

ĐẠI HỌC QUỐC GIA THÀNH PHỐ HỒ CHÍ MINH
TRƯỜNG ĐẠI HỌC BÁCH KHOA
KHOA KHOA HỌC VÀ KỸ THUẬT MÁY TÍNH



XÁC SUẤT THỐNG KÊ (MT2013)

Báo cáo Bài tập lớn

THỐNG KÊ DỮ LIỆU BÁN LẺ GIAO DỊCH
CỦA CỬA HÀNG ĐIỆN TỬ

Tên nhóm: MT01

STT	Họ tên SV	MSSV	Tên lớp	Khoa
1	Bùi Nguyễn Hoàng Thọ	2333017	DT03	KH-KT máy tính
2	Trần Văn Được	2210782	DT03	Điện - Điện tử
3	Trịnh Duy Nghiêm	2312256	DT03	KH-KT máy tính

Mục lục

1	Tóm Tắt Dữ Liệu	5
1.1	Ngữ cảnh	5
1.2	Cách dữ liệu được thu thập	5
1.3	Các loại biến và quan trắc	5
2	Cơ sở lý thuyết (Kiến thức nền)	6
2.1	Giới thiệu về công cụ sử dụng thống kê	6
2.1.1	Ngôn ngữ R	6
2.1.2	Công cụ RStudio	6
2.2	Các khái niệm về thành phần và phương pháp sử dụng thống kê	6
2.2.1	Biến định lượng	6
2.2.2	Phân phối chuẩn	6
2.2.3	Kiến thức thống kê mô tả	6
2.3	Kiến thức thống kê suy luận (Tóm tắt)	8
2.3.1	Lý thuyết Kiểm định thống kê	8
2.3.2	Kiểm định Kruskal-Wallis	8
2.4	Hồi quy tuyến tính	8
2.5	Phân tích phương sai (ANOVA)	8
3	Tiền Xử Lý Dữ Liệu	10
3.1	Ghép dữ liệu	10
3.2	Xác định Dữ liệu Khuyết	11
3.3	Làm sạch dữ liệu	11
3.3.1	Order_price, Order_Total	11
3.3.2	season	12
3.3.3	is_happy_customer	12
3.3.4	Kiểm tra dữ liệu sau khi làm sạch	13
4	Mô Tả Thống Kê	14
4.1	Xử lý các điểm Outlier	14

4.2	Thống kê dữ liệu	16
4.2.1	Ma trận tương quan giữa order_price và total_order	17
4.2.2	Tổng đơn hàng theo mùa	18
4.2.3	Tổng phí giao hàng theo từng mùa	18
5	Thống Kê Suy Diễn	21
5.1	Kiểm định trung bình một mẫu	22
5.1.1	Bài toán thực tế	22
5.1.2	Mô tả dữ liệu và công thức tính	22
5.1.3	Xử lý trên phần mềm RStudio	23
5.1.4	Kết luận	23
5.2	Kiểm định trung bình hai mẫu	24
5.2.1	Bài toán thực tế	24
5.2.2	Tính giá trị kiểm định	24
5.2.3	Mô tả dữ liệu và công thức tính	24
5.2.4	Xử lý trên phần mềm RStudio	25
5.2.5	Kết luận	25
5.3	Anova một yếu tố	25
5.3.1	Bài toán thực tế	25
5.3.2	Giả thuyết kiểm định	26
5.3.3	Hiện thực phép toán	26
5.3.4	Tính các tham số mẫu	26
5.3.5	Giá trị trong và giữa các nhóm	26
5.3.6	Giá trị thống kê kiểm định	27
5.3.7	Miền bác bỏ	27
5.3.8	Kết luận	27
5.4	Xử lý trên phần mềm R	27
5.5	Hồi quy tuyến tính	28
5.5.1	Bài toán thực tế	28
5.5.2	Cơ sở lý thuyết	28

5.5.3	Phương pháp ước lượng	28
5.5.4	Kết quả mô hình OLS	29
6	Thảo luận và Mở rộng	30
6.1	Nhận xét dữ liệu	30
6.2	Tính bao quát	30
6.3	Điểm mạnh và điểm yếu của các phương pháp đã sử dụng	31
6.4	Mối quan hệ giữa mục tiêu và phương pháp được chọn	31
6.5	Mở rộng với phương pháp Kruskal-Wallis	32
6.6	Thực hiện trong R	32
7	Nguồn Dữ Liệu	33
8	Tài liệu Tham Khảo	33

Giới thiệu

Trong thời đại khoa học công nghệ phát triển mạnh mẽ, nhu cầu sử dụng linh kiện và thiết bị điện tử ngày càng gia tăng. Điều này đã đặt ra yêu cầu cao hơn về chất lượng sản phẩm và dịch vụ, buộc các cửa hàng điện tử phải đối mặt với sự cạnh tranh khốc liệt. Để thu hút và giữ chân khách hàng, nhiều chương trình khuyến mãi cùng các chính sách ưu đãi được triển khai liên tục, đáp ứng tốt hơn nhu cầu và nâng cao chất lượng đời sống người tiêu dùng.

Để đạt được những mục tiêu này, các cửa hàng điện tử không ngừng đầu tư vào việc phân tích dữ liệu giao dịch bán lẻ. Đây là một bước quan trọng, giúp khảo sát nhu cầu khách hàng, từ đó xây dựng các chiến lược kinh doanh hiệu quả và tối ưu hóa phương thức tiếp cận thị trường.

Với mong muốn có một góc nhìn tổng quát hơn về hoạt động phân tích trong kinh doanh, chúng em đã chọn đề tài “Thống kê dữ liệu bán lẻ giao dịch của cửa hàng điện tử”. Qua đó, chúng em hy vọng có thể tự mình thử nghiệm và áp dụng các kiến thức về xác suất và thống kê đã được tích lũy trong quá trình học tập.

Trong quá trình thực hiện báo cáo, nếu có bất kỳ thiếu sót nào, nhóm rất mong nhận được sự góp ý từ thầy để hoàn thiện tốt hơn.

1 Tóm Tắt Dữ Liệu

1.1 Ngữ cảnh

Bộ dữ liệu được sử dụng lấy từ Kaggle, mô phỏng các giao dịch bán lẻ tại một cửa hàng điện tử. Nó chứa thông tin chi tiết về đơn hàng, khách hàng, sản phẩm mua, và phản hồi của khách hàng.

1.2 Cách dữ liệu được thu thập

Bộ dữ liệu trên là tổng hợp những đơn hàng sản phẩm đã được thanh toán tại một cửa hàng điện tử. Nó đi kèm với ngày thanh toán, thông tin sản phẩm, và thông tin khách hàng.

1.3 Các loại biến và quan trắc

Nhóm đã tổng hợp lại được tổng cộng 1,000 giá trị quan trắc liên quan đến các giao dịch và 3 giá trị liên quan đến thông tin các kho hàng.

Trong quá trình tổng hợp, các biến trong bộ dữ liệu được đưa ra như sau:

- **Biến định tính (Categorical variables):**

- `order_id`: Mã đơn hàng.
- `customer_id`: ID khách hàng.
- `nearest_warehouse`: Tên kho hàng gần nhất.
- `season`: Mùa trong năm.
- `latest_customer_review`: Nhận xét từ khách hàng.

- **Biến định lượng (Numerical variables):**

- `order_price`: Giá trị đơn hàng trước khuyến mãi.
- `delivery_charges`: Phí giao hàng.
- `coupon_discount`: Giá trị khuyến mãi áp dụng.
- `order_total`: Giá trị đơn hàng sau khuyến mãi.
- `customer_lat` và `customer_long`: Vĩ độ và kinh độ của khách hàng.
- `distance_to_nearest_warehouse`: Khoảng cách đến kho gần nhất.

- **Biến Boolean:**

- `is_expedited_delivery`: Có giao hàng nhanh hay không.
- `is_happy_customer`: Khách hàng hài lòng hay không.

2 Cơ sở lý thuyết (Kiến thức nền)

2.1 Giới thiệu về công cụ sử dụng thống kê

2.1.1 Ngôn ngữ R

R là một công cụ rất mạnh cho học máy, thống kê và phân tích dữ liệu. Nó là một ngôn ngữ lập trình, có thể sử dụng trên bất kỳ hệ điều hành nào do tính chất độc lập nền tảng (*platform-independent*). R có khả năng tích hợp với các ngôn ngữ khác như C, C++ và cho phép tương tác với nhiều nguồn dữ liệu cũng như các gói thống kê như SAS, SPSS.

2.1.2 Công cụ RStudio

RStudio là một môi trường phát triển tích hợp (IDE - Integrated Development Environment) dành riêng cho R. RStudio cung cấp giao diện trực quan và các chức năng thuận tiện để làm việc với R mà không cần chạy R trực tiếp.

