

САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКИЙ ПОЛИТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ИМЕНИ
ПЕТРА ВЕЛИКОГО

ИНСТИТУТ ПРИКЛАДНОЙ МАТЕМАТИКИ И МЕХАНИКИ
ВЫСШАЯ ШКОЛА ПРИКЛАДНОЙ МАТЕМАТИКИ И ФИЗИКИ

Математическая статистика
Отчёт по лабораторной работе №9

Выполнил:

Студент: Сачук Александр

Группа: 5030102/90201

Принял:

к. ф.-м. н., доцент

Баженов Александр Николаевич

2022 г.

Содержание

1. Постановка задачи	3
2. Теория	4
2.1. Представление данных	4
2.2. Линейная регрессия	4
2.2.1. Описание модели	4
2.2.2. Метод наименьших модулей	4
2.3. Предварительная обработка данных	5
2.4. Коэффициент Жаккара	5
2.5. Процедура оптимизации	6
3. Результаты	7
4. Реализация	10
5. Обсуждение	11
6. Список литературы	12
7. Ссылки на репозиторий	13

Список иллюстраций

1. Схема установки для исследования фотоэлектрических характеристик. .	3
2. Исходные данные из экспериментов	7
3. Интервальное представление исходных данных	7
4. Линейная модель дрейфа данных	7
5. Гистограммы значений множителей коррекции w	8
6. Скорректированные модели данных	8
7. Гистограммы скорректированных данных	8
8. Значение коэффициента Жаккара от калибровочного множителя от R_{21}	9
9. Гистограмма объединённых данных при оптимальном значении R_{21} . .	9

1. Постановка задачи

Постановка задачи. Исследование из области солнечной энергетики [1]. На рис 1 показана схема установки для исследования фотоэлектрических характеристик.

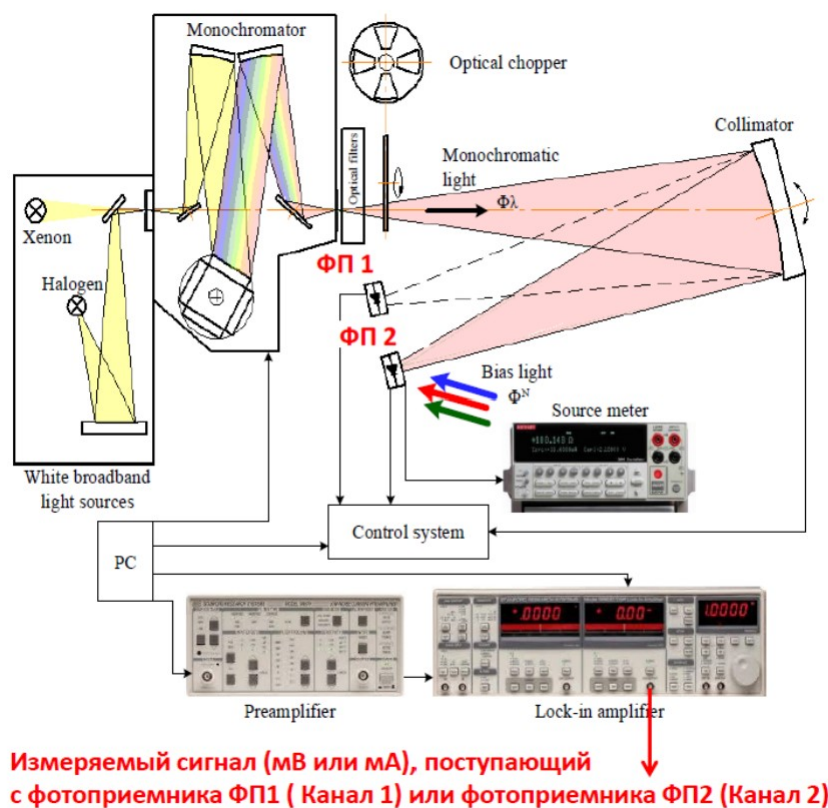


Рис. 1. Схема установки для исследования фотоэлектрических характеристик.

