

Санкт-Петербургский политехнический университет
Петра Великого

Физико-механический институт
Высшая школа прикладной математики и физики

Отчёт
по лабораторным работам №1-4
по дисциплине
«Математическая статистика»

Выполнила студентка:
Дикарева Мария Евгеньевна
Группа: 5030102/00201
Проверил:
к.ф.-м.н., доцент
Баженов Александр Николаевич

Санкт-Петербург
2023

Содержание

1	Постановка задачи	4
2	Теория	4
2.1	Гистограмма	4
2.1.1	Определение	4
2.1.2	Графическое описание	5
2.1.3	Использование	5
2.1.4	Вариационный ряд	6
2.2	Выборочные числовые характеристики	6
2.2.1	Характеристики положения	6
2.2.2	Характеристики рассеяния	7
2.3	Боксплот Тьюки	7
2.3.1	Определение	7
2.3.2	Описание	7
2.3.3	Построение	7
2.4	7
2.5	Эмпирическая функция распределения	8
2.5.1	Статистический ряд	8
2.5.2	Определение	8
2.5.3	Описание	8
2.6	Оценки плотности вероятности	9
2.6.1	Определение	9
2.6.2	Ядерные оценки	9
2.6.3	Оценка качества ядерных приближений	10
3	Реализация	11
4	Результаты	11
4.1	Гистограмма и график плотности распределения	11
4.2	Характеристики положения и рассеяния	13
4.3	Боксплот Тьюки	17
4.4	Доля выбросов	20
4.5	Теоретическая вероятность выбросов	20
4.6	Эмпирическая функция распределения	20
4.7	Ядерные оценки плотности распределения	22
5	Обсуждение	27
5.1	Гистограмма и график плотности распределения	27
5.2	Характеристики положения и рассеяния	27
5.3	Доля и теоретическая вероятность выбросов	27
5.4	Эмпирическая функция и ядерные оценки плотности распределения	28
	Литература	29

Список иллюстраций

1	Нормальное распределение.	11
2	Распределение Коши.	11
3	Распределение Лапласа.	12
4	Распределение Пуассона.	12
5	Равномерное распределение.	12
6	Нормальное распределение.	17
7	Распределение Коши.	18
8	Распределение Лапласа.	18
9	Распределение Пуассона.	19
10	Равномерное распределение.	19
11	Нормальное распределение.	20
12	Распределение Коши.	21
13	Распределение Лапласа.	21
14	Распределение Пуассона.	21
15	Равномерное распределение.	22
16	Нормальное распределение $n = 20$	22
17	Нормальное распределение $n = 60$	22
18	Нормальное распределение $n = 100$	23
19	Распределение Коши $n = 20$	23
20	Распределение Коши $n = 60$	23
21	Распределение Коши $n = 100$	24
22	Распределение Лапласа $n = 20$	24
23	Распределение Лапласа $n = 60$	24
24	Распределение Лапласа $n = 100$	25
25	Распределение Пуассона $n = 20$	25
26	Распределение Пуассона $n = 60$	25
27	Распределение Пуассона $n = 100$	26
28	Равномерное распределение $n = 20$	26
29	Равномерное распределение $n = 60$	26
30	Равномерное распределение $n = 100$	27

Список таблиц

1	Статистический ряд	8
2	Таблица распределения	9
3	Нормальное распределение.	13
4	Распределение Коши.	14
5	Распределение Лапласа.	15
6	Распределение Пуассона.	16
7	Равномерное распределение.	17
8	Экспериментальная доля выбросов.	20
9	Теоретическая вероятность выбросов.	20

1 Постановка задачи

Для 5 распределений:

- Нормальное распределение $N(x, 0, 1)$
- Распределение Коши $C(x, 0, 1)$
- Распределение Лапласа $L(x, 0, \frac{1}{\sqrt{2}})$
- Распределение Пуассона $P(k, 10)$
- Равномерное распределение $U(x, -\sqrt{3}, \sqrt{3})$

1. Сгенерировать выборки размером 10, 50 и 1000 элементов.
Построить на одном рисунке гистограмму и график плотности распределения.
2. Сгенерировать выборки размером 10, 100 и 1000 элементов.
Для каждой выборки вычислить следующие статистические характеристики положения данных: \bar{x} , $med x$, z_R , z_Q , z_{tr} . Повторить такие вычисления 1000 раз для каждой выборки и найти среднее характеристическое положение и их квадратов:

$$E(z) = \bar{z} \quad (1)$$

Вычислить оценку дисперсии по формуле:

$$D(z) = \bar{z^2} - \bar{z}^2 \quad (2)$$

Представить полученные данные в виде таблиц.

