

Varianzkomponentenschätzung

Peter von Rohr

2017-11-24

Einleitung

- ▶ BLUP-Zuchtwertschätzung: bekannte Varianzkomponenten σ_e^2 und σ_a^2
- ▶ In Praxis: Schätzung der Varianzkomponenten von Daten, Verwendung von Schätzwerten in MME
- ▶ Abgesehen von BLUP, wo sind Varianzkomponenten schon aufgetaucht?

Regression und Least Squares

- ▶ Im klassischen Regressionsmodell mit nur fixen Effekten

$$y = Xb + e \quad (1)$$

- ▶ Schätzung \hat{b} mit Least Squares (kleinste Quadrate)
- ▶ Least Squares gibt keine Schätzung für σ_e^2
- ▶ Woher kommt $\hat{\sigma}_e^2$?

Residuen

- ▶ Definition

$$r_i = y_i - \hat{y}_i = y_i - x_i^T \hat{b}$$

- ▶ Summe der quadrierten Residuen als plausibler Schätzer

$$\hat{\sigma}_e^2 = \frac{1}{n-p} \sum_{i=1}^n r_i^2 \quad (2)$$

- ▶ Woher kommt Faktor $\frac{1}{n-p}$
- ▶ Grund: Erwartungstreue:

$$E \left[\hat{\sigma}_e^2 \right] = \sigma_e^2$$

- ▶ Wird auch als Least Squares Schätzer bezeichnet

Beispiel in R

Kalb	Geschlecht	WWG
4	M	4.5
5	F	2.9
6	F	3.9
7	M	3.5
8	M	5.0

Regression in R

- ▶ Mit `summary()` werden die Resultate von `lm()` zusammengefasst

```
lmWwg <- lm(WWG ~ -1 + Geschlecht, data = dfWwgRed)
summary(lmWwg)
```

- ▶ Schätzung für $\hat{\sigma}_e$ unter Residual standard error

```
n <- nrow(dfWwgRed)
p <- length(unique(dfWwgRed$Geschlecht))
vecResiduals <- residuals(lmWwg)
nResVarEst <- crossprod(vecResiduals) / (n-p)
(nResSd <- sqrt(nResVarEst))
```

```
##           [,1]
## [1,] 0.745356
```

Varianzanalyse

- ▶ Ursprünglichstes Verfahren zur Schätzung von Varianzkomponenten
- ▶ Wird auch zum Testen von globalen Hypothesen verwendet
- ▶ Annahme: lineares Modell mit nur fixem Effekt b
- ▶ Frage: Haben Effektstufen von b überhaupt einen Einfluss auf y ?
- ▶ Globale Nullhypothese $H_0 : b_1 = b_2 = \dots = 0$

Tabelle der Varianzanalyse

```
##              Df Sum Sq Mean Sq F value Pr(>F)
## Geschlecht   2  79.45   39.73   71.51 0.00294 **
## Residuals    3   1.67    0.56
## ---
## Signif. codes:  0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1
```

- ▶ Gemittelte Summenquadrate

$$MSQ_R = SSQ_R / df_R = \left(\sum_{i=1}^n r_i^2 \right) / df_R$$

$$MSQ_b = SSQ_b / df_b = \left(\sum_{i=1}^n \hat{y}_i^2 \right) / df_b = \left(\sum_{i=1}^n (x_i^T b)^2 \right) / df_b$$

- ▶ Teststatistik mit \mathcal{F} -Verteilung

$$F = MSQ_b / MSQ_R$$

Schätzung von Varianzkomponenten

- ▶ “zufälliges” Modell: Beispiel Vater-Effekte

$$y = 1\mu + Zu + e$$

- ▶ Eigenschaften von u :
 - ▶ nur ein allgemeines Mittel als fixe Faktorstufe
 - ▶ Zufallsvariable mit vorgegebener Verteilung
 - ▶ unabhängig mit konstanter Varianz σ_u^2 und Erwartungswert $E[u] = 0$
- ▶ Wie können wir σ_u^2 aus den Daten schätzen?

Erwartungswerte von Summenquadraten

- ▶ Erwartungswerte von gemittelten Summenquadraten sind Funktionen von Varianzkomponenten

$$E [MSQ_e] = \sigma_e^2$$

$$E [MSQ_u] = n\sigma_u^2 + \sigma_e^2$$

- ▶ Anstelle der Erwartungswerte die empirischen Werte einsetzen

→ Schätzung für Varianzkomponenten

Schätzungen

$$\widehat{\sigma_e^2} = MSQ_e$$

$$\widehat{\sigma_u^2} = \frac{MSQ_u - MSQ_e}{n}$$

Beispiel

Kalb	Vater	WWG
4	1	4.5
5	3	2.9
6	1	3.9
7	3	3.5
8	3	5.0

Tabelle der Varianzanalyse

```
aovWwgSire <- aov(formula = WwG ~ Vater,  
                  data = dfWwgSire)  
summary(aovWwgSire)
```

##	Df	Sum Sq	Mean Sq	F value	Pr(>F)
## Vater	1	0.192	0.192	0.229	0.665
## Residuals	3	2.520	0.840		

Resultate

$$\widehat{\sigma}_e^2 = MSQ_e = 0.84$$

Setzen wir diese Schätzung in Gleichung (??) ein, dann erhalten wir

$$\widehat{\sigma}_u^2 = \frac{MSQ_u - MSQ_e}{n} = -0.344$$

Negative Schätzwerte

- ▶ Schätzwert für σ_u^2 ist negativ
- ▶ Ursache: spezielle Datenkonstellation (hier zu kleine Datenmenge)
- ▶ Varianzanalyse kann keine negativen Schätzwerte verhindern

→ Varianzanalyse in Tierzucht kaum verwendet → andere Methoden im folgenden Kapitel