Калибровка датчика ФП1 производится по эталону ФП2. Зависимость между квантовыми эффективностями датчиков предполагается одинаковой для каждой пары измерений

$$QE_2 = \frac{I_2}{I_1} * QE_1 \quad (1)$$

QE - квантовые эффективности эталонного и исследуемого датчиков, I - измеренные токи.

Исходные данные. Имеется 2 выборки данных с интервальной неопределенностью. Одна из них относится к эталонному датчику ФП2, другая - к исследуемому датчику ФП1.

Задача. Требуется определить коэффициент калибровки

$$R_{21} = \frac{I_2}{I_1} \quad (2)$$

при помощи линейной регрессии на множестве интервальных данных и коэффициента Жаккара.

2. Теория

2.1. Представление данных

В первую очередь представим данные таким образом, чтобы применить понятия статистики данных с интервальной неопределенностью.

Один из распространённых способов получения интервальных результатов в первичных измерениях - это "обинтерваливание" точечных значений, когда к точечному базовому значению x_0 , которое считывается по показаниям измерительного прибора, прибавляется *интервал погрешности* ϵ :

$$\mathbf{x} = \dot{x} + \epsilon \quad (3)$$

Интервал погрешности зададим как

$$\epsilon = [-\epsilon; \epsilon]$$

В конкретных измерениях примем $\epsilon = 10^{-4}$ мВ.

Согласно терминологии интервального анализа, рассматриваемая выборка - это вектор интервалов, или интервальный вектор $x = (x_1, x_2, \dots, x_n)$.

2.2. Линейная регрессия

2.2.1. Описание модели

Линейная регрессия - регрессионная модель зависимости одной переменной от другой с линейной функцией зависимости:

$$y_i = X_i b_i + \epsilon_i$$

где X - заданные значения, y - параметры отклика, ϵ - случайная ошибка модели. В случае, если y нас y_i зависит от одного параметра x_i , то модель выглядит следующим образом:

$$y_i = b_0 + b_1 * x_i + \epsilon_i \quad (4)$$

В данной модели мы пренебрегаем погрешностью и считаем, что она получается при измерении y_i .

2.2.2. Метод наименьших модулей

Для наиболее точного приближения входных с фотоприемников данных y_i линейной регрессией $f(x_i)$ используется метод наименьших квадратов. Этот метод основывается на минимизации нормы разности последовательности:

$$\|f(x_i) - y_i\|_{l^1} \rightarrow \min \quad (5)$$

В данном случае ставится задача линейного программирования, решение которой дает нам коэффициенты b_0 и b_1 , а также вектор множителей коррекции данных w . По итогу получается следующая задача линейного программирования

$$\sum_{i=1}^n |w_i| \rightarrow \min \quad (6)$$

$$b_0 + b_1 * x_i - w_i * \epsilon \leq y_i, i = 1..n \quad (7)$$

$$b_0 + b_1 * x_i + w_i * \epsilon \leq y_i, i = 1..n \quad (8)$$

$$1 \leq w_i, i = 1..n \quad (9)$$

2.3. Предварительная обработка данных

Для оценки постоянной, как можно будет увидеть далее, необходима предварительная обработка данных. Займемся линейной моделью дрейфа.

$$Lin(n) = A + B * n, n = 1, 2, ...N \quad (10)$$

Поставив и решив задачу линейного программирования, найдем коэффициенты A , B и вектор w множителей коррекции данных для каждого из фотоприемников ФП1 и ФП2. В последствии множитель коррекции данных необходимо применить к погрешностям выборки, чтобы получить данные, которые согласовывались с линейной моделью дрейфа:

$$I^f(n) = \dot{x}(n) + \epsilon * w(n), n = 1, 2, ...N \quad (11)$$

По итоге необходимо построить "спрямленные" данные выборки: получить их можно путем вычитания из исходных данных линейную компоненту:

$$I^c(n) = I^f(n) - B * n, n = 1, 2, ...N \quad (12)$$

2.4. Коэффициент Жаккара

Коэффициент Жаккара - мера сходства множеств. В интервальных данных рассматривается некоторая модификация этого коэффициента: в качестве меры множества (в данном случае интервала) рассматривается его длина, а в качестве пересечения и объединения - взятие минимума и максимума в интервальной арифметике соответственно. Можно заметить, что в силу возможности минимума по включению быть неправильным интервалом, коэффициент Жаккара может достигать значения только в интервале $[-1; 1]$.