3. Сгенерировать выборки размером 20 и 100 элементов.
Построить для них боксплот Тьюки.
Для каждого распределения определить долю выбросов экспериментально (сгенерировав выборку, соответствующую распределению, 1000 раз и вычислив среднюю долю выбросов) и сравнить с результатами, полученными теоретически.
4. Сгенерировать выборки размером 20, 60 и 100 элементов.
Построить на них эмпирические функции распределения и ядерные оценки плотности распределения на отрезке $[-4; 4]$ для непрерывных распределений и на отрезке $[6; 14]$ для распределения Пуассона.

2 Теория

2.1 Гистограмма

2.1.1 Определение

Гистограмма в математической статистике — это функция, приближающая плотность вероятности некоторого распределения, построенная на основе выборки из него [1].

2.1.2 Графическое описание

Графически гистограмма строится следующим образом. Сначала множество значений, которое может принимать элемент выборки, разбивается на несколько интервалов. Чаще всего эти интервалы берут одинаковыми, но это не является строгим требованием. Эти интервалы откладываются на горизонтальной оси, затем над каждым рисуется прямоугольник. Если все интервалы были одинаковыми, то высота каждого прямоугольника пропорциональна числу элементов выборки, попадающих в соответствующий интервал. Если интервалы разные, то высота прямоугольника выбирается таким образом, чтобы его площадь была пропорциональна числу элементов выборки, которые попали в этот интервал [1].

2.1.3 Использование

Гистограммы применяются в основном для визуализации данных на начальном этапе статистической обработки.

Построение гистограмм используется для получения эмпирической оценки плотности распределения случайной величины. Для построения гистограммы наблюдаемый диапазон изменения случайной величины разбивается на несколько интервалов и подсчитывается доля от всех измерений, попавшая в каждый из интервалов. Величина каждой доли, отнесенная к величине интервала, принимается в качестве оценки значения плотности распределения на соответствующем интервале [1].

Они являются мощным инструментом для исследования неизвестных распределений.

В частности, на этом построены различные способы обработки сигналов, изображений и других статистических объектов. Применение гистограмм к обработке экспериментальных данных позволяет устранять артефакты - шумы и выбросы, мешающие работе с данными и не являющиеся содержательными.

Шумы определяются как горизонтальные участки сигнала. Присутствуют они только до и после полезного сигнала, на нем они быть не могут. Определяются участки шума так: находятся границы 2-ух самых больших столбцов гистограммы полученного сигнала, затем путем прохода по сигналу в обе стороны окном определенного размера и сравнения процентного соотношения значений внутри границ большого столбца с выбранным порогом, принимается решение о пометке участка как шумового при превышении этого порога.

Выбросы — экстремальные значения во входных данных, находящиеся далеко за пределами других наблюдений. На гистограмме выбросы будут формировать одиночные пики. Выбросы следует заменить чем-то разумным (средним, медианой в окрестности). Нужно идти по гистограмме скользящим окном (параметр), и, что вылетает далеко по гистограмме (или за 3 сигмы), заменять медианным значением. Тогда ожидается, что колонны гистограммы сравняются с пейзажем.

2.1.4 Вариационный ряд

Вариационным рядом называется последовательность элементов выборки, расположенных в неубывающем порядке. Одинаковые элементы повторяются [2, с. 409].

Запись вариационного ряда: $x_{(1)}, x_{(2)}, \dots, x_{(n)}$.

Элементы вариационного ряда $x_{(i)}$ ($i = 1, 2, \dots, n$) называются порядковыми статистиками.

2.2 Выборочные числовые характеристики

С помощью выборки образуются её числовые характеристики. Это числовые характеристики дискретной случайной величины X^* , принимающей выборочные значения x_1, x_2, \dots, x_n [2, с. 411].

