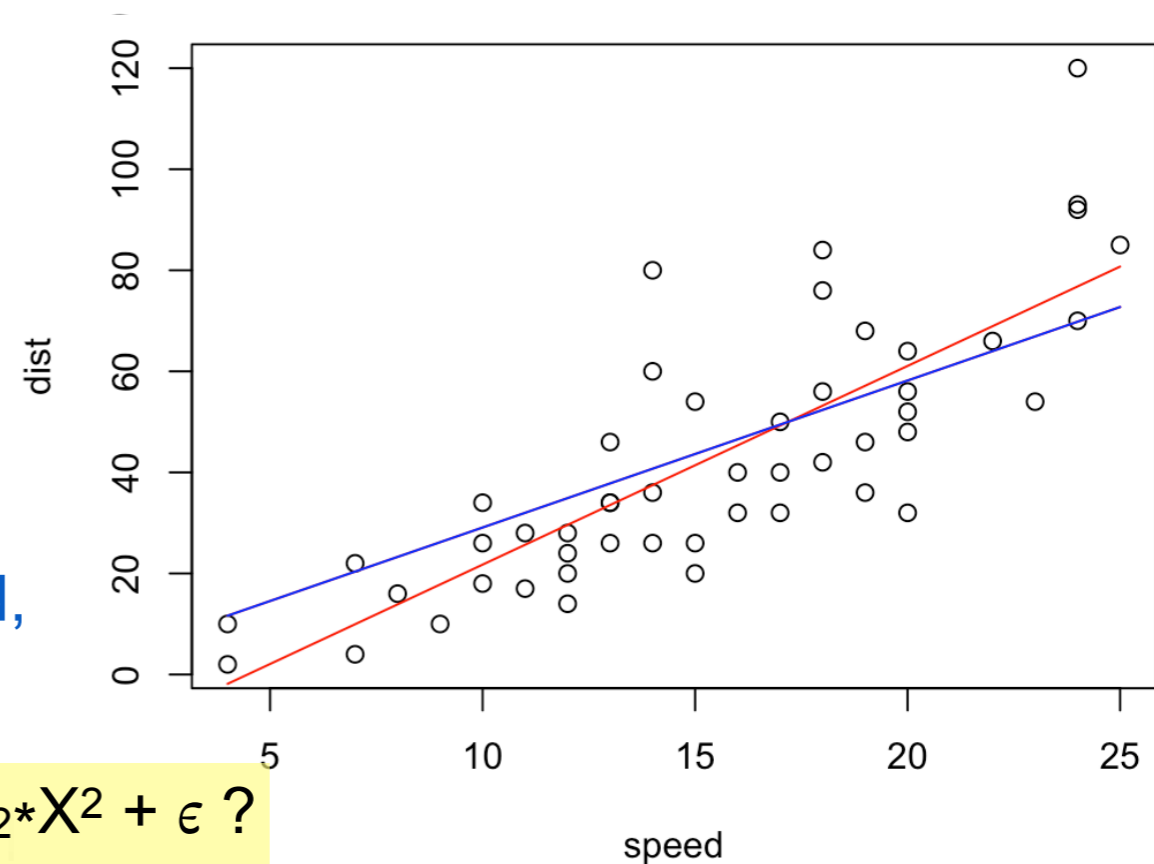
```
> lrc0 <- lm(dist~speed - 1, data=cars)
```

```
> lrc0$coefficients
```

```
speed  
2.909132
```

```
> lines(cars$speed, lrc0$coefficients*cars$speed,  
col = "blue")
```

nebyla by lepší kvadratická regrese: $Y = \beta_1 * X + \beta_2 * X^2 + \epsilon$?



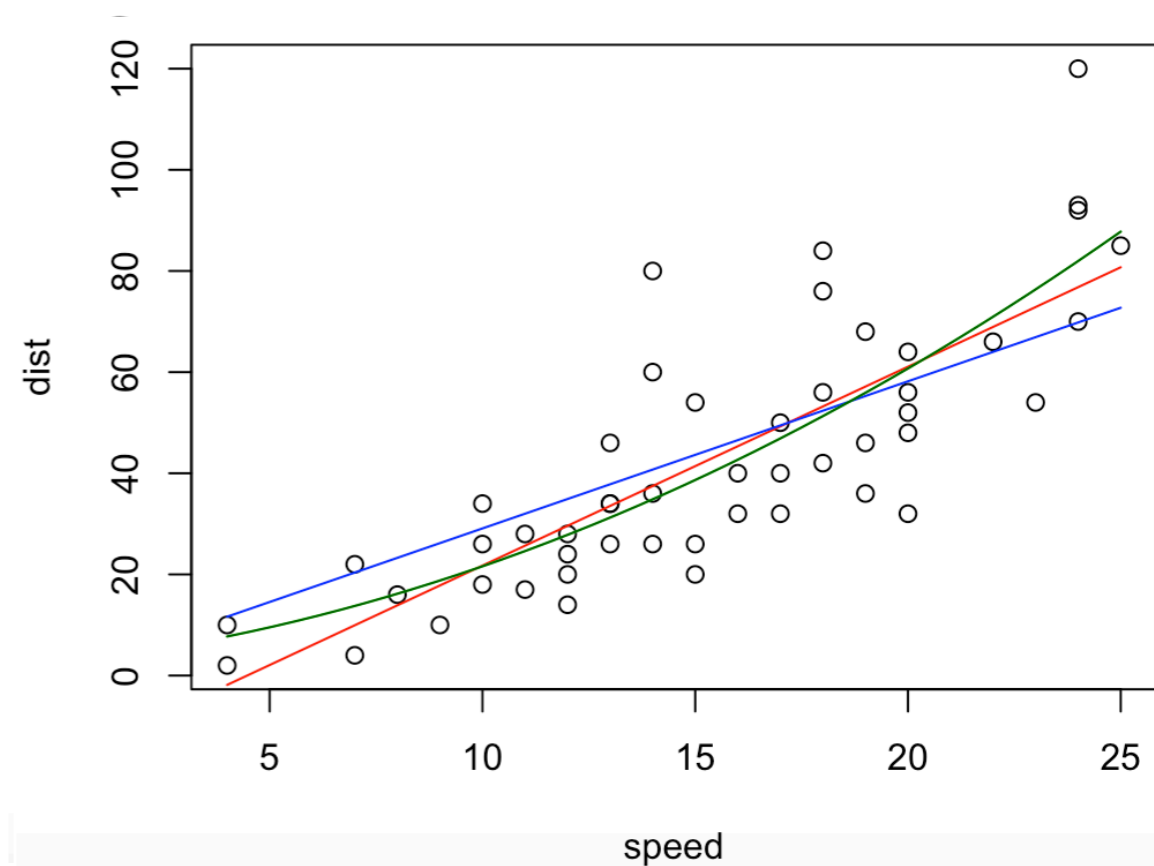
Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

```
> qspeed <- cars$speed^2
> qrc <- lm(dist~speed + qspeed, data=cars)
> qrc$coefficients
  (Intercept)    speed    qspeed
  2.4701378    0.9132876    0.0999593
> xfit<-seq(min(cars$speed),max(cars$speed),
length=40)
> yfit = qrc$coefficients[1]*one
  + qrc$coefficients[2]*xfit
  + qrc$coefficients[3]*xfit^2
> lines(xfit, yfit, col = "darkgreen")
```