$$JK(x) = \frac{width(\wedge x_i)}{width(\vee x_i)} \quad (13)$$

2.5. Процедура оптимизации

Чтоб найти оптимальный параметр калибровки R_{21} необходимо поставить и решить задачу максимизации коэффициента Жаккара, зависящего от параметра калибровки:

$$JK(I_1^c(n) * R \cup I_2^c(n)) \Rightarrow \max \quad (14)$$

где I_1^c и I_2^c - полученные спрямленные выборки, а R - параметр калибровки. Найденный таким образом R и будет искомым оптимальным R_{21} в силу наибольшего совпадения, оцененного коэффициентом Жаккара.

3. Результаты

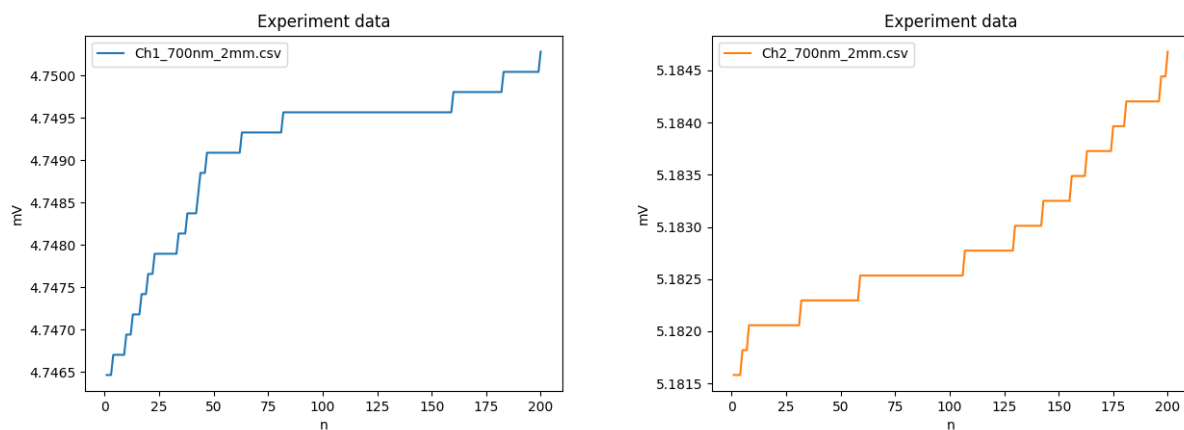


Рис. 2. Исходные данные из экспериментов

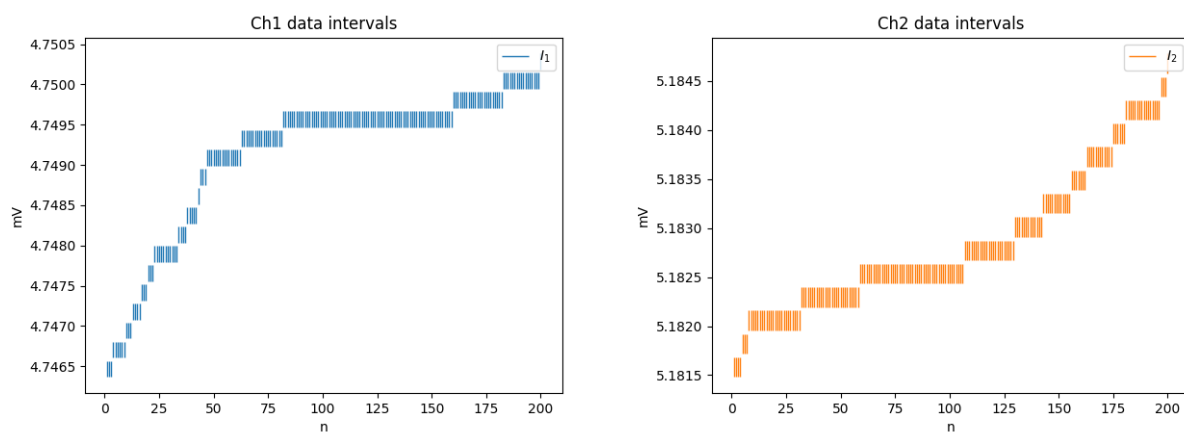


Рис. 3. Интервальное представление исходных данных

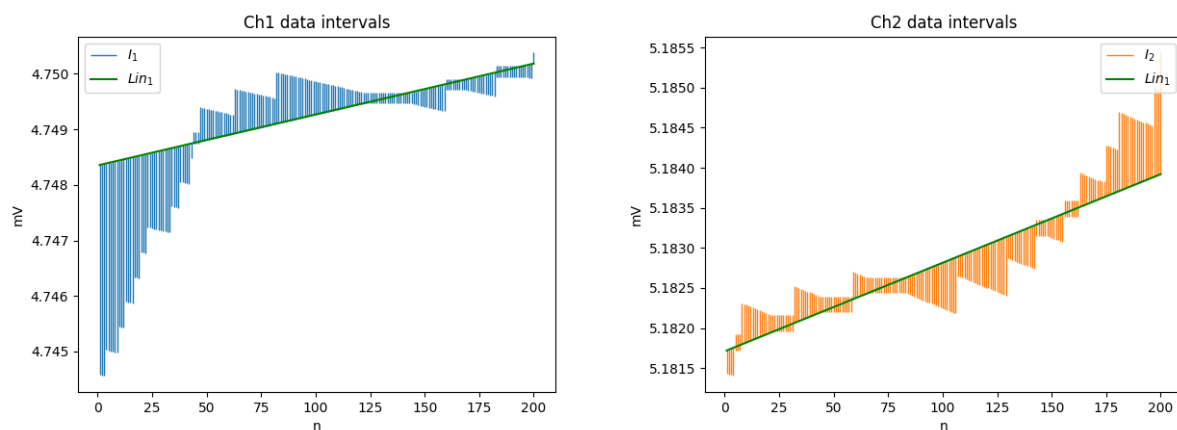


