

Лабораторная работа 3, ТВМС

Бочарников Андрей, М3238

Ковешников Глеб, М3238

Шишкин Алексей, М3238

26 марта 2020 г.

Формулировка

Для случайной величины, распределенной по нормальному закону с параметрами (a, σ^2) , выполнить следующие действия:

1. Задать параметры распределения $X \sim N(a, \sigma^2)$.
2. Построить график $F_x(x)$.
3. Построить выборку генеральной совокупности X .
4. По построенной выборке построить график эмпирической функции распределения $F_n(x)$.
5. Построить доверительную полосу надежности.
6. На этом же графике построить $F_n(x)$ и $F_x(x)$.
7. На основе критерия Колмогорова провести проверку гипотез.

Аналогично для $X \sim U(a, b)$ - равномерно распределенной на $[a, b]$ случайной величины.

Входные данные

- Выборка генеральной совокупности: $n = 100$
- Доверительная полоса надежности: $\gamma = 0.95$, $u(\gamma) = 1.36$
- Проверка критерия Колмогорова: $n = 10^4$ и 10^6

Программа 1

Нормальное распределение.

3.1 Исходный код

```
pkg load statistics

function p = test(n, mu, sigma)
    m = 100;
    X = sort(normrnd(mu, sigma, m, n));
    res = -1;
    for i=1:m
        X_i = X(i, :);
        F_X_i = normcdf(X_i, mu, sigma);
        current_val = max(abs(F_X_i - i / m), abs(F_X_i - (i - 1) / m));
        res = max(res, current_val);
    endfor
    gamma = 0.95;
    u_gamma = 1.36;
    p = mean((sqrt(m) * res) > u_gamma);
endfunction

n = 100;
mu = 1;
sigma = 1;

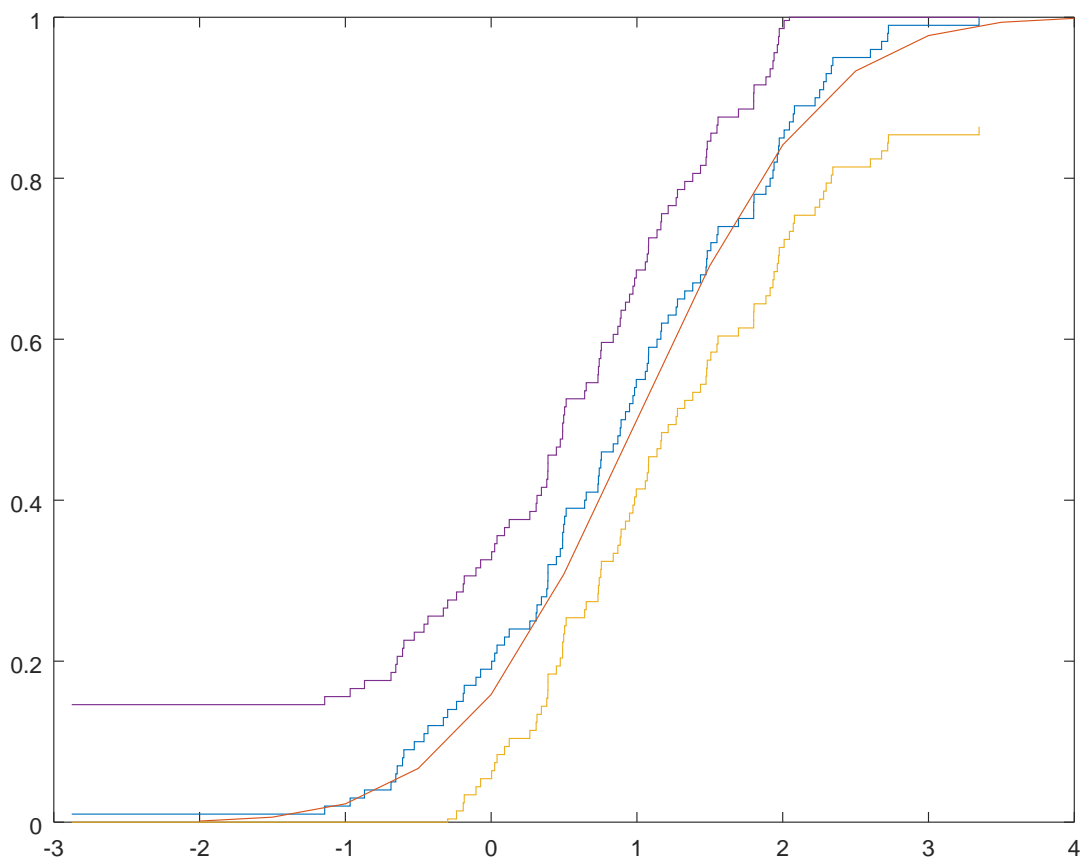
t = mu - 3 * sigma : 0.5 : mu + 3 * sigma;
F_x = normcdf(t, mu, sigma);

X = sort(normrnd(mu, sigma, n, 1));
F_n = 1 / n : 1 / n : 1;
[a, b] = stairs(X, F_n);

u = 1.36;
delta = u / sqrt(n);
plot(a, b, t, F_x, a, max(b - delta, 0), a, min(b + delta, 1))

test(10000, mu, sigma)
test(1000000, mu, sigma)
```

3.2 График



Программа 2

Равномерное распределение.

