

Logistická regrese

POLn4001

10.11.2021

Regresní analýza

- Technika, pomocí které se zjišťuje vliv nezávislých proměnných na závislou proměnnou
- Testujeme teorie
- Kontrola třetích proměnných
- Možnost predikce závislé proměnné – odhad její hodnoty při určité kombinaci hodnot nezávislých proměnných
 - Jakou bude mít film sledovanost, pokud je to horor, trvá 94 minut, režisér má 37 let a rozpočet filmu byl 200 mil. USD?
 - Jaká je pravděpodobnost úspěšného zakončení tohoto kurzu, pokud má student/ka 60 % účast na přednáškách, vypracuje všechny úkoly a věnuje přípravě na závěrečný test 20 hodin?

Regresní analýza

- Neexistuje jedna regrese
- Velké množství typů, rozhoduje závislá proměnná
- V tomto kurzu:
 - Kardinální proměnná – lineární (OLS) regrese
 - Kategorická proměnná – logistická regrese

Logistická regrese

- Technika, pomocí které se zjišťuje vliv nezávislých proměnných na závislou proměnnou
- Požadavky na proměnné:
 - Přesně jedna závislá proměnná – kategorické
 - Jedna nebo víc nezávislých proměnných
 - Nezávislé proměnné mohou být všech typů
- Důležitá je vždy teorie – cílem není počítat regresní modely s desítkami nezávislých proměnných

Logistická regrese

- Dokáže dát odpovědi na mnohé otázky
 - Zvyšuje se šance kandidáta na zvolení, pokud získá titul Mgr.?
 - Ovlivňuje šance Realu Madrid na výhru v zápase to, kdo je jeho aktuálním trenérem?
 - Mají studenti, kteří pravidelně navštěvují přednášky, vyšší šanci na úspěšné absolvování kurzu?
 - Mají uchazeči o práci s praxí vyšší šanci na úspěch ve výběrovém řízení?