2.2 Các khái niệm về thành phần và phương pháp sử dụng thống kê

2.2.1 Biến định lượng

Biến định lượng là những biến có thể đo lường được bằng các con số và thực hiện các phép toán số học như cộng, trừ, nhân, chia. Biến định lượng cung cấp thông tin về "mức độ" hoặc "số lượng" của một đặc điểm cụ thể.

2.2.2 Phân phối chuẩn

Khái niệm: Phân phối chuẩn, còn gọi là phân phối Gauss (theo tên nhà toán học Carl Friedrich Gauss), là một loại phân phối liên tục. Đặc điểm nổi bật của phân phối chuẩn là:

- Đối xứng qua giá trị trung bình.
- Có hình dạng chuông.
- Các giá trị được phân bố đều xung quanh trung bình và giảm dần khi xa trung bình.

2.2.3 Kiến thức thống kê mô tả

Các chỉ số đo lường xu hướng tập trung:

- **Trung bình (Mean):** Là giá trị trung tâm của bộ dữ liệu, được tính bằng công thức:

$$\text{Mean} = \frac{\sum x_i}{n}$$

trong đó x_i là các giá trị quan sát, n là số lượng giá trị.

- **Trung vị (Median):** Là giá trị nằm ở giữa khi các giá trị được sắp xếp theo thứ tự tăng dần.
- **Mốt (Mode):** Là giá trị xuất hiện nhiều nhất trong bộ dữ liệu.

Các chỉ số đo lường sự phân tán

- **Phương sai (Variance):** Đo lường mức độ phân tán của dữ liệu xung quanh giá trị trung bình, được tính bằng công thức:

$$\text{Variance} = \frac{\sum (x_i - \bar{x})^2}{n}$$

- **Độ lệch chuẩn (Standard Deviation):** Là căn bậc hai của phương sai:

$$\text{SD} = \sqrt{\text{Variance}}$$

- **Khoảng (Range):** Là hiệu giữa giá trị lớn nhất và giá trị nhỏ nhất trong bộ dữ liệu.

Các chỉ số mô tả sự phân bố

- **Tứ phân vị (Quartiles):** Là các giá trị chia dữ liệu thành bốn phần bằng nhau.
- **Khoảng tứ phân vị hay độ khoảng giữa (Interquartile Range - IQR):** Là khoảng cách giữa tứ phân vị thứ ba (Q_3) và tứ phân vị thứ nhất (Q_1), được tính bằng:

$$\text{IQR} = Q_3 - Q_1$$

IQR là một chỉ số quan trọng giúp xác định sự phân tán dữ liệu và phát hiện các giá trị ngoại lai (outliers). Các giá trị được coi là ngoại lai nếu nằm ngoài khoảng:

$$[Q_1 - 1.5 \times \text{IQR}, Q_3 + 1.5 \times \text{IQR}]$$

Biểu đồ sử dụng thống kê

- **Biểu đồ cột (Barplot):** Dùng so sánh các giá trị khác nhau.
- **Biểu đồ hộp (Box plot):** Thể hiện các tứ phân vị và phát hiện giá trị ngoại lai.
- **Biểu đồ Q-Q (Quantile-Quantile plot):** Kiểm tra dữ liệu có tuân theo phân phối chuẩn hay không.
- **Biểu đồ corrplot:** thể hiện sự tương quan của dữ liệu.

2.3 Kiến thức thống kê suy luận (Tóm tắt)

2.3.1 Lý thuyết Kiểm định thống kê

Kiểm định là quá trình sử dụng dữ liệu mẫu để đưa ra quyết định về một giả thuyết nào đó liên quan đến tổng thể.

- **Giả thuyết không (Null Hypothesis - H_0):** Giả thuyết ban đầu cho rằng không có sự khác biệt hoặc mối quan hệ nào giữa các biến.
- **Giả thuyết thay thế (Alternative Hypothesis - H_1):** Giả thuyết cho rằng có sự khác biệt hoặc mối quan hệ giữa các biến.
- **Mức ý nghĩa (Significance Level - α):** Xác định ngưỡng để bác bỏ giả thuyết không, thường là 0.05 hoặc 0.01.
- **Giá trị p (p-value):** Xác suất để quan sát được dữ liệu mẫu nếu giả thuyết không là đúng. Nếu p-value nhỏ hơn mức ý nghĩa α , ta bác bỏ giả thuyết không.

2.3.2 Kiểm định Kruskal-Wallis

- **Định nghĩa:** Kiểm định phi tham số dùng để so sánh trung vị của **ba hoặc nhiều nhóm độc lập** nhằm xác định xem có sự khác biệt đáng kể giữa các nhóm khi dữ liệu không theo phân phối chuẩn.
- **Ý nghĩa:**
 - Phù hợp cho dữ liệu không chuẩn hoặc dữ liệu thứ bậc.
 - Kiểm tra sự khác biệt trung vị giữa các nhóm độc lập.

2.4 Hồi quy tuyến tính

Hồi quy tuyến tính là một kỹ thuật phân tích dữ liệu dự đoán giá trị của biến phụ thuộc dựa trên giá trị của một hoặc nhiều biến độc lập. Mối quan hệ giữa các biến được mô hình hóa bằng một phương trình tuyến tính.

Ý nghĩa

- Xác định mối quan hệ và mức độ ảnh hưởng của các biến độc lập đến biến phụ thuộc.
- Dự đoán giá trị của biến phụ thuộc khi biết trước giá trị biến độc lập.

2.5 Phân tích phương sai (ANOVA)

Phân tích phương sai (ANOVA) là một phương pháp thống kê được sử dụng để kiểm tra sự khác biệt trung bình giữa từ hai nhóm trở lên, dựa trên việc so sánh biến thiên giữa các nhóm với biến thiên trong cùng nhóm.

Ý nghĩa



- Đánh giá xem sự khác biệt giữa các nhóm có ý nghĩa thống kê hay chỉ do ngẫu nhiên.
- Hỗ trợ lựa chọn biến hoặc yếu tố có ảnh hưởng đáng kể đến kết quả nghiên cứu.

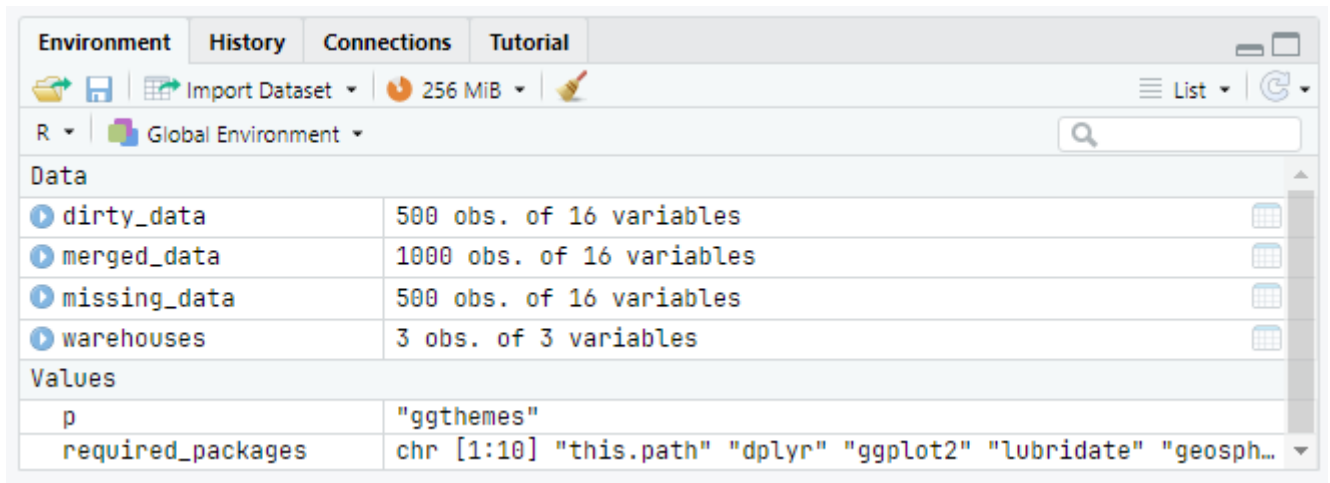
3 Tiền Xử Lý Dữ Liệu

3.1 Ghép dữ liệu

Trước hết, nhóm cần cài đặt các thư viện cần được sử dụng trong suốt quá trình làm sạch và xử lý dữ liệu.

```
1 required_packages <- c("this.path", "dplyr", "ggplot2", "lubridate", "geosphere", "readr", "
  corrplot", "faraway", "car", "ggthemes", "gt", "nortest", "knitr", "FSA", "ggcorrplot", "dunn.
  test")
2 for (p in required_packages) {
3   if (!require(p, character.only = TRUE)) install.packages(p)
4   library(p, character.only = TRUE)
5 }
6 # Load đường dẫn hiện tại của thư mục data chứa các file CSV mẫu
7 setwd(this.path::here())
8 dirty_data <- read_csv("data/dirty_data.csv")
9 missing_data <- read_csv("data/missing_data.csv")
10 # Chuyển định dạng tháng ngày năm cột date
11 dirty_data$date <- parse_date_time(dirty_data$date, orders = c("mdy", "ymd", "dmy"))
12 missing_data$date <- parse_date_time(missing_data$date, orders = c("mdy", "ymd", "dmy"))
13 merged_data <- rbind(dirty_data, missing_data)
```

