

Продвинутая статистика



Корреляционный анализ данных (продолжение). Линейная регрессия. Функция потерь. Матрицы ковариаций и корреляций. Правило трех сигм. Центральная предельная теорема. Виды распределений: дискретные и непрерывные распределения. Дискретное равномерное распределение. Логнормальное распределение. Экспоненциальное распределение. Распределение Бернулли. Биноминальное распределение. t-критерий Стьюдента.

Юстина Иванова

Специалист по Анализу Данных



НЕТОЛОГИЯ



Юстина Иванова
студент-аспирант
University of Bolzano

Инженер-программист МГТУ им. Баумана

Master of Science in Artificial Intelligence
University of Southampton

Специалист по компьютерному зрению
в компании Dataplex.

Специалист по анализу данных
в компании ОЦРВ.

Нахождение зависимости случайных величин

Дисперсия — квадрат среднеквадратичного отклонения от среднего значения (насколько данные разбросаны)

$$\sigma^2(x) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \mu)^2$$

Ковариация — наличие зависимости между величинами

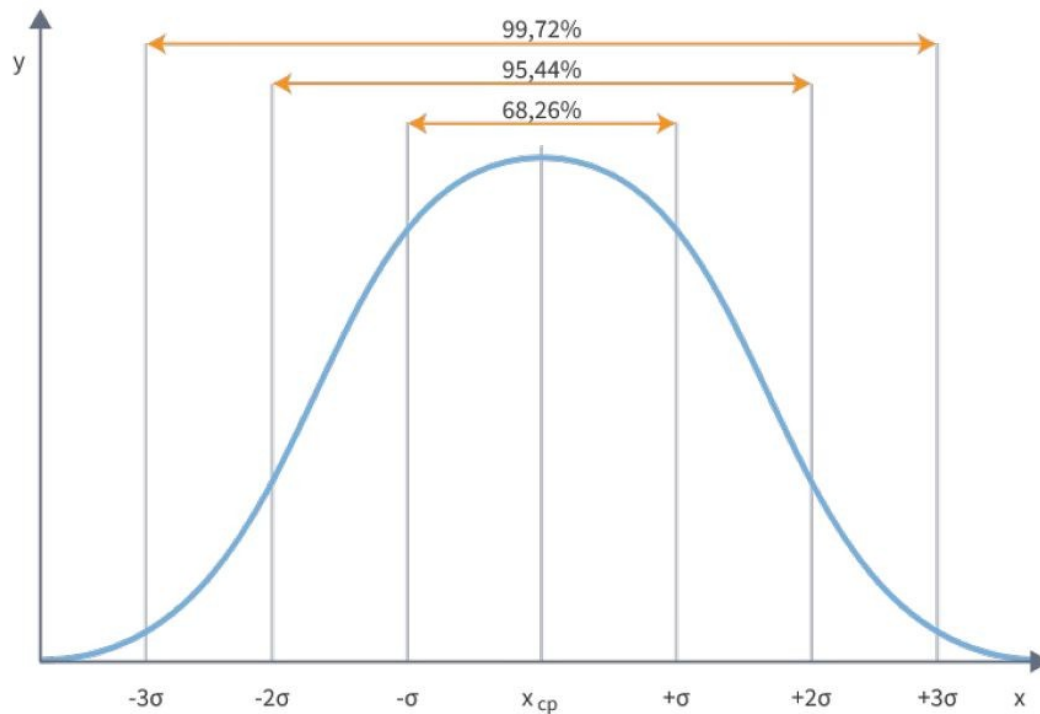
$$\sigma(x, y) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x - \mu_x)(y - \mu_y)$$

Ковариация не равна нулю — можно предположить зависимость.

Ковариация показывает разброс величин относительно друг друга.
Проблема ковариации: данные могут иметь разный масштаб.

Корреляция – нормированная ковариация.