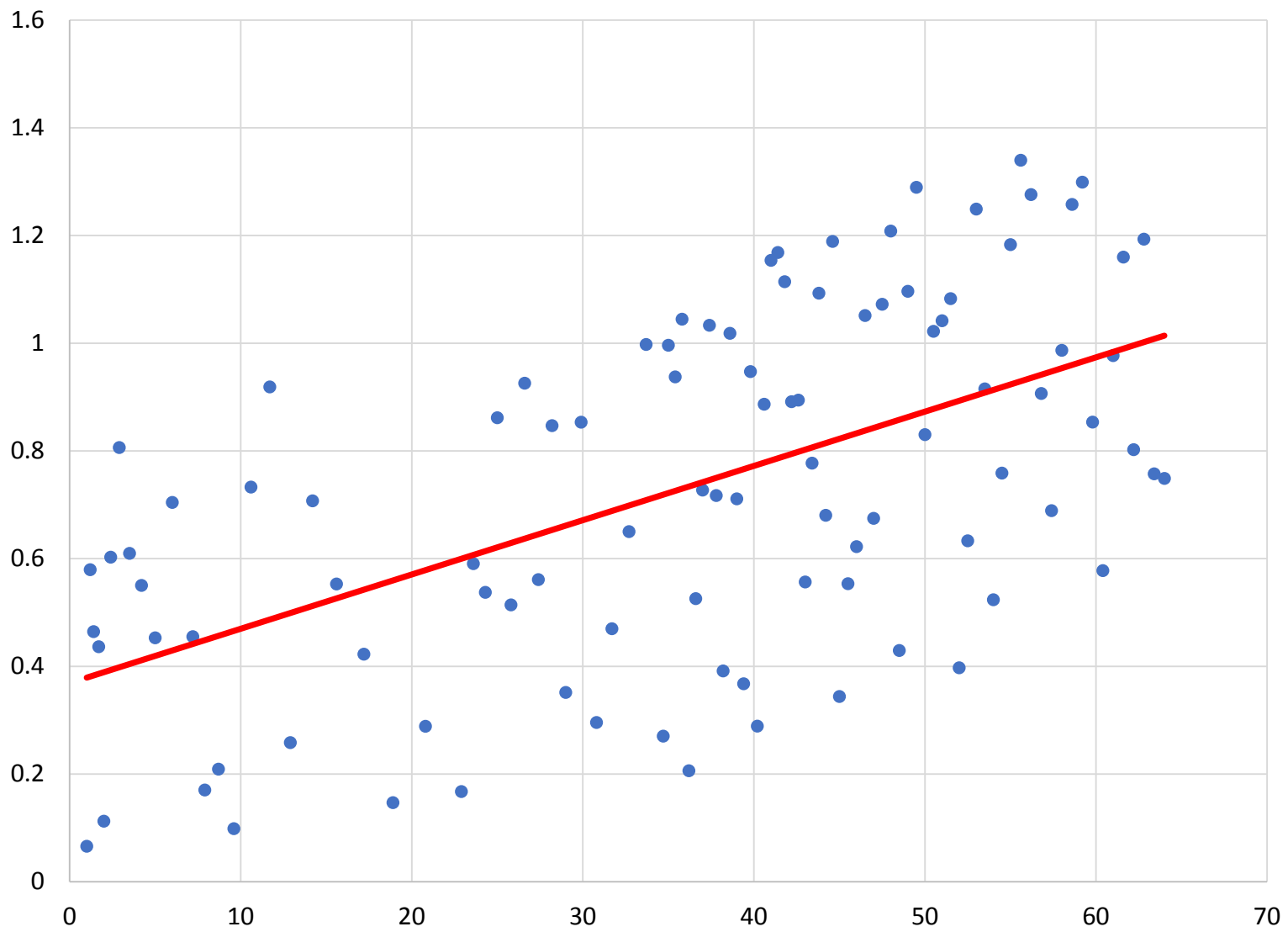
Logistická regrese – dva typy

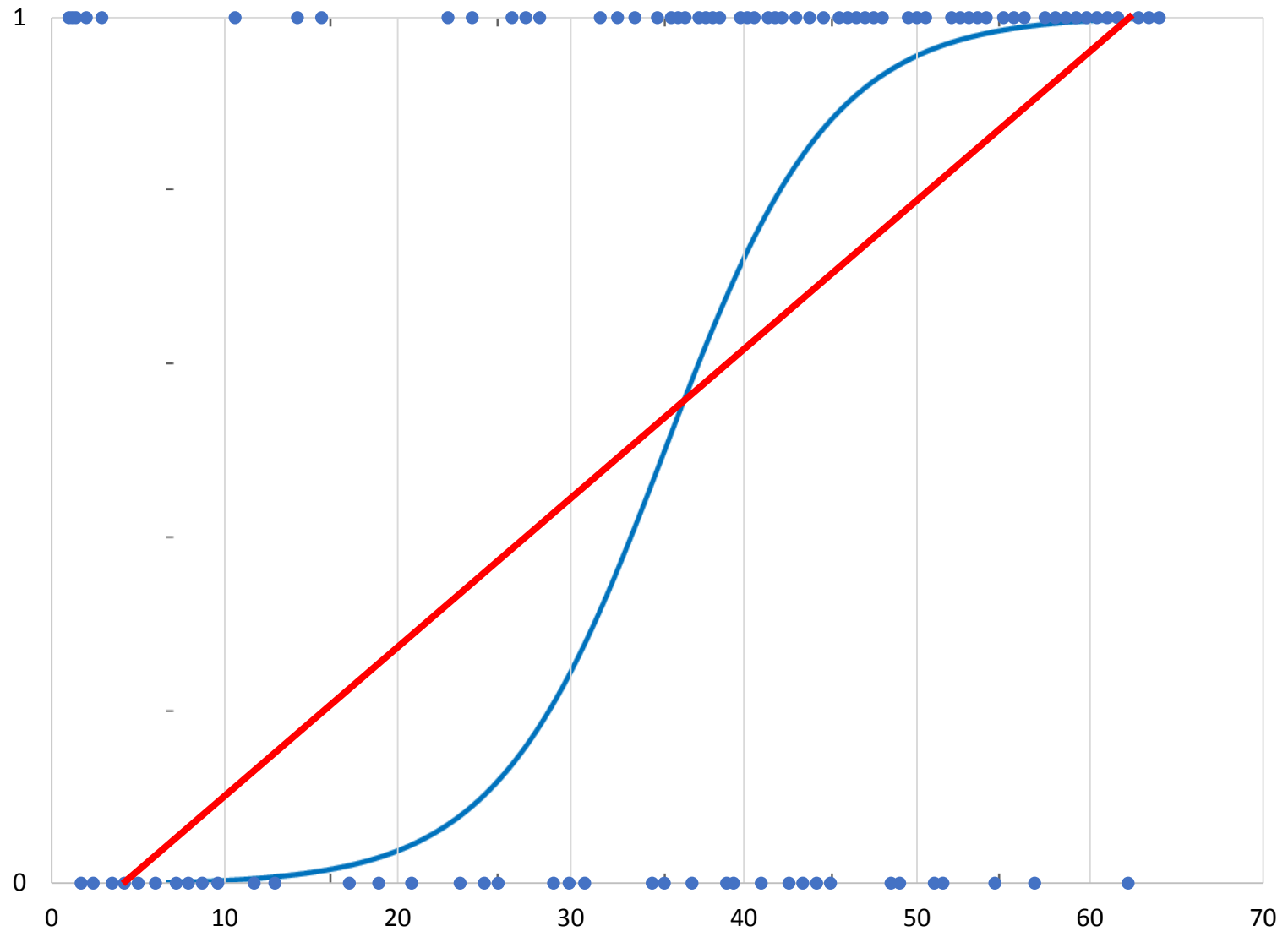
- Binární (binomial):
 - Závislá proměnná má dvě hodnoty (0/1)
 - Příklady – (0) Kandidát byl, (1) nebyl zvolený,
(0) Volič se zúčastnil, (1) nezúčastnil voleb
- Multinomiální (multinomial, polynomial):
 - Závislá proměnná má více než dvě hodnoty (0/1/2)
 - Příklady – (0) Občan se nezúčastnil voleb, (1) zúčastnil a volil vládní stranu, (2) zúčastnil a volil opoziční stranu