Listing 1: Ghép dữ liệu trong R



Environment		History	Connections	Tutorial
<div> <div>Import Dataset</div> <div>256 MiB</div> <div>List</div> </div>				
R Global Environment				
Data				
dirty_data	500 obs. of 16 variables			
merged_data	1000 obs. of 16 variables			
missing_data	500 obs. of 16 variables			
warehouses	3 obs. of 3 variables			
Values				
p	"ggthemes"			
required_packages	chr [1:10] "this.path" "dplyr" "ggplot2" "lubridate" "geosph...			

Hình 1: Sau khi gộp 2 files CSV

Giải thích: Thư viện **this.path** giúp tự động cập nhật đường dẫn thư mục gốc của dự án tại nơi chứa file R. Sau khi tải dữ liệu từ các file CSV mẫu, nhóm gộp hai file này thành một bảng duy nhất để thuận tiện xử lý.

3.2 Xác định Dữ liệu Khuyết

Trong quá trình phân tích dữ liệu mẫu, nhóm đã tiến hành kiểm tra sự tồn tại của các giá trị bị khuyết (NA) trong bộ dữ liệu. Kết quả cho thấy một số cột có chứa giá trị khuyết, cụ thể như sau:

```
1 > na_cout<- colSums(is.na(merged_data ))
2 > print(na_cout)
3           order_id           customer_id           date
4                0                0                0
5 nearest_warehouse shopping_cart order_price
6                10                0                10
7 delivery_charges customer_lat customer_long
8                0                10                10
9 coupon_discount order_total season
10               0                10                10
11 is_expedited_delivery distance_to_nearest_warehouse latest_customer_review
12               0                10                0
13 is_happy_customer
14               10
```

Listing 2: Các cột dữ liệu chứa giá trị bị khuyết

Để phục vụ mục đích làm bài tập lớn và vẽ đồ thị, nhóm đã quyết định bỏ đi ba cột **distance_to_nearest_warehouse**, **customer_long** và **customer_lat** và **nearest_warehouses**.

3.3 Làm sạch dữ liệu

3.3.1 Order_price, Order_Total

Để xử lý các giá trị bị khuyết ở hai cột **order_price** và **order_total**, nhóm áp dụng công thức:

$$\text{order_total} = \frac{\text{order_price} \times (100 - \text{coupon_discount})}{100} + \text{delivery_charges} \quad (1)$$

$$\text{order_price} = \frac{(\text{order_total} - \text{delivery_charges}) \times 100}{100 - \text{coupon_discount}} \quad (2)$$

```
1 merged_data <- merged_data %>%
2   mutate(
3     order_total = ifelse(is.na(order_total), order_price * (100 - coupon_discount) / 100 +
4       delivery_charges, order_total),
5     order_price = ifelse(is.na(order_price), (order_total - delivery_charges) * 100 / (100 -
6       coupon_discount), order_price)
7   )
```

Listing 3: Xử lý cột **order_total** và **order_price**

Giải thích: Hàm **mutate** của thư viện **dplyr** được sử dụng để thêm hoặc cập nhật cột trong bảng dữ liệu.

3.3.2 season

Ở cột **season**, nhóm nhận thấy một số giá trị không đồng nhất về cách viết hoa hoặc viết thường, dẫn đến dữ liệu thiếu đồng bộ được thể hiện dưới đây:

```
1 season_unique_before<-unique(merged_data$season)
2 print(season_unique_before)
```

Listing 4: Giá trị cột **season** ban đầu

```
1 merged_data$season <- tolower(merged_data$season) # Đổi tất cả giá trị mùa dạng viết thường
2 month_value <- month(merged_data$date) # lấy tháng trong cột $date
3 merged_data <- merged_data %>%
4   # Toán tử %>% : Truyền kết quả của phép toán hoặc hàm vào hàm tiếp theo .
5   # mutate: Tạo ra cột mới hoặc thay đổi giá trị các cột trong data frame
6   mutate(season = case_when(
7     !is.na(season) ~ season,
8     month_value %in% c(12, 1, 2) ~ "winter",
9     month_value %in% c(3, 4, 5) ~ "spring",
10    month_value %in% c(6, 7, 8) ~ "summer",
11    TRUE ~ "autumn"
12  ))
```

Listing 5: Xử lý cột **season**

Giải thích: Nhóm đã lấy giá trị **tháng** trong cột **date** của dữ liệu mẫu và sử dụng hàm **case_when** xuất ra mùa và thế vào các giá trị bị khuyết.

```
1 > season_unique_after<-unique(merged_data$season)
2 > print(season_unique_after)
3 [1] "winter" "summer" "autumn" "spring"
```

Listing 6: Dữ liệu cột **season** sau khi xử lý

3.3.3 is_happy_customer

```
1 median_happy_customer <- round(median(merged_data$is_happy_customer, na.rm = TRUE), digits =
  0)
2 merged_data$is_happy_customer[is.na(merged_data$is_happy_customer)] <- median_happy_customer
```

Listing 7: Làm tròn trung vị

Giải thích: Lí do nhóm sử dụng giá trị trung vị cho cột **is_happy_customer** để **phản ánh độ hài lòng của khách hàng**, chúng chỉ có rơi vào một trong hai trường hợp là 0 và 1 (Hài lòng hoặc không hài lòng) và không ảnh hưởng bởi các giá trị ngoại lai .

3.3.4 Kiểm tra dữ liệu sau khi làm sạch

Sau khi dữ liệu được làm sạch, kiểm tra có cột nào còn dính giá trị bị khuyết nữa không.

```
1 > na_cout<- colSums(is.na(merged_data ))
2 > print(na_cout)
3           order_id           customer_id           date
4                0                0                0
5 nearest_warehouse shopping_cart order_price
6                10                0                0
7 delivery_charges customer_lat customer_long
8                0                10                10
9 coupon_discount order_total season
10               0                0                0
11 is_expedited_delivery distance_to_nearest_warehouse latest_customer_review
12                0                10                0
13 is_happy_customer
14                0
15 >
```

Listing 8: Kiểm tra dữ liệu bị khuyết sau khi làm sạch

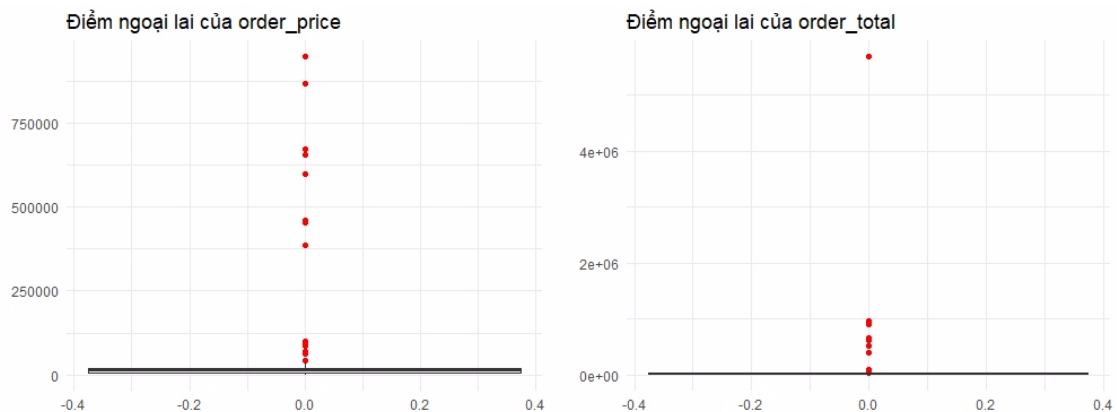
4 Mô Tả Thống Kê

4.1 Xử lý các điểm Outlier

Sau khi xử lý dữ liệu gốc, nhóm phát hiện rằng một số cột trong bộ dữ liệu xuất hiện những điểm bất thường, dẫn đến sai lệch nghiêm trọng. Điều này có thể bắt nguồn từ lỗi trong bộ dữ liệu gốc hoặc phát sinh trong quá trình xử lý. Những giá trị này được nhận diện là outliers. Để xác định các cột chứa giá trị ngoại lai, nhóm sử dụng *Borplot* để trực quan hóa dữ liệu.

```
1 ggplot(data = merged_data, aes(y = order_price)) +  
2   geom_boxplot(outlier.shape = 16, outlier.colour = "red", outlier.fill = "red") +  
3   theme_minimal() +  
4   labs(  
5     title = "Điểm ngoại lai của order_price",  
6     y = ""  
7   )  
8 ggplot(data = merged_data, aes(y = order_total)) +  
9   geom_boxplot(outlier.shape = 16, outlier.colour = "red", outlier.fill = "red") +  
10  theme_minimal() +  
11  labs(  
12    title = "Điểm ngoại lai của order_total",  
13    y = ""  
14  )
```