4.1 Исходный код

```
pkg load statistics

function p = test(n, a, b)
    m = 100;
    X = unifrnd(a, b, m, n);
    X = sort(X);
    res = -1;
    for i=1:m
        X_i = X(i, :);
        F_X_i = unifcdf(X_i, a, b);
        current_val = max(abs(F_X_i - i / m), abs(F_X_i - (i - 1) / m));
        res = max(res, current_val);
    endfor
    gamma = 0.95;
    u_gamma = 1.36;
    p = mean((sqrt(m) * res) > u_gamma);
endfunction

n = 100;
a = 20;
b = 80;

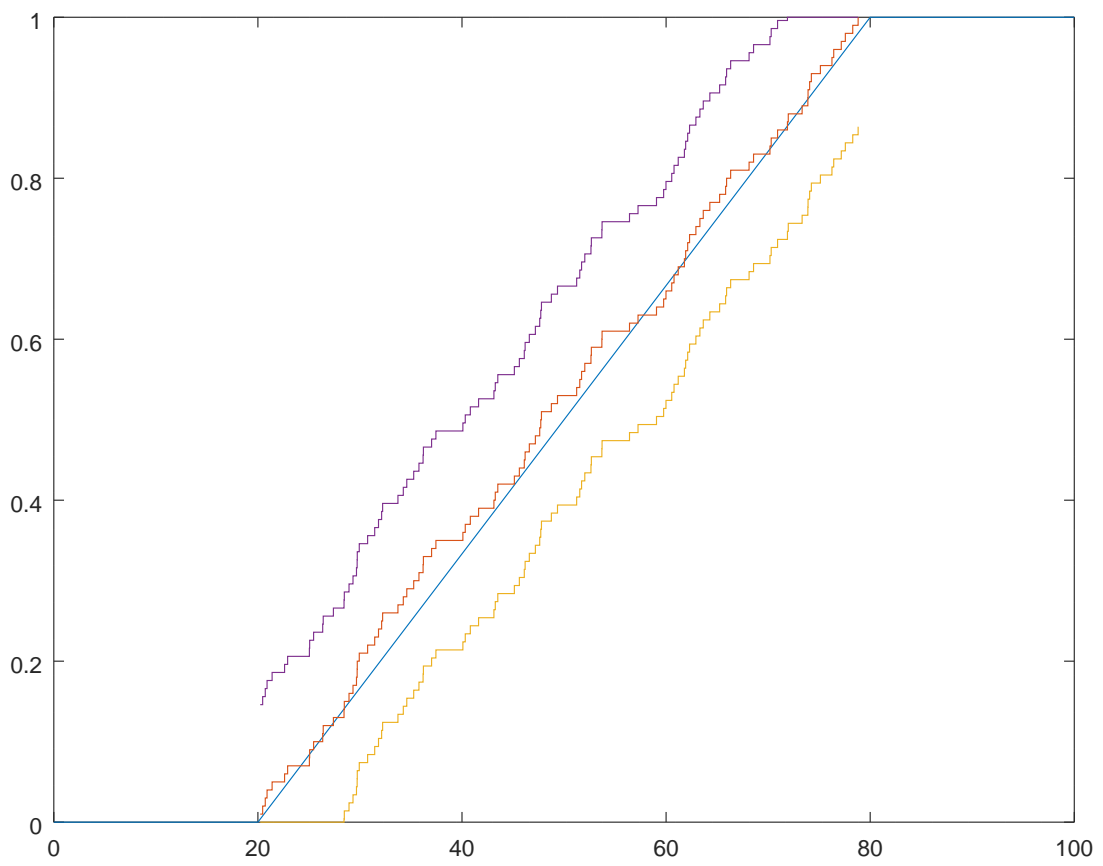
df_x = 0:0.01:n;
df_y = unifcdf(df_x, a, b);

edf_x = sort(unifrnd(a, b, 1, n));
edf_y = 1/n:1/n:1;
[st_a, st_b] = stairs(edf_x, edf_y);

gamma = 0.95;
u = 1.36;
delta = u / sqrt(n);
edf_y_minus = max(0, st_b - delta);
edf_y_plus = min(1, st_b + delta);
plot(df_x, df_y, st_a, st_b, st_a, edf_y_minus, st_a, edf_y_plus);

test(10000, a, b)
test(1000000, a, b)
```

4.2 График



Вывод

Убедится, что функция распределения попадает (?) в доверительную полосу.
На основе критерия Колмогорова провести проверку гипотез.