Základní body

- Předpokladem lineární regrese je lineární vztah mezi nezávislými a závislou proměnnou
- Binární závislá proměnná toto neumožňuje, proto je tu lineární regrese nepoužitelná
- Logistická regrese absenci lineárního vztahu obchází použitím logaritmu





Výstupy logistické regrese

- Co její pomocí můžeme zjistit?
 - Vhodnost modelu na analyzovaná data
 - Efekt každé nezávislé proměnné
- Důležité výstupy:
 - Log-likelihood
 - R^2
 - Konstanta
 - Odds ratio
 - Pravděpodobnosti

Log-likelihood

- Srovnává skutečná (pozorovaná) a modelem předpokládaná data
- Ukazuje, jak model pasuje na analyzovaná data
- Jeho hodnota vyjadřuje, jaký podíl variability zůstává po aplikaci modelu **nevysvětlený**
- Vyšší hodnoty ukazují na slabší sílu modelu a naopak

R^2

- V lineární regresí R^2 vyjadřuje, jaký podíl variability závislé proměnné je vysvětlen pomocí modelu
- V logistické regresí se R^2 interpretuje podobně, ale nejde o ekvivalent
- Více variant, SPSS produkuje Cox & Snell a Nagelkerke
- Mnozí autoři výpovědní hodnotu R^2 v logistické regresí zpochybňují

Konstanta a regresní koeficienty

- Konstanta:
 - Odhadovaná hodnota závislé proměnné, když je hodnota všech nezávislých proměnných rovna 0
 - Ve výstupu SPSS zapisováno jako Constant
- Koeficienty:
 - Odhadovaný efekt nezávislé proměnné na závislou proměnnou
 - Jak se změní hodnota závislé proměnné, pokud se hodnota nezávislé proměnné zvýší o jednotku
 - Náročnější intuitivní interpretace – hodnota je v podobě logaritmu
 - Ve výstupu SPSS zapisováno jako B

Odds ratio

- Ukazatel efektu prediktorů, jednoduchá interpretace
- Ukazuje, jak se se změnou nezávislé proměnné o jednotku mění šance na to, že nastane konkrétní výstup v závislé proměnné
- Hodnota 1 znamená žádný efekt, hodnoty nad 1 znamenají nárůst šancí, hodnoty pod 1 pokles šancí
- Ve výstupu SPSS zapisováno jako $\text{Exp}(B)$

Logistická vs. lineární regrese

$$Y_i = b_0 + b_1 X_{1i} + b_2 X_{2i} + \dots + b_n X_{ni}$$

$$P(Y) = \frac{1}{1 + e^{-(b_0 + b_1 X_{1i} + b_2 X_{2i} + \dots + b_n X_{ni})}}$$

Příklad

- Faktory úspěchu Zuzany Čaputové ve volbách 2019 na Slovensku
- Závislá proměnná:
 - Binární (0/1)
 - 1 = ZČ získala v obci nejvíc hlasů ze všech, 0 = ZČ nezískala tento počet hlasů
- Nezávislé proměnné:
 - Podíl obyvatel obce s VŠ vzděláním
 - Podíl Maďarů v obci
 - Podíl hlasů ĽSNS v parlamentních volbách
 - Velikost počtu obyvatel obce

Práce v SPSS

- Analyze → Regression → Binary Logistic
 - Závislá proměnná do *Dependent*
 - Nezávislé do *Covariates*
- Doporučené možnosti v *Options* a *Save* (Field, 281-282)
- Výběr metody:
 - Enter – všechny proměnné vstoupí do modelu okamžitě
 - Forward/Backward – postupné vkládání / ubírání
 - Závisí od cílů práce

Model 1 (VŠ, Mad'aři, L'SNS)

Model Summary

Step	-2 Log likelihood	Cox & Snell R Square	Nagelkerke R Square
1	3160,702 ^a	,263	,350

a. Estimation terminated at iteration number 5 because parameter estimates changed by less than ,001.

