

# Оценка оптимального объема выборки для исследований в медицине\*

Евгин А. А.<sup>1</sup>

aleasims@gmail.com

<sup>1</sup>Московский физико-технический институт

Задача посвящена нахождению оценки оптимальных размеров выборки, необходимых для медицинских исследований. Требуется спрогнозировать оптимальные объемы выборки в условиях ограниченного числа измерений. В качестве алгоритма используются серия эмпирических алгоритмов оценки объема выборки.

**Ключевые слова:** *объем выборки.*

## Введение

**Цель исследования:** Целью работы является создание и теоретическое обоснование методов оценки объема многофакторных выборок, учитывающих вид модели классификации и более точных по сравнению с известными методами; создание методов классификации малых выборок.

**Предмет исследования:** Оценить минимальный объем выборки — количество производимых измерений некоторого параметра или набора параметров, необходимый для выполнения некоторых ранее сформулированных условий.

**Исследуемая проблема:** Исследование направлено на решение проблемы выбора моделей при классификации выборок малой мощности. По заданной выборке, включающей многокритериальное описание объектов и метки класса объектов, требуется получить оценку структурных параметров, получить асимптотическую оценку необходимого объема выборки и указать предпочтительный подход к решению задачи классификации. Для классификации объекта требуется получить оценку параметров выбранной модели и выполнить анализ ошибок классификации.

**Решаемая в данной работе задача:** В данной работе основное внимание уделяется байесовским методам оценки объема выборки. Оценка объема выборки в байесовской постановке включает оценку апостериорного распределения  $p(D|w)$  параметров модели. При отсутствии наблюдаемых данных, апостериорное распределение

$$p(w, D) = \frac{p(D|w)p(w)}{p(D)}$$

совпадает с априорным  $p(w)$ , как в классических методах оценки объема выборки. Разница между вторым и третьим случаями заключается только в способе оценки распределения  $p(w|D)$  — на основе сэмплированных, либо реально наблюдаемых данных.

**Предлагаемое решение:** Статистические методы позволяют оценить объем выборки, исходя из предположений о распределении данных и информации о соответствии наблюдаемых величин предположениям нулевой гипотезы. В случае, если объем исследуемой выборки достаточен или избыточен, возможно применение методов, основанных на наблюдении за изменением некоторой характеристики процедуры построения модели при увеличении объема выборки. В частности, наблюдая за отношением качества прогнозирования

---

Научный руководитель: Стрижов В. В. Задачу поставил: Катруца А. М. Консультант: Т. Гадаев

на контрольной выборке и обучающей выборке, определим достаточный объем выборки как соответствующий началу переобучения. Таким же образом производится оценка объема выборки в рамках предлагаемого метода: предлагается считать объем выборки достаточным, если расстояние между распределениями, оцененными на подвыборках данного объема, достаточно мало. Такой подход не требует дополнительного обобщения на случай многих переменных. Кроме того, оценку можно производить как при наличии предположений о распределении данных, так и в их отсутствие.

**Анализ сильных и слабых сторон предлагаемого решения:** Недостатком данного подхода является то что количественные оценки возможно получить лишь в случае, когда объем выборки избыточен. В противном случае метод позволяет лишь определить, является ли текущий объем выборки достаточным

## Постановка задачи

**Постановка задачи классификации:** Рассмотрим выборку вида  $D_m = \{(\mathbf{x}_i, y_i)\}_{i=1}^m$ , где  $\mathbf{x}_i \in \mathbb{R}^n$  — описание  $i$ -го элемента выборки, а  $y_i \in \mathcal{Y}$  — его метка класса. Введем обозначение  $D_m = (X, \mathbf{y})$ , где  $\mathbf{y} = [y_1, \dots, y_m]^R = [\mathbf{x}_1^R, \dots, \mathbf{x}_m^R]^R$  — матрица плана.

В задаче классификации необходимо подстроить отображение наблюдаемых данных  $\in \mathbb{R}^m$  на множество меток класса  $\mathcal{Y}$ . Будем называть функцию  $a : \mathbb{R}^m \rightarrow \mathcal{Y}$  *классификатором*. Будем использовать подход максимизации правдоподобия данных.

**Постановка задачи определения оптимального объёма выборки:** При заведомо недостаточном количестве  $m$  объектов выборки  $D$  с распределением  $P(\mathbf{x}, y)$  для обучения устойчивой логистической регрессии, требуется найти такое количество  $m^*$  объектов выборки, которое будет достаточным.

## Вычислительный эксперимент

**Данные:** Проведем эксперимент на вручную сгенерированных данных с нормальным распределением так, чтобы на них можно было протестировать работу алгоритмов классификации. Размер синтетических данных соответствует размеру исходных данных. Проведя эксперимент, было выяснено, что рассматриваемые выше глобальные параметры в модели на реальных данных стабилизируются быстрее, а именно при размерах выборки около 65 объектов.

## Вывод

Наибольшую ценность из вышеперечисленных параметров составила след матрицы ковариации. Данный компонент выходит на плато при размерах выборок более 80 объектов.

## Литература

- [1] Stephen Bush. Sample size determination for logistic regression: A simulation study. *Communications in Statistics - Simulation and Computation*, 44(2):360–373, 2015.
- [2] Michael P. Cohen. Sample size determination. In Miodrag Lovric, editor, *International Encyclopedia of Statistical Science*, pages 1269–1271. Springer, 2011.
- [3] Sample Size Determination. Ralph b. dell, steve holleran, and rajasekhar ramakrishnan. *Ijar Journal*, 2002.
- [4] Rosa L Figueroa, Qing Zeng-Treitler, Sasikiran Kandula, and Long H Ngo. Predicting sample size required for classification performance. *BMC Medical Informatics and Decision Making*, 12(1), feb 2012.
- [5] Ira Cohen Forman George. Learning from little: Comparison of classifiers given little training. In *ECML/PKDD*, 2004.

- [6] LAWRENCE JOSEPH, ROXANE DU BERGER, and PATRICK BE LISLE. Bayesian and mixed bayesian/likelihood criteria for sample size determination. *STATISTICS IN MEDICINE*, 1997.
- [7] BS; Christine Schammel PhD; Kevin Hutson PhD; Justin Collins, BS; Jordan Brown and MD W. Jeffery Edenfield. Meaningful analysis of small data sets: A clinician's guide. *Greenville health system*, 2016.
- [8] Anastasiya Motrenko, Vadim Strijov, and Gerhard-Wilhelm Weber. Sample size determination for logistic regression. *Journal of Computational and Applied Mathematics*, 255:743 – 752, 2014.
- [9] Sayan Mukherjee, Pablo Tamayo, Simon Rogers, Ryan Rifkin, Anna Engle, Colin Campbell, Todd R. Golub, and Jill P. Mesirov. Estimating dataset size requirements for classifying DNA microarray data. *Journal of Computational Biology*, 10(2):119–142, apr 2003.