Рис. 4. Линейная модель дрейфа данных

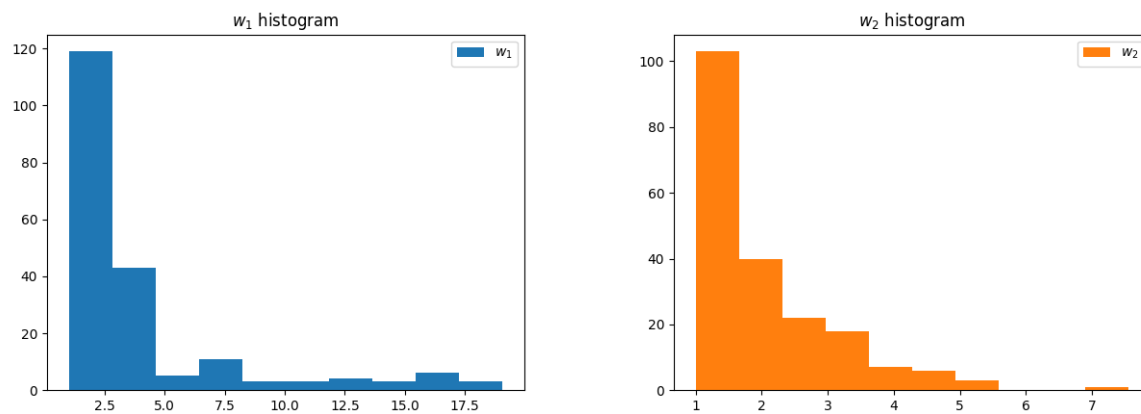


Рис. 5. Гистограммы значений множителей коррекции w

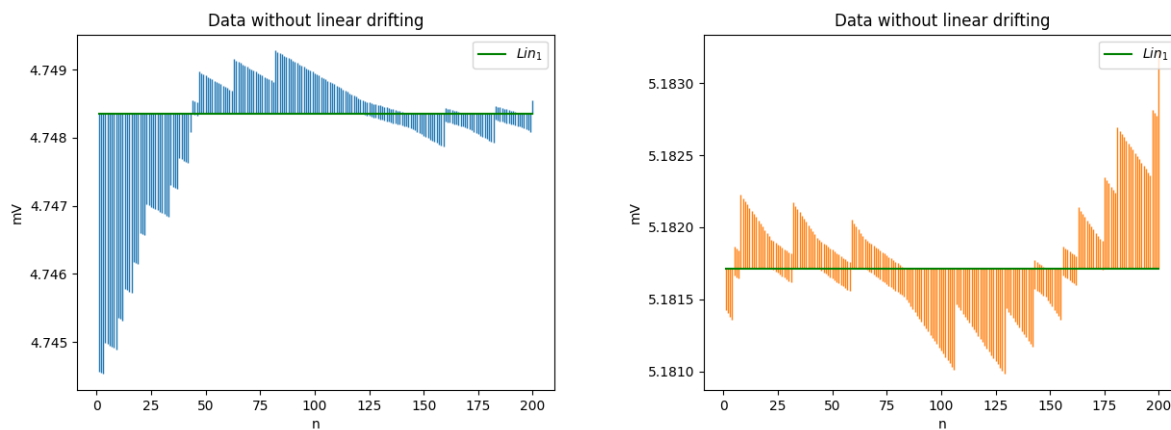


Рис. 6. Скорректированные модели данных

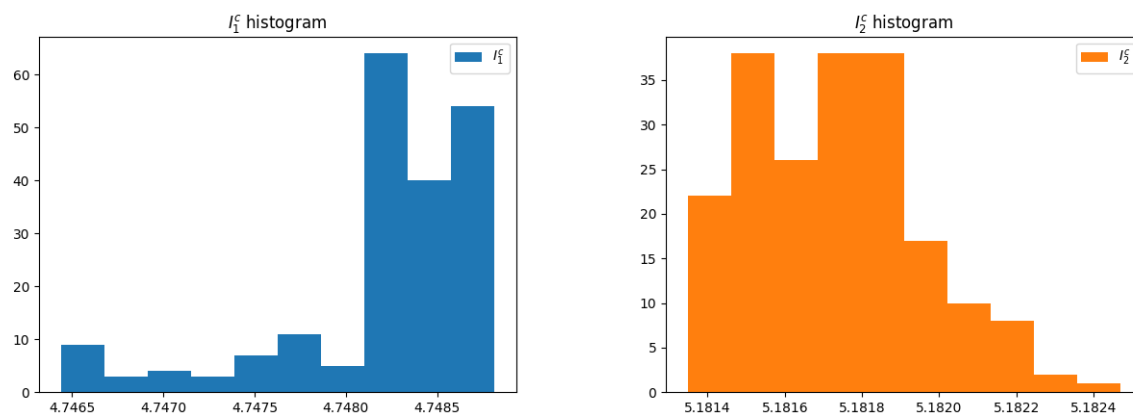


Рис. 7. Гистограммы скорректированных данных

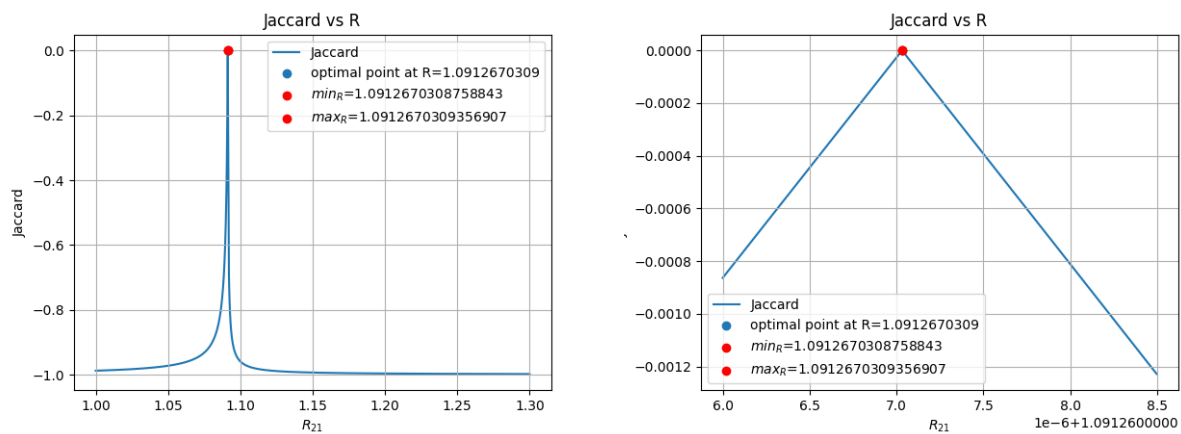


Рис. 8. Значение коэффициента Жаккара от калибровочного множителя от R_{21}

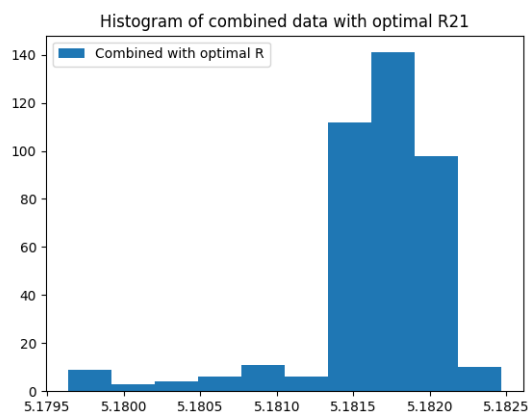


Рис. 9. Гистограмма объединённых данных при оптимальном значении R_{21}

4. Реализация

Лабораторная работа была реализована при помощи языка программирования Python 3.10 с использованием библиотек NumPy, Matplotlib и SciPy. Работа выполнена в интегрированной среде разработки Visual Studio 2019. Отчет выполнен в онлайн-редакторе LaTeX "Overleaf" (май 2022г.)