Variables in the Equation

	B	S.E.	Wald	df	Sig.	Exp(B)
Step 1 ^a						
VS	,148	,012	152,043	1	<,001	1,159
Madari	,048	,003	190,001	1	<,001	1,049
LSNS	-,093	,010	80,319	1	<,001	,911
Constant	-,809	,169	22,824	1	<,001	,445

a. Variable(s) entered on step 1: VS, Madari, LSNS.

Interpretace efektů - VŠ

- Regresní koeficient B:
 - Jak se při změně hodnoty nezávislé proměnné o jednotku změní logaritmus hodnoty závislé proměnné
 - Zvýšení podílu lidí s VŠ vzděláním o 1 procentní bod vede k zvýšení logaritmu hodnoty závislé proměnné o 0,148 (ne příliš intuitivní)
- Poměr šancí (Odds Ratio):
 - Jednodušší interpretace efektu
 - $1,159 > 1 \rightarrow$ zvýšení podílu lidí s VŠ vzděláním o 1 procentní bod **zvyšuje šanci**, že ZČ získá v obcí nejvíc hlasů o 15,9 procenta

Interpretace efektů – Maďaři

- Regresní koeficient B:
 - Jak se při změně hodnoty nezávislé proměnné o jednotku změní logaritmus hodnoty závislé proměnné
 - Zvýšení podílu Maďarů v obci o 1 procentní bod vede k zvýšení logaritmu hodnoty závislé proměnné o 0,048 (ne příliš intuitivní)
- Poměr šancí (Odds Ratio):
 - Jednodušší interpretace efektu
 - $1,049 > 1 \rightarrow$ zvýšení podílu lidí s VŠ vzděláním o 1 procentní bod **zvyšuje šanci**, že ZČ získá v obcí nejvíc hlasů o 4,9 procenta

Interpretace efektů – L'SNS

- Regresní koeficient B:
 - Jak se při změně hodnoty nezávislé proměnné o jednotku změní logaritmus hodnoty závislé proměnné
 - Zvýšení podílu hlasů pro L'SNS v obci o 1 procentní bod vede k snížení logaritmu hodnoty závislé proměnné o 0,093 (ne příliš intuitivní)
- Poměr šancí (Odds Ratio):
 - Jednodušší interpretace efektu
 - $0,911 < 1 \rightarrow$ zvýšení podílu hlasů pro L'SNS v obci o 1 procentní bod **snižuje šanci**, že ZČ získá v obci nejvíc hlasů o 8,9 procenta

Logistická vs. lineární regrese

$$Y_i = b_0 + b_1 X_{1i} + b_2 X_{2i} + \dots + b_n X_{ni}$$

$$P(Y) = \frac{1}{1 + e^{-(b_0 + b_1 X_{1i} + b_2 X_{2i} + \dots + b_n X_{ni})}}$$

Variables in the Equation

		B	S.E.	Wald	df	Sig.	Exp(B)
Step 1 ^a	VS	,148	,012	152,043	1	<,001	1,159
	Madari	,048	,003	190,001	1	<,001	1,049
	LSNS	-,093	,010	80,319	1	<,001	,911
	Constant	-,809	,169	22,824	1	<,001	,445

a. Variable(s) entered on step 1: VS, Madari, LSNS.

$$P(Y) = \frac{1}{1 + e^{- (b_0 + b_1 X_{1i} + b_2 X_{2i} + b_3 X_{3i})}}$$

Modelová obec 1 – 0 % VŠ, 0 % Maďarů, 0 % ĽSNS

$$b_0 + b_1X_1 + b_2X_2 + b_3X_3$$

- $b_0 = -0,809$
- $b_1 = 0,148$
- $b_2 = 0,048$
- $b_3 = -0,093$
- $X_1 = 0$
- $X_2 = 0$
- $X_3 = 0$



= KONSTANTA

$$-0,809 + 0,148*0 + 0,048*0 + (-0,093)*0$$

$$-0,809 + 0 + 0 + 0$$

$$= -0,809$$

- $B \rightarrow \text{Exp}(B)$
- $\text{Exp}(-0,809) = 0,45$
- $P = \text{Exp}(B) / (1 + \text{Exp}(B))$
- $P = 0,45 / (1 + 0,45)$
- $P = 0,45 / 1,45$
- $P = 0,3103$
- Pravděpodobnost, že ZČ získá nejvíc hlasů ze všech kandidátů v obci s danými vlastnostmi je **31 procent**

