**Korelační analýza**

Cílem korelační analýzy je určit sílu lineární závislosti mezi veličinami. První představu o závislosti znaků ***X*** a ***Y*** lze získat tak, že tyto znaky sledujeme u ***n*** statistických jednotek a zjištěná data znázorníme bodovým diagramem. Je to diagram, v němž je každá dvojice pozorování ***(xi,yi)*** znázorněna jako bod v pravoúhlé souřadnicové soustavě, kde na vodorovné ose je umístěna stupnice hodnot znaku ***X*** a na svislé stupnice hodnot znaku ***Y***. Vynesené body pak tvoří množinu, z níž lze vystopovat charakteristické rysy závislosti obou znaků.

*Bodový diagram pro posouzení závislosti potřeby úspěšného výkonu (PUV) a prospěchu žáků.*



**Pearsonův korelační koeficient**

Nejčastěji se pro měření závislosti používá Pearsonův korelační koeficient ρ , který měří lineární závislost dvou náhodných veličin s dvourozměrným normálním rozdělením



Součty čtverců ve jmenovateli jsou n-1 násobkem výběrových rozptylů. Proto se často setkáváme s jednodušším vyjádřením korelačního koeficientu

r = ,

kde sx je směrodatná odchylka proměnné X, sy směrodatná odchylka proměnné Y a sxy takzvaná kovariance proměnných X a Y

sxy = .

Správná interpretace korelačního koeficientu předpokládá, že obě proměnné jsou náhodné veličiny a mají společné dvourozměrné normální rozdělení. Potom nulový korelační koeficient znamená, že veličiny jsou nezávislé. Pokud není splněn předpoklad dvourozměrné normality, z nulové hodnoty korelačního koeficientu nelze usuzovat na nic víc, než že veličiny jsou nekorelované.

Čím těsnější je vztah mezi oběma veličinami, tím více se absolutní hodnota korelačního koeficientu blíží k jedné. Záporné hodnoty korelačního koeficientu vyjadřují nepřímou korelaci (se zvyšováním hodnot jedné proměnné se snižují hodnoty druhé proměnné - např. čím vyšší počet bodů v didaktickém testu, tím lepší (nižší) známka), kladné hodnoty udávají korelaci přímou (se zvyšováním hodnot jedné proměnné se zvyšují i hodnoty druhé proměnné - např. čím delší období přípravy k testu, tím vyšší bodové ohodnocení).

Druhá mocnina korelačního koeficientu se nazývá **koeficient determinace**. Vyjadřuje podíl, jakým je rozptyl závisle proměnné veličiny vysvětlen změnami nezávisle proměnné. Obvykle se násobí stem, čímž je podíl, jakým je rozptyl závisle proměnné veličiny vysvětlen změnami nezávisle proměnné, vyjádřen v procentech.

**Korelační matice**

Různé praktické důvody, ale zejména potřeba vyjádřit se současně o větším počtu proměnných, např. o prospěchu žáka v různých předmětech, vedou často k vícerozměrnému přístupu ke korelační analýze. Při současném zpracování n proměnných hodnotíme korelační koeficienty n(n-1)/2 dvojic proměnných, které sestavujeme do **korelační matice**, jejíž řádky
i sloupce jsou věnovány postupně první až n-té proměnné. Na průsečíku i-tého řádku a j-tého sloupce je tedy uveden korelační koeficient rij i-té a j-té proměnné. Korelační matice je čtvercová a na diagonále obsahuje jedničky, protože rii = 1.

*Korelační matice pro průměrný prospěch, PUV (potřeba úspěšného výkonu) a PVN (potřeba vyhnout se neúspěchu)*

 **Correlations**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|   |   | Průměrný prospěch | PUV | PVN |
| Průměrný prospěch | Pearson Correlation | 1 | -,478(\*\*) | ,164(\*\*) |
|  Sig. (1-tailed) |   | ,000 | ,001 |
|  N | 478 | 387 | 387 |
| PUV | Pearson Correlation | -,478(\*\*) | 1 | -,261(\*\*) |
|  Sig. (1-tailed) | ,000 |   | ,000 |
|  N | 387 | 388 | 388 |
| PVN | Pearson Correlation | ,164(\*\*) | -,261(\*\*) | 1 |
|  Sig. (1-tailed) | ,001 | ,000 |   |
|  N | 387 | 388 | 388 |

\*\* Correlation is significant at the 0.01 level (1-tailed).

**T-test pro korelační koeficient**

Zpravidla nezjišťujeme korelační koeficient u celé sledované populace, ale odhadujeme ho na výběru. Potom je třeba provést **statistický test** nulové hypotézy, která tvrdí, že výběr pochází z dvourozměrného normálního rozdělení, v němž je korelační koeficient nulový. Za platnosti H0 má veličina



rozdělení ***t*** o ***n - 2*** stupních volnosti, kde ***n*** je rozsah výběru.