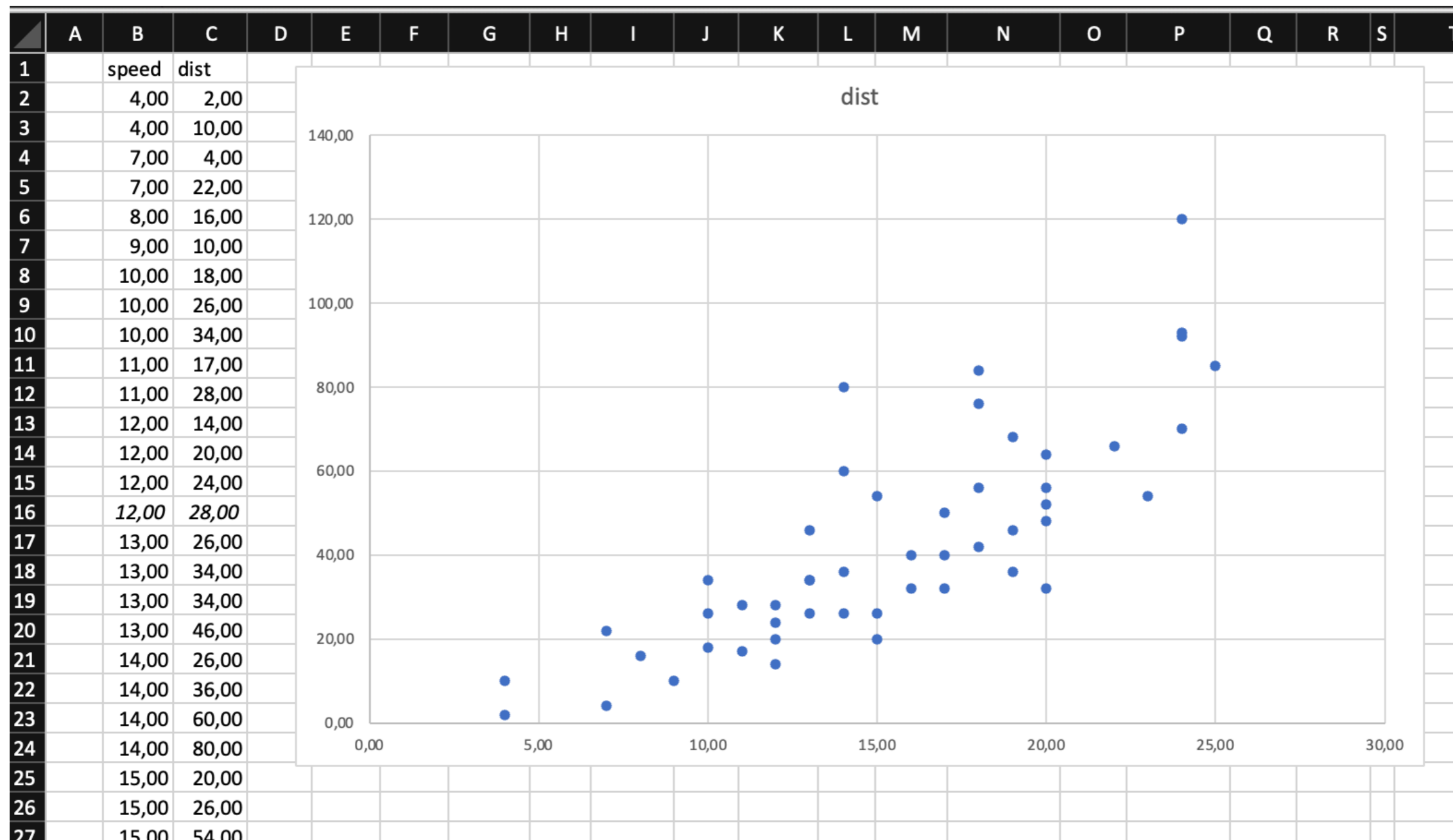


Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

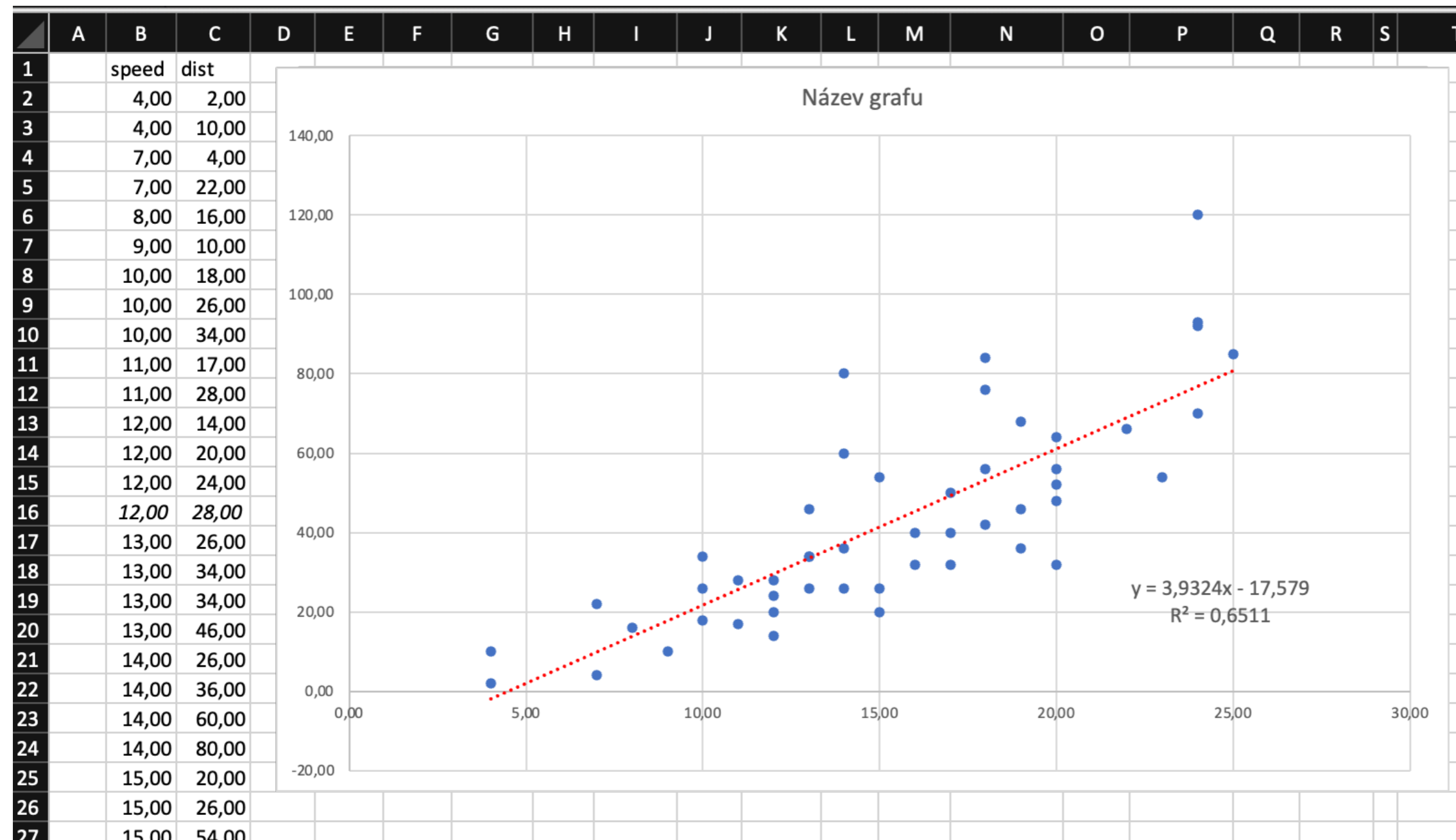


Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

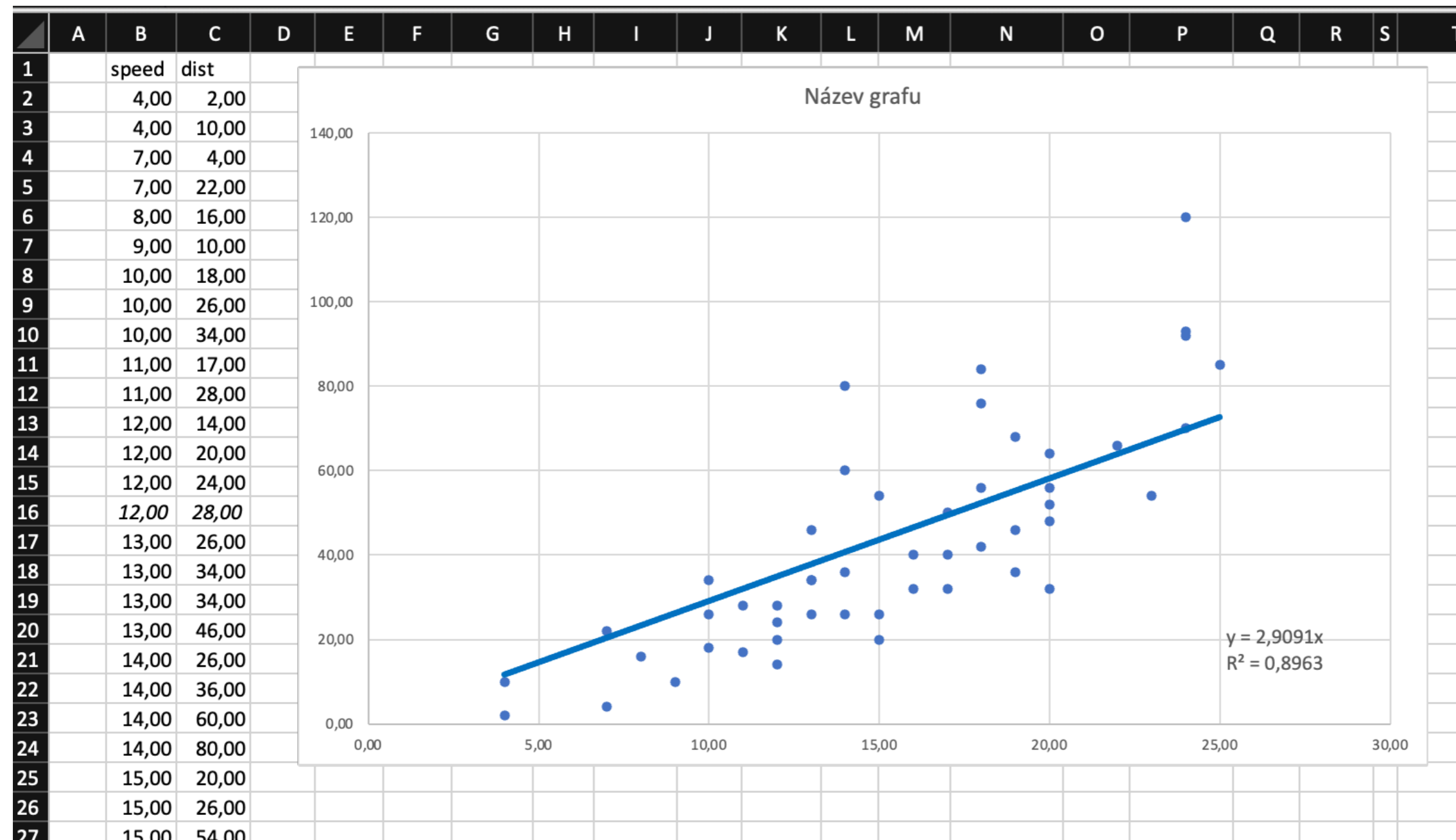


Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

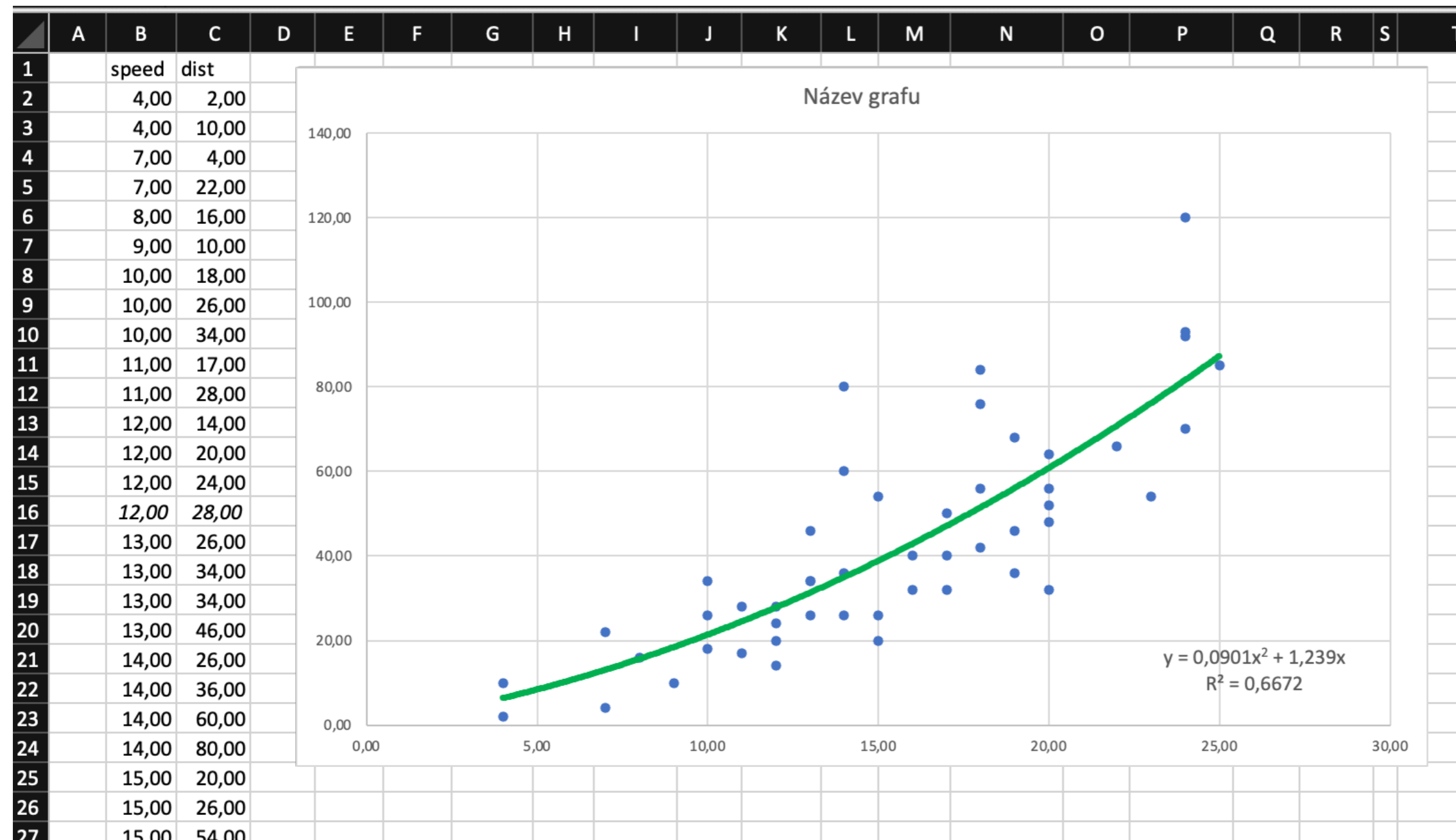


Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)



Lineární regresní model

Testování významnosti koeficientů (přímkové) lineární regrese

- reziduální součet čtverců: $S_R = \sum_{i=1}^n e_i^2 = \sum_{i=1}^n (y_i - a - bx_i)^2$ $s^2 = \frac{1}{n-2} S_R$

- intervalové odhady koeficientů:

$$a - s_a t_{1-\gamma/2}(n-2) \leq \alpha \leq a + s_a t_{1-\gamma/2}(n-2)$$

$$s_a^2 = \frac{\sum_{i=1}^n x_i^2}{n} s_b^2$$

$$b - s_b \cdot t_{1-\gamma/2}(n-2) \leq \beta \leq b + s_b \cdot t_{1-\gamma/2}(n-2)$$

$$s_b^2 = \frac{s^2}{\sum_{i=1}^n x_i^2 - n\bar{x}^2}$$

- test významnosti regresních koeficientů:

$$|T_a| = \left| \frac{a}{s_a} \right| \geq t_{1-\gamma/2}(n-2)$$

$$|T_b| = \left| \frac{b}{s_b} \right| \geq t_{1-\gamma/2}(n-2)$$

- koeficient determinace R^2 :

$$R^2 = \frac{\sum_{i=1}^n (a + bx_i - \bar{y})^2}{\sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2} = 1 - \frac{S_R}{\sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2} = \frac{\text{část variability vysvětlená modelem}}{\text{celková variabilita dat}}$$



Lineární regresní model

Testování významnosti regresního modelu

zde se testuje nulová hypotéza $H_0: \beta_1 = \beta_1 = \dots = \beta_k$
proti alternativní hypotéze $H_A: \beta_j \neq 0$ pro alespoň jedno $j = 1, 2, \dots, k$.

K tomu se používá metoda ANOVA s testovou statistikou $F = \frac{\frac{S_T}{k-1}}{\frac{S_R}{n-k}}$
která má F-rozdělení s $k-1$ a $n-k$ stupni volnosti.

kde $S_R = \sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2$ $S_T = \sum_{i=1}^n (\hat{y}_i - \bar{y})^2$ $\hat{y} = \mathbf{X} \cdot \vec{b}$ $\bar{y}_i = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n y_i$



Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedli jsme experiment s 50 vozidly: máme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

```
> lrc <- lm(dist~speed, data=cars)
> summary(lrc)
```

Call: `lm(formula = dist ~ speed, data = cars)`

Residuals:

Min	1Q	Median	3Q	Max
-29.069	-9.525	-2.272	9.215	43.201

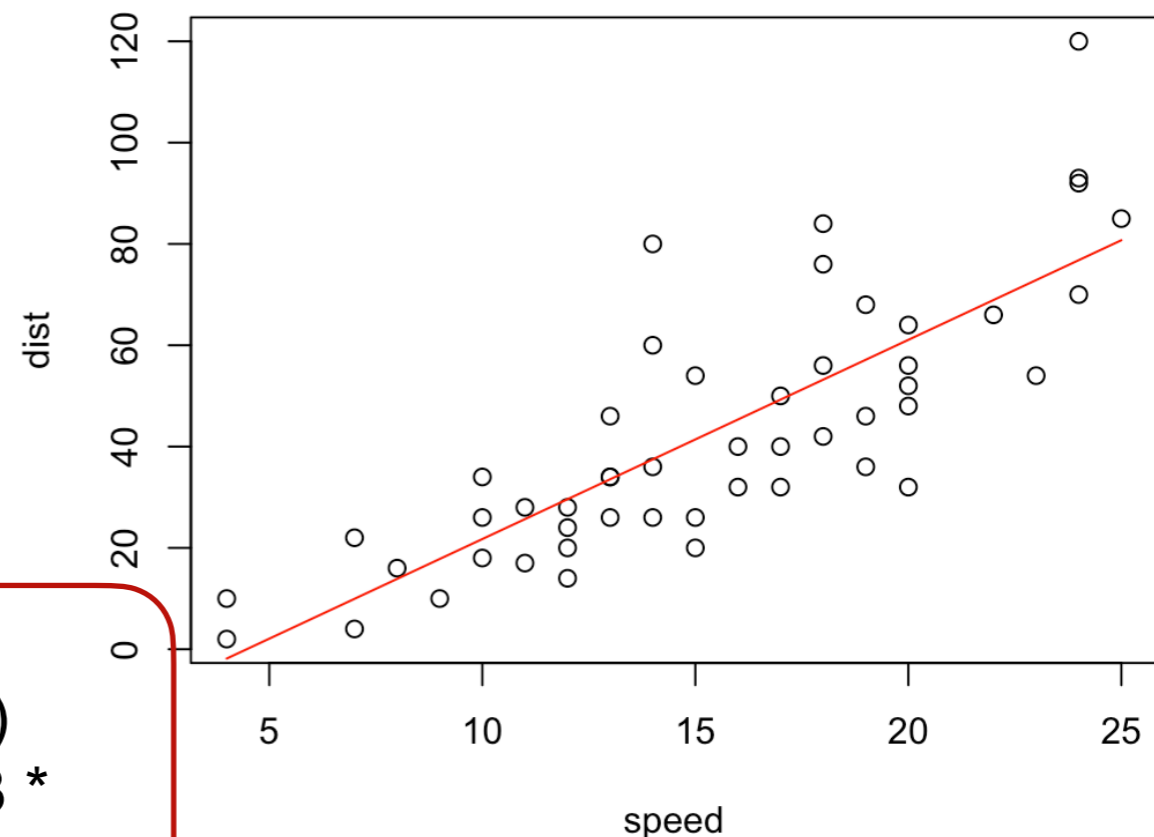
Coefficients:

	Estimate	Std. Error	t value	Pr(> t)
(Intercept)	-17.5791	6.7584	-2.601	0.0123 *
speed	3.9324	0.4155	9.464	1.49e-12 ***

Residual standard error: 15.38 on 48 degrees of freedom

Multiple R-squared: 0.6511, Adjusted R-squared: 0.6438

F-statistic: 89.57 on 1 and 48 DF, p-value: 1.49e-12



Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

```
> lrc0 <- lm(dist~speed-1, data=cars)
> summary(lrc0)
```

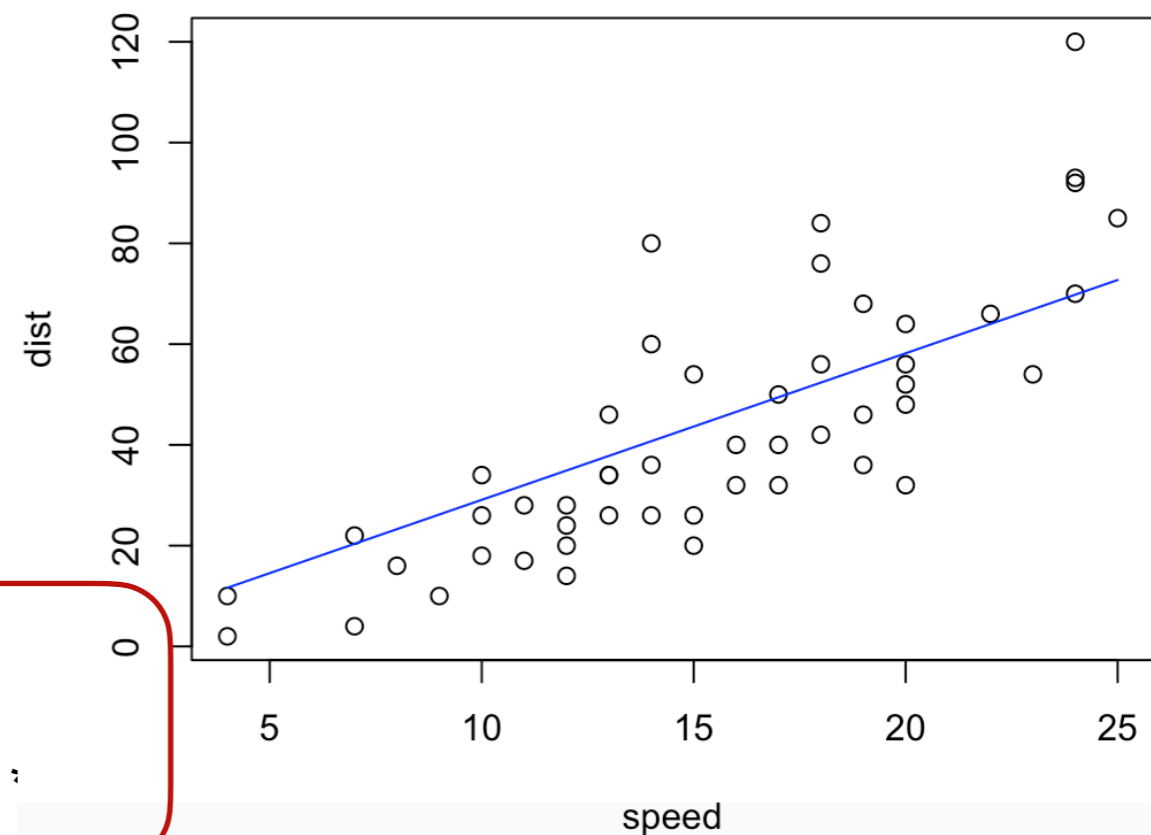
Call: lm(formula = dist ~ speed - 1, data = cars)

Residuals:

Min	1Q	Median	3Q	Max
-26.183	-12.637	-5.455	4.590	50.181

Coefficients:

	Estimate	Std. Error	t value	Pr(> t)
speed	2.9091	0.1414	20.58	<2e-16



Residual standard error: 16.26 on 49 degrees of freedom

Multiple R-squared: 0.8963, Adjusted R-squared: 0.8942

F-statistic: 423.5 on 1 and 49 DF, p-value: < 2.2e-16



Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

```
> qrc <- lm(dist~speed + I(speed^2), data=cars)
> qrc$coefficients
```

```
> summary(qrc)
```

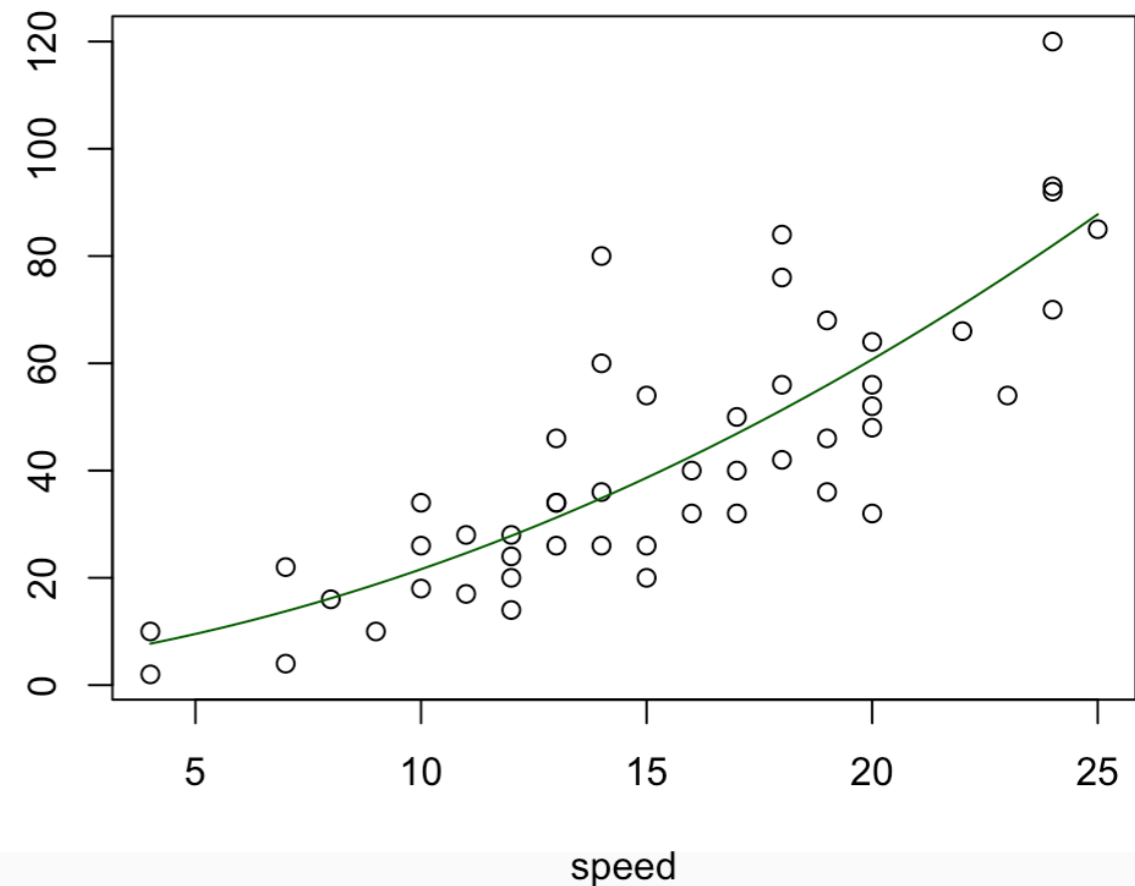
Call: lm(formula = dist ~ speed + qspeed, data = cars)

Residuals:

Min	1Q	Median	3Q	Max
-28.720	-9.184	-3.188	4.628	45.152

Coefficients:

	Estimate	Std. Error	t value	Pr(> t
(Intercept)	2.47014	14.81716	0.167	0.868
speed	0.91329	2.03422	0.449	0.656
I(speed^2)	0.09996	0.06597	1.515	0.136



Residual standard error: 15.18 on 47 degrees of freedom

Multiple R-squared: 0.6673, Adjusted R-squared: 0.6532

F-statistic: 47.14 on 2 and 47 DF, p-value: 5.852e-12



Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

```
> qrc0 <- lm(dist~speed + I(speed^2) - 1,  
  data=cars)
```

```
> summary(qrc0)
```

Call: lm(formula = dist ~ speed+I(speed^2)-1, data = cars)

Residuals:

Min	1Q	Median	3Q	Max
-28.836	-9.071	-3.152	4.570	44.986

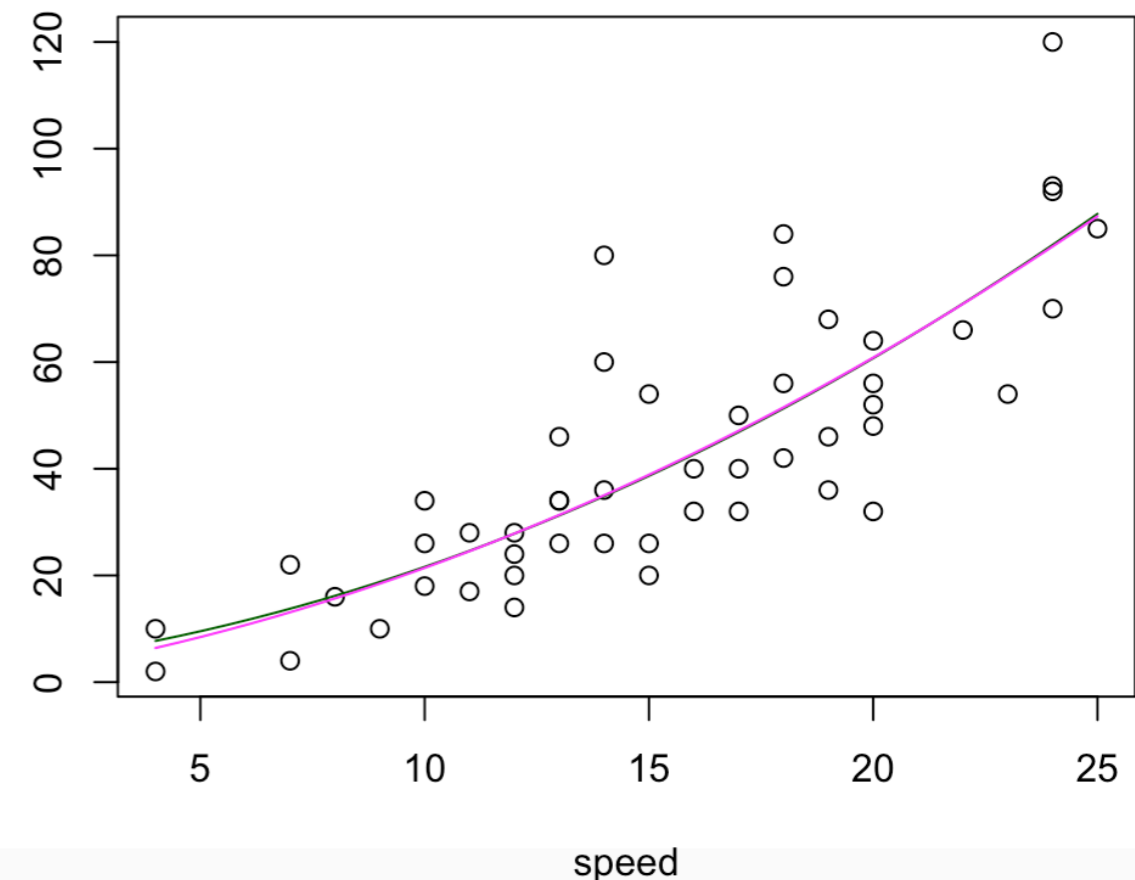
Coefficients:

	Estimate	Std. Error	t value	Pr(> t)
speed	1.23903	0.55997	2.213	0.0317
I(speed^2)	0.09014	0.02939	3.067	0.00355

Residual standard error: 15.02 on 48 degrees of freedom

Multiple R-squared: 0.9133, Adjusted R-squared: 0.9097

F-statistic: 252.8 on 2 and 48 DF, p-value: < 2.2e-16



Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

```
> qrc2 <- lm(dist~I(speed^2) - 1, data=cars)
```

```
> summary(qrc2)
```