Modelová obec 2 – 24 % VŠ, 13 % Maďarů, 6,7 % ĽSNS

$$b_0 + b_1X_1 + b_2X_2 + b_3X_3$$

- $b_0 = -0,809$
- $b_1 = 0,148$
- $b_2 = 0,048$
- $b_3 = -0,093$
- $X_1 = 24$
- $X_2 = 13$
- $X_3 = 6,7$

$$-0,809 + 0,148*24 + 0,048*13 + (-0,093)*6,7$$

$$-0,809 + 3,552 + 0,624 - 0,6231$$

$$= 2,7439$$

- $B \rightarrow \text{Exp}(B)$
- $\text{Exp}(2,7439) = 15,55$
- $P = \text{Exp}(B) / (1 + \text{Exp}(B))$
- $P = 15,55 / (1 + 15,55)$
- $P = 15,55 / 16,55$
- $P = 0,9396$
- Pravděpodobnost, že ZČ získá nejvíc hlasů ze všech kandidátů v obci s danými vlastnostmi je 93,96, tedy téměř **94 procent**

Model 2 (VŠ, Mad'aři, L'SNS, Město)

Model Summary

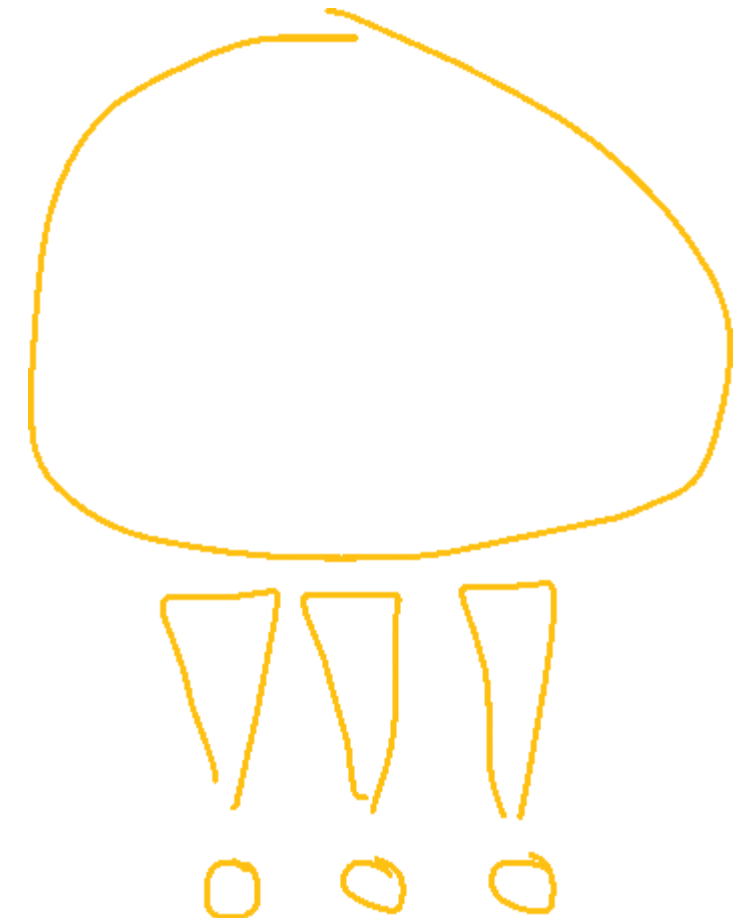
Step	-2 Log likelihood	Cox & Snell R Square	Nagelkerke R Square
1	3157,654 ^a	,263	,351

a. Estimation terminated at iteration number 5 because parameter estimates changed by less than ,001.

Variables in the Equation

	B	S.E.	Wald	df	Sig.	Exp(B)
Step 1 ^a VS	,141	,012	128,476	1	<,001	1,152
Madari	,048	,003	187,983	1	<,001	1,049
LSNS	-,093	,010	80,482	1	<,001	,911
Mesto	,377	,218	2,986	1	,084	1,458
Constant	-,771	,171	20,401	1	<,001	,463

a. Variable(s) entered on step 1: VS, Madari, LSNS, Mesto.