Правило трёх сигм



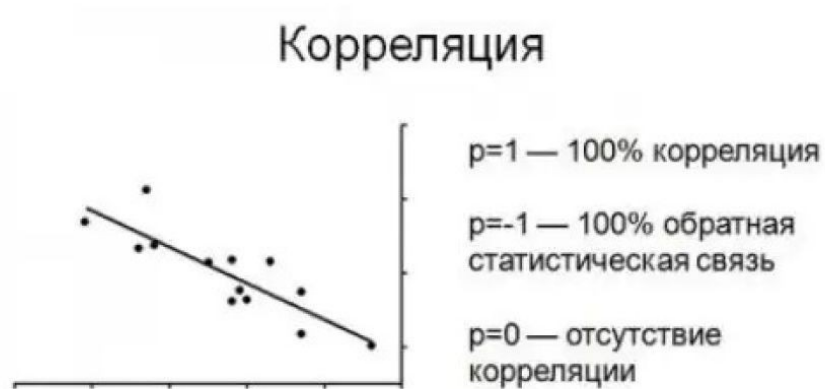
<https://wiki.loginom.ru/articles/3-sigma-rule.html>

Корреляция Пирсона - нормированная ковариация

Корреляция Пирсона — нормированная ковариация, определяет силу зависимости

$$\sigma(x, y) = \frac{Cov(x, y)}{\sqrt{Var(x)}\sqrt{Var(y)}} = \frac{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x - \mu_x)(y - \mu_y)}{\sqrt{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \mu_x)^2} \sqrt{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (y_i - \mu_y)^2}}$$

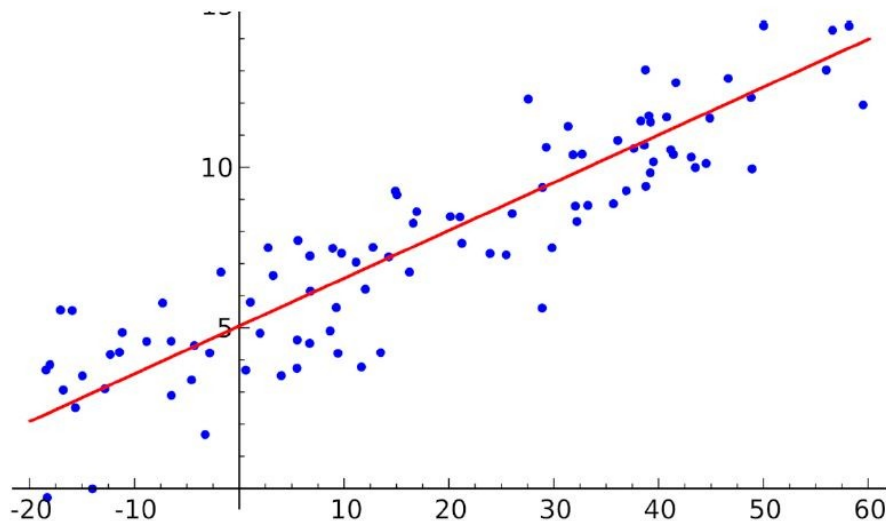
Корреляция Пирсона



http://economic-definition.com/Exchange_Terminology/Koefficient_korrelyacii_Correlation_coefficient__eto.html

Линейная регрессия

Линейная регрессия — модель зависимости переменной x от одной или нескольких других переменных (факторов, регрессоров, независимых переменных) с линейной функцией зависимости



Модель:

$$y = f(x, b) + \varepsilon,$$

где ε - случайная ошибка модели

Функция регрессии имеет вид

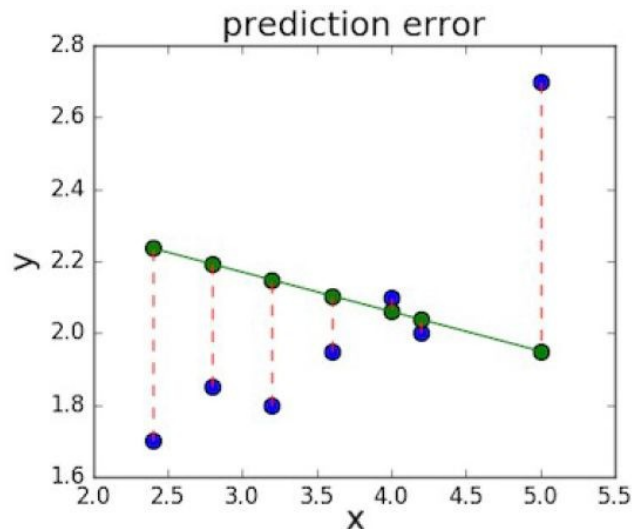
$$f(x, b) = b_0 + b_1x_1 + b_2x_2 + \dots + b_kx_k$$

b_j - параметры (коэффициенты) регрессии
 x_j - атрибуты

<https://neurohive.io/ru/osnovy-data-science/linejnaja-regressija/>

Функция потерь

Функция потерь — мера количества ошибок, которые линейная регрессия делает на наборе данных



