

Статистическая проверка гипотез



Логистическая регрессия. Сигмоида. Функция ошибки в модели логистической регрессии. Кросс-валидация. Квантиль и квартиль. Дизайн эксперимента и статистические гипотезы о данных. Ошибки 1-го и 2-го рода. Статистическая значимость p-value. A/B тестирование. Тесты на нормальность. Корреляционные тесты. Проверка гипотезы t-критерия Стьюдента. Одновыборочный t-критерий. Двухвыборочный t-критерий для независимых выборок. Множественный тест (ANOVA).

Даниил Корбут

Специалист по Анализу Данных



НЕТОЛОГИЯ



Даниил Корбут
DL Researcher
Insilico Medicine, Inc

Окончил бакалавриат ФИВТ
МФТИ (Анализ данных) в 2018г
Учусь на 2-м курсе
магистратуры ФИВТ МФТИ
Работал в Statsbot и Яндекс.
Алиса.
Сейчас в Insilico Medicine, Inc,
занимаюсь генерацией
активных молекул и
исследованиями старения с
помощью DL.

Логистическая регрессия

Задача логистической регрессии – определить вероятность принадлежности к классу.

Построена на основе линейной функции.

$$h(x) = \theta^T x$$

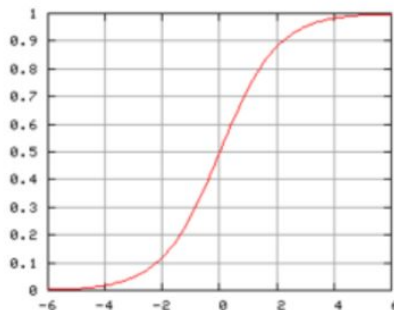
К линейной функции применяется функция активации:

$$h(x) = \sigma(\theta^T x)$$

Функция активации:

$$\sigma(t) = \frac{1}{1 + e^{-t}}$$

Сигмоида



$$\sigma(x) = \frac{1}{1 + e^{-x}}$$

Производная сигмоиды:

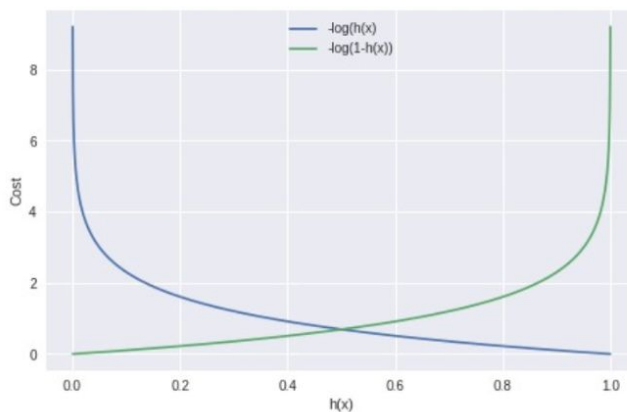
$$\sigma'(x) = \sigma(x) \cdot (1 - \sigma(x))$$

Функция ошибки логистической регрессии

Модель ищет параметры, которые минимизируют функцию ошибки:

$$cost = \begin{cases} -\log(h(x)), & \text{if } y = 1 \\ -\log(1 - h(x)), & \text{if } y = 0 \end{cases}$$

Чем выше вероятность определения класса 1 при верном классе 0, тем выше стоимость ошибки.



Функция ошибки логистической регрессии

Общий вид функции ошибки для модели:

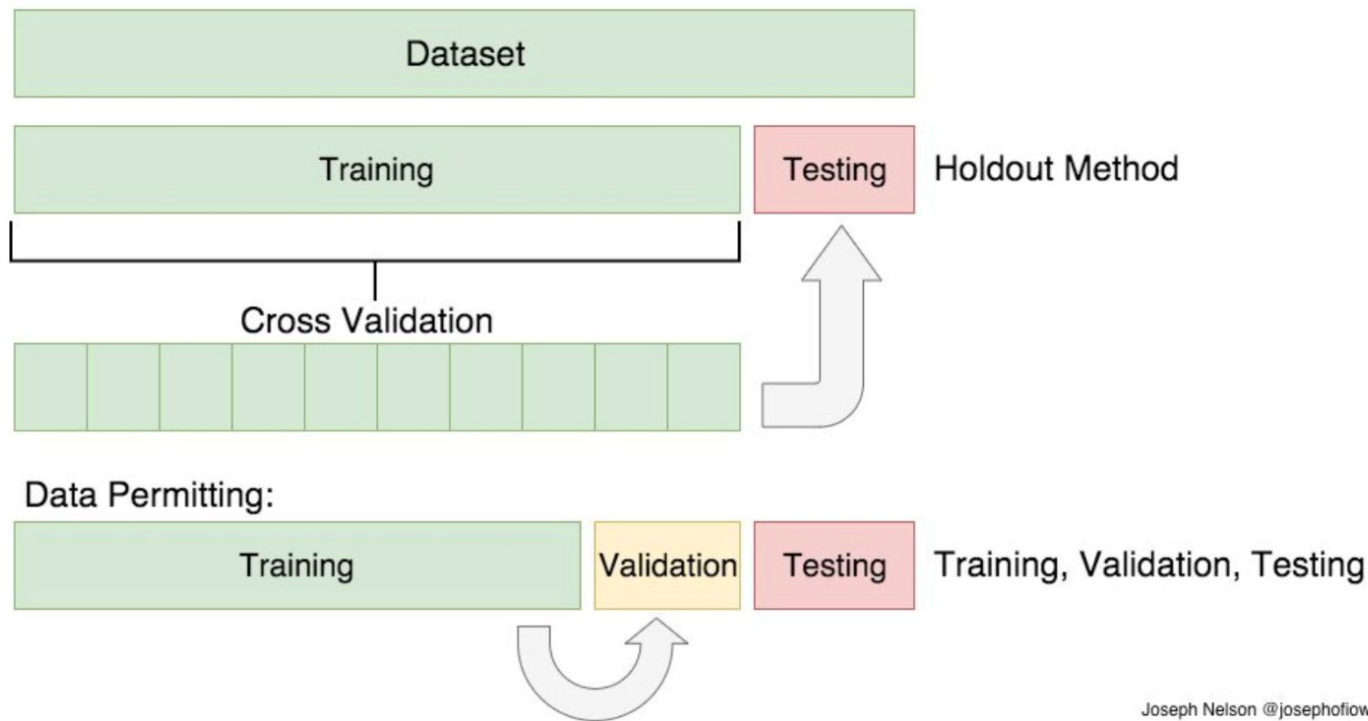
$$\text{cost}(h(x), y) = -y \cdot \log(h(x)) - (1 - y)\log(1 - h(x))$$

Ошибка для всех данных датасета:

$$J(\theta) = -\frac{1}{m} \sum_{i=1}^m [y^i \log(h(x^i)) + (1 - y^i) \log(1 - h(x^i))]$$

Где m – количество элементов.