Dummy proměnné

- Mají pouze dvě hodnoty (typicky 0/1)
- Nárůst jejich hodnoty „o jednotku“ je kompletně vyčerpá – není možný opakovaný nárůst jejich hodnoty
- Nižší hodnota (0) tak v modelu vystupuje v roli **referenční kategorie**, vůči které je efekt poměřován

Interpretace efektů – Město

- Regresní koeficient B:
 - Jak se při změně hodnoty nezávislé proměnné o jednotku změní logaritmus hodnoty závislé proměnné
 - Ve městech (1) je oproti malým obcím (0) logaritmus závislé proměnné vyšší o 0,377 (ne příliš intuitivní)
- Poměr šancí (Odds Ratio):
 - Jednodušší interpretace efektu
 - $1,458 > 1 \rightarrow$ šance na to, že ZČ získá lokálně nejvíc hlasů, je ve městech ve srovnání s malými obcemi o 45,8 % vyšší
 - Jinými slovy, ve městech má ZČ podstatně vyšší šanci na vítězství než v malých obcích

Modelová obec 3 – 10 % VŠ, 5 % Maďarů, 8 % ĽSNS, Město (ano)

$$b_0 = b_1X_1 + b_2X_2 + b_3X_3 + b_4X_4$$

- $b_0 = -0,771$
- $b_1 = 0,141$
- $b_2 = 0,048$
- $b_3 = -0,093$
- $b_4 = 0,377$
- $X_1 = 10$
- $X_2 = 5$
- $X_3 = 8$
- $X_4 = 1$

$$-0,771 + 0,141*10 + 0,048*5 + (-0,093)*8 + 0,377*1$$

$$-0,771 + 1,41 + 0,24 - 0,744 + 0,377$$

$$= 0,512$$

- $B \rightarrow \text{Exp}(B)$
- $\text{Exp}(0,512) = 1,67$
- $P = \text{Exp}(B) / (1 + \text{Exp}(B))$
- $P = 1,67 / (1 + 1,67)$
- $P = 1,67 / 2,67$
- $P = 0,6255$
- Pravděpodobnost, že ZČ získá nejvíc hlasů ze všech kandidátů v obci s danými vlastnostmi je **62,6 procent**

Modelová obec 4 – 10 % VŠ, 5 % Maďarů, 8 % ĽSNS, **Město (ne)**

$$b_0 = b_1X_1 + b_2X_2 + b_3X_3 + b_4X_4$$

- $b_0 = -0,771$
- $b_1 = 0,141$
- $b_2 = 0,048$
- $b_3 = -0,093$
- $b_4 = 0,377$
- $X_1 = 10$
- $X_2 = 5$
- $X_3 = 8$
- $X_4 = 0$

$$-0,771 + 0,141*10 + 0,048*5 + (-0,093)*8 + 0,377*0$$

$$-0,771 + 1,41 + 0,24 - 0,744 + 0$$

$$= 0,135$$

- $B \rightarrow \text{Exp}(B)$
- $\text{Exp}(0,135) = 1,14$
- $P = \text{Exp}(B) / (1 + \text{Exp}(B))$
- $P = 1,14 / (1 + 1,14)$
- $P = 1,14 / 2,14$
- $P = 0,5327$
- Pravděpodobnost, že ZČ získá nejvíc hlasů ze všech kandidátů v obci s danými vlastnostmi je **53,3 procent**

Kategorické nezávislé proměnné

- Stejná logika jako u dummy proměnných
- Napr. dny v týdnu, druhy zvířat, politické strany
- Postup:
 - Vytvořit dummy proměnné
 - Do modelu dát všechny kromě jedné – ta plní roli referenční kategorie
 - Koeficienty pro jednotlivé kategorie v modelu se poměří vůči referenční kategorii
 - *(SPSS umožňuje místo tvorby dummy proměnných označit proměnnou jako kategorickou, výsledky modelu jsou stejné)*

Model 3 (VŠ, Maďaři, L'SNS, velikostní kategorie obcí)

- Proměnná mapující počet obyvatel obce byla upravená na 4 dummy proměnné:
 - Obyv1 – obce do 500 obyvatel (1), ostatní obce (0)
 - Obyv2 – obce mezi 501 a 1000 ob. (1), ostatní obce (0)
 - Obyv3 – obce mezi 1001 a 5000 ob. (1), ostatní obce (0)
 - Obyv4 – obce s 5001+ ob. (1), ostatní obce (0)
- Jako referenční kategorie zvolena proměnná Obyv1
- Do modelu vstupují Obyv2, Obyv3 a Obyv4

Model 3 (VŠ, Maďaři, LSNS, velikostní kategorie obcí)

Model Summary

Step	-2 Log likelihood	Cox & Snell R Square	Nagelkerke R Square
1	3109,823 ^a	,275	,367

a. Estimation terminated at iteration number 5 because parameter estimates changed by less than ,001.

Variables in the Equation

	B	S.E.	Wald	df	Sig.	Exp(B)
Step 1 ^a VS	,129	,013	105,391	1	<,001	1,138
Madari	,048	,004	186,666	1	<,001	1,049
LSNS	-,095	,011	79,945	1	<,001	,909
501-1000 ob	,351	,110	10,243	1	,001	1,421
1001-5000 ob	,739	,107	47,345	1	<,001	2,094
5001+ ob	,777	,226	11,801	1	<,001	2,174
Constant	-,986	,179	30,442	1	<,001	,373

a. Variable(s) entered on step 1: VS, Madari, LSNS, 501-1000 ob, 1001-5000 ob, 5001+ ob.