Call: `lm(formula = dist ~ I(speed^2)-1, data = c`_{dist}

Residuals:

Min	1Q	Median	3Q	Max
-29.350	-7.988	1.325	8.080	49.939

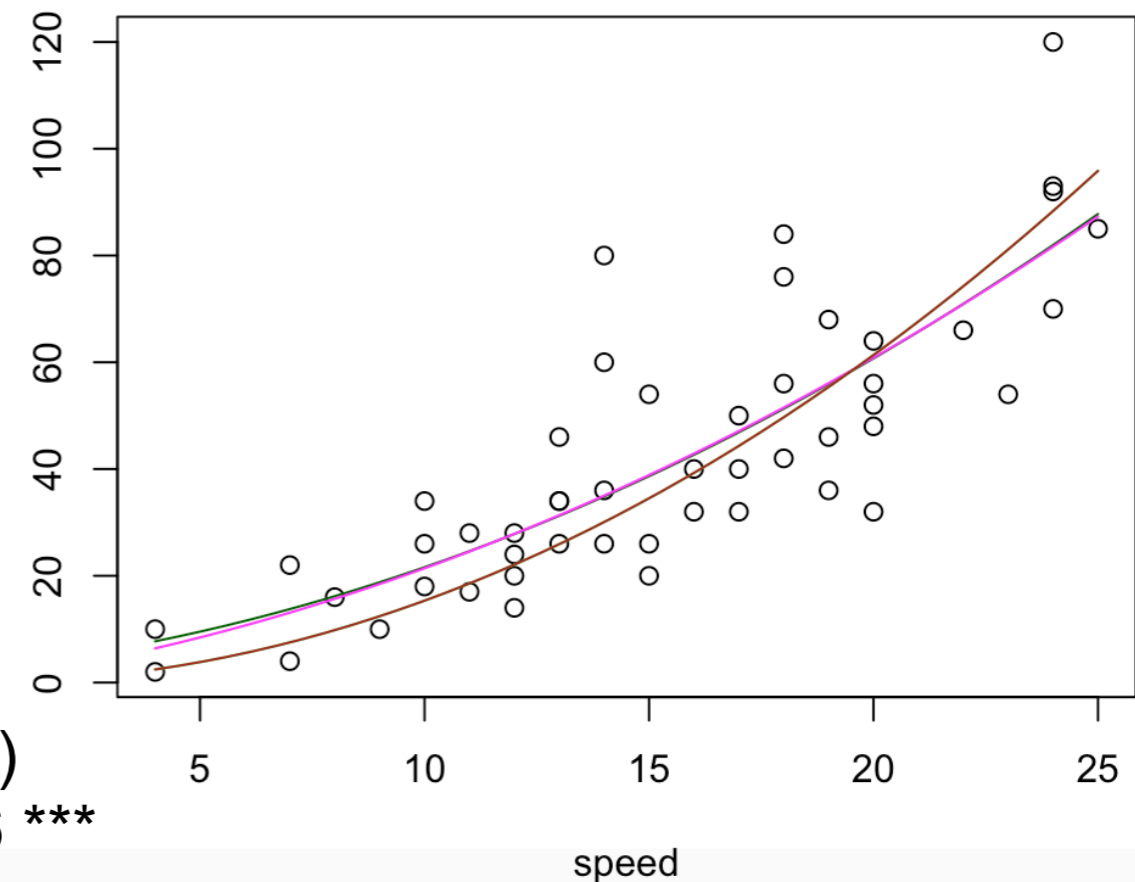
Coefficients:

	Estimate	Std. Error	t value	Pr(> t)
I(speed^2)	0.153374	0.007122	21.54	<2e-16 ***

Residual standard error: 15.61 on 49 degrees of freedom

Multiple R-squared: 0.9044, Adjusted R-squared: 0.9025

F-statistic: 463.8 on 1 and 49 DF, p-value: < 2.2e-16



Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

> `summary(qrc0)`

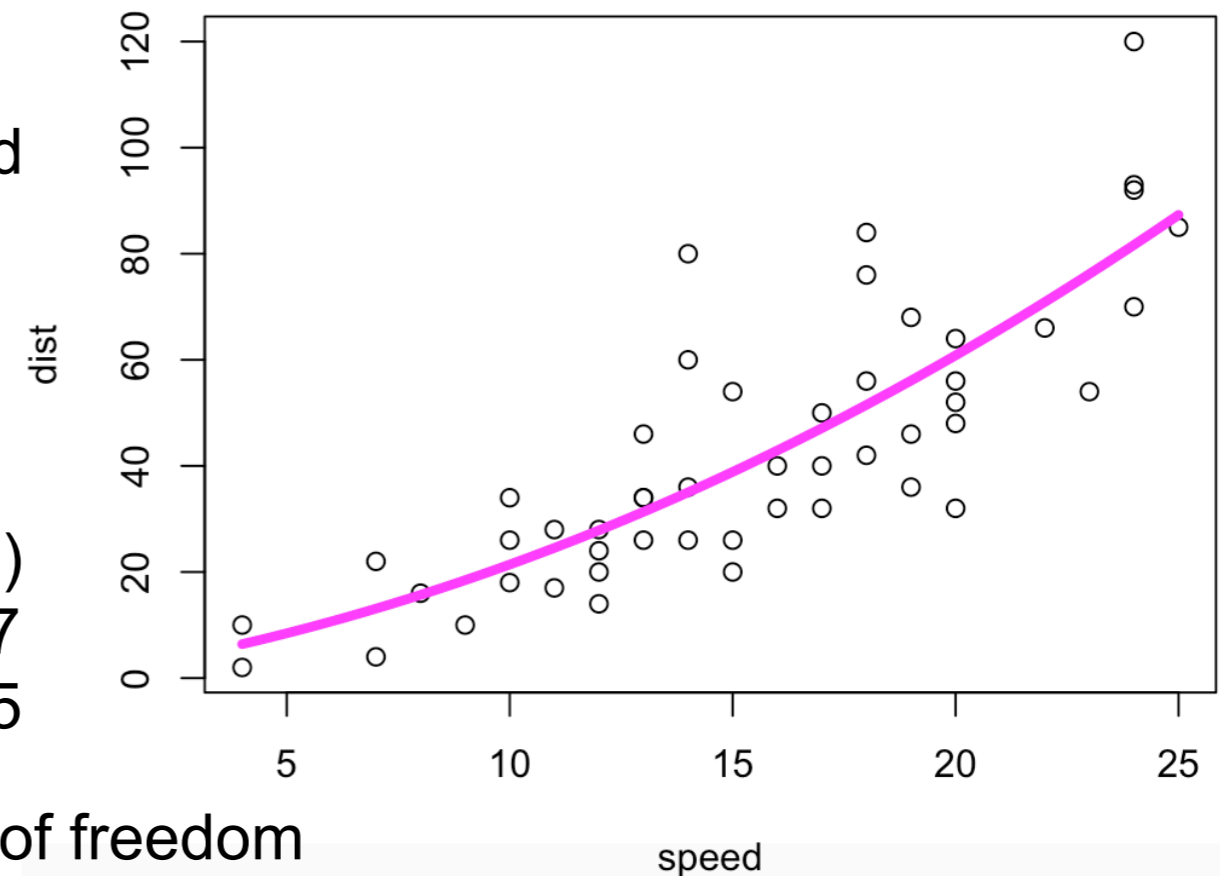
Call: `lm(formula = dist ~ speed + I(speed^2) - 1, d`

Residuals:

Min	1Q	Median	3Q	Max
-28.836	-9.071	-3.152	4.570	44.986

Coefficients:

	Estimate	Std. Error	t value	Pr(> t)
speed	1.23903	0.55997	2.213	0.0317
I(speed^2)	0.09014	0.02939	3.067	0.0035



Residual standard error: 15.02 on 48 degrees of freedom

Multiple R-squared: 0.9133, Adjusted R-squared: 0.9097

F-statistic: 252.8 on 2 and 48 DF, p-value: < 2.2e-16

Závěr: Závislost délky brzdné dráhy (y) na rychlosti (x) je kvadratická.
Na základě měření jsme odhadli tuto závislost rovnicí: $y = 1,24x + 0,09x^2$



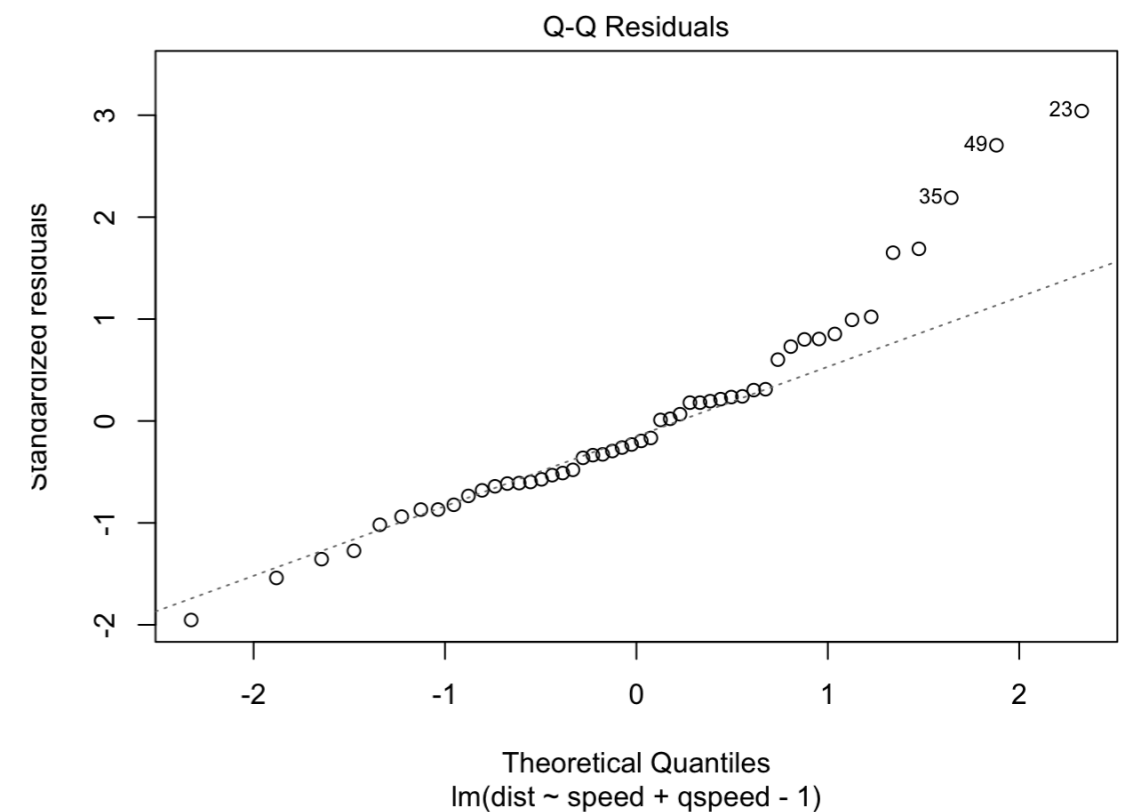
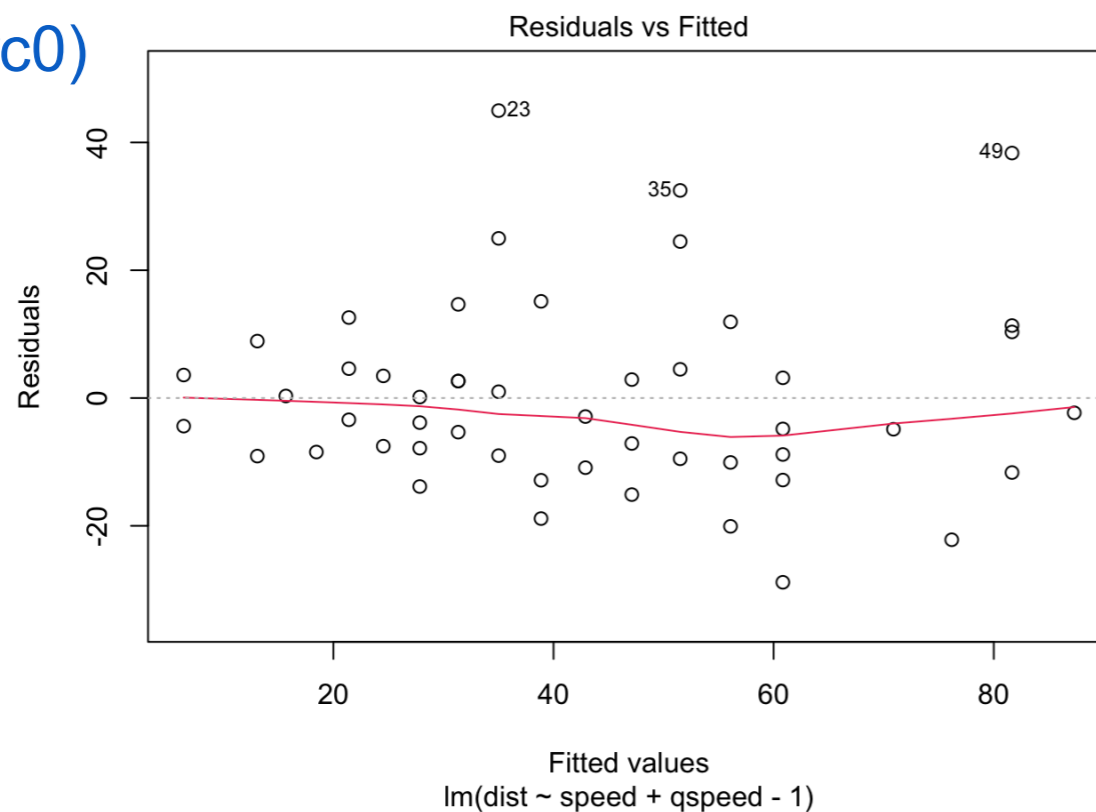
Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