5. Обсуждение

Множители коррекции w . На гистограммах значений множителей коррекции (Рис.5), видно, что половина (для эталлоного фотопередатчика даже больше) не требует коррекции. Это означает, что линейная модель дрейфа данных является разумным приближением.

Коэффициент Жаккара На рис.8 видно, что оптимальным множителем R_{21} является число, равное 1.0912670309. Однако видно, что коэффициент Жаккара при оптимальном значении едва-едва превышает 0, а интервал, при котором $JK \geq 0$, соизмерим с точкой (длина интервала оценивается $10^{-9} - 10^{-10}$). Это показывает на то, что исходные данные имеют ряд неточностей, которые сложно устранить. Это же можно было и заметить на Рис.3, иллюстрирующий входные данные. Однако, как будет далее видно, подобранный коэффициент R_{21} приблизит данные первого фотоприемника к данным второго фотоприемника.

Гистограмма объединённых данных при оптимальном значении R . Сравнивая гистограмму объединённых данных при оптимальном значении R_{21} (Рис. 9) с гистограммами скорректированных данных (Рис. 7), видно, что гистограмма объединённых данных повторяет форму гистограммы входных данных с ФП1, однако пик гистограммы смещен в сторону значения пика на гистограмме ФП2.

6. Список литературы

1. М.З.Шварц. Данные технологических испытаний оборудования для калибровки фотоприемников солнечного излучения. 2022.

7. Ссылки на репозиторий

<https://github.com/AS2/Mathematical-statistics/tree/main/lab3> - GitHub
репозиторий