Метод наименьших квадратов:

$$\sum_i e_i^2 = \sum_i (y_i - f_i(x))^2 \rightarrow \min_x.$$

<https://neurohive.io/ru/osnovy-data-science/linejnaja-regressija/>

https://ru.wikipedia.org/wiki/Метод_наименьших_квадратов

Алгоритм построения модели линейной регрессии

Для того, чтобы построить модель линейной регрессии в python, необходимо:

- 1) выбрать предсказываемую величину (y) и независимую величину (x)
(x величина может быть многомерной, y – только одномерная)
- 2) разделить данные на тренировочные (80%) и тестовые (20%)
- 3) создать модель линейной регрессии (с помощью библиотеки `sklearn`)
- 4) обучаем модель на тренировочных данных
- 5) посчитать ошибку на тестовых данных (с помощью функции потерь)
- 6) оценить качество модели
- 7) сделать график

Центральная предельная теорема (ЦПТ)

Давайте рассматривать выборки из случайных величин.

Выборка из $X \sim F(x)$:
 $X^n = (X_1, X_2, \dots, X_n)$

Выборочное среднее: $\bar{X}_n = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i$

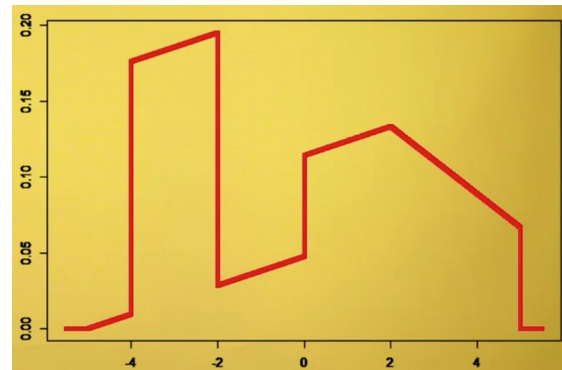
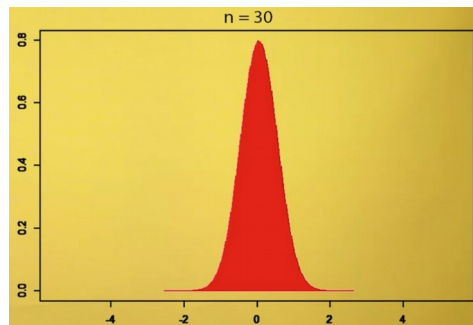
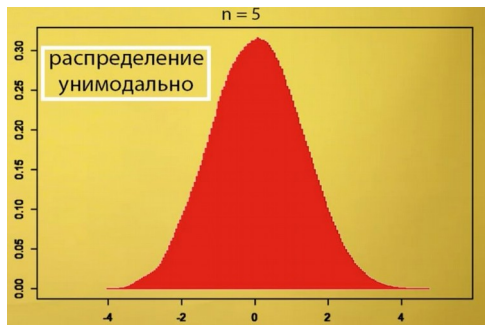
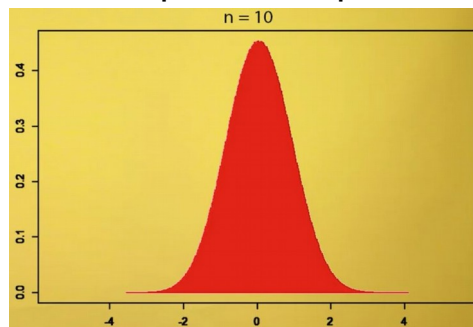
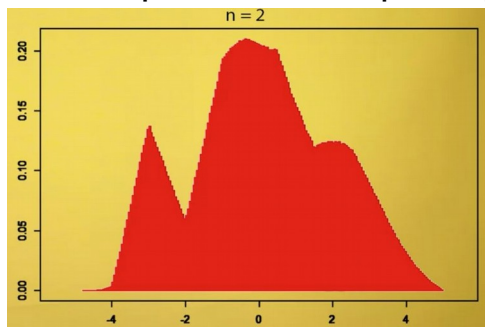
У выборочного среднего пишем нижний индекс n , просто чтобы понимать с выборкой какого размера мы работаем. Давайте подумаем, как связано выборочное среднее с исходным распределением?