Tento vzorec se ale nehodí pro test hypotézy rovnosti korelačního koeficientu nenulové hodnotě. Proto je třeba hodnotu ***r*** pomocí vhodné transformace "normalizovat".

**Fisherova transformace**

Nejpoužívanější transformace je dána logaritmickým vztahem

.

Hodnoty ***z*** mají pro velký počet pozorování přibližně normální rozložení bez ohledu na to, jak velký je korelační koeficient. Výběrová chyba veličiny ***z*** má jednoduchý tvar

**.**

Pro test hypotézy r = r0 pak použijeme testové kritérium U

U = (z - z0) ** ,**

přičemž ***z0*** získáme pomocí výše uvedené transformace kde za ***r*** dosadíme ***r0***. Chceme-li testovat hypotézu o shodě dvou nebo více korelačních koeficientů postupujeme obdobně.

Při tvorbě obecných výroků vztahujících se souběžně k většímu počtu proměnných je třeba zachovat určitou opatrnost. Ve stručnosti lze říci, že tu nestačí prostě kombinovat úsudky o jednotlivých dvojicích proměnných, protože kombinovaný výrok by měl už podstatně nižší spolehlivost. Pro řešení takových úloh lze doporučit některé z metod vícerozměrné statistické analýzy, kterým je věnována např. kniha (Anděl, J. 1978).

**Spearmanův korelační koeficient**

Pearsonův korelační koeficient daný vztahem lze použít i pro pořadové proměnné, jsou-li pořadová čísla brána jako naměřené hodnoty. Dá se dokázat, že za těchto okolností vzorec pro Pearsonův korelační koeficient přechází do jednoduššího tvaru

r = 1 - ,

který se nazývá Spearmanův koeficient korelace.

**Interval spolehlivosti pro korelační koeficient**

Pro konstrukci intervalu spolehlivosti použijeme Fisherovu transformaci. Pak platí

P (-u1-α/2 < (Z - z0) **** < u1-α/2) = 1 - a.

Odtud lze zjistit, že pro konkrétní hodnotu ***z*** (vypočtenou pro daný korelační koeficient) platí

P (Z - u1-α/2****< z0 < Z + u1-α/2****) = 1 - a.

Dvoustranný 100(1-a)procentní interval spolehlivosti je tudíž

(z - u1-α/2**,**  z + u1-α/2****).

Ze vztahu



lze odvodit, že

.

Pomocí této transformace lze meze spolehlivosti pro ***z*** převést na meze spolehlivosti pro korelační koeficient.

**Mnohonásobný koeficient korelace**



**Parciální korelační koeficient**

****.

Pro test významnosti koeficientu parciální korelace se dá použít podobného vzorce jako pro Pearsonův koeficient korelace, ovšem máme přitom o jeden stupeň volnosti méně, a proto



má při platnosti H0: ρ12-3 = 0, t rozdělení s *n - 3* stupni volnosti. Rovněž Fisherova transformace je pro parciální korelaci dovolena, přičemž při výpočtu výběrové chyby se hodnota *n - 3* sníží na *n - 4.*

**Kendallův koeficient pořadové korelace**

,

kde ***P*** je počet konkordancí, ***Q*** počet diskordancí a ***n*** počet pozorování. Přitom platí, že dvě dvojice pořadí pozorování (xi , yi) a (xj, yj) jsou **konkordantní** když pro xi < xj je yi <yj nebo když pro xi > xj je yi > yj . Naproti tomu dvě dvojice pořadí pozorování (xi , yi) a (xj, yj) jsou
**diskordantní**  když pro xi < xj je yi > yj nebo když pro xi < xj je yi > Ryj .

**Bodově biseriální korelační koeficient**

je vztah mezi spojitou metrickou proměnnou a proměnnou binární nabývající hodnot 0,1. Označíme-li spojitou proměnnou y a binární proměnnou x, platí že



kde je průměr těch *yi ,* u nichž je *x* = 1, je průměr těch *yi ,* u nichž je *x* = 0, ***s***  je výběrová směrodatná odchylka všech ***y****,*  *n*0 je počet nul a *n*1 počet jedniček mezi *x.*

**Závislost kvalitativních znaků**

Síla závislosti dvou kvalitativních znaků se nejčastěji udává koeficientem kontingence

KK = ,

kde K je hodnota testového kritéria používaného pro test závislosti dvou kvalitativních znaků (viz chí-kvadrát test nezávislosti). Nevýhoda koeficientu kontingence KK spočívá v tom, že i při úplné závislosti (v kontingenční tabulce je v každém řádku resp. sloupci obsazeno jedno jediné políčko) je KK menší než 1. Proto se používá oprava

KKO = ****,

kde

KKmax = ****,

kde *r* značí počet řádků v kontingenční tabulce. V tabulkách, které nejsou čtvercové (*r ≠ c*), je třeba za*r* dosadit vždy menší z obou hodnot *r, c.*