> plot(qrc0)



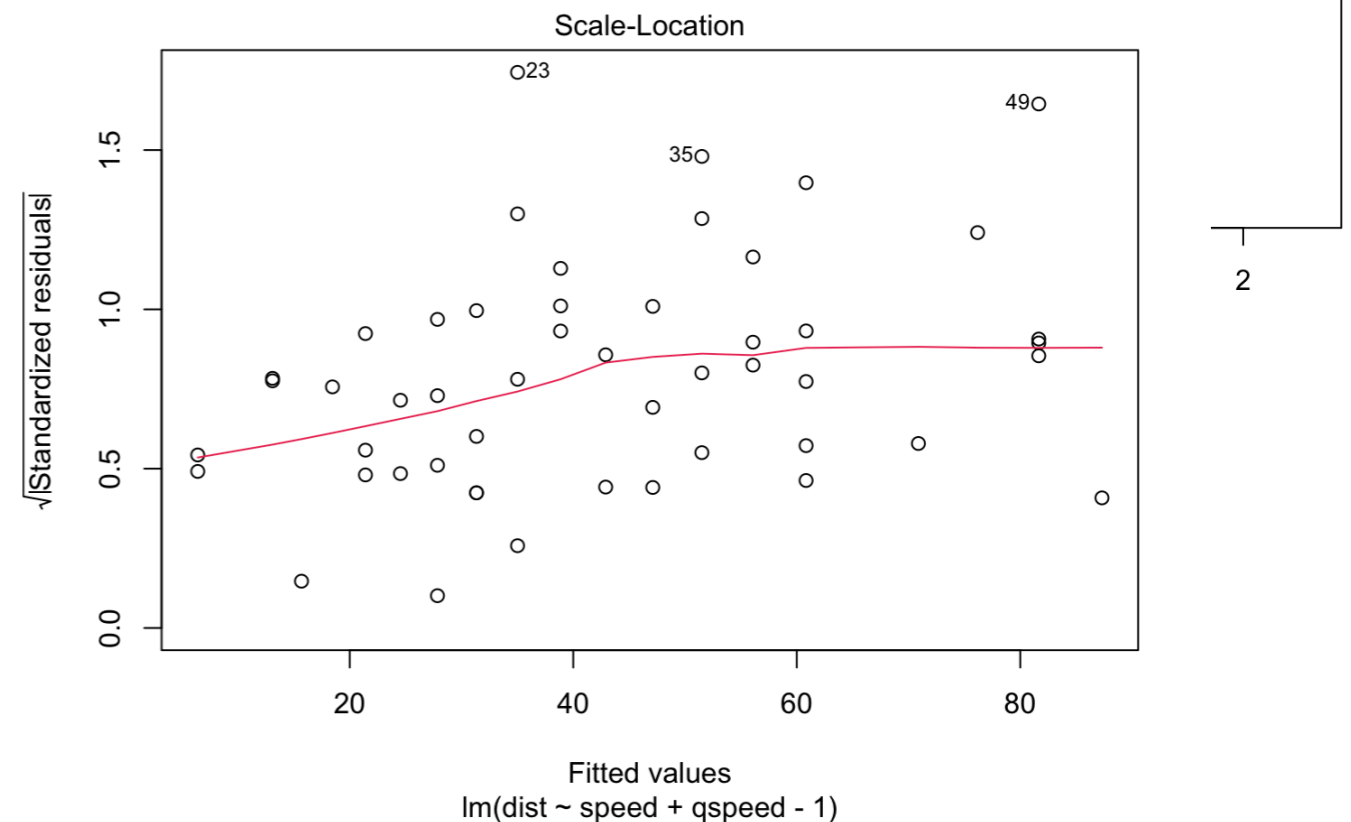
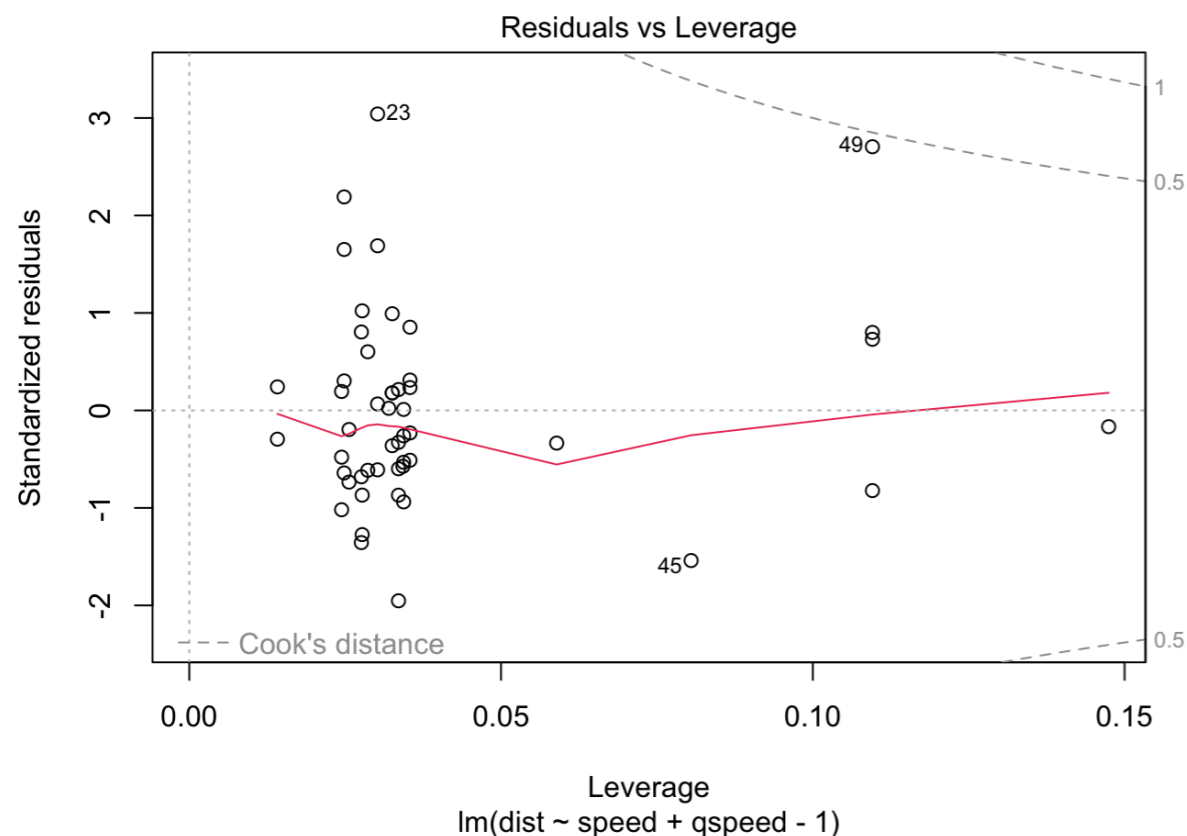
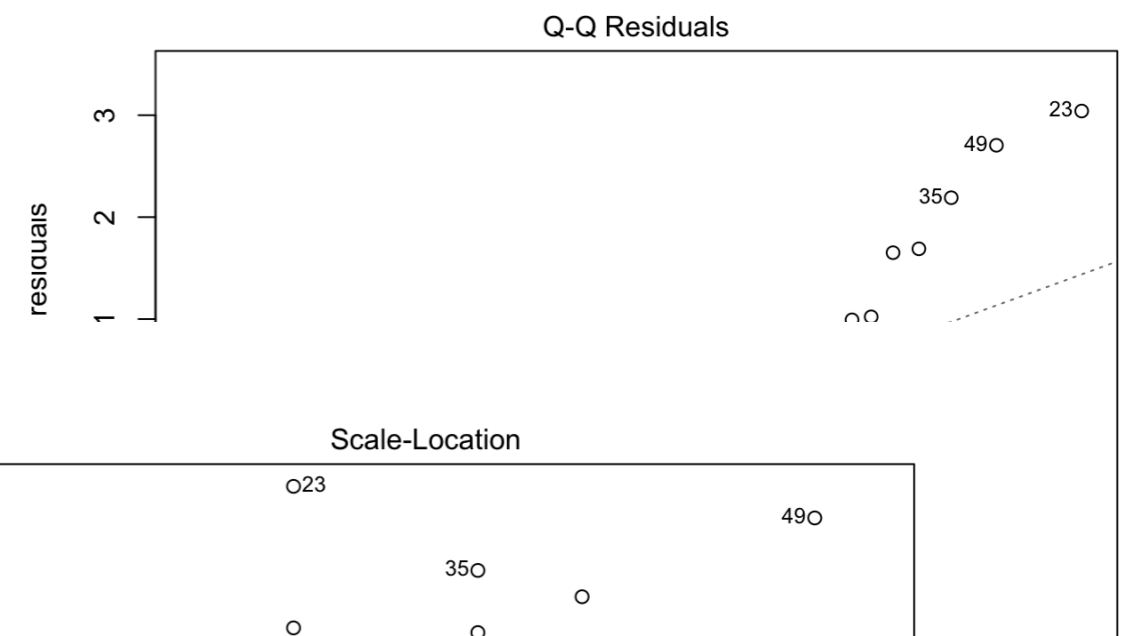
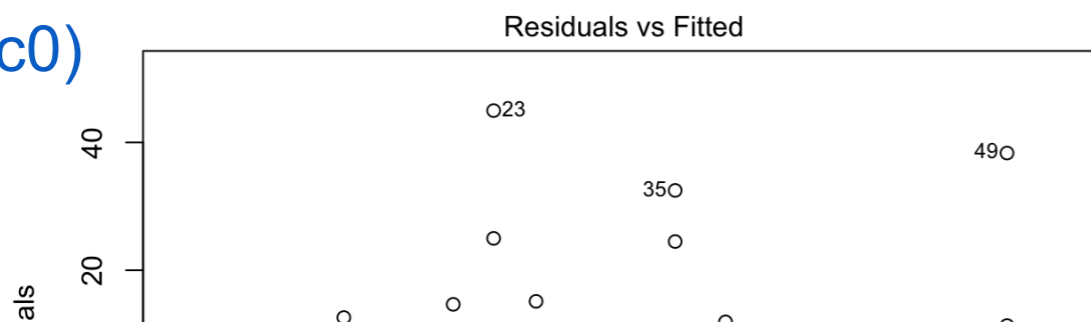
Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

> plot(qrc0)

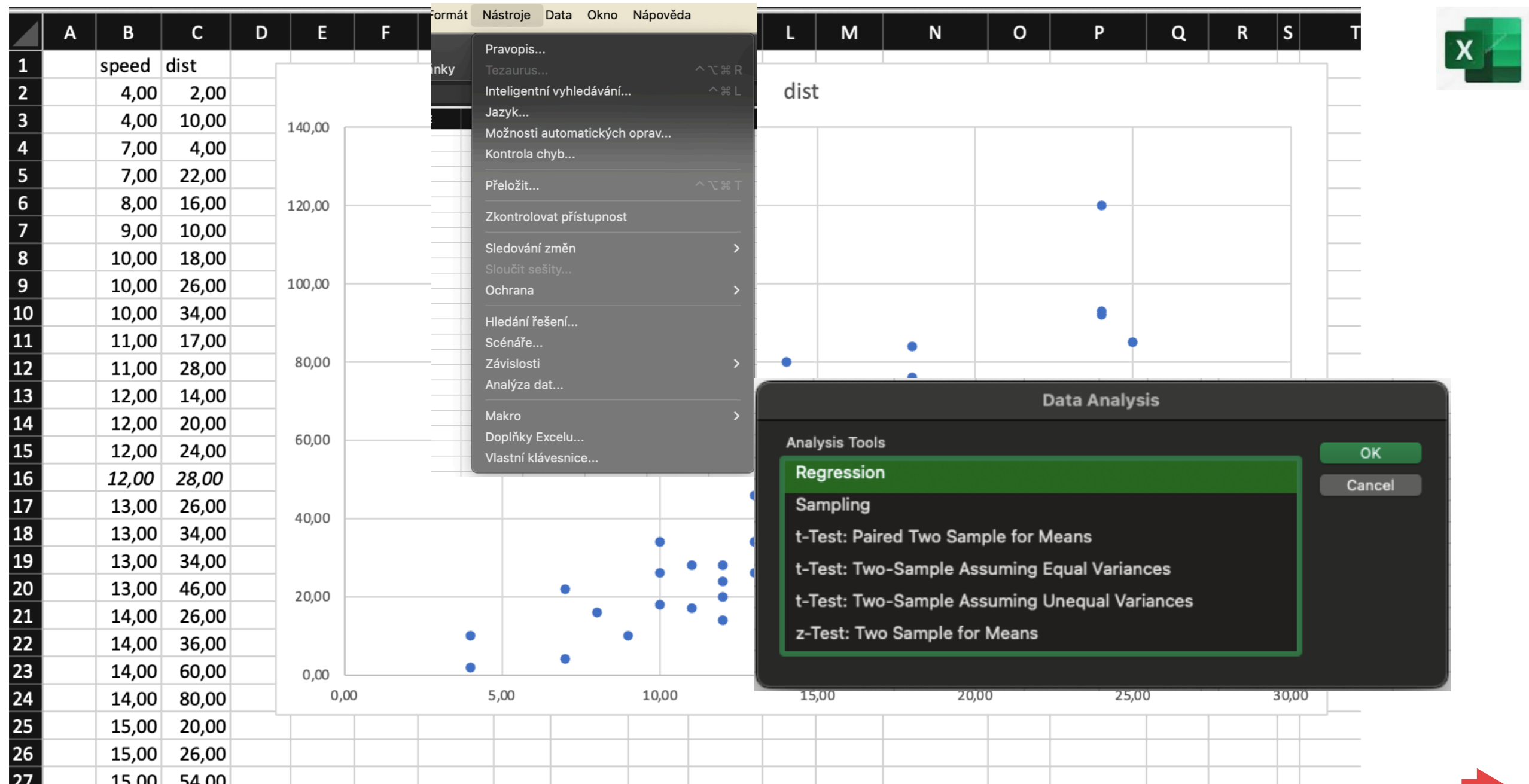


Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)



Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

SUMMARY OUTPUT				
Regression Statistics				
Multiple R	0,8069			
R Square	0,6511			
Adjusted R Square	0,6438			
Standard Error	15,38			
Observations	50			
ANOVA				
	<i>df</i>	<i>SS</i>	<i>MS</i>	<i>F</i>
Regression	1	21185,45895	21185	89,57
Residuals	48	11353,52105	236,53	
Total	49	32538,98		
Coefficients				
	<i>Coefficient</i>	<i>Standard Error</i>	<i>t Stat</i>	<i>P-value</i>
Intercept	-17,58	6,758440169	-2,6011	0,012
X Variable 1	3,9324	0,415512777	9,464	1E-12

Regression

Input

Input Y Range: \$C\$2:\$C\$51

Input X Range: \$B\$2:\$B\$51

Labels

Constant is Zero

Confidence Level: 95 %

Output options

Output Range: \$E\$2

New Worksheet Ply:

New Workbook

Residuals

Residuals

Residual Plots

Standardized Residuals

Line Fit Plots

Normal Probability

Normal Probability Plots

OK

Cancel



Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)

SUMMARY OUTPUT				
<i>Regression Statistics</i>				
Multiple R		0,947		
R Square		0,896		
Adjusted R Square		0,876		
Standard Error		16,26		
Observations		50		
<i>ANOVA</i>				
	<i>df</i>	<i>SS</i>	<i>MS</i>	<i>F</i>
Regression	1	111949	111949	423,46
Residual	49	12954	264,363	
Total	50	124903		
<i>Coefficients</i>				
	<i>Standard Error</i>	<i>t Stat</i>	<i>P-value</i>	
Intercept	0	#####	#####	#####
X Variable 1	2,909	0,1414	20,5783	9,23E-26

Regression

Input

Input Y Range:

Input X Range:

Labels Constant is Zero

Confidence Level: %

Output options

Output Range:

New Worksheet Ply:

New Workbook

Residuals

Residuals Residual Plots

Standardized Residuals Line Fit Plots

Normal Probability

Normal Probability Plots

OK Cancel

T22

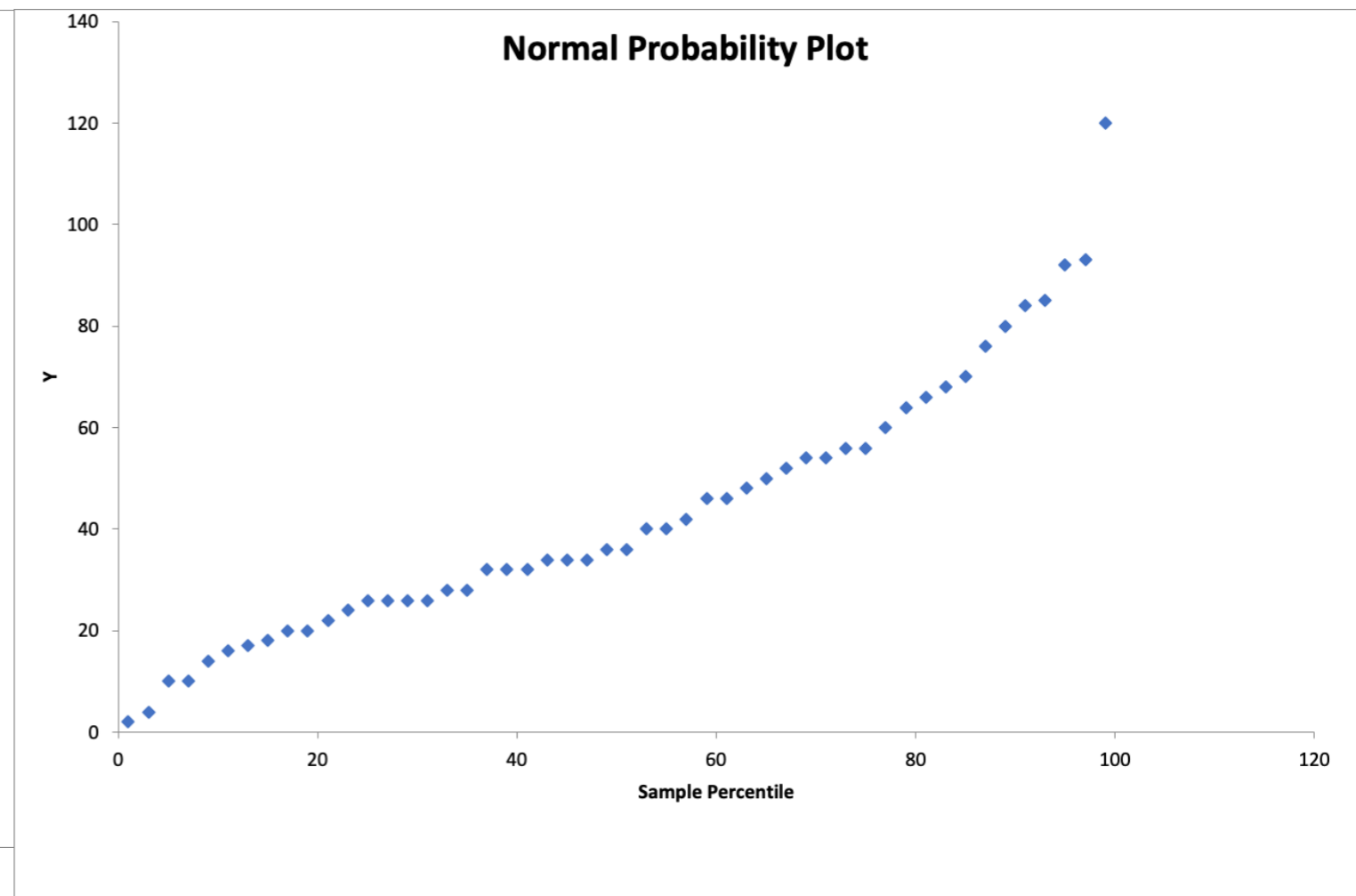
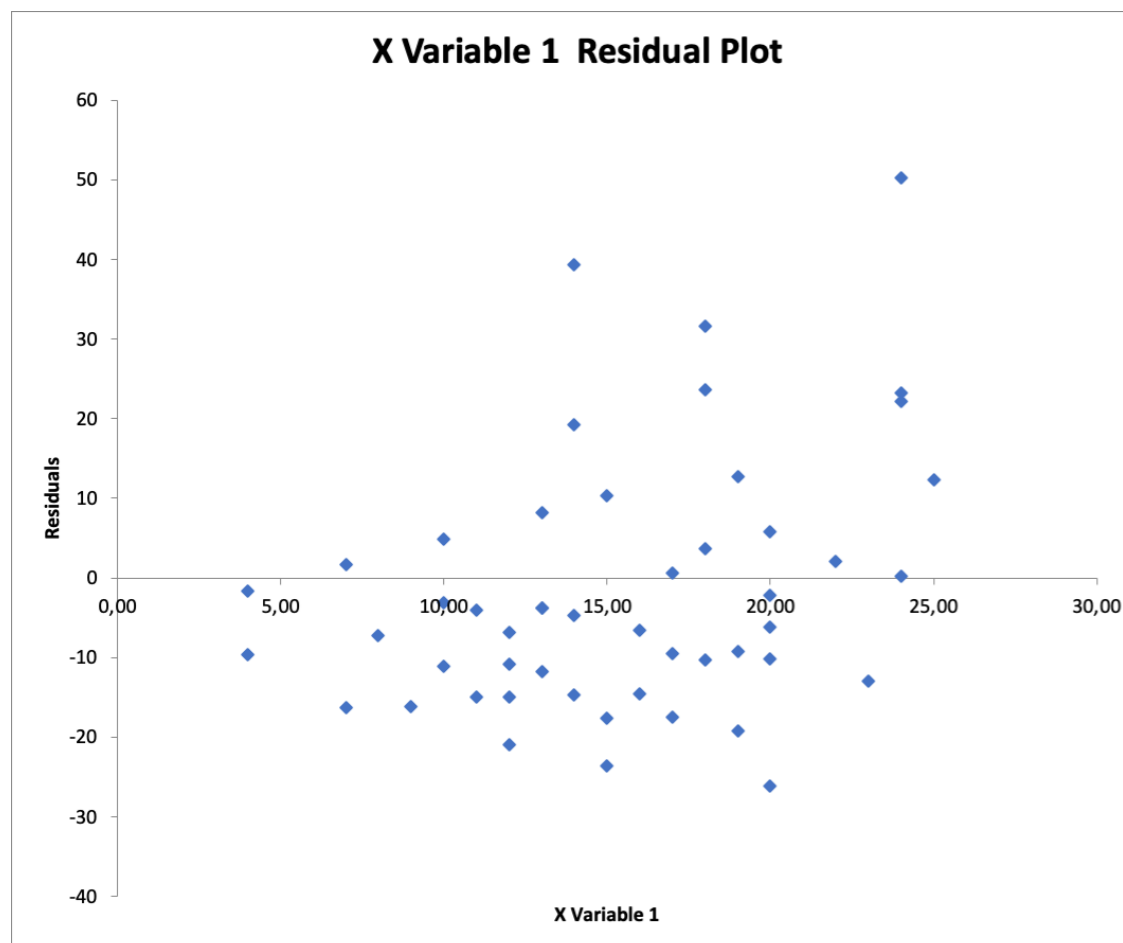


Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

Jak závisí délka brzdné dráhy na rychlosti vozidla?

Provedeme experiment s 50 vozidly: měříme délku brzdné dráhy (dist) a rychlost (speed)



Lineární regresní model

Vyhodnocení významnosti regresního modelu

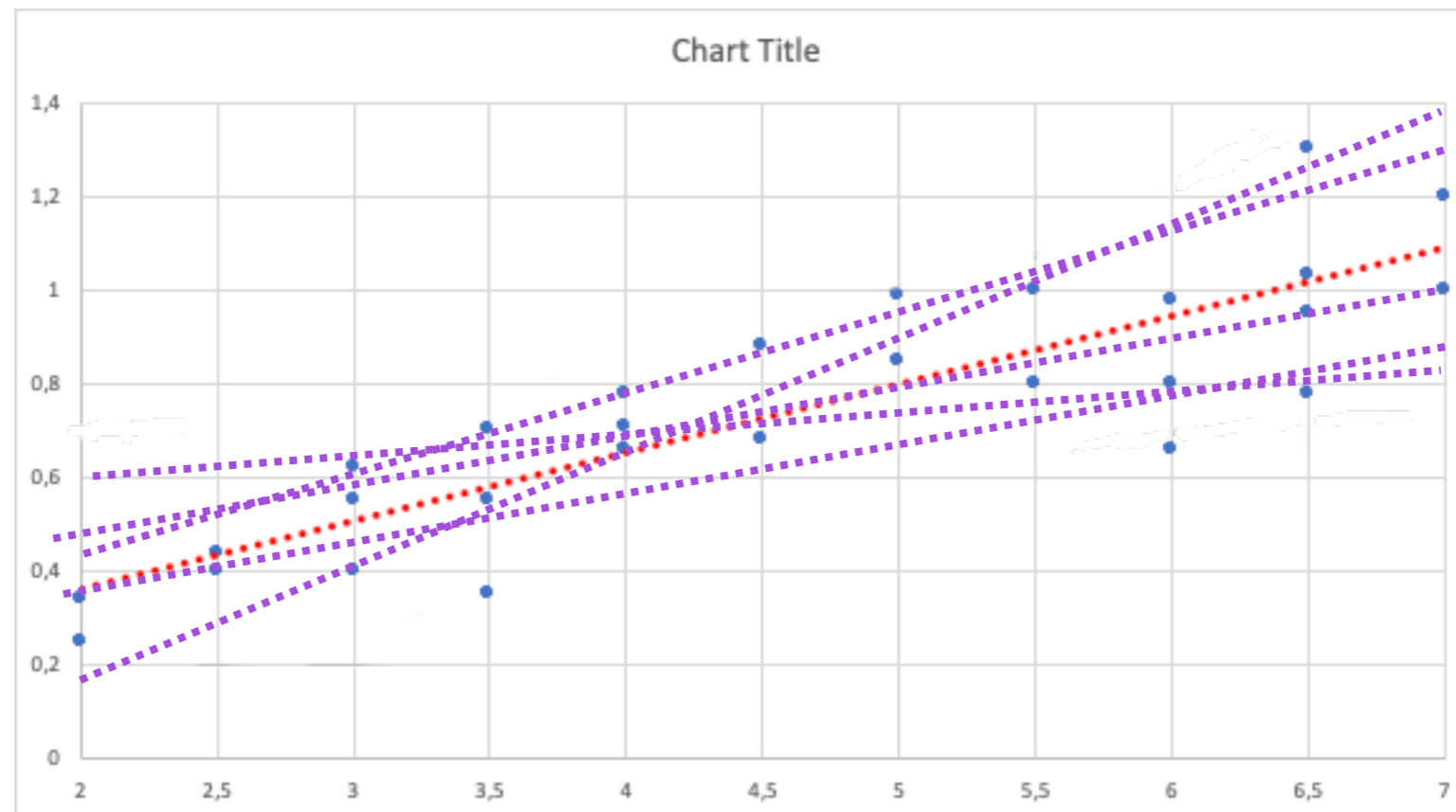
- **Jsou-li celkový F-test i všechny t-testy statisticky významné**, model se považuje za vhodný k vystižení variability proměnné Y (to však ještě neznamená, že je model správně navržen).
- **Jsou-li celkový F-test i všechny t-testy statisticky nevýznamné**, model se považuje za nevhodný, protože nevystihuje variabilitu proměnné Y .
- **Je-li celkový F-test statisticky významný, ale některé t-testy vychází nevýznamné**, model se považuje za vhodný, ale provádí se zpravidla vypuštění nevýznamných parametrů.
- **Je-li celkový F-test statisticky významný, ale všechny t-testy vychází nevýznamné**, je to paradox: formálně model jako celek vyhovuje, ale žádný člen modelu sám o sobě významný není – jde o důsledek tzv. multikolinearity, tj. lineární závislosti mezi jednotlivými regresory.