Listing 9: Phát hiện giá trị outlier



Hình 2: Điểm ngoại lai được đánh dấu đỏ

Qua phân tích, các cột được phát hiện có chứa outliers bao gồm:

- `order_price`
- `order_total`

Để loại bỏ điểm ngoại lai này, nhóm áp dụng phương pháp tính Độ trải giữa (*Interquartile Range*, viết tắt là IQR). Cụ thể, nhóm đặt cận trên *Whisker Upper* và cận dưới theo công thức sau:

- Cận trên

$$(Q3 + 1.5) \times IQR \text{ (độ trải giữa)}$$

- Cận dưới

$$(Q1 - 1.5) \times IQR \text{ (độ trải giữa)}$$

Những giá trị vượt qua cận trên hoặc dưới sẽ được thay thế bằng chính giá trị tương ứng của những cận này.

```
1 # Tính toán các tứ phân vị cho các cột order_price và order_total
2 quantiles_price <- quantile(merged_data$order_price)
3 quantiles_total <- quantile(merged_data$order_total)
4 # Trong R , hàm quantile trả về 5 giá trị cùng [index]
5 # [1]: 0%
6 # [2]: 25% [Q1]
7 # [3]: 50%
8 # [4]: 75% [Q3]
9 # [5]: 100%
10 # Hàm tứ phân vị trong R
11 q1_price <- quantiles_price[2]
12 q3_price <- quantiles_price[4]
13 q1_total <- quantiles_total[2]
14 q3_total <- quantiles_total[4]
15 # Tính IQR cho order_price và order_total
16 IQR_price <- q3_price - q1_price
17 IQR_total <- q3_total - q1_total
18
19 # Hàm tính giá trị biên dưới (lower) và biên trên (upper) của IQR
20 calc_lower <- function(Q1, IQR) { return(Q1 - 1.5 * IQR) }
21 calc_upper <- function(Q3, IQR) { return(Q3 + 1.5 * IQR) }
22
23 # Tính giá trị cận dưới và cận trên cho order_price và order_total
24 lower_price <- calc_lower(q1_price, IQR_price)
25 upper_price <- calc_upper(q3_price, IQR_price)
26 lower_total <- calc_lower(q1_total, IQR_total)
27 upper_total <- calc_upper(q3_total, IQR_total)
28 # Điều chỉnh giá trị order_total ra ngoài phạm vi IQR
29 for (i in 1:length(merged_data$order_total)) {
30   Tạo một vòng lặp cho cột order_total
31   if (merged_data$order_total[i] > upper_total) {
32     merged_data$order_total[i] = upper_total # Thay giá trị cận trên của order_total
33   } else if (merged_data$order_total[i] < lower_total) {
34     merged_data$order_total[i] = lower_total # Thay giá trị cận dưới của order_total
35   }
36 }
37 # Điều chỉnh giá trị order_price ra ngoài phạm vi IQR
38 ## Tạo một vòng lặp cho cột order_price
39 for (i in 1:length(merged_data$order_price)) {
40   if (merged_data$order_price[i] > upper_price) {
41     merged_data$order_price[i] = upper_price # Thay giá trị cận trên của order_price
```

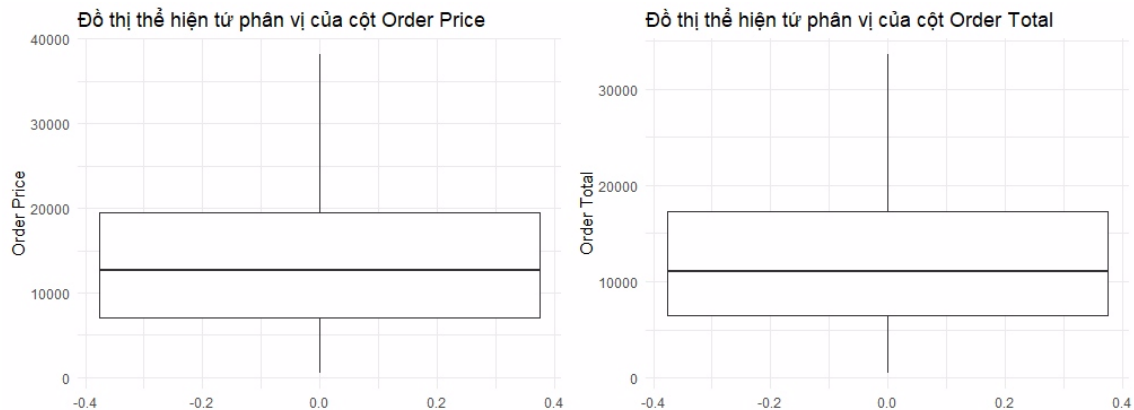


```

42 } else if(merged_data$order_price[i] < lower_price){
43     merged_data$order_price[i] = lower_price # Thay giá trị dưới của order_price
44 }
45 }

```

Listing 10: Xử lý giá trị ngoại lai bằng phương pháp IQR



Hình 3: Sau khi dùng tứ phân vị

4.2 Thống kê dữ liệu

Mục tiêu của nhóm là hiểu rõ hơn về chi phí và doanh thu trong từng mùa, từ đó đưa ra các quyết định hợp lý như thay đổi chiến lược giao hàng hoặc cải thiện hiệu quả kinh doanh trong các mùa. Hướng đến mục tiêu chung là cung cấp dịch vụ tốt nhất cho khách hàng theo từng thời điểm trong năm, nhóm đã thực hiện các phân tích thống kê về những hạng mục quan trọng bao gồm:

- Kiểm tra sự tương quan giữa `order_price` và `order_total`
- Tổng số đơn hàng theo từng mùa.
- Tổng chi phí giao hàng.

```

1 season_summary <- merged_data %>%
2   group_by(season) %>%
3   summarise(
4     total_orders = n(),
5     avg_order_total = mean(order_total, na.rm = TRUE),
6     total_delivery_charges = sum(delivery_charges, na.rm = TRUE)
7   )
8 print(season_summary)

```

Listing 11: Thống kê

```

1 > print(season_summary)
2   season total_orders avg_order_total total_delivery_charges
3   <chr>      <int>      <dbl>      <dbl>

```

4	1	autumn	247	12992.	17277.
5	2	spring	266	12320.	23526.
6	3	summer	249	12487.	19892.
7	4	winter	238	12009.	16475.