$$\bar{X}_n \sim ?$$

Центральная предельная теорема (ЦПТ)

Будем работать с таким “странным” распределением.

Давайте будем семплировать выборки объёма n , считать по ним выборочные средние и повторять так много-много раз. И давайте построим гистограмму этих выборочных средних.



На плотность какого распределения похожи полученные графики?

Центральная предельная теорема

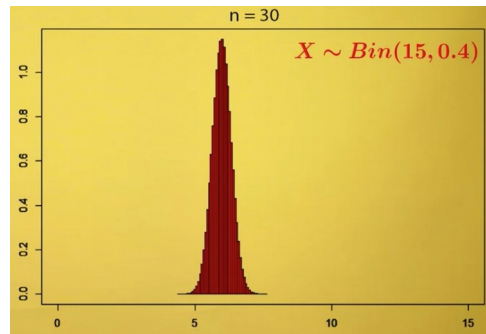
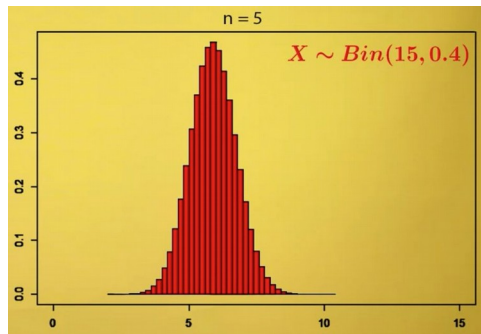
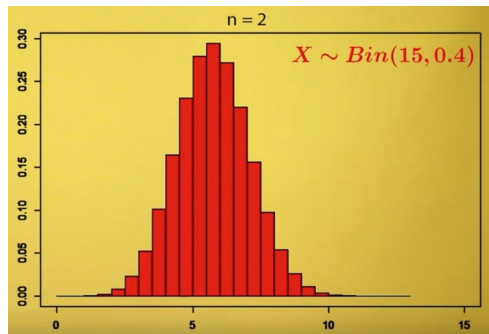
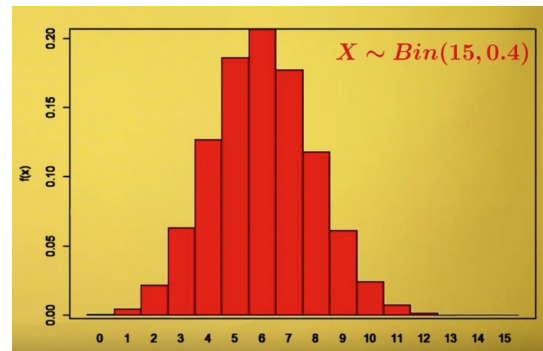
$$X \sim F(x),$$

