Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования «Национальный исследовательский университет ИТМО»

Факультет программной инженерии и вычислительной техники

**Отчет**

**По лабораторной работе № 4**

по дисциплине «Математическая статистика»

Вариант 1, 4

Выполнила: Старостина Е. П., группа Р3219

Преподаватель: Лимар И. А.

Цель работы:

Попрактиковаться в построении линейных моделей, вычислении оценок коэффициентов модели и остаточной дисперсии, построении доверительных интервалов.

Задание 1:

Код:

import numpy as np

import scipy.stats as stats

variables = []

prices = []

with open('cars93.csv') as f:

lines = f.readlines()

for i in lines[1:]:

line = i.strip().split(',')

variables.append([float(line[6]), float(line[7]), float(line[12])])

prices.append(float(line[4]))

X = np.array(variables)

y = np.array(prices)

X = np.hstack([np.ones((X.shape[0], 1)), X])

XtX = X.T @ X

Xty = X.T @ y

beta = np.linalg.solve(XtX, Xty)

y\_pred = X @ beta

residuals = y - y\_pred

sigma\_squared = (residuals.T @ residuals) / (len(y) - X.shape[1])

total\_variance = ((y - y.mean()).T @ (y - y.mean()))

r\_squared = 1 - (residuals.T @ residuals) / total\_variance

XtX\_inv = np.linalg.inv(XtX)

se\_beta = np.sqrt(np.diag(sigma\_squared \* XtX\_inv))

n, p = X.shape

t\_value = stats.t.ppf(1 - 0.05 / 2, df=n - p)

ci\_beta = [(beta[i] - t\_value \* se\_beta[i], beta[i] + t\_value \* se\_beta[i]) for i in range(len(beta))]

chi2\_lower = stats.chi2.ppf(0.05 / 2, df=n - p)

chi2\_upper = stats.chi2.ppf(1 - 0.05 / 2, df=n - p)

ci\_sigma\_squared = ((n - p) \* sigma\_squared / chi2\_upper, (n - p) \* sigma\_squared / chi2\_lower)

print("Коэффициенты модели:", beta)

print("Доверительные интервалы для коэффициентов:")

for i, ci in enumerate(ci\_beta):

print(f"b{i}: {ci}")

print("Остаточная дисперсия:", sigma\_squared)

print("Доверительный интервал для остаточной дисперсии:", ci\_sigma\_squared)

print("Коэффициент детерминации (R^2):", r\_squared)

Результат работы программы:

Коэффициенты модели: [ 6.68867892 -0.03860018 -0.17885863 0.13131383]

Доверительные интервалы для коэффициентов:

b0: (-5.210205050961368, 18.587562894626235)

b1: (-0.7481224455443461, 0.6709220880283578)

b2: (-0.883501689262523, 0.5257844353877957)

b3: (0.099311208691445, 0.16331645547598622)

Остаточная дисперсия: 35.69468573318614

Доверительный интервал для остаточной дисперсии: (27.154902343428706, 49.03013144303709)

Коэффициент детерминации (R^2): 0.6299138920082776

(В коэффициентах первое число – свободная переменная, далее расход в городе, расход на шоссе, мощность)

Проверка подозрений:

1. Чем больше мощность, тем больше цена – верно, коэффициент при мощности (3-ая переменная) положителен
2. Цена изменяется в зависимости от расхода в городе – верно, коэффициент при расходе в городе (1-ая переменная) не равен нулю
3. H0: коэффициенты при расходе в городе и расходе на шоссе одновременно равны нулю. Отвергаем, это не так.

Задание 2:

Выводы по работе:

В ходе лабораторной работы я попрактиковалась в построении линейных моделей, вычислении оценок коэффициентов модели и остаточной дисперсии, построении доверительных интервалов.

Приложение:

Ссылка на код:

<https://github.com/Starostina-elena/math_stat_lab4>