Кросс-валидация

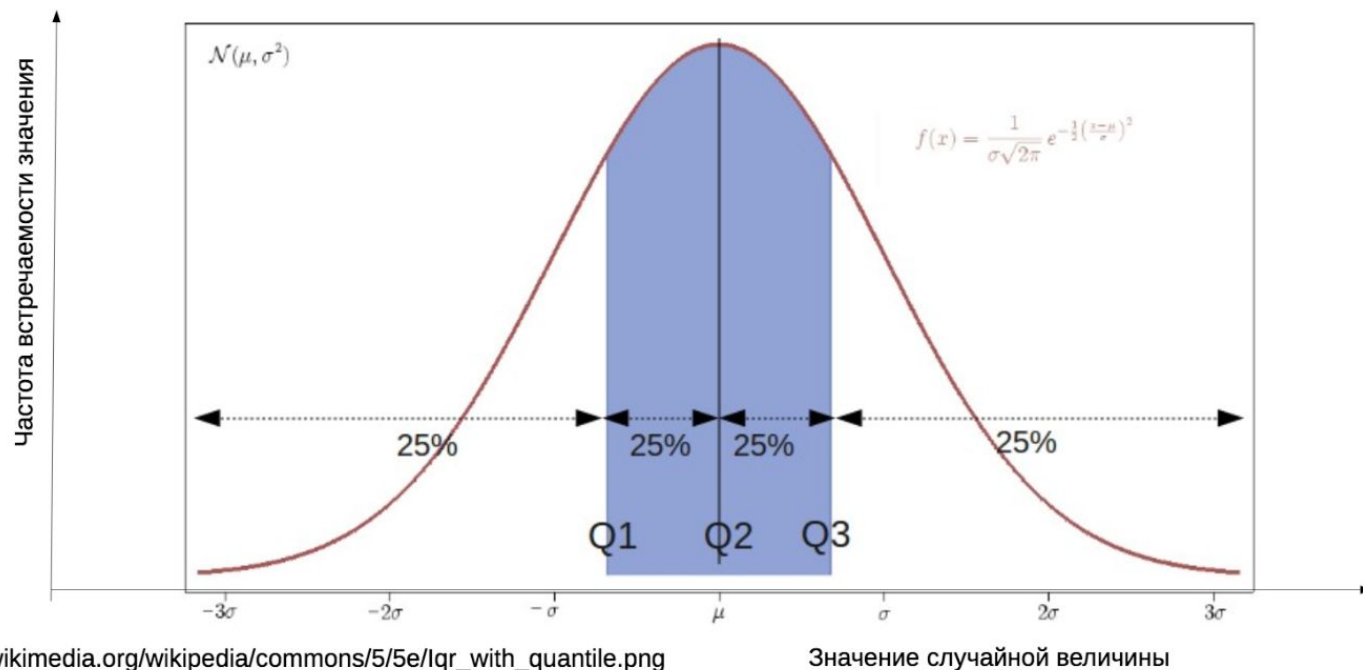


Joseph Nelson @josephofiowa

<https://discuss.pytorch.org>

Квантиль

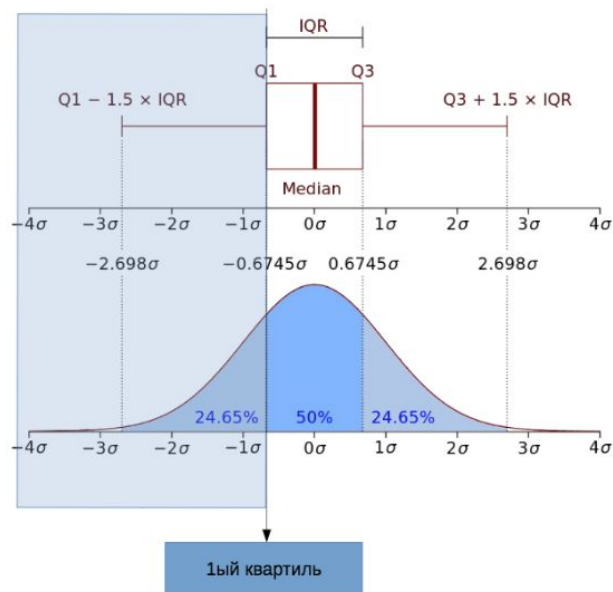
значение, которое заданная случайная величина не превышает с фиксированной вероятностью



https://upload.wikimedia.org/wikipedia/commons/5/5e/lqr_with_quantile.png

Значение случайной величины

Квартиль



Предоставляют важную информацию о структуре **вариационного** (колонок таблицы) ряда признака. Вместе с медианой они делят вариационный ряд на 4 равные части. Квартилей две, их обозначают символами Q , верхняя и нижняя квартиль. 25% значений меньше, чем нижняя квартиль, 75% значений меньше, чем верхняя квартиль.

Статистические гипотезы о данных

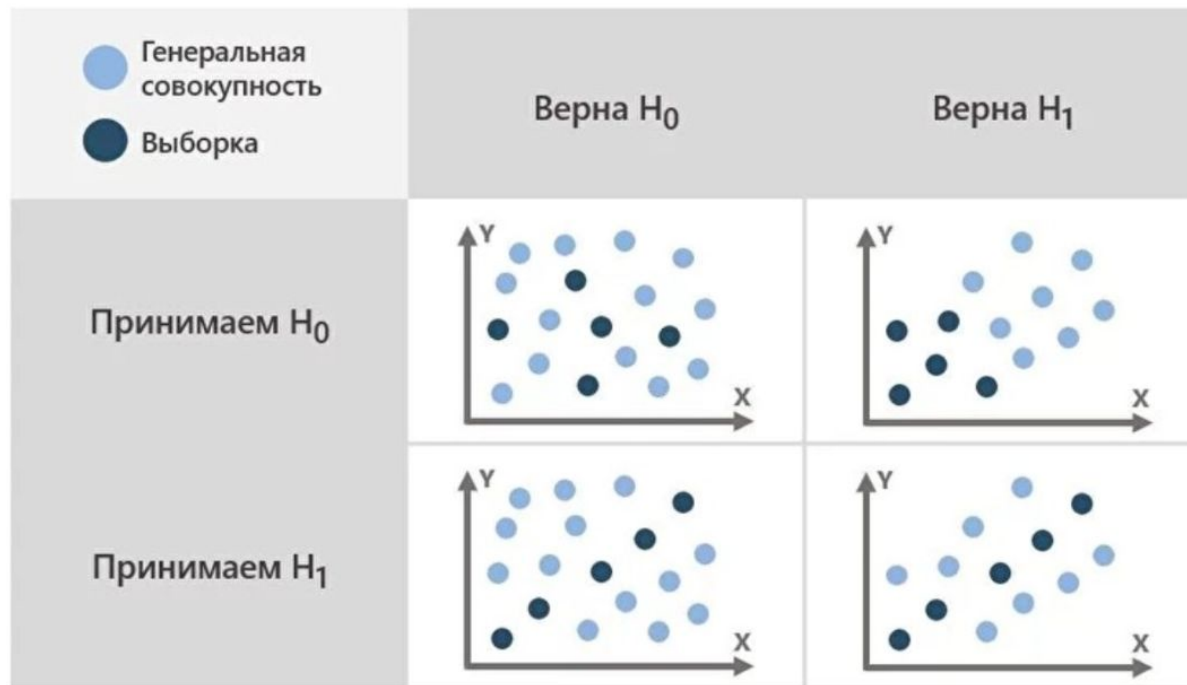
Выборочная совокупность — множество всех объектов, отобранных случайно из генеральной совокупности для изучения.