Listing 12: Thông số từng hạng mục theo mùa

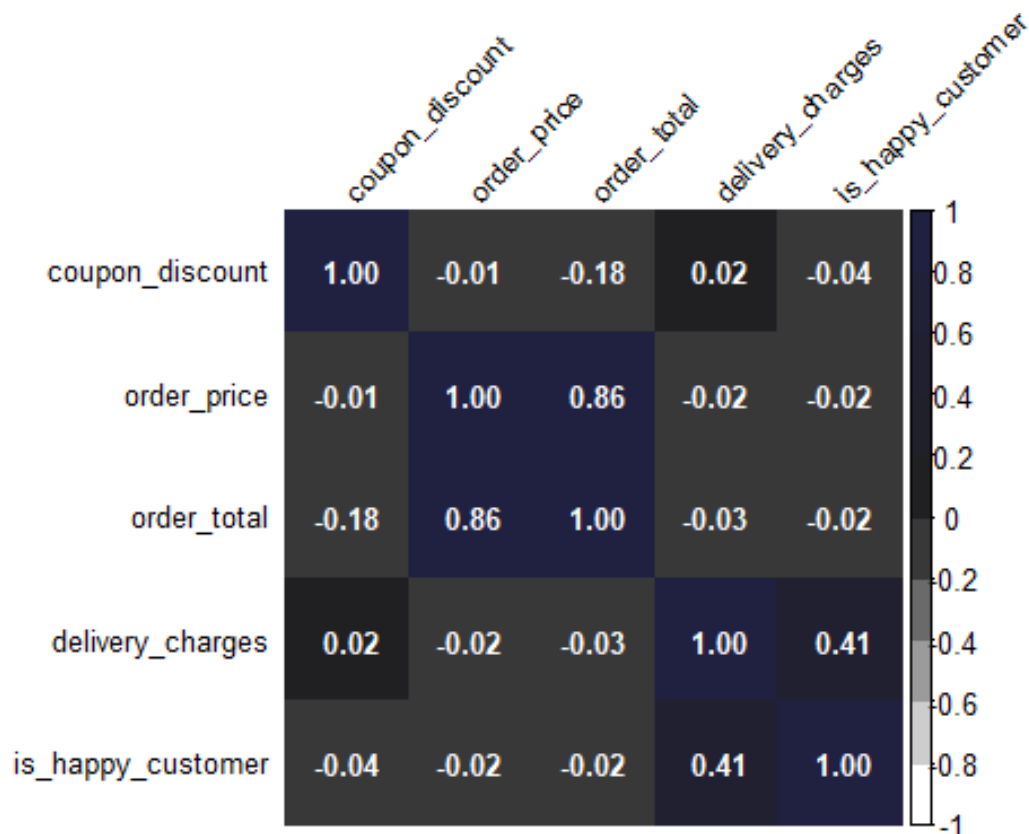
4.2.1 Ma trận tương quan giữa `order_price` và `total_order`

Trước khi vẽ đồ thị, nhóm muốn kiểm tra liệu có mối quan hệ giữa `order_total` và `order_price` hay không?

Nhóm chọn phương pháp ma trận **cor** để thể hiện độ tương quan

```
1 overview_data <- merged_data[c("order_price", "delivery_charges", "coupon_discount", "order_
  total", "is_expedited_delivery", "is_happy_customer", "shopping_cart")]
2 numeric_data <- overview_data[sapply(overview_data, is.numeric)]
3 cor_matrix <- cor(numeric_data)
4 # Hiện thị ma trận
5 corplot(
6   cor_matrix,
7   method = "color",
8   col= colorRampPalette(c("white", "#202020", "#202040"))(10) ,
9   type = "full",
10  order = "hclust",
11  tl.col = "black",
12  tl.srt = 45,
13  addCoef.col = "white",
14  number.cex = 0.8,
15  tl.cex = 0.8,
16  diag = TRUE,
17  cl.pos = "r"
18 )
```

Listing 13: Code kiểm tra độ tương quan



Hình 4: Biểu đồ colorgram

Nhận xét: Có sự tương quan giữa order_total và order_price.

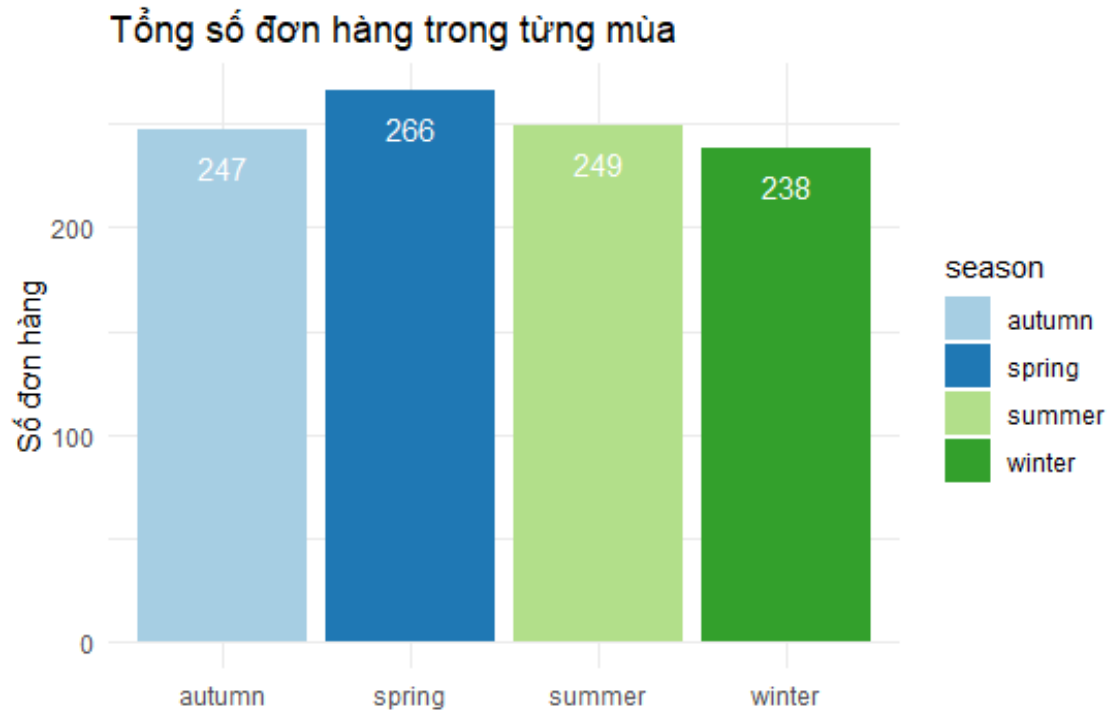
4.2.2 Tổng đơn hàng theo mùa

```
1 ggplot(data = season_summary, aes(x = season, y = total_orders, fill = season)) +
2   geom_bar(stat = "identity") +
3   geom_text(aes(label = total_orders), vjust = 2, color = "white", ) +
4   theme_minimal() +
5   labs(
6     title = "Tổng số đơn hàng trong từng mùa",
7     x = " ",
8     y = " " # Để trống
9   ) +
10  scale_fill_brewer(palette = "Paired")
```

Listing 14: Đồ thị thể hiện tổng số đơn hàng theo từng mùa

Nhận xét: Vào mùa xuân (spring), khách hàng thường mua sắm nhiều hơn nên tổng số đơn hàng tập trung nhiều vào mùa xuân. Nhưng sự chênh lệch không đáng kể.

4.2.3 Tổng phí giao hàng theo từng mùa



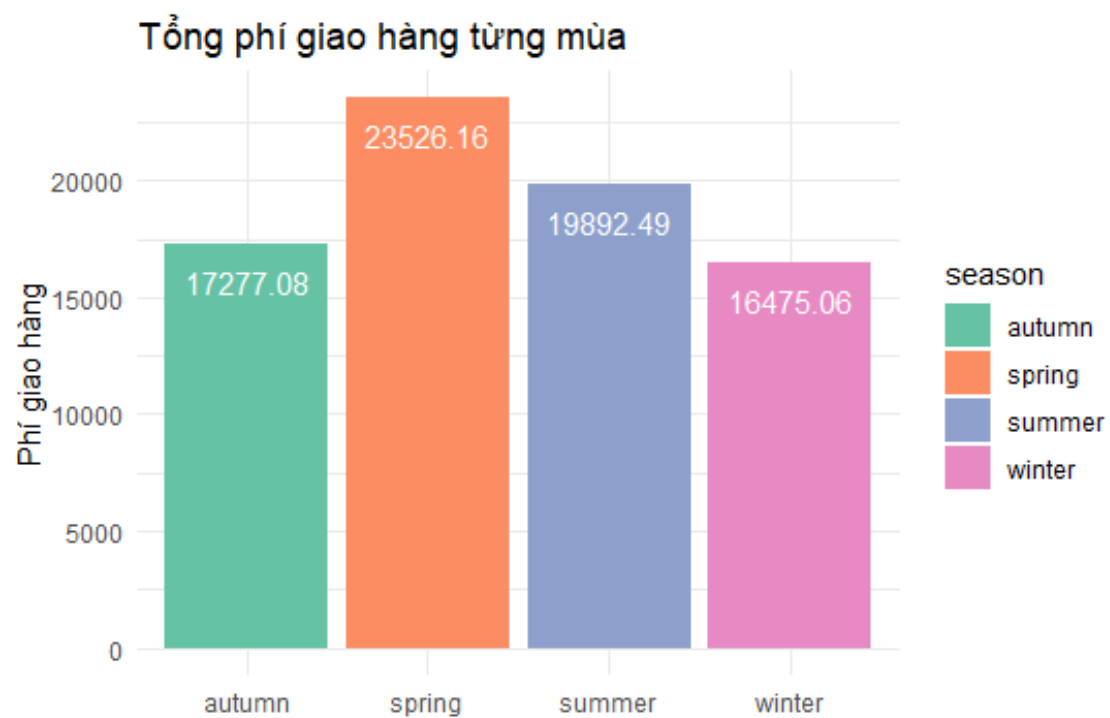
Hình 5: Tổng số đơn hàng theo từng mùa

```
1 ggplot(data = season_summary, aes(x = season, y = total_delivery_charges, fill = season)) +  
2   geom_bar(stat = "identity") +  
3   geom_text(aes(label = total_delivery_charges), vjust = 2, color = "white", ) +  
4   theme_minimal() +  
5   labs(  
6     title = "Tổng phí giao hàng từng mùa",  
7     x = " ",  
8     y = " " #Để trống  
9   ) +  
10  scale_fill_brewer(palette = "Set2")
```

Listing 15: Đồ thị Tổng chi phí giao hàng theo từng mùa

Nhận xét: Lượng chi phí đơn hàng đạt giá trị cao nhất vào mùa xuân và chúng nó độ chênh lệch cao giữa các mùa.

