

TBDA01: Laboration 3

Måns Magnusson, Mattias Villani

26 augusti 2017

Instruktioner

- Laborationen ska göras **två och två**
 - Labben ska vara en **PDF-rapport** med kod, analys och grafer. Ett tips är att använda R markdown. I rapporten ska följande ingå:
 - Båda studenternas namn och LiU-id.
 - Universitet och institution
 - Laborationsnummer
 - Deadlinen för laborationen framgår av [kurshemsidan](#).
 - Laborationsrapporten skickas in via LISAM.
 - För att få godkänt på laborationen krävs godkänt på **75%** av uppgifterna.
-

Innehåll

1	Introduktion till R	3
2	Laboration	4
2.1	Bayes sats och aposteriorifördelningen	4
2.2	Binomial - beta	5
2.3	Normal - normal	6
2.4	Multinomial - Dirichlet	7

Kapitel 1

Introduktion till R

R är ett programmeringspråk för statistisk programmering som påminner mycket om Matlab. R bygger på öppen källkod och kan laddas ned [här](#). R-Studio är en mycket populär IDE för R (som också påminner mycket om Matlab). Denna IDE finns att tillgå [här](#). I R-Studio finns funktionalitet för literate programming med R markdown implementerat för att kombinera R kod med markdownsyntax. På detta sätt är det enkelt att generera rapporter med både text, grafik och kod. Det är R:s motsvarighet till Python Notebook.

För en ingång till R från andra språk kan onlineboken *Advanced R* rekommenderas som finns [här](#). Kapitlen *Data structures*, *Subsetting* och *Functions* bör ge en snabb introduktion.

Även boken *The art of R programming* av Norman Matloff kan vara till hjälp som referenslitteratur. Boken finns [här](#).

Videomaterial

- För en introduktion till syntaxen i R se Google developers R videomaterial [här](#).
- Mer (detaljerat) videomaterial av Roger Peng finns att tillgå [här](#).
- För att visualisera med basgrafiken finns [följande](#) introduktionsvideo.
- För mer komplicerad grafik rekommenderas *ggplot2*-paketet. En introduktionsvideo finns [här](#).
- En introduktion till R markdown finns [här](#).

Cheatsheets

- *R reference card v.2* av Matt Baggot med vanliga funktioner i R finns att tillgå [här](#).
- *R markdown cheatsheet* av R-Studio med tips för R markdown finns att tillgå [här](#).

Kapitel 2

Laboration

I denna laboration kommer vi gå djupare in på bayesianska metoder. När vi arbetar med bayesianska metoder betraktar vi inte längre våra okända parametrar som konstanta strheter, utan vi betraktar dem som okända stokastiska variabler.

2.1 Bayes sats och aposteriorifördelningen

Bayes sats ges av

$$p(\theta|\mathbf{y}) = \frac{p(\mathbf{y}|\theta)p(\theta)}{p(\mathbf{y})}$$

Dock kan $p(\mathbf{y}) = \int p(\mathbf{y}|\theta)p(\theta)d\theta$ ofta var kluriga att beräkna. Då vi är intresserade av en given parameter θ kan vi i många fall "kasta" bort de delar som inte innehåller vår parameter av intresse, d.v.s.

$$p(\theta|\mathbf{y}) \propto p(\mathbf{y}|\theta)p(\theta)$$

Se Baron [2013, s. 342-343] för exempel på en härledning av en onormaliserad sannolikhetsfunktion.

Uppgift 1 Visualisera posteriorn

Vi ska nu visualisera en lite klurigare posterior. Antag att dina data kommer från en normalfördelning där $\sigma = 1$ (d.v.s är känd). Du är intresserad av parametern μ för denna normalfördelning och vill beräkna posteriorn för μ .

Som prior för μ använder vi en t-fördelning med $\nu = 1$.

a) Visualisera din prior exakt (d.v.s. använd `dt()`) över intervallet $[-5, 15]$. **Obs!** Gör detta utan att titta på datamaterialet.

b) Nedan är 7 datapunkter som du observerat. Visualisera dessa som ett histogram på intervallet $[-5, 15]$.

```
[1] 11.3710  9.4353 10.3631 10.6329 10.4043  9.8939 11.5115
```

Tips! Använd argumentet `xlim` i `hist()`.

c) Skapa en funktion för log likelihooden för μ som du kallar `normal_log_likelihood(mu, data)`. Anta att $\sigma = 1$. Visualisera likelihooden för μ över intervallet $[-5, 15]$, precis som med priorn i uppgift a).

```
> llik <- normal_log_likelihood(5, data)
> round(llik, 1)

[1] -17.3
```

d) Härled (analytiskt, steg för steg) den proportionella (onormaliserade) posteriorn för μ , d.v.s. $p(\theta|\mathbf{y}) \propto p(\mathbf{y}|\theta)p(\theta)$. Tänk på att de faktorer som inte innehåller μ kan förkortas bort.

e) Visualisera den onormaliserade posteriorn på samma sätt som priorn och likelihooden ovan.