Нулевая гипотеза (H_0)— гипотеза о сходстве

Альтернативная гипотеза, конкурирующая, (H_1)— гипотеза о различиях

Нулевая и альтернативная гипотезы



Примеры основной и альтернативной гипотез

Основная гипотеза:

$$H_0 : a = 368$$

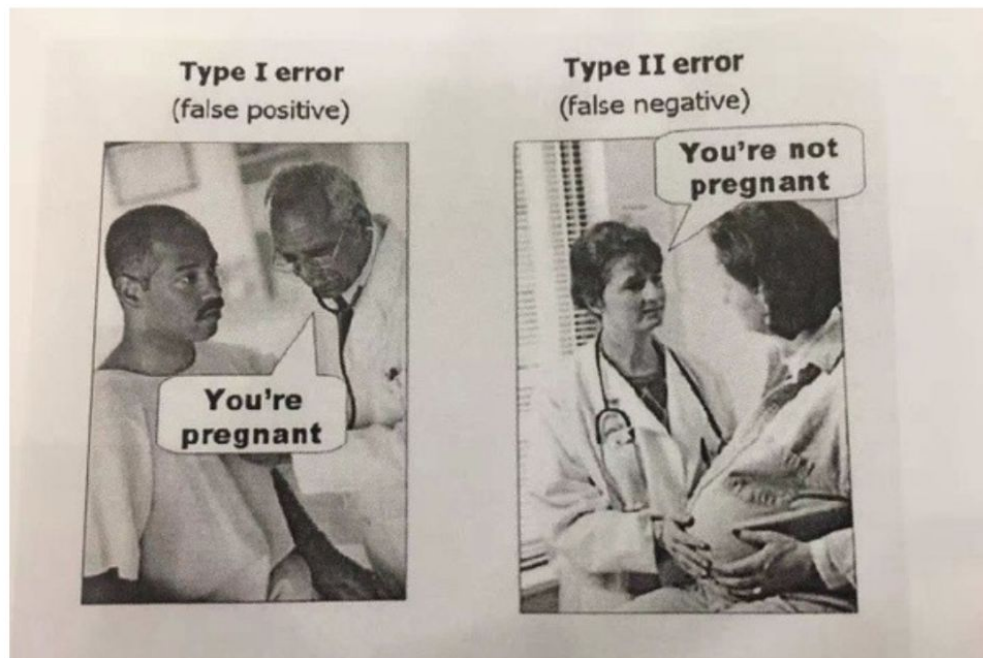
Средний вес выпускаемых коробок равен 368 г,
конвейер работает нормально

Альтернативная гипотеза:

$$H_1 : a \neq 368$$



Средний вес выпускаемых коробок отличен от 368 г,
конвейер требует наладки

Пример: тест на беременность



<https://blog.mathquant.com/2019/01/26/why-do-you-have-to-learn-to-lose-money-in-the-futures-market.html>

Статистические гипотезы о данных

	Disease present	Disease absent
Positive	a True positive	b False positive 
Negative	c False negative 	d True negative