Společná referenční kategorie Obyv1 (obce do 500 lidí)

Interpretace efektů – Vel. kategorie obcí

- Poměr šancí (Odds Ratio):
 - Obyv2: $1,421 > 1 \rightarrow$ V obcích s 501-1000 obyvateli je **oproti obcím do 500 lidí** šance ZČ na lokální vítězství vyšší o 42,1 %
 - Obyv3: $2,094 > 1 \rightarrow$ V obcích s 1001-5000 obyvateli je **oproti obcím do 500 lidí** šance ZČ na lokální vítězství téměř 2,1 násobně vyšší
 - Obyv4: $2,174 > 1 \rightarrow$ V obcích s 5000 a víc obyvatel je **oproti obcím do 500 lidí** šance ZČ na lokální vítězství téměř 2,2 násobně vyšší
- Věcný závěr je, že v obcích s větší velikostí se ZČ dařilo podstatně lépe než v malých obcích

Důležité pro interpretaci efektů

- Vždy poznat vlastnosti nezávislých proměnných
 - Kardinální proměnné
 - Dummy proměnné
 - Kategorické proměnné s 3+ hodnotami
- Signifikantnost – závisí od povahy dat (vzorek/populace, reprezentativní vzorek?)
- Při počítání pravděpodobností nikdy nevynechat konstantu ani žádnou proměnnou, která je součástí modelu