Lineární regresní model

Závislost mezi nezávisle proměnnou a závisle proměnnou: $y=f(x)$

- funkční závislost: x a y jsou nenáhodné, pro jedno x je nejvýše jedna hodnota y
- regresní závislost: y je realizace náhodné veličiny Y při konkrétním x ; pro jedno x můžeme pozorovat různé hodnoty Y

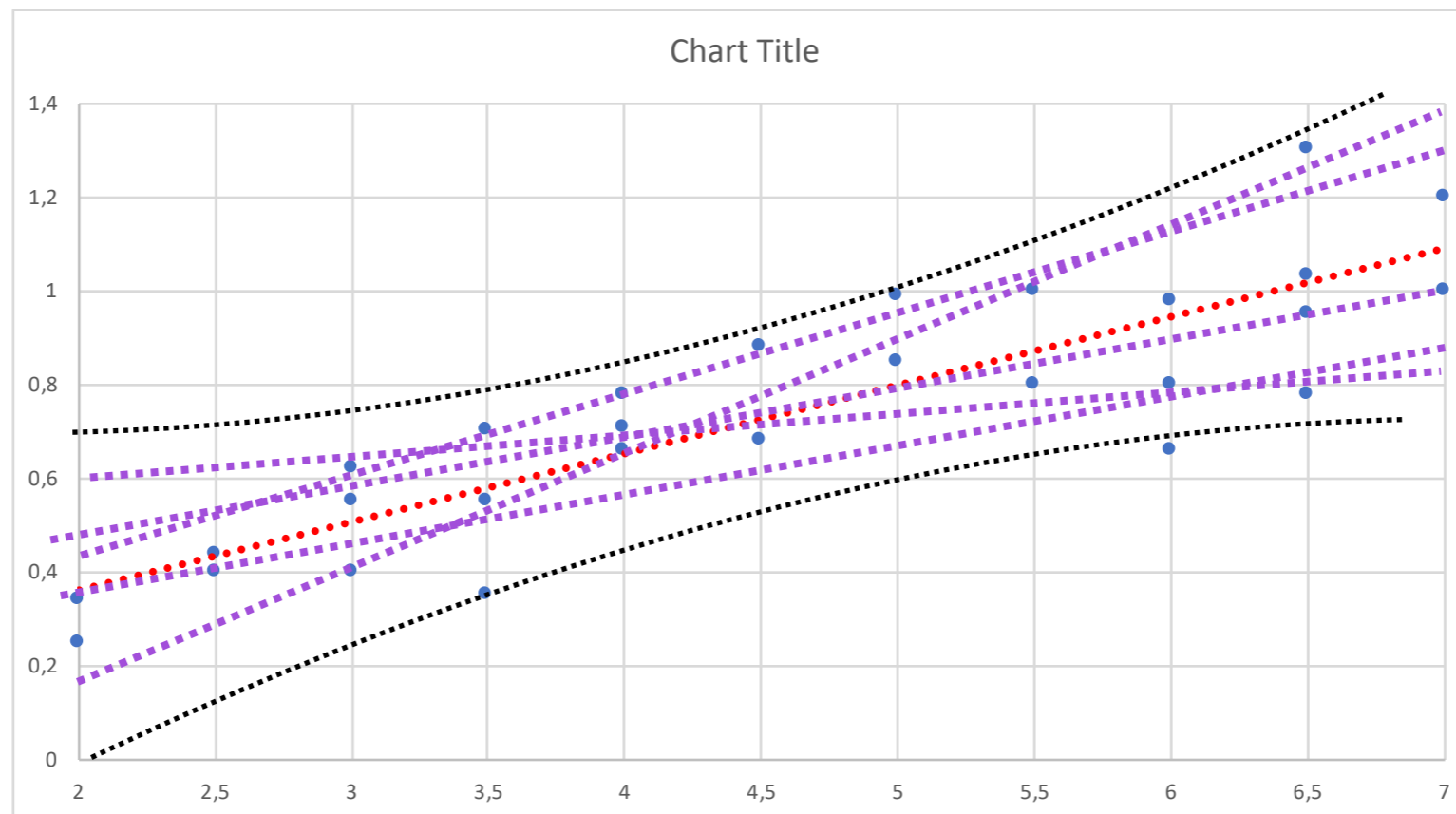


Lineární regresní model

Závislost mezi nezávisle proměnnou a závisle proměnnou: $y=f(x)$

- funkční závislost: x a y jsou nenáhodné, pro jedno x je nejvýše jedna hodnota y
- regresní závislost: y je realizace náhodné veličiny Y při konkrétním x ; pro jedno x můžeme pozorovat různé hodnoty Y

pás
spolehlivosti
pro regresní
přímku



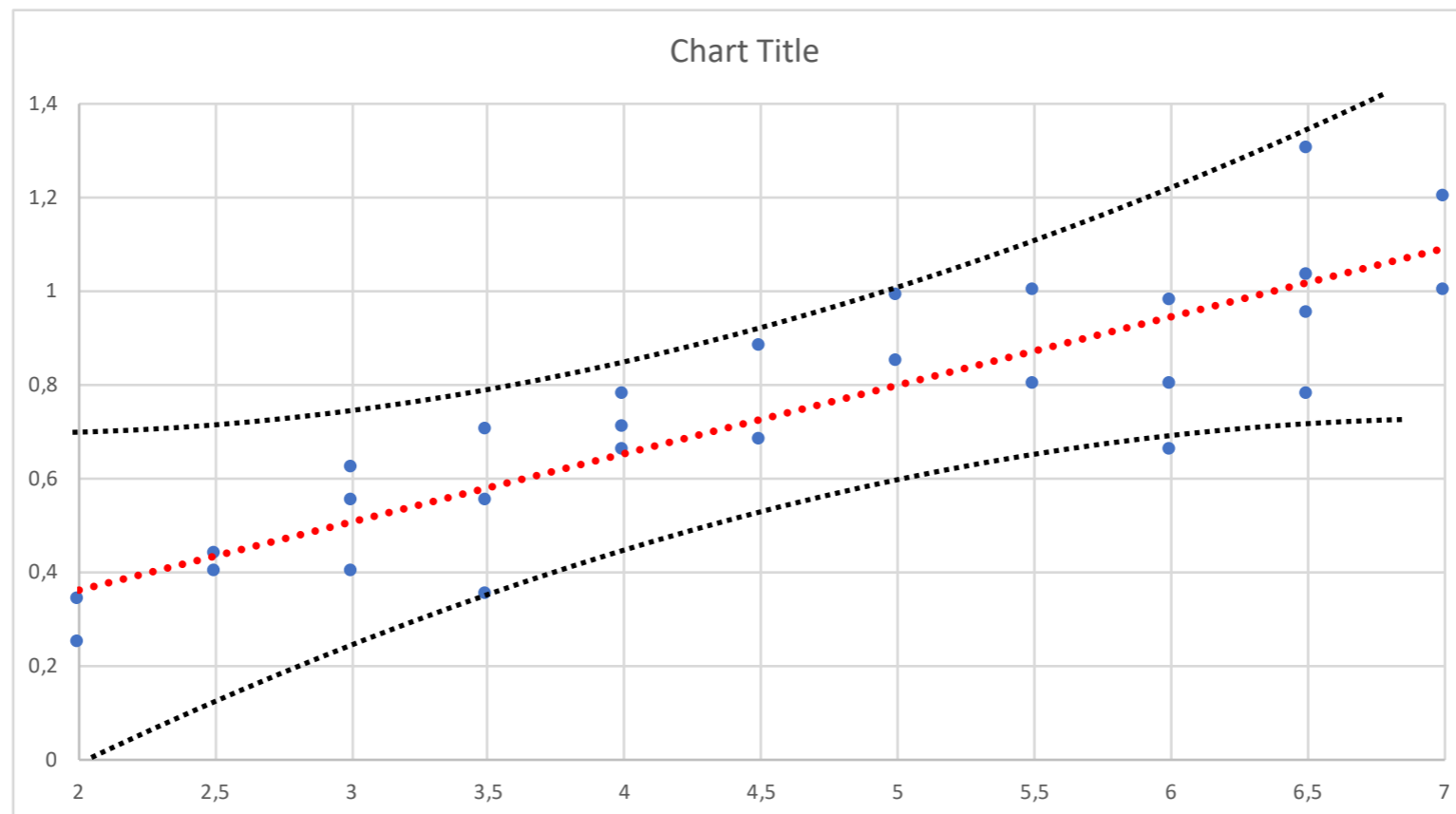
Lineární regresní model

Pás spolehlivosti pro regresní přímku $Y(x) = a + bx$:

$$\hat{Y}(x) \pm s_{\hat{y}}(x)t_{1-\gamma/2}(n-2)$$

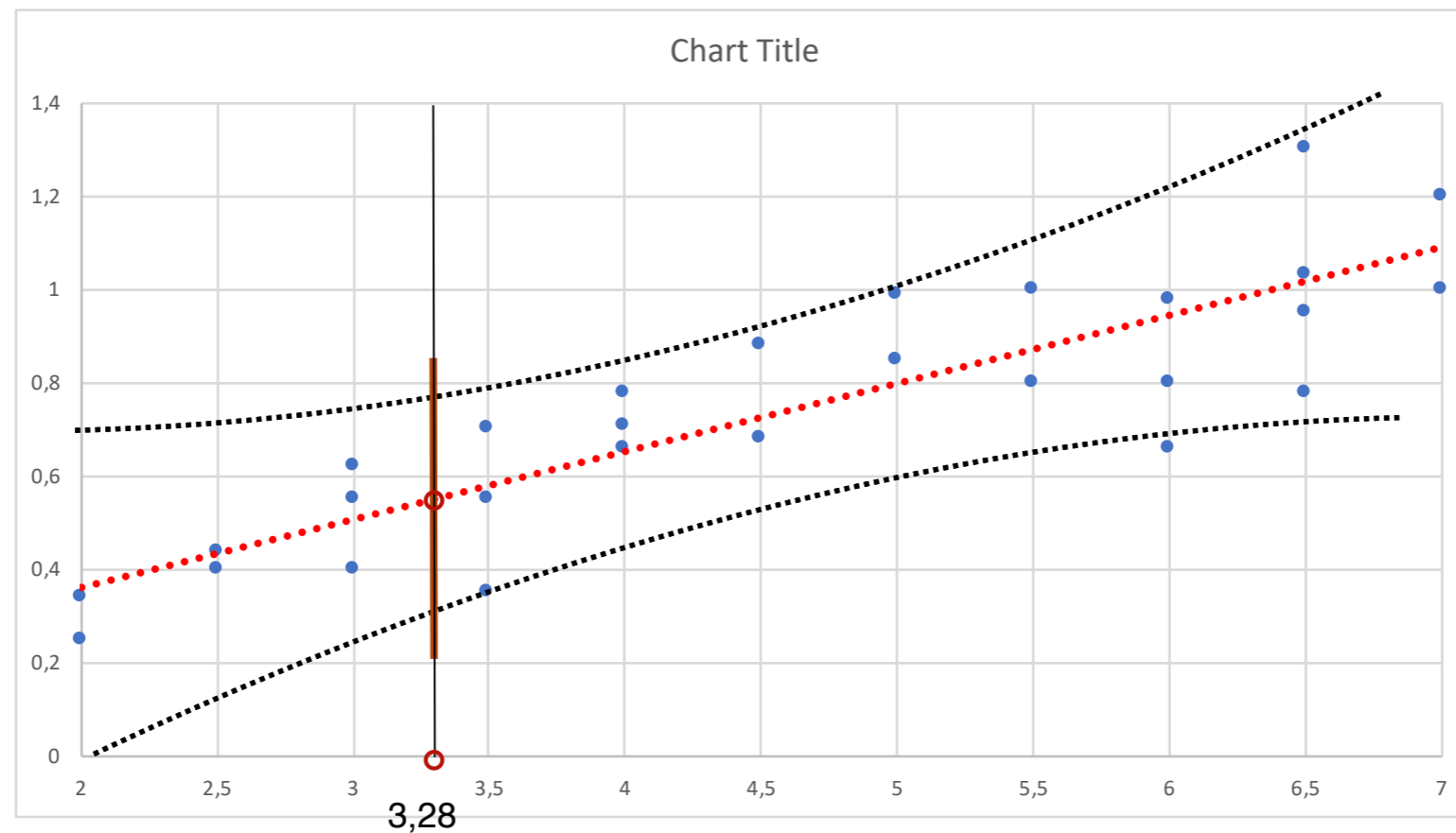
kde

$$s_{\hat{y}}(x) = s \cdot \sqrt{\frac{1}{n} + \frac{(x - \bar{x})^2}{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2}}$$