Ошибка 1 рода:
Вероятность отвергнуть гипотезу,
но в действительности она верна

Критически значимый уровень
alpha = 0.05

Ошибка 2 рода:
Вероятность принять гипотезу,
но в действительности она неверна
beta — вероятность ошибки.
Мощность исследования = 1-beta.

https://www.youtube.com/watch?v=4eyEp_NTxAU

<https://www.nejm.org/doi/full/10.1056/NEJM199908193410823>

Статистическая значимость

СТАТИСТИЧЕСКАЯ ЗНАЧИМОСТЬ (ЗНАЧЕНИЕ P)
– РАСЧЕТНАЯ ВЕРОЯТНОСТЬ ОШИБКИ
ПЕРВОГО РОДА, КОТОРАЯ РАССЧИТЫВАЕТСЯ С
ПОМОЩЬЮ РАЗЛИЧНЫХ СТАТИСТИЧЕСКИХ
КРИТЕРИЕВ



$$P < 0,05$$

Виды статистических критериев

Критерии согласия -

исследуемая случайная величина подчиняется предполагаемому закону.

```
1 If Data Is Gaussian:  
2   Use Parametric Statistical Methods  
3 Else:  
4   Use Nonparametric Statistical Methods
```

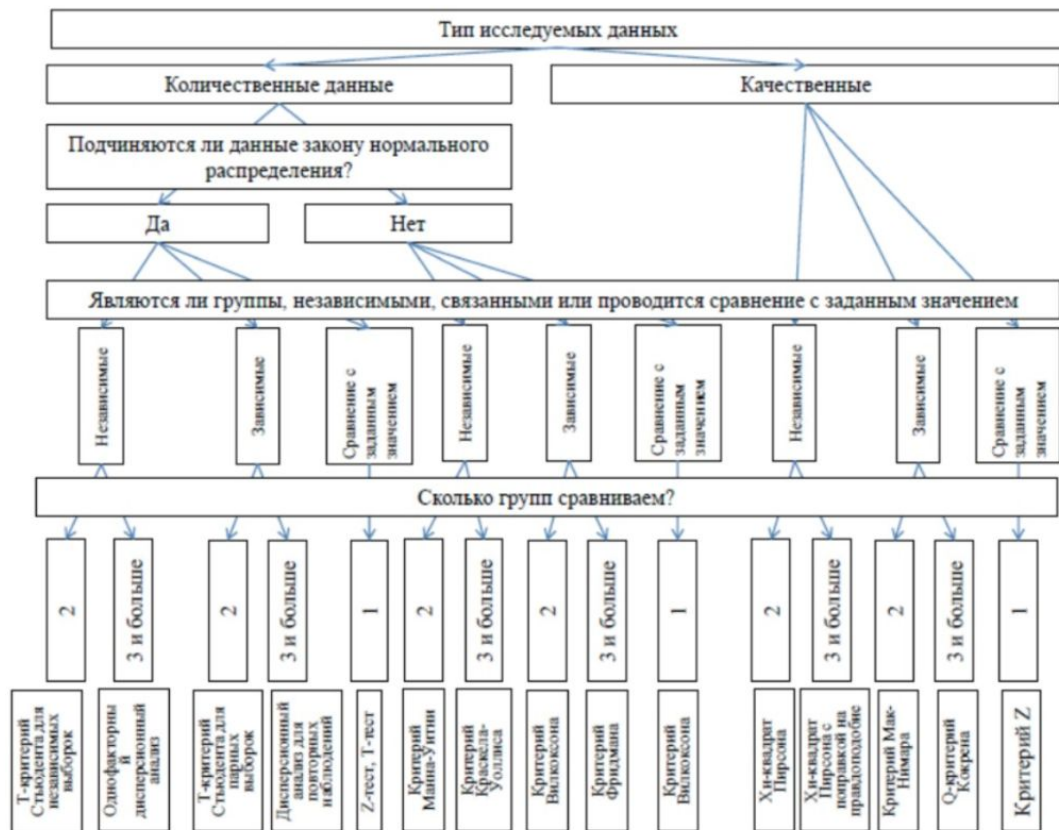
Параметрические критерии -

включают в расчет параметры вероятностного распределения признака (средние и дисперсии).

Непараметрические критерии -

которые не включают в расчёт параметры вероятностного распределения и основаны на оперировании частотами или рангами.