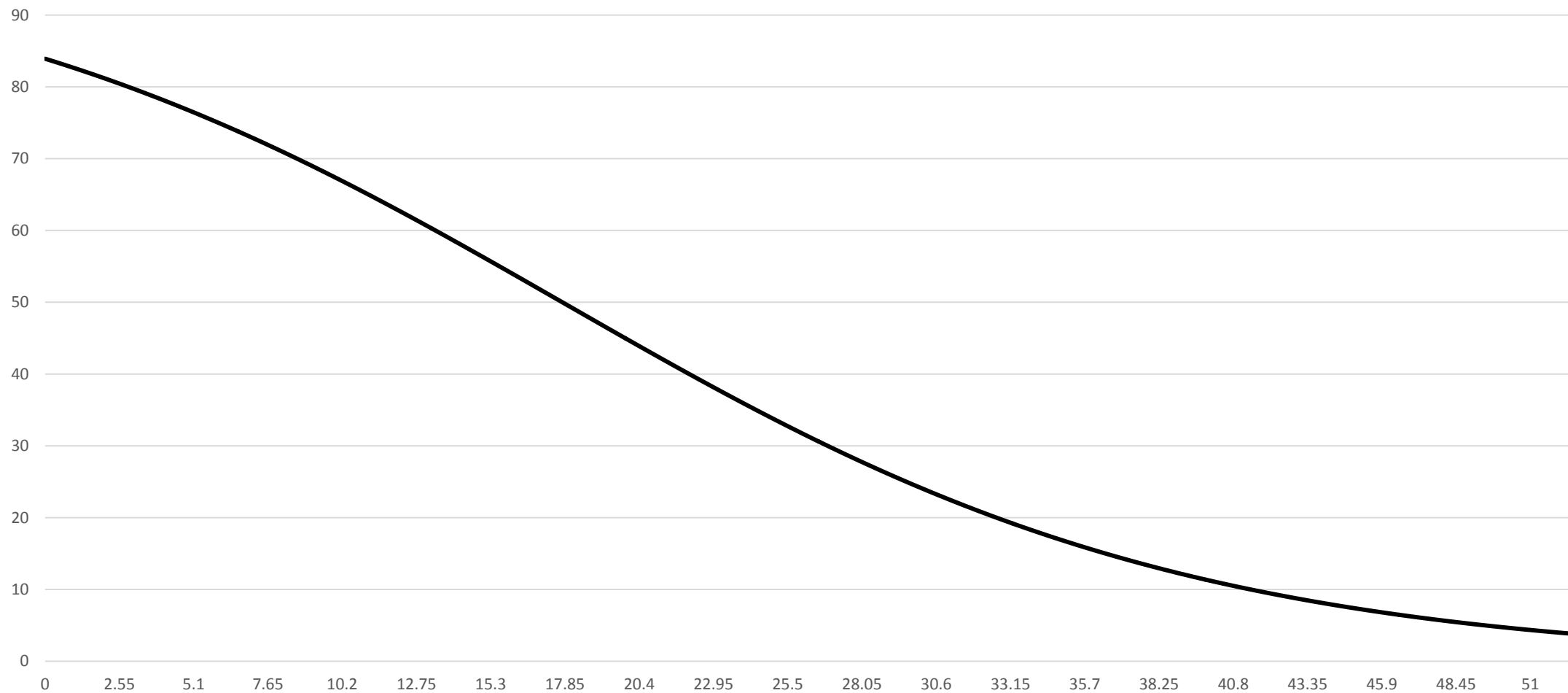
Vizualizace výsledků

- V SPSS značně omezená
- (Limitovaná) možnost využití jiného softwaru:
 - Znázornění efektu jedné nezávislé proměnné
 - Je potřebné spočítat pravděpodobnosti s postupnou změnou dané nezávislé proměnné
 - Ostatní nezávislé proměnné musí být po celý čas konstantní!
 - Zanesení hodnot do grafu

Vizualizace výsledků (LSNS z Modelu 1)

VŠ	Maďaři	LSNS	P (ZČ Win)
15	5	0	83,90
15	5	0,1	83,78
15	5	0,2	83,65
15	5	0,3	83,52
15	5	0,4	83,39
15	5	0,5	83,26
15	5	0,6	83,13
15	5	0,7	83,00
15	5	0,8	82,87
...
15	5	52,63	3,76

Vizualizace výsledků (LSNS z Modelu 1)



Předpoklady a kontrola

- Vhodný typ závislé proměnné
- Nezávislost pozorování

- Absence multikolinearity

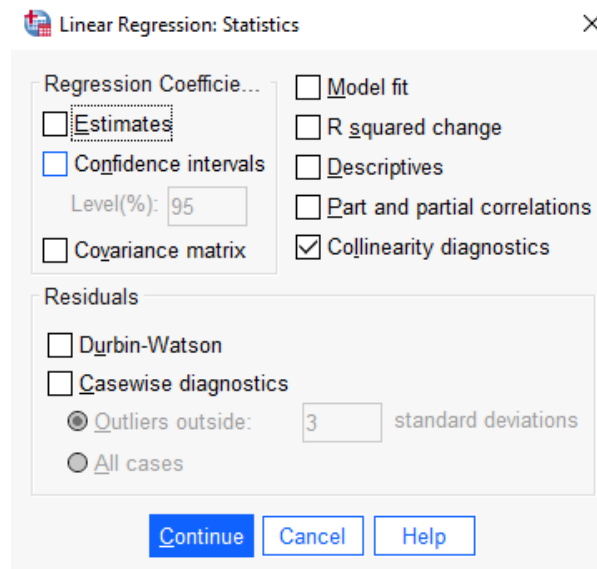
- Rezidua
 - 95 % případů v rámci pásma -2 až 2
 - 99 % případů v rámci pásma -2,5 až 2,5

Testování multikolinearity

- Týká se pouze modelů s více než 1 nezávislou proměnnou
- Totožný postup jako u lineární regrese (SPSS nemá samostatné testování pro logistickou regresi)
- VIF – hodnoty nad 5 (10) indikují multikolinearitu
- Tolerance ($1 / \text{VIF}$) – hodnoty pod 0,1 (0,2) jsou problém
- Eigenvalues:
 - Proměnné by neměly mít vysokou variabilitu na stejných hladinách malých eigenvalues
- Pozor na dummy proměnné vytvořené z jedné kategorické proměnné

Testování multikolinearity

- Analyze → Regression – Linear
 - Nastavit proměnné
 - V *Statistics* zvolit *Collinearity Diagnostics*
 - Ostatní možnosti je možné vypnout (*Estimates*) – jde nám pouze o test multikolinearity



Coefficients^a

Model		Collinearity Statistics	
		Tolerance	VIF
1	Penn State Worry Questionnaire	,575	1,741
	State Anxiety	,014	71,764
	Percentage of previous penalties scored	,014	70,479

a. Dependent Variable: Result of Penalty Kick

Collinearity Diagnostics^a

Model	Dimension	Eigenvalue	Condition Index	(Constant)	Variance Proportions		
					Penn State Worry Questionnaire	State Anxiety	Percentage of previous penalties scored
1	1	3,434	1,000	,00	,01	,00	,00
	2	,492	2,641	,00	,04	,00	,00
	3	,073	6,871	,00	,95	,01	,00
	4	,001	81,303	1,00	,00	,99	,99

a. Dependent Variable: Result of Penalty Kick

Testování multikolinearity

- Co v případě zjištění multikolinearity?
- Není možné zjistit unikátní efekty příslušných nezávislých proměnných
- Možnosti
 - Vyhodit jednu z příslušných proměnných
 - Separátní modely vždy pouze s jednou z daných proměnných