

사회통계연습

김현우, PhD¹

October 1, 2021

진행 순서

- 1 이론적 확률분포
- 2 대표적인 이산확률분포: 이항분포
- 3 대표적인 연속확률분포: 정규분포

이론적 확률분포

이론적 확률분포

다양한 유형의 시행(trials) 또는 실험은 서로 다른 확률분포를 생성한다.

- 앞서 척도는 먼저 숫자형(numerical)과 범주형(categorical)로 나눌 수 있고, 숫자형은 다시 이산형(discrete)과 연속형(continuous)으로 나뉜다고 했다.
- 마찬가지로 논리로 확률분포 역시 이산확률분포(discrete probability distribution)와 연속확률분포(continuous probability distribution)로 나눌 수 있다.

일단 확률분포가 주어지면 그것의 평균과 분산을 계산할 수 있다는 것을 꼭 기억하자!

- 수리통계학에서는 꽤 공들여 여러 종류의 이론적 확률분포를 공부한 다음, 각각의 평균과 분산을 도출하고 각종 수학적 테크닉을 동원해서 다양하게 증명한다.

우리는 오로지 두 가지 이론적 확률분포만 공부한다.

- 대표적인 이산확률분포로 이항분포(binomial distribution)를, 대표적인 연속확률분포로 정규분포(normal distribution)를 공부한다.

대표적인 이산확률분포: 이항분포

대표적인 이산확률분포: 이항분포

가장 대표적인 이산확률분포(discrete probability distribution)는 이항분포(binomial distribution)이다.

이항분포를 위한 준비운동으로 먼저 베르누이 과정(Bernoulli process)을 이해할 필요가 있다.

- 딱 한 번의 독립적인 시행(trial)이 이루지고 각 시행의 사건(event)은 두 가지 뿐이다 (e.g., 성공/실패, H/T, 1/0).
- 두 사건의 확률은 각각 $P(X = 1) = p$ 와 $P(X = 0) = 1 - p$ 로 표현된다.

$$f_{k;p} = \begin{cases} p & \text{if } k=1 \\ 1-p & \text{if } k=0 \end{cases}$$

- 좀 더 축약해서 표현하면,

$$f_{k;p} = p^k(1-p)^{1-k}$$

- 이때 p 는 성공할 확률(e.g., 동전 던지기의 경우 0.5), k 는 성공 여부(i.e., 1이 성공, 0이 실패)다.

대표적인 이산확률분포: 이항분포

베르누이 분포(Bernoulli Distribution)

- 너무 단순하기 때문에 이를 새삼 확률분포로 나타내는 것도 웃기지만, 우리가 더 관심있는 이항분포(binomial distribution)을 공부하기 위해서 필요하다.
- 아까 일단 확률분포가 주어지면 확률변수의 평균과 분산을 계산할 수 있다고 말했다.
- 베르누이 확률분포의 기댓값(=평균)은 $E(X) = p \cdot 1 + (1 - p) \cdot 0 = p$ 이다.
- 베르누이 확률분포의 분산은 $\text{Var}(X) = E(X^2) - E(X)^2 = p(1 - p)$ 이다.

대표적인 이산확률분포: 이항분포

이항분포의 분산은 $\text{Var}(X) = np(1 - p)$ 이다.

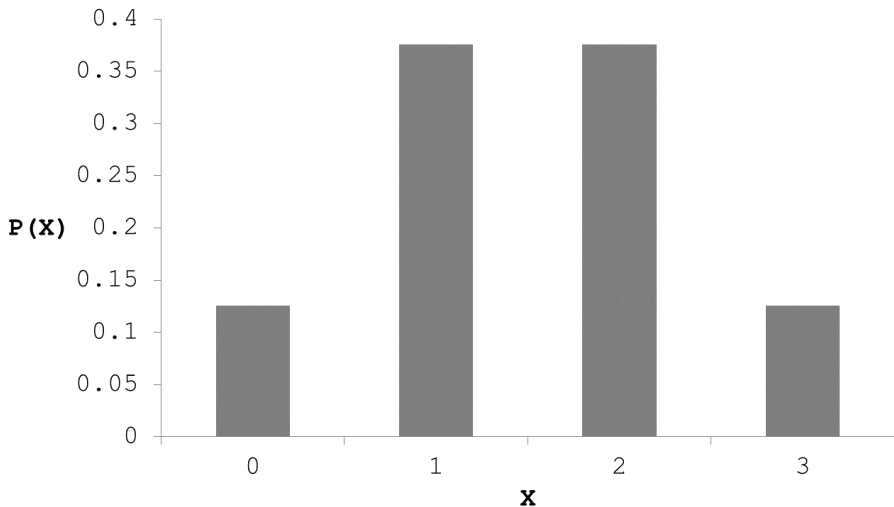
- 까다로운 수학적 증명은 수학도들에게 맡기고 그저 직관적으로만 살펴보자.
- 베르누이 분포(Bernoulli distribution)의 분산은 $p(1-p)$ 다(8페이지 참고).
- 이항분포(binomial distribution)는 **N번의 베르누이 과정(Bernoulli process)**을 독립 시행했을 때 성공 횟수를 확률과 함께 보여준다.
- 그러므로 각 베르누이 시행(each Bernoulli trial)의 분산, 즉 $p(1-p)$ 은 서로 얹히지 않고 독립적이므로 단지 n 번만 곱한 것과 같다.