Схема применения критериев



Параметрические критерии

Параметрические критерии - группа статистических критериев, которые включают в расчет параметры вероятностного распределения признака (средние и дисперсии).

t-критерий Стьюдента

Критерий Фишера

Критерий отношения правдоподобия

Критерий Романовского

t-критерий Стьюдента

Случайная величина t имеет распределение Стьюдента с $n-1$ степенями свободы, где n — размер выборки.

$$t = \frac{\bar{x} - \mu}{s/\sqrt{n}}$$

Критические значения t для заданного уровня доверия можно взять из таблицы:

<https://www.kontrolnaya-rabota.ru/s/teoriya-veroyatnosti/tablica-studenta/>

t-критерий Стьюдента

Если t-критерий НЕ превышает пороговое t , при $p\text{-level} = 0.05$ — это значит, что у нас **нет оснований для отклонения нулевой гипотезы**.

Если фактическое **t** превышает критическое табличное значение при **$p=0.05$** , мы отклоняем нулевую гипотезу, — это означает, что мы обнаружили значимую закономерность!

Непараметрические критерии

Непараметрические критерии

Группа статистических критериев, которые не включают в расчёт параметры вероятностного распределения и основаны на оперировании частотами или рангами.

Q-критерий Розенбаума

U-критерий Манна — Уитни

Критерий Уилкоксона

Критерий Пирсона

Критерий Колмогорова — Смирнова

A/B тесты

A/B тестирование — это мощный маркетинговый инструмент для повышения эффективности работы вашего интернет-ресурса.

Ниже на картинках приведены примеры распределения значений показателя в сегментах.



Пример А/В теста

Компания WallMonkeys решила оптимизировать веб-сайт на клики и конверсию.



Пример А/В теста

1 тест: 27% кликов.



2 тест: 550% кликов



Пример А/В теста

CONTROL

The screenshot shows the Obama Classic 2012 website. The header includes the Obama Biden logo and navigation links. Below the header, there is a blue banner with the Obama Classic logo and text: "You could be there". Below this, there is a form titled "Contribute" with fields for "First name", "Last name", "Address", "City", "State", "Zip", "Email", and "Phone number". There is a "Select amount" section with radio buttons for \$10, \$25, \$50, \$100, \$250, \$500, and \$1,000, and a "Other" option. There is a "Credit card" section with fields for "Card number" and "Expiration" (Month and Year). There is a checkbox for "I'd like to be a monthly donor to support this campaign in the time you have left - Election Day is closer than you think." There is an "Employment" section with fields for "Employer" and "Occupation". At the bottom, there is a "DONATE NOW" button. The background of the form is a photo of a young boy holding a basketball.

"SEQUENTIAL"

The screenshot shows the Obama Classic 2012 website. The header includes the Obama Biden logo and navigation links. Below the header, there is a blue banner with the Obama Classic logo and text: "You could be there". Below this, there is a form titled "How much would you like to donate today?". There is a "Select amount" section with buttons for \$15, \$25, \$50, \$100, \$250, \$500, and \$1,000, and a "Other amount" option. At the bottom, there is a "CONTINUE" button. The background of the form is a photo of a young boy holding a basketball.

↑ +5%

<http://ly.lerank.net>

Пример А/В теста

CONTROL

OBAMA BIDEN

OBAMA CLASSIC 2012

You could be there

Members include: Barack Obama, Michelle Obama, Joe Biden, Kamala Harris, and many more! Members receive exclusive access to all Obama Classic 2012 events. You will be asked to meet the President — and spend time with him and his family. Members will receive a special gift.

Members are not required to donate.

Contribute

First name:

Last name:

Address:

City: State: Zip:

Email: Phone number:

Select amount

☐ \$10 ☐ \$25 ☐ \$50 ☐ \$100 ☐ \$250 ☐ \$500 ☐ \$1,000

Other:

Credit card

Card number:

Expiration: Month Year

Cardholder name:

Employment

Employer:

Occupation:

DONATE NOW

“SEQUENTIAL”

OBAMA BIDEN

OBAMA CLASSIC 2012

You could be there

Members include: Barack Obama, Michelle Obama, Joe Biden, Kamala Harris, and many more! Members receive exclusive access to all Obama Classic 2012 events. You will be asked to meet the President — and spend time with him and his family. Members will receive a special gift.

Members are not required to donate.

How much would you like to donate today?

Select amount

☐ \$15 ☐ \$25 ☐ \$50 ☐ \$100 ☐ \$250 ☐ \$500 ☐ \$1,000

Other amount:

DONATE NOW

↑ +5%

<http://ky.lerank.net>

Спасибо за внимание!