



Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Московский государственный технический университет
имени Н.Э. Баумана
(национальный исследовательский университет)»
(МГТУ им. Н.Э. Баумана)

ФАКУЛЬТЕТ _____ «Информатика и системы управления»

КАФЕДРА _____ «Программное обеспечение ЭВМ и информационные технологии»

ОТЧЕТ ПО ЛАБОРАТОРНОЙ РАБОТЕ №1 по курсу «Математическая статистика»

«Гистограмма и эмпирическая функции распределения»

Студент _____ Маслова Марина Дмитриевна

Группа _____ ИУ7-63Б

Оценка (баллы) _____

Преподаватель _____ Власов Павел Александрович

2022 г.

1 Задание

Цель работы: построение гистограммы и эмпирической функции распределения.

Содержание работы

1. Для выборки объема n из генеральной совокупности X реализовать в виде программы на ЭВМ
 - (а) вычисление максимального значения M_{max} и минимального значения M_{min} ;
 - (б) размаха R выборки;
 - (с) вычисление оценок $\hat{\mu}$ и S^2 математического ожидания MX и дисперсии DX ;
 - (д) группировку значений выборки в $m = [\log_2 n] + 2$ интервала;
 - (е) построение на одной координатной плоскости гистограммы и графика функции плотности распределения вероятностей нормальной случайной величины с математическим ожиданием $\hat{\mu}$ и дисперсией S^2 ;
 - (ф) построение на другой координатной плоскости графика эмпирической функции распределения и функции распределения нормальной случайной величины с математическим ожиданием $\hat{\mu}$ и дисперсией S^2 ;
2. Провести вычисления и построить графики для выборки из индивидуального варианта.

Содержание отчета

1. формулы для вычисления величин M_{max} , M_{min} , R , $\hat{\mu}$, S^2 ;
2. определение эмпирической плотности и гистограммы;
3. определение эмпирической функции распределения;
4. текст программы;
5. результаты расчетов для выборки¹ из индивидуального варианта.

2 Теоретическая часть

2.1 Формулы для вычисления величин

Пусть $\vec{x} = (x_1, \dots, x_n)$ — выборка объема n из генеральной совокупности X .

Максимальное и минимальное значения выборки:

$$M_{max} = x_{(n)}, \quad (2.1)$$

$$M_{min} = x_{(1)}, \quad (2.2)$$

где $x_{(1)}, x_{(n)}$ — крайние члены вариационного ряда, отвечающего выборке \vec{x} .

Размах выборки:

$$R = M_{max} - M_{min} \quad (2.3)$$

Оценки математического ожидания и дисперсии:

$$\hat{\mu}(\vec{x}) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i \quad (2.4)$$

$$S^2(\vec{x}) = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2, \quad (2.5)$$

где $\bar{x} = \hat{\mu}$.

2.2 Определение эмпирической плотности и гистограммы

Если объем выборки достаточно велик ($n > 50$), то элементы выборки группируют в так называемый интервальный статистический ряд. Для этого отрезок $J = [x_{(1)}, x_{(n)}]$ разбивают на m равновеликих промежутков. Ширина каждого из них:

$$\Delta = \frac{|J|}{m} = \frac{x_{(n)} - x_{(1)}}{m}. \quad (2.6)$$

Далее получают:

$$\begin{aligned} J_i &= [x_{(1)} + (i-1)\Delta; x_{(1)} + i\Delta], \quad i = \overline{1, m-1} \\ J_m &= [x_{(1)} + (m-1)\Delta]. \end{aligned} \quad (2.7)$$

Определение. Интервальным статистическим рядом, отвечающим выборке \vec{x} , называется таблица вида:

J_1	...	J_i	...	J_m
n_1	...	n_i	...	n_m

Здесь n_i — число элементов выборки \vec{x} , попавших в промежуток J_i , $i = \overline{1, m}$.

Также:

$$\sum_{i=1}^n n_i = n; \quad (2.8)$$

$$m = [\log_2 n] + 2. \quad (2.9)$$

Пусть для данной выборки \vec{x} построен интервальный статистический ряд $(J_i, n_i), i = \overline{1, m}$.

Определение. Эмпирической плотностью распределения (соответствующей выборке \vec{x}) называется функция:

$$\hat{f}(x) = \begin{cases} \frac{n_i}{n\Delta}, & x \in J_i, i = \overline{1, m} \\ 0, & \text{иначе} \end{cases} \quad (2.10)$$

Определение. График эмпирической функции плотности называется гистограммой.

2.3 Определение эмпирической функции распределения

Пусть $\vec{x} = (x_1, \dots, x_n)$ — выборка из генеральной совокупности X .

Обозначим $n(t, \vec{x})$ — число компонент вектора \vec{x} , которые меньше, чем t .

Определение. Эмпирической функцией распределения, построенной по выборке \vec{x} , называют функцию $F_n : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, определенную правилом:

$$F_n(t) = \frac{n(t, \vec{x})}{n} \quad (2.11)$$

3 Практическая часть