Tổng kết: Việc phân tích các chỉ số trên sẽ giúp nhóm có cái nhìn tổng quan và đưa ra các chiến lược phù hợp nhằm tối ưu hóa các yếu tố kinh doanh theo từng mùa, đáp ứng nhu cầu của khách hàng một cách tối đa.



Hình 6: Tổng phí đơn hàng theo từng mùa

5 Thống Kê Suy Diễn

Kiểm tra phân phối chuẩn

Trước khi lựa chọn các phương pháp thống kê, nhóm phải kiểm tra dữ liệu **season**, **price_total**, **order_total** có tuân theo bảng phân phối chuẩn hay không với phương pháp **shapiro**.

```
1 # Trích xuất các cột order_price và order_total từ merged_data
2 get_order_price <- merged_data$order_price
3 get_order_total <- merged_data$order_total
4
5 # Kiểm tra phân phối chuẩn với Shapiro-Wilk cho cột order_total
6 shapiro_order_total <- shapiro.test(get_order_total)
7 # Kiểm tra phân phối chuẩn với Shapiro-Wilk cho cột order_price
8 shapiro_order_price <- shapiro.test(get_order_price)
9
10 # In kết quả kiểm tra Shapiro-Wilk cho toàn bộ dữ liệu
11 print(shapiro_order_price) # Kết quả kiểm tra cho order_price
12 print(shapiro_order_total) # Kết quả kiểm tra cho order_total
13 # Kiểm tra phân phối chuẩn theo từng mùa
14 seasons <- c("spring", "summer", "fall", "winter")
15 # Tạo danh sách để lưu giá trị order_price theo từng mùa
16 order_price_by_season <- list()
17 # Lặp qua từng mùa, trích xuất dữ liệu và lưu vào danh sách
18 for (season in seasons) {
19   # Trích xuất dữ liệu của từng mùa bằng subset()
20   season_data <- subset(merged_data, season == season)
21   # Lưu giá trị order_price của từng mùa vào danh sách
22   order_price_by_season[[season]] <- season_data$order_price
23 }
24 # Tạo bảng tóm tắt kết quả kiểm tra Shapiro-Wilk cho từng mùa
25 shapiro_summary <- data.frame(
26   Season = names(order_price_by_season), # Tên các mùa
27   P_value = sapply(order_price_by_season, function(order_price) {
28     # Tính p-value từ kiểm tra Shapiro-Wilk cho từng mùa
29     shapiro.test(order_price)$p.value
30   })
31 )
32 # Đánh giá phân phối chuẩn: nếu p-value > 0.05 thì phân phối chuẩn
33 shapiro_summary$Normal_Distribution <- ifelse(shapiro_summary$P_value > 0.05, "True", # Phân
   phối chuẩn
34 "False") # Không phải phân phối chuẩn
35 # In bảng tóm tắt kết quả kiểm tra Shapiro-Wilk theo mùa
36 print(shapiro_summary)
```

Listing 16: Shapiro Test

Mùa	P-value	Có phải phân phối chuẩn?
spring	7.348016e-18	Không
summer	7.348016e-18	Không
fall	7.348016e-18	Không
winter	7.348016e-18	Không

Bảng 1: Kiểm tra phân phối chuẩn của mùa

```

1 > print(shapiro_order_price) # Kết quả kiểm tra cho order_price
2 Shapiro-Wilk normality test
3 data:  get_order_price
4 W = 0.95034, p-value < 2.2e-16
5 > print(shapiro_order_total) # Kết quả kiểm tra cho order_total
6 Shapiro-Wilk normality test
7 data:  get_order_total
8 W = 0.94557, p-value < 2.2e-16
9
10 % Giới thiệu

```

Listing 17: Hai cột còn lại

Nhận xét: Từ những dữ kiện trên, ta có thể kết luận chúng không tuân theo phân phối chuẩn.

5.1 Kiểm định trung bình một mẫu

5.1.1 Bài toán thực tế

Để kiểm định giá trị trung bình một mẫu, nhóm đã đặt giả thuyết rằng doanh thu bán hàng của cửa hàng trong mùa Xuân có bằng với doanh thu kỳ vọng là 50 triệu đồng hay không? ($\mu = 50$) Nhóm đưa ra hai giả thuyết như sau:

Giả thuyết kiểm định:

- $H_0: \mu = 50$
- $H_1: \mu > 50$

5.1.2 Mô tả dữ liệu và công thức tính

```

1 spring_data <- merged_data %>%
2   filter(season == "spring")
3 ## Xuất ra trung bình mẫu, sd , moy
4 spring_stats <- spring_data %>%
5   summarise(
6     mean = mean(order_total),

```

```
7 sd = sd(order_total),
8 n = n()
9 )
```

Listing 18: Tính các thông số

Thông số	Giá trị
Trung bình mẫu \bar{X}	12,320
Giá trị kỳ vọng μ_0	50
Độ lệch chuẩn mẫu s	7,757
Số quan sát n	266 (vì $df = 265$)

Bảng 2: Các thông số thống kê dùng trong bài toán kiểm định một mẫu

Áp dụng công thức lý thuyết cho trường hợp phân phối tùy ý, mẫu ≥ 30 , ta có công thức tính giá trị kiểm định như sau:

$$Z_{qs} = \frac{\bar{X} - \mu_0}{\frac{s}{\sqrt{n}}}$$

Thay số vào:

$$Z = \frac{12320 - 50}{\frac{7757}{\sqrt{266}}} = \frac{12270}{474.89} \approx 25.83$$

5.1.3 Xử lý trên phần mềm RStudio

Xử lý trên phần mềm RStudio, nhóm sử dụng hàm `z.test` để tính giá trị kiểm định và p-value. Cụ thể, nhóm sử dụng hàm này với các tham số như sau:

```
1 z.test(x = spring_data$order_total,
2       mu = 50,
3       sigma.x = sd(spring_data$order_total),
4       alternative = "greater")
```

Listing 19: Kiểm định một mẫu

5.1.4 Kết luận

```
1 One-sample z-Test
2 data: spring_data$order_price
3 z = 28.704, p-value < 2.2e-16
4 alternative hypothesis: true mean is greater than 50
5 95 percent confidence interval:
6 12920.34 NA
```



```
7 sample estimates:  
8 mean of x  
9 13702.69
```

Listing 20: Kết quả sau khi dùng t-test

Kết luận: $p\text{-value} < 0.05$, như vậy ta có thể khẳng định, không đủ điều kiện để bác bỏ H_0

5.2 Kiểm định trung bình hai mẫu

5.2.1 Bài toán thực tế

Sau khi đã xác định được doanh thu của cửa hàng tại mùa xuân không vượt qua giá trị kì vọng, nhóm tiếp tục đem so sánh dữ liệu **mùa xuân** so với **mùa hè** với mức ý nghĩa $\alpha = 0.05$

Nhóm đặt giả thuyết như sau

- Giả thuyết không (H_0): $\mu_1 = \mu_2$
- Giả thuyết đối (H_1): $\mu_1 \neq \mu_2$

5.2.2 Tính giá trị kiểm định

Để tính giá trị kiểm định, nhóm sử dụng phương pháp tách 2 mẫu **xuân** và **hè** ra làm 2 và lọc ra thông số độ lệch chuẩn, n (số mẫu) và mean (trung bình mẫu)

```
1 group_stats <- merged_data %>%  
2   filter(season %in% c("spring", "summer")) %>%  
3   group_by(season) %>%  
4   summarise(  
5     mean = mean(order_total),  
6     sd = sd(order_total),  
7     n = n(),  
8     .groups = "drop"  
9   )  
10 print(group_stats)
```

Listing 21: Chia nhóm và tính toán chỉ số đặc trưng

5.2.3 Mô tả dữ liệu và công thức tính

Bảng 3: Chỉ số bài toán `order_total` theo mùa Xuân và Hè

Mùa	Trung bình (μ)	Độ lệch chuẩn (s)	Số lượng (n)
Xuân (Spring)	12,320	7,757	266
Hè (Summer)	12,487	7,697	249