$$X^n = (X_1, X_2, \dots, X_n) \Rightarrow$$

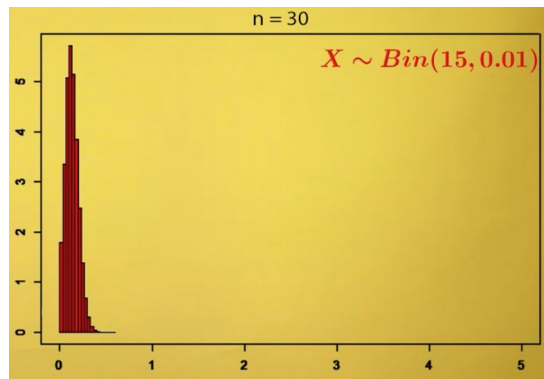
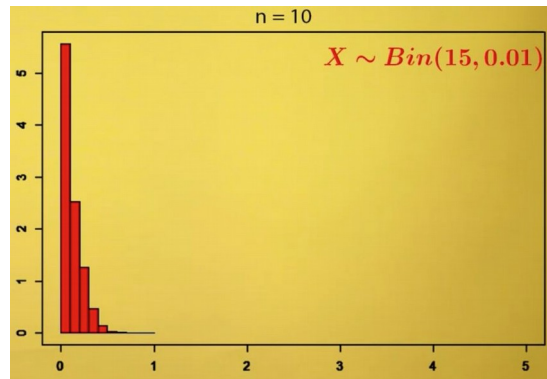
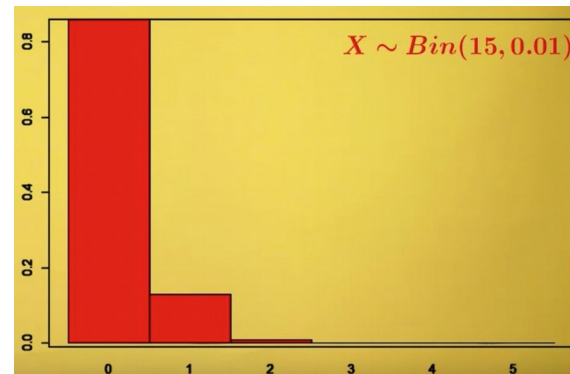
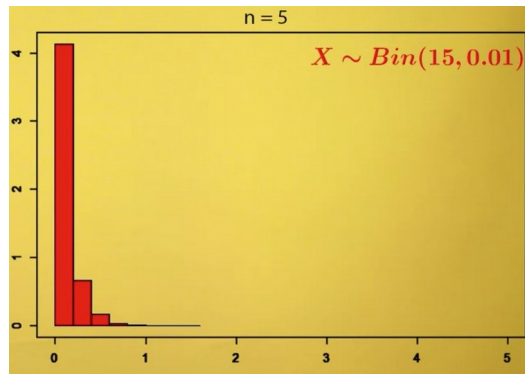
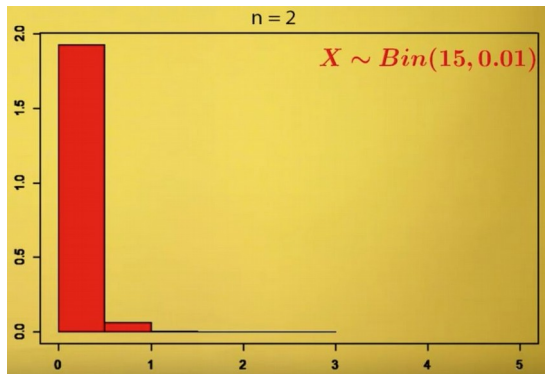
$$\bar{X}_n \approx \sim N(\mathbb{E}X, \frac{\mathbb{D}X}{n})$$

С ростом n точность аппроксимации увеличивается

Интересно, что это справедливо не только для абсолютно непрерывных распределений, но и для дискретных.