2.2 Binomial - beta

Vi ska nu studera aposteriorifördelningen för p i en binomialfördelning. Mer information finns i Baron [2013, s. 344].

Uppgift 2 Produkt A eller B?

Du har precis skapat en startup med två produktidéer, A och B. Du har skapat prototyper för de två produkterna och demonstrerat dem för ett antal personer.

a) För att det ska gå att dra slutsatser från materialet behöver du bestämma din prior som parametrar i en Betafördelning. Vilka parametrar väljer du och varför? **Obs!** Tänk på att du ännu inte observerat några data ännu.

Produkt A har du demonstrerat för 13 personer varav 8 var intresserade och produkt B har ni bara haft möjlighet att demonstrera för tre personer och av dessa var två personer intresserade. Ni kommer initialt bara kunna skapa en av dessa produkter och kommer därför behöva välja vilken produkt ni ska satsa på.

b) Visualisera din prior, eller om du väljer två olika priorfördelning (en för varje produkt), visualisera båda dessa prior-sannolikhetsfördelningar.

c) Använd konjugategenskapen mellan Beta och binomialfördelningen för att räkna ut din posteriorfördelning analytiskt i respektive fall. Beräkna den förväntade proportionen för respektive produkt (med hjälp av det förväntade värdet för en Betafördelning). Vilken produkt har den högsta förväntade proportionen intresserade?

d) Precis som när det gäller maximum likelihood kan vi studera maximum av vår posteriorfördelning, vilket ofta kallas maximum a posteriori skattningen (MAP). Detta kan vi göra på tre sätt, analytiskt, numeriskt (med ex. `optim()`) eller ta reda på maximum ("mode") för Betafördelningen. Ta reda på hur man beräknar "mode" i en Beta fördelning (se ex. Wikipedia). Vad är MAP skattningen för respektive produkt?

e) Visualisera dina två posteriorfördelning ovan i ett histogram och svara på följande frågor:

1. Vad är sannolikheten att proportionen intresserade kunder är större för produkt A än produkt B?
2. Vad är sannolikheten att $P(p > 0.5)$ för respektive produkt?

e) Storleken på er marknad är 87 andra företag ni vill nå med era produkter. Använd era två posteriorfördelningar för respektive produkt för att simulera hur många intresserade kunder ni kan tänkas få för respektive produkt. Simulera först från er (posterior) betafördelning och använd sedan de simulerade värdena p_i för produkt i för att dra en binomialfördelad variabel med $X_i \sim \text{Bin}(n = 87, p_i)$. Visualisera fördelningen över antalet intresserade kunder ni kommer ha med respektive produkt.

1. Hur stor är sannolikheten att ni får fler än 40 intresserade kunder med respektive produkt?
2. Vad är det förväntade antalet intresserade kunder med respektive produkt ($E(X_1)$ och $E(X_2)$)?

2.3 Normal - normal

I denna uppgift ska vi arbeta med normalfördelade data. Som framgår av Baron [2013, s. 344] är en normal prior konjugat för μ i en normal likelihoodmodell.

Uppgift 3 Aktieanalys

Du ska bygga en handelsrobot som löpande bevakar aktieutvecklingen för olika aktier. Den dagliga avkastningen för en aktie beräknas med formeln

$$x_t = \frac{y_t - y_{t-1}}{y_{t-1}}$$

där y_t är aktievärdet vid dag t . Vi är intresserade av att modellera den dagliga avkastningen för SCAs B-aktie.

a) Börja med att ange en prior för μ och ange också din osäkerhet med apriorivariansen τ^2 . Visualisera vad du tror, a priori, om den dagliga avkastningen för SCA B.

Nedan följer den dagliga avkastningen för aktien SCA B under vecka 39.

```
[1] 0.0315 -0.0180 -0.0021 -0.0202 0.0076
```

Vi modellerar den dagliga avkastningen som oberoende normalfördelade slumpvariabler med väntevärde μ och varians σ^2 . I denna uppgift gör vi det enkelt för oss, vi säger att σ^2 är känd men räknar ut den baserat på de datapunkter vi har. D.v.s. σ^2 är följande värde för SCA B:

```
[1] 0.00044654
```

b) Använd dig av resultaten i Baron [2013, s. 344] för att räkna ut vår aposteriorifördelning för avkastningen efter att vi har observerat data. Vad är den förväntade avkastningen $E(\mu|Data)$, där *Data* representerar observerad avkastning för SCA B under vecka 39?

c) Investerarare är ofta intresserade av det som kallas Value-at-Risk (VaR) för en investering. VaR är ett mått på hur illa det kan gå vid en investering och defineras ofta som 1% percentilen i avkastningens fördelning. Man ser helt enkelt ett utfall i 1% percentilen som ett oturligt, men inte omöjligt, negativt utfall. Säg att er robot har investerat 100 000 kr i SCA A (eller ngn annan aktie). Vi vill nu veta vad Value-at-Risk är för denna investering per dag.