대표적인 이산확률분포: 이항분포

이항 확률질량함수(binomial PMF) 그래프를 그려보자!

- 만일 x축을 확률변수 X로 하고 y축을 **이항분포를 따르는 확률질량함수**라고 한다면 그림을 그려볼 수 있다.
- 동전을 세 번 던져 앞면이 나오는 경우의 이항 확률질량함수는,
- 앞면이 0번 나오는 확률(=P(X=0))은 $\frac{3!}{0!(3-0)!} \cdot .5^0 \cdot (1 - .5)^{3-0} = .125$
- 앞면이 1번 나오는 확률(=P(X=1))은 $\frac{3!}{1!(3-1)!} \cdot .5^1 \cdot (1 - .5)^{3-1} = .375$
- 앞면이 2번 나오는 확률(=P(X=2))은 $\frac{3!}{2!(3-2)!} \cdot .5^1 \cdot (1 - .5)^{3-2} = .375$
- 앞면이 3번 나오는 확률(=P(X=3))은 $\frac{3!}{3!(3-3)!} \cdot .5^1 \cdot (1 - .5)^{3-3} = .125$

대표적인 이산확률분포: 이항분포



대표적인 이산확률분포: 이항분포

아까 그림은 엑셀로 그린 거다. 여러분도 쉽게 그릴 수 있다.

- eCampus에서 binomdist.xlsx를 다운받아서 [fig4] 탭을 보자. 이게 아까 그 그림이다. 맘대로 숫자를 바꾸어 보자.
- 이번엔 [PLAY!] 탭을 보자. 동전을 30번 던져 1번에서 15번 사이의 앞면(H)이 나올 확률을 계산하고 있다.
- binom.dist() 함수로 직접 그려볼 수도 있고, 패러미터를 조금씩 달리해서 어떻게 달라지는지도 확인할 수 있다.
- 심지어 JASP에서는 더 쉽게 가능하다.

예제: “동전을 열 번 던져서 앞면(H)이 세 번 이하로 나올 확률은?”

- 다시 [PLAY!] 탭의 엑셀 함수를 사용하여 직접 계산해보자.
- 참고로 답은 $0.0009765625 + 0.009765625 + 0.043945313 + 0.1171875$ 다.

대표적인 연속확률분포: 정규분포

대표적인 연속확률분포: 정규분포

척도와 확률분포

- 지금까지 이산형 척도(discrete scale)로 측정되는 사건(e.g., 여성별로 출산한 아이의 수, 청주시에서 일어난 시위의 수)에 대한 이산확률분포를 다루었다.
- 이제부터 연속형 척도(continuous scale)로 측정되는 사건(e.g, 지역별 평균출산율, 청주시 평균 상가임대료)에 대한 연속확률분포를 다루기로 한다.

대표적인 연속확률분포: 정규분포

정규분포(normal distribution)는 지금까지 다룬 확률분포 중에 가장 중요한 것이다.

- 가우스(Gauss)가 발견하여 가우스 분포(Gaussian distribution)라고도 불리운다.
- 모든 이론적 확률분포 가운데 가장 수학적으로 아름답다(elegant).
- 있는 그대로도 자연과 사회에서 나타나는 여러 현상들을 터무니없이 잘 설명한다.
- “이건 잘 설명되지 못하네” 싶은 현상도 각도를 달리해서 보면 바꾸면 정규분포에 의해 잘 설명된다.
- 통계적 추론(statistical inference)의 초석 역할을 한다.