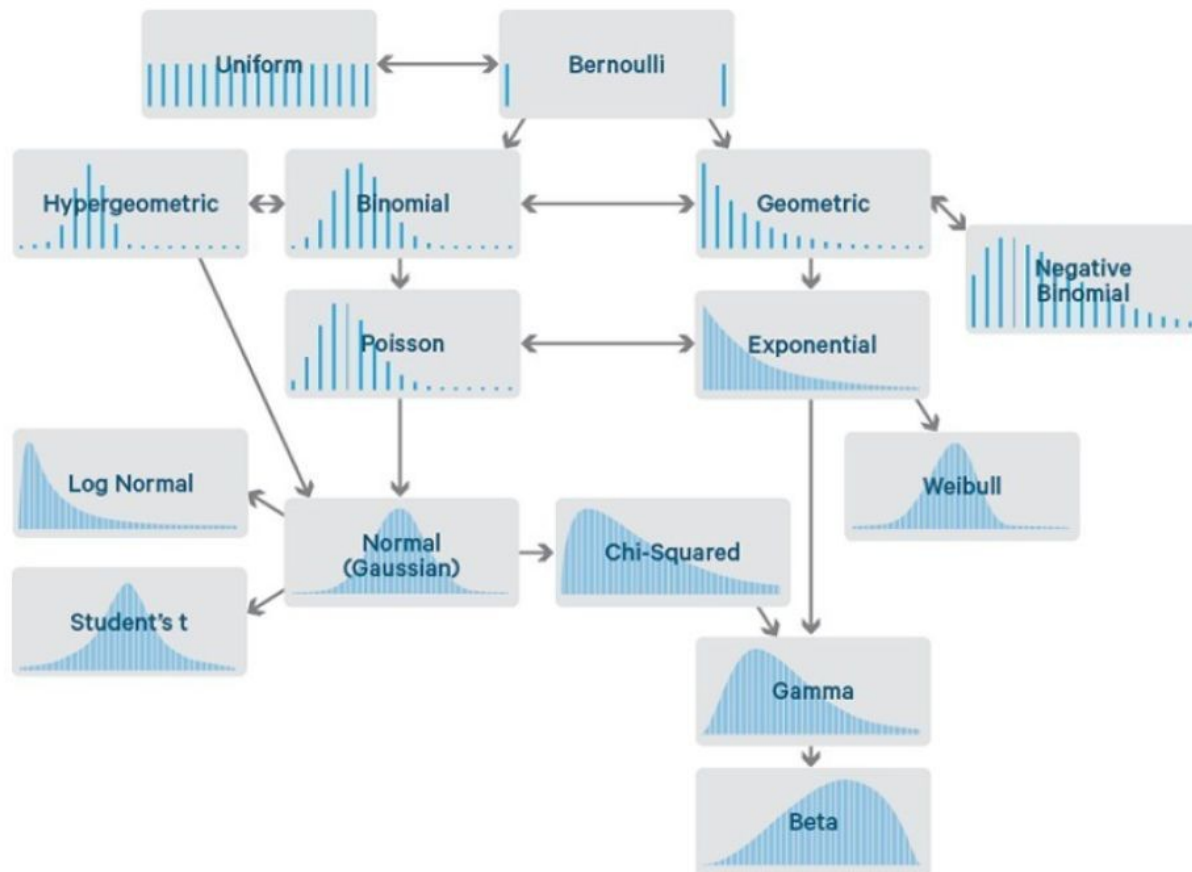


Центральная предельная теорема



Когда распределение X не слишком
скошено, распределение \bar{X}_n хорошо
описывается нормальным при $n \geq 30$.

Виды распределений



Дискретные и непрерывные распределения

Дискретной случайной величиной называется случайная величина, которая в результате испытания принимает отдельные значения с определёнными вероятностями. Число возможных значений дискретной случайной величины может быть конечным и бесконечным. Примеры дискретной случайной величины: запись показаний спидометра или измеренной температуры в конкретные моменты времени.

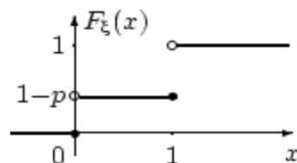
Непрерывной случайной величиной называют случайную величину, которая в результате испытания принимает все значения из некоторого числового промежутка. Число возможных значений непрерывной случайной величины бесконечно. Пример непрерывной случайной величины: измерение скорости перемещения любого вида транспорта или температуры в течение конкретного интервала времени.

Распределение Бернулли

Случайная величина — переменная, значения которой представляют собой исходы какого-нибудь случайного феномена или эксперимента. $y = X(\omega)$
Простыми словами: это численное выражение результата случайного события.

Случайная величина **X** имеет **распределение Бернулли**, если она принимает всего два значения: 1 и 0 с вероятностями p и $q=1-p$ соответственно.

$$F_{\xi}(x) = P(\xi < x) = \begin{cases} 0, & x \leq 0; \\ 1-p, & 0 < x \leq 1 \\ 1, & x > 1. \end{cases}$$



$$\mathbb{P}(X = 1) = p,$$

$$\mathbb{P}(X = 0) = q.$$

Принято говорить, что событие $\{X = 1\}$ соответствует «успеху», а $\{X = 0\}$ «неудаче». Эти названия условные, и в зависимости от конкретной задачи могут быть заменены на противоположные.