Lineární regresní model

Pás spolehlivosti pro predikci $Y(x_0) = a + bx_0$:



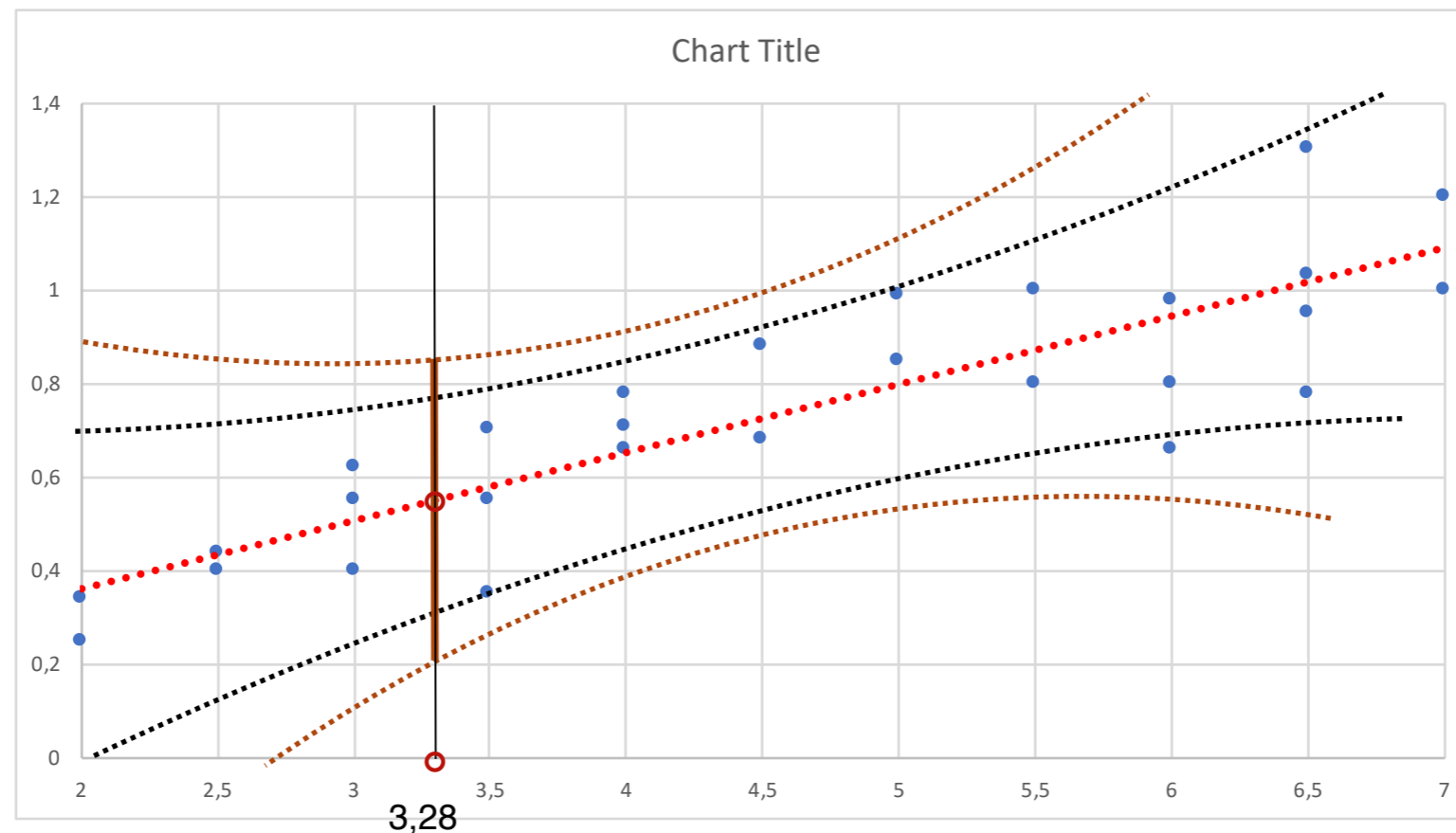
Lineární regresní model

Pás spolehlivosti pro predikci $Y(x_0) = a + bx_0$:

$$\hat{Y}(x_0) \pm s_{\hat{y}}(x_0)t_{1-\gamma/2}(n-2)$$

kde

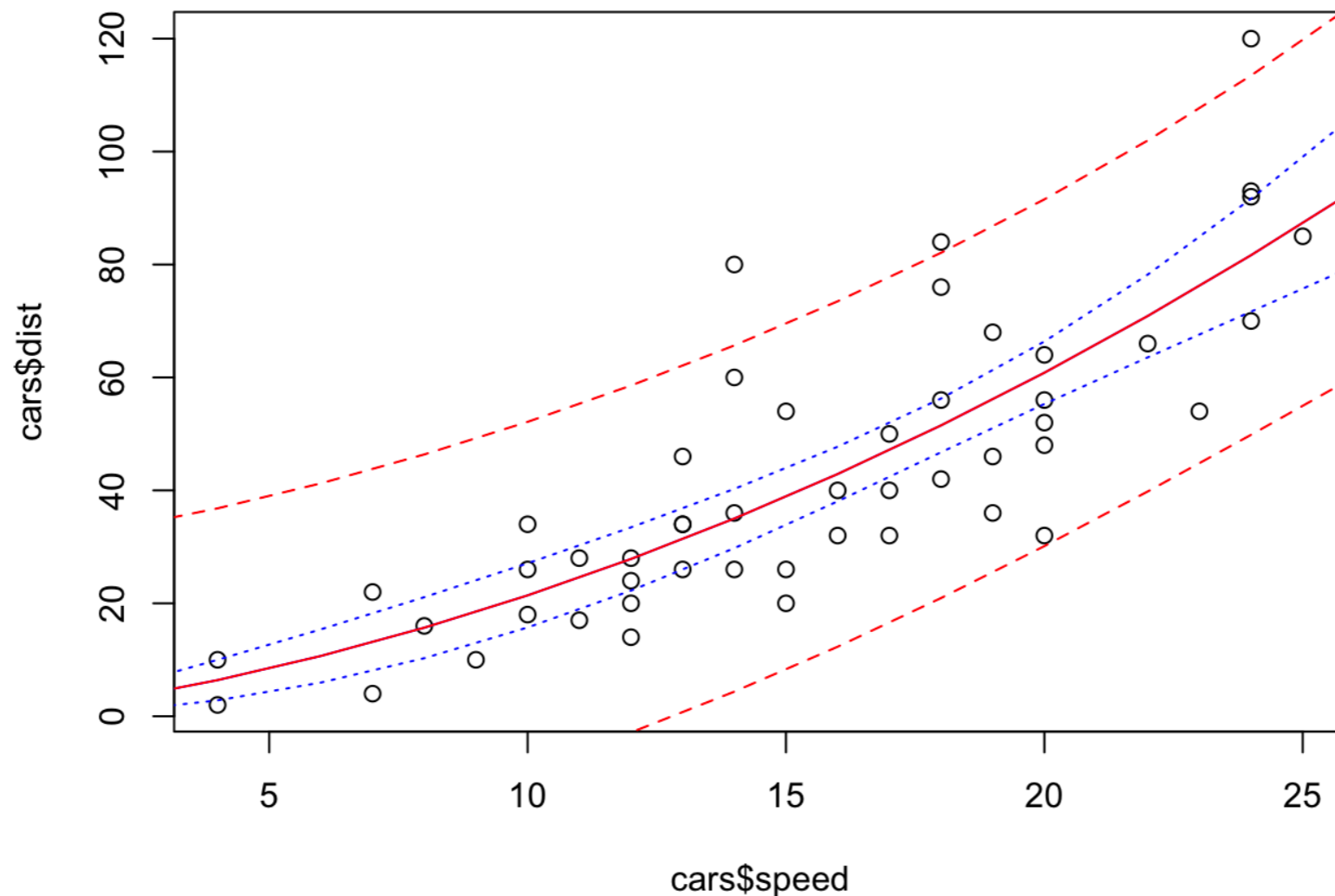
$$s_{\hat{y}}(x_0) = s \cdot \sqrt{\frac{1}{n} + \frac{(x_0 - \bar{x})^2}{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2} + 1}$$



Lineární regresní model

Příklad: Závislost délky brzdné dráhy na rychlosti.

```
> qrc1 <- lm(dist~speed + I(speed^2)-1, data=cars)
> pred.frame <- data.frame(speed=seq(0,120,2))
> pp <- predict(qrc1, newdata=pred.frame, interval="pred")
> pc <- predict(qrc1, newdata=pred.frame, interval="conf")
> plot(cars$speed, cars$dist)
> matlines(pred.frame$speed, pc, lty=c(1,3,3), col="blue")
> matlines(pred.frame$speed, pp, lty=c(1,2,2), col="red")
```



Lineární regresní model

Lineární model je „lineární“ proto, že je lineární v parametrech (lze jej zapsat maticově).

- =>
- Model lineární regrese lze použít i v případech, kdy závislost mezi veličinami X a Y není lineární (viz třeba kvadratická regrese)
 - Někdy lze použít tzv. „linearizaci modelu“, kterou původně nelineární model převedeme na lineární s transformovanými veličinami X a Y
 - Při linearizaci musíme být opatrní: vše, co je odvozeno pro linearizovaný model za předpokladu normality chybového členu ϵ , platí pouze pro něj; nikoli pro model původní. A to opět za předpokladu, že transformovaná náhodná veličina v linearizovaném modelu má opět normální rozdělení.

Úloha: Pokuste se linearizovat následující nelineární modely:

$$Y = \ln(\alpha + \beta \cdot X + \epsilon)$$

$$Y = \frac{1}{\alpha + \beta \cdot X + \epsilon}$$



Lineární regresní model

Příklad: Závislost mezi teplotou nástroje θ a rychlostí posuvu ν při obrábění lze považovat za regresní závislost ve tvaru $\theta = \alpha \cdot \nu^\beta \cdot \epsilon$, kde α a β jsou regresní koeficienty a ϵ je náhodná veličina se střední hodnotou 1. Na základě měření odhadněte neznámé regresní koeficienty.

Předpokládaná závislost není lineární v parametrech \Rightarrow použijeme linearizaci:
zlogaritmováním vztahu mezi teplotou a posuvem dostaneme

$$\ln \theta = \ln \alpha + \beta \cdot \ln \nu + \ln \epsilon.$$

Položíme-li $Y = \ln \theta$, $X = \ln \nu$, $a = \ln \alpha$, $\epsilon = \ln \epsilon$, $b = \beta$, dostáváme lineární vztah

$$Y = a + b \cdot X + \epsilon$$

Dále postupujeme jako v případě přímkové regrese.

Poznámka: Pokud by mělo mít ϵ normální rozdělení, musí veličina ϵ v původním modelu mít logaritmicko-normální rozdělení LN(0, σ^2).

```
> logreg <- lm(log(tempr)~log(speed), data=machining)
> a=exp(logreg$coefficient[1])
> b=logreg$coefficient[2]
```



Vícerozměrný lineární regresní model

Lineární model pro dvě vysvětlující proměnné:

$$Y = a + bX + cZ + dXZ + \varepsilon$$

$$\mathbf{Y} = \begin{pmatrix} Y_1 \\ \dots \\ Y_n \end{pmatrix} \quad \mathbf{X} = \begin{pmatrix} 1 & X_1 & Z_1 & X_1 Z_1 \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ 1 & X_n & Z_n & X_n Z_n \end{pmatrix} \quad \beta = \begin{pmatrix} a \\ b \\ c \\ d \end{pmatrix} \quad \epsilon = \begin{pmatrix} \epsilon_1 \\ \dots \\ \epsilon_n \end{pmatrix}$$

$$\mathbf{X}'\mathbf{X} = \begin{pmatrix} n & \sum x_i & \sum z_i & \sum x_i z_i \\ \sum x_i & \sum x_i^2 & \sum x_i z_i & \sum x_i^2 z_i \\ \sum z_i & \sum x_i z_i & \sum z_i^2 & \sum x_i z_i^2 \\ \sum x_i z_i & \sum x_i^2 z_i & \sum x_i z_i^2 & \sum x_i^2 z_i^2 \end{pmatrix} \quad \mathbf{X}'\mathbf{Y} = \begin{pmatrix} \sum Y_i \\ \sum x_i Y_i \\ \sum z_i Y_i \\ \sum x_i z_i Y_i \end{pmatrix}$$