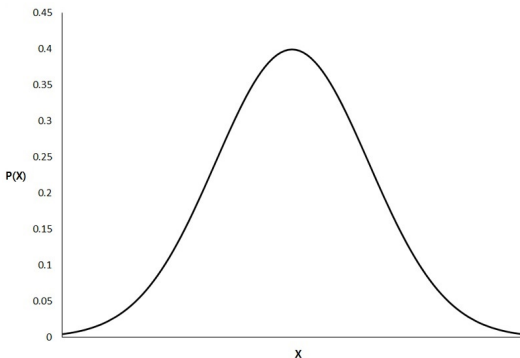


독일화폐 10마르크(지금은 유로화로 대체)에는 가우스와 정규분포가 그려져 있다

대표적인 연속확률분포: 정규분포

다음과 같은 정규분포(normal distribution)의 기본적인 속성이 잘 알려져 있다.

- 정규분포는 대칭적(symmetric)이고 종 모양(bell-shaped)이다.
- 양측의 꼬리는 무한히 이어지며 결코 x축에 닿지 않는다.
- 평균(mean)과 중위값(median)이 같다.
- x축은 확률변수(random variable)인 X 이고, y축은 확률밀도함수(PDF)이다.



대표적인 연속확률분포: 정규분포

정규분포의 확률밀도함수(PDF)는 아래와 같다.

$$P(x) = \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} e^{-(x-\mu)^2/2\sigma^2}$$

- 첫째, 외우지 마라.
- 둘째, 원주율(π)이 나온다. 신기하네~
- 셋째, 모수(parameter)로 무엇이 나오는지 살펴보자(μ 와 σ).
- 넷째, 위 식에서 말하는 확률밀도함수(PDF)란 연속확률변수에서 특정 값을 받으면 그에 따른 확률을 토해내는 함수이다.
- “잠깐! 아까 확률질량함수(PMF)와는 뭐가 다르지?” 같은 개념인데 이산확률변수에 대해서는 확률질량함수, 연속확률변수에 대해서는 확률밀도함수라고 부른다.

대표적인 연속확률분포: 정규분포

정규 확률밀도함수(normal PDF)는 엑셀로 장난치면서 배워야 더 금방 이해할 수 있다.

- `norm.dist(x, mean, standard_dev, cumulative)` 함수로 레코드를 만들고 그래프를 만든다.
- 여기서 `cumulative`는 `TRUE` 또는 `FALSE` 중 고르는 건데 만일 누적(`cumulative`) 함수를 그릴거면 `TRUE`, 아니면 `FALSE`.
- eCampus에서 `normdist.xlsx`를 다운받아서 [PLAY! (1)] 탭을 보자. 모수 (parameter)로 무엇이 있는지, 또 그것들을 어떻게 엑셀 함수에서 어떻게 쓰이고 있는지 눈으로 확인하자!
- $P(X)$ 에서 구해지는 숫자나 계산보다는 그래프의 모양 변화에 집중해보자.
- μ (mu; 평균)가 커질수록 그래프의 모양이 어떻게 변하는가?
- σ (sigma; 표준편차)가 커질수록 그래프의 모양이 어떻게 변하는가?

대표적인 연속확률분포: 정규분포

표준정규분포(standard normal distribution)는 **표준화**된 정규분포이다!

- 정규분포의 꼴은 모수(parameter)인 μ 와 σ 에 따라 다르다(엑셀로 실험해 보았다).
- 그러다보니 좀처럼 표준적인 정규분포를 말하기 어렵다는 단점이 있다.
- normdist.xlsx 파일의 [PLAY! (2)] 탭을 보자. 위의 확률분포 $P(X)$ 와 아래의 확률분포 $P(X)$ 가 어떻게 다른지 관찰하자.
- 분포가 완전히 똑같은데 단지 μ 와 σ 가 다르기 때문에 $P(X)$ 가 전혀 다르다는 것을 확인할 수 있다.
- 이렇게 되면 두 개의 정규분포를 비교하기가 까다로워진다. 그러므로 통계학자들 사이에서 $\mu = 0$, $\sigma = 1$ 로 하는 정규분포를 이제부터 표준(standard)으로 삼자고 규약을 정했다. 그게 바로 **표준정규분포**다.

대표적인 연속확률분포: 정규분포

편리하게도 통계학자들은 그냥 정규분포하는 자료를 표준정규분포로 변환하는 방법도 개발했다!