Биномиальное распределение

Случайная величина ξ имеет **биномиальное распределение** (англ. *binomial distribution*) с параметрами $n \in \mathbb{N}$ и $p \in (0, 1)$ и пишут: $\xi \in \mathbb{B}_{n,p}$ если ξ принимает значения $k = 0, 1, \dots, n$ с вероятностями $P(\xi = k) = \binom{n}{k} \cdot p^k \cdot (1 - p)^{n-k}$.

Случайная величина с таким распределением имеет смысл числа успехов в n испытаниях схемы Бернулли с вероятностью успеха p .

Таблица распределения ξ имеет вид

ξ	0	1	...	k	...	n
P	$(1 - p)^n$	$n \cdot p \cdot (1 - p)^{n-1}$...	$\binom{n}{k} \cdot p^k \cdot (1 - p)^{n-k}$...	p^n

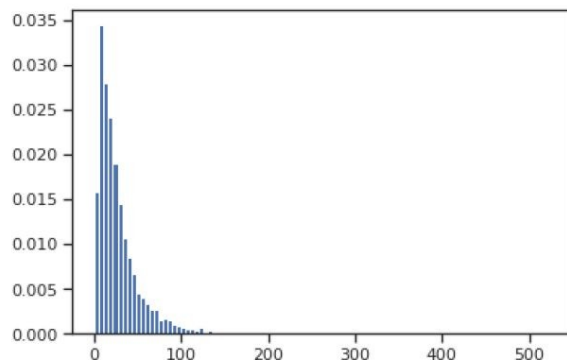
Логнормальное распределение

Логнормальное распределение задается плотностью вероятности:

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

Где μ - это среднее значение, σ - стандартное отклонение

Пример:



$$\mu = 3$$

$$\sigma = 0.9$$

Экспоненциальное распределение

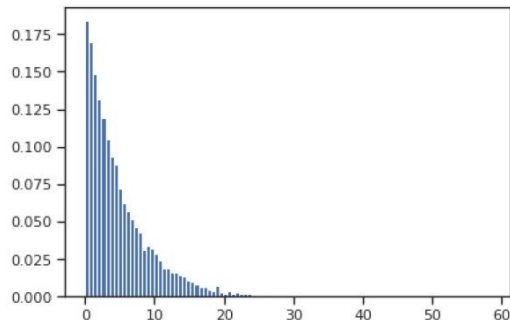
Экспоненциальное распределение задается плотностью вероятности:

$$f(x; \frac{1}{\beta}) = \frac{1}{\beta} \exp(-\frac{x}{\beta})$$

если $x \geq 0$, иначе $f(x; \frac{1}{\beta}) = 0$

где β - это параметр

Пример:



$$\beta = 5$$

Распределение Стьюдента

Мы хотим сгенерировать нормальное распределение, но по некоторым причинам не можем вычислить среднеквадратичное отклонение (например, выборка маленькая). Мы можем найти выборочное среднее и выборочную дисперсию по выборке.

Пусть x_1, \dots, x_n — выборка размером n

Выборочное среднее $\bar{x} = \frac{\sum_{i=1}^n x_i}{n}$

Выборочная дисперсия $s^2 = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2$

t-критерий Стьюдента

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

$$t = \frac{\bar{X} - m}{s_X / \sqrt{n}}$$

Данный критерий был разработан Уильямом Госсетом для оценки качества пива в компании Гиннесс. В связи с обязательствами перед компанией по неразглашению коммерческой тайны (руководство Гиннеса считало таковой использование статистического аппарата в своей работе), статья Госсета вышла в 1908 году в журнале «Биометрика» под псевдонимом «Student» (Студент).

t-критерий Стьюдента

Применяется для проверки нулевой гипотезы $H_0 : E(X) = m$

о равенстве математического ожидания $E(X)$ некоторому неизвестному значению m .

$$t = \frac{\bar{X} - m}{s_X / \sqrt{n}}$$

При нулевой гипотезе распределение этой статистики $t(n-1)$.

Следовательно, при превышении значения статистики по абсолютной величине критического значения данного распределения (при заданном уровне значимости) нулевая гипотеза отвергается.

Спасибо за внимание!