Công thức tính cho trường hợp kiểm định 2 mẫu độc lập, có phân phối tùy ý và 2 mẫu ≥ 30 như sau:

$$Z_{qs} = \frac{\bar{X}_1 - \bar{X}_2}{\sqrt{\frac{s_1^2}{n_1} + \frac{s_2^2}{n_2}}}$$

Thế số vào:

$$Z = \frac{12319.55 - 12486.75}{\sqrt{\frac{7757.41^2}{266} + \frac{7697.42^2}{249}}} \approx -0.24542$$

5.2.4 Xử lý trên phần mềm RStudio

Xử lý trên phần mềm RStudio, nhóm sử dụng hàm `t.test` để tính giá trị kiểm định và p-value. Cụ thể, nhóm sử dụng hàm này với các tham số như sau:

```
1 t_test_result_two_sample<-t.test(order_total ~ season,
2     data = merged_data %>% filter(season %in% c("spring", "summer")),
3     var.equal = FALSE) # giả định phương sai không bằng nhau
4 print(t_test_result_two_sample)
```

Listing 22: Các thông số thống kê dùng trong kiểm định trung bình 2 mẫu

```
1 Welch Two Sample t-test
2
3 data: order_total by season
4 t = -0.24542, df = 511.26, p-value = 0.8062
5 alternative hypothesis: true difference in means between group spring and group summer is not
   equal to 0
6 95 percent confidence interval:
7  -1505.705 1171.298
8 sample estimates:
9 mean in group spring mean in group summer
10      12319.55      12486.75
```

Listing 23: Kết quả t-test

5.2.5 Kết luận

Với $p_{value} = 0.8602 > 0.05$, nhóm không có đủ bằng chứng để bác bỏ giả thuyết H_0 tức là không có sự khác biệt trong doanh thu giữa hai mùa.

5.3 Anova một yếu tố

5.3.1 Bài toán thực tế

Một cửa hàng điện tử muốn kiểm tra xem **giá trị đơn hàng trung bình** (`order_total`), với cỡ mẫu của mỗi nhóm là 30, có bị ảnh hưởng bởi **mùa vụ** (`season`) hay không. Dữ liệu được thu thập từ các đơn hàng, phân

loại thành 4 nhóm theo mùa: **Winter** (mùa đông), **Summer** (mùa hè), **Autumn** (mùa thu) và **Spring** (mùa xuân).

Với mức ý nghĩa $\alpha = 5\%$, sử dụng phương pháp **mô hình ANOVA một yếu tố** để kiểm tra xem giá trị đơn hàng trung bình giữa các mùa có sự khác biệt đáng kể hay không.

5.3.2 Giả thuyết kiểm định

- Các tổng thể phải tuân theo phân phối chuẩn $N(\mu, \sigma^2)$
- Số nhóm $k = 4$
- Phương sai bằng nhau $\sigma_1^2 = \sigma_2^2 = \sigma_3^2 = \sigma_4^2$
- Các mẫu quan sát (từ k tổng thể) được lấy độc lập, với $n = 30$ cho mỗi nhóm, tổng số quan sát $N = 120$.
-

5.3.3 Hiện thực phép toán

Gọi μ_i là giá trị đơn hàng trung bình của mùa thứ i .

$$H_0 : \mu_1 = \mu_2 = \mu_3 = \mu_4,$$

$$H_1 : \exists \mu_i \neq \mu_j \text{ sao cho } i \neq j.$$

5.3.4 Tính các tham số mẫu

Bảng 4: Trung bình và phương sai mẫu theo mùa

Mùa	Trung bình mẫu \bar{x}_i	Phương sai mẫu s_i^2
Winter	12499.31	56,686,589.91
Summer	12493.37	61,622,987.35
Autumn	12858.15	48,321,908.37
Spring	14594.52	106,019,827.40

Trung bình tổng thể \bar{x} là 1311.33

5.3.5 Giá trị trong và giữa các nhóm

Tổng bình phương giữa nhóm (SSB):

$$SSB = 14,303,293.20 + 14,550,442.35 + 3,299,751.675 + 55,465,154.35 = 87,618,641.575$$

Bình phương trung bình giữa nhóm (MSB):

$$MSB = \frac{SSB}{k-1} = \frac{87,618,641.575}{3} \approx 29,206,213.86$$

Tổng bình phương trong nhóm (SSW):

$$SSW = 1,643,911,107 + 1,787,066,635 + 1,401,335,343 + 3,074,574,995 = 7,906,888,080$$

Bình phương trung bình trong nhóm (MSW):

$$MSW = \frac{SSW}{N - k} = \frac{7,906,888,080}{116} \approx 68,162,828.28$$

5.3.6 Giá trị thống kê kiểm định

$$F = \frac{MSB}{MSW} = \frac{29,206,213.86}{68,162,828.28} \approx 0.4285$$

5.3.7 Miền bác bỏ

Với $\alpha = 5\%$, $df_1 = k - 1 = 3$, $df_2 = N - k = 116$:

$$F_{0.05;3;116} \approx 2.6802$$

Miền bác bỏ:

$$RR = (2.6802, +\infty)$$

5.3.8 Kết luận

Kết luận: Vì $F \approx 0.4285 < 2.6802$, không bác bỏ H_0 nên không có bằng chứng thống kê cho thấy giá trị đơn hàng trung bình giữa các mùa khác biệt đáng kể.

5.4 Xử lý trên phần mềm R

Sử dụng phương pháp leveneTest trong R để thực hiện

```
1 df_cleaned <- merged_data %>%
2   group_by(season) %>%
3   mutate(order_total_cleaned = ifelse(order_total > quantile(order_total, 0.75) + 1.5 * IQR(
4     order_total) | order_total < quantile(order_total, 0.25) - 1.5 * IQR(order_total), NA,
5     order_total)) %>%
6   ungroup()
7 leveneTest(order_total_cleaned ~ season, data = df_cleaned)
8 anova_model <- aov(order_total_cleaned ~ season, data = df_cleaned)
9 summary(anova_model)
```

Listing 24: Phép kiểm ANOVA một yếu tố

```
1 Df      Sum Sq    Mean Sq F value Pr(>F)
2 season      3 3.576e+08 119214928  2.299 0.0759 .
3 Residuals 981 5.086e+10 51848700
```

Listing 25: Kết quả ANOVA một yếu tố

Kết luận: Không đủ điều kiện để bác bỏ giả thuyết H_0 với $p\text{-value} = 0.0759 > 0.05$, tức là không có sự khác biệt đáng kể giữa giá trị đơn hàng trung bình của các mùa.

5.5 Hồi quy tuyến tính

5.5.1 Bài toán thực tế

Xây dựng mô hình hồi quy tuyến tính với biến phụ thuộc:

$$Y = \text{order_price}$$

và hai biến độc lập:

$$X_1 = \text{coupon_discounts}, \quad X_2 = \text{delivery_charges}.$$

Mô hình hồi quy bội được viết dưới dạng:

$$Y = \beta_0 + \beta_1 X_1 + \beta_2 X_2 + \varepsilon_i, \quad i = 1, 2, \dots, n$$

trong đó:

- Y : Giá trị đơn hàng (`order_price`)
- X_1 : Giảm giá bằng coupon (`coupon_discounts`)
- X_2 : Phí giao hàng (`delivery_charges`)
- ε_i : Sai số ngẫu nhiên, có kỳ vọng $E(\varepsilon) = 0$, phương sai σ^2

5.5.2 Cơ sở lý thuyết

Mô hình hồi quy bội mở rộng mô hình hồi quy đơn bằng cách đưa vào nhiều biến độc lập:

$$Y = \beta_0 + \beta_1 X_1 + \beta_2 X_2 + \dots + \beta_p X_p + \varepsilon$$

- β_0 : Hệ số chặn
- β_j : Hệ số hồi quy của biến độc lập X_j
- ε : Sai số ngẫu nhiên

5.5.3 Phương pháp ước lượng

Sử dụng phương pháp **Bình phương tối thiểu (OLS)**:

$$\hat{\beta} = (X^T X)^{-1} X^T Y$$

trong đó:

- X : Ma trận giá trị các biến độc lập ($n \times (p + 1)$)
- Y : Vector giá trị của biến phụ thuộc ($n \times 1$)
- $\hat{\beta}$: Vector hệ số hồi quy $(p + 1) \times 1$

Hệ số xác định R^2 :

$$R^2 = 1 - \frac{SS_{\text{res}}}{SS_{\text{tot}}}$$

với:

$$SS_{\text{res}} = \sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2, \quad SS_{\text{tot}} = \sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2$$

5.5.4 Kết quả mô hình OLS

Mô hình trong R:

```
model <- lm(order_price ~ coupon_discount + delivery_charges, data = df)
summary(model)
```

Kiểm tra đa cộng tuyến:

```
vif(model)
# coupon_discount: 1.000546
# delivery_charges: 1.000546
```

\Rightarrow VIF xấp xỉ 1 cho cả hai biến, không xảy ra đa cộng tuyến.

