

Лабораторная №2

Черновая версия описания задачи (будет дополняться и уточняться)

Задание

1. Сгенерировать выборки для разных распределений и посчитать доверительные интервалы для них. Распределения: нормальное, бернулли, пуассона, экспоненциальное.
2. Построить ядерную оценку для $N(3, 5)$ с прямоугольным и гауссовским ядром (за h принять h_{opt}). То же самое сделать для `uniform[3, 5]`

Дополнительная информация

Часть 1. Генерация выборок и доверительные интервалы

Доверительным интервалом параметра θ с уровнем доверия $1 - \alpha$ называется

$$P\{\hat{\theta}_{1,n} \leq \theta \leq \hat{\theta}_{2,n}\} = 1 - \alpha$$

$$\alpha = 0.05$$

Нормальное распределение

Нормальное распределение $N(M, \sigma^2)$, $\{x_1, \dots, x_n\}$ имеет функцию распределения

$$F(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma} \int_{-\infty}^x e^{-\frac{(t-M)^2}{2\sigma^2}} dt$$

Доверительный интервал

$$\bar{x}_n - \frac{S_n}{\sqrt{n}} t_{\frac{\alpha}{2}, n-1} \leq M \leq \bar{x}_n + \frac{S_n}{\sqrt{n}} t_{\frac{\alpha}{2}, n-1}$$

Выборку генерировать размера $n = 200$

За k принять $k = \lceil \log_2 200 \rceil + 1 \approx 8$

$$\frac{n-1}{\chi_{1-\frac{\alpha}{2}, n-1}^2} S_n^2 \leq r^2 \leq \frac{n-1}{\chi_{\frac{\alpha}{2}, n-1}^2} S_n^2$$

Распределение Бернулли

Распределение Бернулли $B(0.3; 200)$

Доверительный интервал

$$\frac{m}{n} - \mu_{\frac{\alpha}{2}} \frac{\sqrt{m(n-m)}}{n} \leq P \leq \frac{m}{n} + \mu_{\frac{\alpha}{2}} \frac{\sqrt{m(n-m)}}{n}$$

Для выборки размера $n = 50$

$$B(0.3; 50)$$

Можно посчитать отдельно оценки $P_{\text{ниж}}$ и $P_{\text{верх}}$, такие что $P_{\text{ниж}} \leq P \leq P_{\text{верх}}$

$$\hat{P}_{\text{ниж}} = \frac{n}{n + \mu_{\frac{\alpha}{2}}} \left(\frac{m}{n} + \frac{\mu_{\frac{\alpha}{2}}^2}{2n} - \mu_{\frac{\alpha}{2}} \sqrt{\frac{m}{n} \left(1 - \frac{m}{n}\right) + \frac{\mu_{\frac{\alpha}{2}}^2}{2n}} \right)$$

$$\hat{P}_{\text{верх}} = \frac{n}{n + \mu_{\frac{\alpha}{2}}} \left(\frac{m}{n} + \frac{\mu_{\frac{\alpha}{2}}^2}{2n} + \mu_{\frac{\alpha}{2}} \sqrt{\frac{m}{n} \left(1 - \frac{m}{n}\right) + \frac{\mu_{\frac{\alpha}{2}}^2}{2n}} \right)$$

Распределение Пуассона

Распределение Пуассона $P(\theta)$ имеет функцию распределения:

$$P(\theta) = \frac{\theta^k}{k!} e^{-\theta}$$

И среднее и дисперсия равны θ

Доверительный интервал:

$$\bar{x}_n - \frac{\sqrt{\bar{x}_n}}{\sqrt{n}} (?) \leq \theta \leq \bar{x}_n + \frac{\sqrt{\bar{x}_n}}{\sqrt{n}} \mu_{\frac{\alpha}{2}}$$

Выборку генерировать размера $n = 200$

Экспоненциальное распределение

Экспоненциальное распределение имеет следующую плотность распределения

$$\lambda e^{-\lambda}, x > 0$$

$$0, x \leq 0$$

Доверительный интервал

$$\frac{1}{\bar{x}_n} - \frac{\mu_{\frac{\alpha}{2}}}{\sqrt{n\bar{x}_n}} \leq \lambda \leq \frac{1}{\bar{x}_n} + \frac{\mu_{\frac{\alpha}{2}}}{\sqrt{n\bar{x}_n}}$$

Часть 2. Ядерные оценки

Ядро

Исходная выборка "портится" другим распределением

Функция $k(x)$ называется ядром, если

$$k(x) \geq 0$$

$$\int_{-\infty}^{\infty} k(x) dx = 1$$

$$k(-x) = k(x)$$

Ядра бывают разными: полукруглыми, треугольными, прямоугольными (равномерными) и др.

Нормальная ядерная функция

$$k(x) = \frac{e^{-\frac{x^2}{2}}}{\sqrt{2\pi}}$$

Прямоугольная ядерная функция

$k(x)$ задаётся системой

$$\frac{1}{2}, |x| \leq 1$$

$$0, |x| > 1$$

??? Или $\frac{1}{2a}$ при $x \leq a$???

Ядерный оценщик плотности

Ядерный оценщик плотности равен

$$\hat{f}(x) = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n k_h(x - x_j)$$

где

$$k_h(x) = \frac{1}{h} k\left(\frac{x}{h}\right)$$

h называется шириной окна

С учётом h :

$$\hat{f}(x) = \frac{1}{hn} \sum_{j=1}^n k\left(\frac{x - x_j}{h}\right)$$

Где k - дельтообразное что-то там, оно стремится к дельта функции при $h \rightarrow 0$

При $n \rightarrow \infty$ и $h \rightarrow 0$, h можно принять за $h \sim \frac{1}{\sqrt[5]{n}}$

h оптимизированная под распределение гаусса:

$$h_{opt} = \frac{1,05 S_n}{\sqrt[5]{n}}$$

где S_n - исправленная дисперсия

$$S_{n \text{ исправленная}}^2 = \frac{n}{n-1} \sum_{i=1}^k (x_i - \bar{x}_n)^2 n_i$$

Оценка для нормального и равномерного распределений

Построить ядерную оценку для $N(3; 5)$ с h_{opt} , за $k(x)$ взять гауссовское и прямоугольное ядра

Построить ядерную оценку для $uniform[3; 5]$ с h_{opt} , за $k(x)$ взять гауссовское и прямоугольное ядра

Построить графики исходных плотностей и ядерных оценок

Материалы по матстату

- [Теория вероятностей и математическая статистика : учебное пособие Е. А. Трофимова, Н. В. Кисляк, Д. В. Гилёв](#)