

Coeficiente de determinação

O coeficiente de determinação (R^2) expressa a proporção da variação de uma medida (variável resposta) que é explicada pela variação de outra (variável explanatória). Se supomos que a variação é explicada por uma relação linear, os cálculos são simples e ajudam muito a entender a lógica da partição da variação que está por trás do R^2 .

Neste roteiro vamos usar a regressão linear e um conjunto pequeno de dados para entender o coeficiente de determinação.

Preparação para o exercício

Para começar, crie uma pasta para você na área de trabalho (desktop) do seu computador. Copie para essa pasta o arquivo com os dados que vamos usar:

[dadinho.csv](#)

Em seguida, abra o programa R, clicando no ícone  que está na área de trabalho do seu computador.

Se tudo deu certo até aqui, abrirá uma janela do R como essa:



Já com a janela do programa R aberto, o próximo passo será mudar o diretório de trabalho para aquela pasta que você acabou de criar. Com isso será mais fácil importar os dados dos arquivos “.csv” para dentro do ambiente R.

A mudança de diretório deve ser feita da seguinte forma:

- Abra o Menu “Arquivo” (ou “File”);
- Selecione “Mudar dir” (ou “Change dir”);
- Escolha a sua pasta na janela que abrir.

[Obs. Para Mac, essa opção está no Menu “Misc” e a opção é “Change working dir”]

Para checar se você está na pasta correta, copie e cole o comando abaixo na linha de comando do R. Atenção: O comando deve ser colado na frente do símbolo “>”, circundado em azul na imagem anterior. Este símbolo indica o início da linha de comando ou “prompt”, onde você deve escrever comandos para o R.

```
getwd()
```

Após colar, aperte a tecla “enter” e veja se o R retorna o nome da sua pasta. Se sim, ótimo. Se não, chame um monitor ou professor.

Importando os dados para o R

Agora vamos importar para o R os dados que você gravou em seu diretório. Para isso copie o comando abaixo, cole na linha de comando do R e pressione “enter”:

```
dadinhos <- read.csv("dadinho.csv")
```

Se não houve nenhuma mensagem de erro agora você tem no R uma tabela com 8 linhas e duas colunas, que explicaremos a seguir. Se quiser verificar se a tabela foi importada, digite o nome dela no R

```
dadinhos
```

Cálculos passo a passo

A variação total

Nosso ponto de partida é a variação de uma variável, no caso Y. Uma das maneiras mais usadas na estatística para expressar a variação de medidas é sua dispersão em torno da média. Para isso, calculamos a diferença de cada medida à média de todas as medidas. Vamos adicionar isto à nossa tabela de dados:

```
dadinhos$dif <- dadinhos$Y - mean(dadinhos$Y)  
dadinhos
```

Visualmente o que fizemos foi calcular a distância de cada ponto à média de todos os pontos, que está representada como uma linha horizontal azul:



Para resumir estas distâncias em um único número, as elevamos ao quadrado e somamos. Isso é chamado “soma dos desvios quadrados” ou simplesmente “soma dos quadrados”¹⁾. Ela expressa a variação **total** da variável Y.

Calcule esta soma no R com o comando a seguir, e guarde em um objeto chamado V.total

```
V.total <- sum(dadinhos$dif^2)
```

Lembrando que para ver o valor que vc obteve e armazenou neste objeto, basta digitar o nome do objeto na linha de comando:

```
V.total
```

A variação que sobra da regressão

Uma regressão linear busca explicar a variação observada em uma variável pela variação de outra.

Se a regressão é bem sucedida, esperamos que reste bem menos variação sem explicação, que chamamos de **variação residual** da regressão. Esta variação residual é a soma dos quadrados dos desvios de cada ponto à linha de regressão.

Na figura a seguir está a linha da regressão linear de Y em função de X, e os desvios de cada observação em relação a esta reta de regressão. Os resíduos da regressão são bem menores que os desvios em relação à média, da figura anterior:



Como chegamos a estes valores na figura? Vamos calcular passo a passo. Primeiro ajustamos a regressão:

```
dadinhos.lm <- lm(Y ~ X, data=dadinhos)
```

Os intercepto e a inclinação da equação da reta ajustada são:

```
(dadinhos.cf <- coef(dadinhos.lm))
```

E agora adicionamos os valores de Y previstos pela equação da reta para cada valor de X:

```
dadinhos$Y.pred <- predict(dadinhos.lm)
```

e também a diferença entre os valores de Y e os previstos, que são os resíduos da regressão:

```
dadinhos$residuo <- dadinhos$Y - dadinhos$Y.pred
```

Nossa tabela de dados agora tem cinco colunas:

```
> dadinhos
  X      Y      dif  Y.pred  residuo
1 1 1.110051 -3.0608617 0.5497765 0.5602747
2 2 2.343195 -1.8277177 1.5843869 0.7588084
3 3 2.420523 -1.7503898 2.6189973 -0.1984742
4 4 2.590459 -1.5804543 3.6536077 -1.0631491
5 5 3.617083 -0.5538302 4.6882181 -1.0711354
6 6 5.311097 1.1401837 5.7228285 -0.4117319
7 7 7.564503 3.3935902 6.7574390 0.8070641
8 8 8.410393 4.2394798 7.7920494 0.6183433
```

A soma dos quadrados dos resíduos expressa a variação que restou da regressão. É a variação de Y que não é explicada pela variação de X, em uma regressão linear. Para calculá-la somamos os valores da coluna dos resíduos, elevados ao quadrado:

```
V.resid <- sum(dadinhos$residuo^2)
```

E vemos que de fato esta variação residual é bem menor que a total:

```
V.resid
```

A variação explicada pela regressão

Acima calculamos a variação total de Y e a variação que resta em Y depois de considerarmos um efeito linear de X sobre Y. A soma dos quadrados, medida que escolhemos para expressar estes componentes de variação, tem uma propriedade muito útil. Se consideramos o efeito linear de X como a única fonte de explicação para Y, podemos então dizer que:

$$V_{\text{total}} = V_{\text{explic}} + V_{\text{resid}}$$

ou seja, que a soma dos quadrados total (variação total) é o resultado da adição da soma dos quadrados explicados (pela regressão) e da soma dos quadrados dos resíduos da regressão. Em outras palavras, estamos repartindo, ou **particionando aditivamente** a variação total de Y em dois componentes²⁾.

Como já calculamos V_{total} e V_{resid} obtemos a variação explicada pela regressão com:

$$V_{\text{explic}} = V_{\text{total}} - V_{\text{resid}}$$

Que podemos calcular no R usando os valores acima, que armazenamos:

```
(V.expl <- V.total - V.resid)
```

E finalmente o coeficiente de determinação!

Obtemos o coeficiente de determinação dividindo V_{explic} por V_{total} :

```
V.expl/V.total
```

Neste caso dizemos que 91% da variação de Y é explicada por X. Nada mal. Mas o que você poderia esperar de dados que a gente mesmo criou, né! 😊

¹⁾

por que elevar ao quadrado os desvios à média? Bom, primeiro porque a soma dos desvios é sempre zero... Mas também porque a soma dos desvios ao quadrado tem várias propriedades estatísticas úteis, como a aditividade que vamos ver em seguida.

²⁾

este raciocínio pode ser generalizado para mais componentes de variação, como veremos no roteiro seguinte

From:

<http://labtrop.ib.usp.br/> - **Laboratório de Ecologia de Florestas Tropicais**

Permanent link:

http://labtrop.ib.usp.br/doku.php?id=cursos:popcom:2019:roteiros:ec_r2



Last update: **2021/07/20 12:43**