Hệ số ước lượng:

$$\hat{\beta}_0 = 13297.85, \quad \hat{\beta}_1 = 143.66, \quad \hat{\beta}_2 = 59.37$$

Ý nghĩa:

- Khi X_1 tăng 1 đơn vị, Y tăng trung bình 143.66
- Khi X_2 tăng 1 đơn vị, Y tăng trung bình 59.37

Kiểm định t :

- X_1 : $p = 0.527 > 0.05 \Rightarrow$ không đủ bằng chứng biến có ý nghĩa
- X_2 : $p = 0.662 > 0.05 \Rightarrow$ không đủ bằng chứng biến có ý nghĩa

Kiểm định F : p -value lớn hơn 0.05, $R^2 \approx 0 \Rightarrow$ mô hình không có ý nghĩa thống kê, biến phụ thuộc quan hệ yếu với các biến độc lập.

6 Thảo luận và Mở rộng

6.1 Nhận xét dữ liệu

- Trong mô hình tổng quan, có những cột dữ liệu không tuân theo phân phối chuẩn như **order_total** và **order_price**. Điều này có thể do sự hiện diện của các giá trị ngoại lai hoặc phân phối không đồng nhất.
- Phương sai không đồng nhất, có thể do sự biến động lớn trong giá trị đơn hàng giữa các mùa.
- Có những cột phụ thuộc với nhau, ví dụ **order_price** ảnh hưởng bởi **coupon_discount**.

6.2 Tính bao quát

Nhóm đã phân tích các yếu tố ảnh hưởng đến sự thay đổi của dữ liệu, cũng như phân tích và kiểm định trong từng trường hợp như sau: Các kiểm định được chọn phù hợp với mục tiêu và đặc điểm dữ liệu (không chuẩn, không đồng nhất phương sai, có cặp). Ngoài ra, nhóm cũng mở rộng bằng kiểm định phi tham số Krustal Wallis, do đó, phân tích được đánh giá là có tính bao quát tốt và hợp lý về mặt phương pháp. Cụ thể các phương pháp đã được nhóm sử dụng như sau:

- Phân tích 1 mẫu với **z-test**
- Phân tích 2 mẫu với **t-test**
- Phân tích Anova bằng Krustal-Wallis
- Phân tích hồi quy tuyến tính

6.3 Điểm mạnh và điểm yếu của các phương pháp đã sử dụng

Bảng 5: Tổng hợp ưu điểm và nhược điểm của các phương pháp kiểm định

Phương pháp	Ưu điểm	Nhược điểm
Z-test một mẫu	<ul style="list-style-type: none"> Dễ hiểu và triển khai. Hiệu quả với cỡ mẫu lớn ($n > 30$). Không yêu cầu phân phối chuẩn nhờ định lý giới hạn trung tâm. 	<ul style="list-style-type: none"> Giả định dữ liệu độc lập, mẫu đại diện. Không phù hợp với cỡ mẫu nhỏ.
T-test hai mẫu (Welch)	<ul style="list-style-type: none"> So sánh hai nhóm độc lập. Không yêu cầu phương sai bằng nhau. 	<ul style="list-style-type: none"> Nhạy cảm với ngoại lai nếu dữ liệu không chuẩn. Cần số lượng mẫu đủ lớn nếu phân phối không chuẩn.
Anova 1 yếu tố	<ul style="list-style-type: none"> Dễ hiểu và thực hiện Có khả năng mở rộng hay kết hợp với các kiểm định bổ sung như Tukey's HSD để xác định cụ thể nhóm nào khác biệt. 	<ul style="list-style-type: none"> Yêu cầu tổng thể có phân phối chuẩn. Không chỉ ra cặp nhóm nào khác biệt. Cần kiểm định hậu nghiệm (như Dunn Test).
Phương pháp OLS trong hồi quy tuyến tính	<ul style="list-style-type: none"> Dễ hiểu, tính toán nhanh, nhiều công cụ kiểm định, nền tảng lý thuyết vững 	<ul style="list-style-type: none"> Nhạy cảm với ngoại lai, cần giả định chặt chẽ, không xử lý tốt dữ liệu phi tuyến, đa cộng tuyến làm mất ổn định

6.4 Mối quan hệ giữa mục tiêu và phương pháp được chọn

Mục tiêu chính của nghiên cứu không phải là dự đoán giá trị, mà là kiểm tra xem các yếu tố như mùa vụ, đặc điểm sản phẩm hay hành vi mua hàng có tạo ra sự khác biệt có ý nghĩa thống kê về giá trị đơn hàng hay không.

Nhóm lựa chọn các phương pháp sau:

- Z-test một mẫu:** kiểm tra sự khác biệt giữa trung bình mẫu và giá trị giả thuyết.
- T-test hai mẫu (Welch):** so sánh trung bình của hai nhóm độc lập khi phương sai không đồng nhất.
- ANOVA một yếu tố:** kiểm tra sự khác biệt trung bình giữa nhiều nhóm; nếu có ý nghĩa thống kê, mở rộng thêm **Dunn test** để xác định cặp nhóm khác biệt.
- Hồi quy tuyến tính:** phân tích tác động của biến độc lập lên biến phụ thuộc và đánh giá mức độ giải thích của mô hình.

Việc lựa chọn trên đảm bảo phù hợp với đặc điểm dữ liệu, đáp ứng mục tiêu so sánh sự khác biệt và phân tích mối quan hệ, thay vì thuần túy dự đoán.

6.5 Mở rộng với phương pháp Kruskal-Wallis

Nguyên lý của phương pháp Kruskal-Wallis

- Sắp xếp tất cả các quan sát từ nhỏ đến lớn và gán thứ hạng (rank).
- Tính tổng thứ hạng cho từng nhóm.
- So sánh sự khác biệt tổng thứ hạng giữa các nhóm để đánh giá liệu các nhóm có xuất phát từ cùng một phân phối hay không.

Lí do nhóm chọn **Kruskal-Wallis** là vì:

- Dữ liệu không tuân theo phân phối chuẩn và có phương sai không đồng nhất.
- Kruskal-Wallis là phương pháp phi tham số, không yêu cầu giả định phân phối chuẩn.
- Phù hợp để so sánh nhiều nhóm độc lập, đặc biệt khi dữ liệu không đáp ứng giả định của ANOVA.

6.6 Thực hiện trong R

```
1 kruskal_result <- kruskal.test(order_price ~ season, data = merged_data)
2 # Hiển thị kết quả
3 print(kruskal_result)
```

Listing 26: Phép kiểm Kruskal-Wallis trong R

```
1 Kruskal-Wallis rank sum test
2 data: order_price by season
3 Kruskal-Wallis chi-squared = 2.2004, df = 3, p-value = 0.5319
```

Listing 27: Kết quả kiểm định Kruskal-Wallis trong R

Kết quả: Kiểm định Kruskal-Wallis cho thấy $\chi^2 = 2.2004$, $df = 3$, $p\text{-value} = 0.5319$. Vì $p\text{-value}$ lớn hơn mức ý nghĩa 0.05, ta không bác bỏ giả thuyết gốc. Điều này nghĩa là chưa có bằng chứng thống kê để kết luận giá trị `order_price` khác biệt giữa các mùa.

7 Nguồn Dữ Liệu

- Dữ liệu mẫu: <https://www.kaggle.com/datasets/muhammadshahrayar/transactional-retail-dataset-of-electronics-store>

8 Tài liệu Tham Khảo

Tài liệu

- [1] Anderson, D. R., Sweeney, D. J., & Williams, T. A. (2016). *Statistics for Business and Economics* (11th ed.). Cengage Learning Vietnam Company Limited.
- [2] Peter Dalgaard. *Introductory Statistics with R* (8th ed)
- [3] Nguyễn Đình Huy. *Giáo trình xác suất và thống kê(2023)*, Nxb. Đại học Quốc Gia, Thành phố Hồ Chí Minh.

Lời kết

Như vậy là đã hoàn thành xong bài báo cáo nhóm của chúng em ! Em xin cảm ơn cô và các bạn đã lắng nghe !

Trong quá trình báo cáo và nội dung có gì sai sót, kính mong được cô và các bạn góp ý thêm của bài báo cáo trở nên hoàn thiện!