- 표준정규분포로 변환하기 위해서는 원점수(raw score)를 Z-점수(Z-score)로 변환하면 된다.
- 보다 구체적으로, 원점수 레코드(x_i)에서 평균(μ)을 뺀 값을 표준편차(σ)로 나누어 Z-점수를 구한다.

$$Z_i = \frac{X_i - \mu}{\sigma}$$

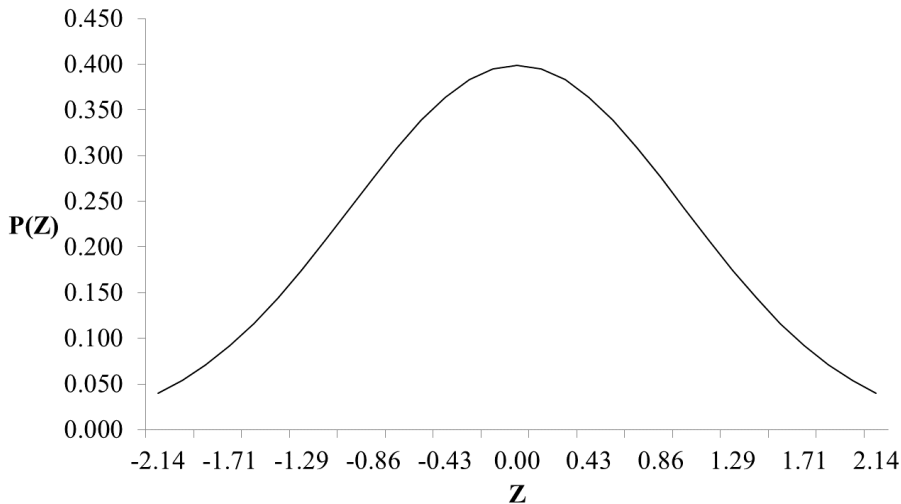
- “평균을 빼준다”는 점에서 개별 관측치는 평균에서 벗어난 정도가 클수록 높은 Z-점수를 갖게 된다.
- “표준편차로 나눈다”는 점에서 (설령 원점수가 제법 컸더라도) 표준편차가 클수록 Z-점수는 작아진다.

대표적인 연속확률분포: 정규분포

엑셀을 가지고 표준정규분포(standard normal distribution)의 누적밀도함수(CDF)를 쉽게 계산할 수 있다.

- 예제 1. 아까 말한 C병원에서 어젯밤 새벽에 한 아이가 태어났다. 이름은 동혁이다. 출생시 몸무게는 4.1kg이었다. C병원에서 태어난 아이 중 동혁보다 가벼운 아이는 전체의 몇 퍼센트인가?
- 예제 2. 지금 말하기 바쁘게 방금 전 또 한 아이가 태어났다. 이름은 채린이다. 출생시 몸무게는 2.8kg이었다. C병원에서 태어난 아이 중 채린보다 무겁고 동혁보다 가벼운 아이는 전체의 몇 퍼센트인가?
- 예제 3. C병원에서 제일 일찍 태어난 도균은 당시 몸무게가 2.3kg이었다. C병원에서 태어난 아이 중 도균보다 무거운 아이는 전체의 몇 퍼센트인가?

대표적인 연속확률분포: 정규분포



대표적인 연속확률분포: 정규분포

확률이 주어졌을 때 대응하는 원점수를 파악하는 연습이 조금 필요하다.

- 예제: 작년 정부 보고서에 따르면 공직자적성검사의 점수는 평균 72점과 표준편차 8점으로 정규분포한다고 알려졌다. 하위 40% 이하는 무조건 탈락이라고 한다. 과락을 면하려면 최소한 몇 점을 넘어야 하나?
- 답안: $=\text{NORM.INV}(.4, 0, 1)$ 는 약 -0.25이다. 확률로 0.4를 넣었으니 돌아온 것은 Z-점수다. -0.25라는 Z-점수로는 뭐가 뭔지 알 수 없고, 요걸 다시 원점수로 환산해야 이해할 수 있다. 아까 배운 식을 활용해서 $-0.25 \cdot \sigma + \mu = 70$ 를 얻을 수 있다. 즉, 70점을 넘어야 한다.

대표적인 연속확률분포: 정규분포

대표적인 이항분포만을 공부했지만 사실 이산일양분포와 푸아송도 배우면
좋다.

- 교재를 통해 푸아송 분포(Poisson distribution)도 함께 공부할 것.

[간단히 핵심을 언급할 것]

대표적인 정규분포만을 공부했지만 사실 일양분포와 지수분포도 배우면
좋다. [간단히 핵심을 언급할 것]

교재를 통해 공부할 것.

가장 쉬운 것은 일양분포(uniform distribution)이다.

일양분포에서 일양이란 하나 一(uni)에 모양 樣(form)으로 uniform을
직역한 것이다.

끝!

와~ 이번 숙제는 엑셀 문제네~