Simulera 10 000 dragningar från din posteriorfördelning för μ . Beräkna sedan den 1% percentilen för en normalfördelning med vårt simulerade μ och kända σ^2 . Nu har du fått en fördelning för 1% percentilen, p_1 . Använd detta för att beräkna ut fördelningen för Value-at-Risk, d.v.s.

$$\text{VaR} = |p_1 \cdot 100\,000|$$

för varje simulerat värde för μ . Nu har du beräknat fördelningen för Value-at-Risk. Visualisera denna fördelning.

d) Beräkna ett 95% sannolikhetsintervall för Value-at-Risk. **Tips!** `quantile()`

e) Din modell ovan antar att avkastningarna är oberoende över tid och att avkastningarna är normalfördelade. Diskutera om du tror att dessa antaganden är rimliga.

2.4 Multinomial - Dirichlet

En generalisering av betafördelningen är dirichletfördelningen och på samma sätt är multinomialfördelningen en generalisering av binomialfördelningen. Använd Mattias föreläsningssanteckningar om apriori och aposteriorifördelningen för multinomialfördelningen för att lösa dessa uppgifter.

Uppgift 4 Analys av opinionsundersökningar

I denna uppgift ska vi analysera väljarstödet för de olika partierna i den Svenska Riksdagen.

a) Vi börjar med att försöka bestämma vår apriori-fördelning för de olika partierna. Vår apriorifördelning specificerar vi som en dirichletfördelning med parametrarna $\alpha_1, \dots, \alpha_9$. Pröva dig fram och simulera från din prior. Dirichletfördelningen finns i R-paketet `gtools`. Eftersom Dirichletfördelningen är multivariat görs en dragning för alla partier på en och samma gång. Gör 1000 dragningar från din apriorifördelning och presentera din (marginella) prior för respektive parti som ett histogram. I din apriorifördelning bör utfallen från valet 2014 inte vara allt för osannolikt. Använd `abline()` och argumentet `v` för att visualisera din valresultatet 2014 tillsammans med din (marginella) prior för **samtliga** partier.

```
> install.packages("gtools")
```

```
> library(gtools)
> rdirichlet(n = 3, alpha = c(1,1.2,0.2,3,2))
```

	[,1]	[,2]	[,3]	[,4]	[,5]
[1,]	0.048050	0.0065094	0.095057	0.81934	0.031043
[2,]	0.179796	0.1697056	0.048327	0.32062	0.281553
[3,]	0.011985	0.0622557	0.260204	0.41314	0.252416

b) **Här** finns samtliga svenska opinionsundersökningar. Ladda ned eller använd en av de senaste undersökningarna. Ange vilken undersökning du valt. Det finns en hel del problem med opinionsundersökningar vilket gör att vi inte kan räkna baserat på institutens urvalsstorlekar direkt. Anta därför istället att den undersökning du valt har 200 personer som deltagit och räkna ut (och avrunda) hur många som svarat för respektive parti.

Ange vilken undersökning du valt och dina (avrundade) antal observationer för respektive parti.

c) Beräkna nu aposteriorifördelningen för andelen per riksdagsparti och gör 10 000 simuleringar från din aposteriorifördelning. När du svarar på frågorna nedan ska du ta hänsyn till de s k 4% spärren, dvs att ett parti måste få minst 4% av rösterna för att sitta i Riksdagen. Får ett parti mindre än 4% ska du sätta deras andel till 0% för denna dragning. Svara på följande frågor:

1. Vad är sannolikheten att de rödgröna är större än alliansen?
2. Vad är sannolikheten att Sverigedemokraterna (SD) är större än Moderaterna (M)?
3. Vad är sannolikheten att Kristidemokraterna **inte** skulle komma in i Riksdagen (få mindre än 4 %)
4. Vad är sannolikheten att Miljöpartiet (MP) skulle åka ur Riksdagen?
5. Skapa ett sannolikhetsintervall (95 %) för Socialdemokraterna.

Litteraturförteckning

Michael Baron. *Probability and statistics for computer scientists*. CRC Press, 2013.