2.2.1 Характеристики положения

- Выборочное среднее

$$\bar{x} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i \quad (3)$$

- Выборочная медиана

$$\text{med } x = \begin{cases} x_{(l+1)} & \text{при } n = 2l + 1 \\ \frac{x_{(l)} + x_{(l+1)}}{2} & \text{при } n = 2l \end{cases} \quad (4)$$

- Полусумма экстремальных выборочных элементов

$$z_R = \frac{x_{(1)} + x_{(n)}}{2} \quad (5)$$

- Полусумма квартилей

Выборочная квартиль z_p порядка p определяется формулой

$$z_p = \begin{cases} x_{([np]+1)} & \text{при } np \text{ дробном,} \\ x_{(np)} & \text{при } np \text{ целом.} \end{cases} \quad (6)$$

Полусумма квартилей

$$z_Q = \frac{z_{1/4} + z_{3/4}}{2} \quad (7)$$

- Усечённое среднее

$$z_{tr} = \frac{1}{n-2r} \sum_{i=r+1}^{n-r} x_{(i)}, \quad r \approx \frac{n}{4} \quad (8)$$

2.2.2 Характеристики рассеяния

Выборочная дисперсия

$$D = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2 \quad (9)$$

2.3 Боксплот Тьюки

2.3.1 Определение

Боксплот (англ. box plot) — график, использующийся в описательной статистике, компактно изображающий одномерное распределение вероятностей.

2.3.2 Описание

Такой вид диаграммы в удобной форме показывает медиану, нижний и верхний квартили и выбросы. Несколько таких ящиков можно нарисовать бок о бок, чтобы визуально сравнивать одно распределение с другим; их можно располагать как горизонтально, так и вертикально. Расстояния между различными частями ящика позволяют определить степень разброса (дисперсии) и асимметрии данных и выявить выбросы [3].

2.3.3 Построение

Границами ящика служат первый и третий квартили, линия в середине ящика — медиана. Концы усов — края статистически значимой выборки (без выбросов). Длину «усов» определяют разность первого квартиля и полутора межквартильных расстояний и сумма третьего квартиля и полутора межквартильных расстояний. Формула имеет вид

$$X_1 = Q_1 - \frac{3}{2}(Q_3 - Q_1), \quad X_2 = Q_3 + \frac{3}{2}(Q_3 - Q_1), \quad (10)$$

где X_1 — нижняя граница уса, X_2 — верхняя граница уса, Q_1 — первый квартиль, Q_3 — третий квартиль.

Данные, выходящие за границы усов (выбросы), отображаются на графике в виде маленьких кружков [3].

2.4

Теоретическая вероятность выбросов

Встроенными средствами языка программирования R в среде разработки RStudio можно вычислить теоретические первый и третий квартили распределений (Q_1^T и Q_3^T соответственно). По формуле (10) можно вычислить теоретические нижнюю и верхнюю границы уса (X_1^T и X_2^T соответственно). Выбросами считаются величины x , такие что:

$$\begin{cases} x < X_1^T \\ x > X_2^T \end{cases} \quad (11)$$

Теоретическая вероятность выбросов для непрерывных распределений

$$P_v^T = P(x < X_1^T) + P(x > X_2^T) = F(X_1^T) + (1 - F(X_2^T)), \quad (12)$$

где $F(X) = P(x \leq X)$ - функция распределения.

Теоретическая вероятность выбросов для дискретных распределений

$$P_v^T = P(x < X_1^T) + P(x > X_2^T) = (F(X_1^T) - P(x = X_1^T)) + (1 - F(X_2^T)), \quad (13)$$

где $F(X) = P(x \leq X)$ - функция распределения.

2.5 Эмпирическая функция распределения

2.5.1 Статистический ряд

Статистическим рядом называется последовательность различных элементов выборки z_1, z_2, \dots, z_k , расположенных в возрастающем порядке с указанием частот n_1, n_2, \dots, n_k , с которыми эти элементы содержатся в выборке. Статистический ряд обычно записывается в виде таблицы

z	z_1	z_2	\dots	z_k
n	n_1	n_2	\dots	n_k

Таблица 1: Статистический ряд

2.5.2 Определение

Эмпирической (выборочной) функцией распределения (э. ф. р.) называется относительная частота события $X < x$, полученная по данной выборке:

$$F_n^*(x) = P^*(X < x). \quad (14)$$

2.5.3 Описание

Для получения относительной частоты $P^*(X < x)$ просуммируем в статистическом ряде, построенном по данной выборке, все частоты n_i , для которых элементы z_i статистического ряда меньше x . Тогда $P^*(X < x) = \frac{1}{n} \sum_{z_i < x} n_i$. Получаем

$$F^*(x) = \frac{1}{n} \sum_{z_i < x} n_i. \quad (15)$$

$F^*(x)$ — функция распределения дискретной случайной величины X^* , заданной таблицей распределения

X^*	z_1	z_2	\dots	z_k
P	$\frac{n_1}{n}$	$\frac{n_2}{n}$	\dots	$\frac{n_k}{n}$

Таблица 2: Таблица распределения

Эмпирическая функция распределения является оценкой, т. е. приближённым значением, генеральной функции распределения

$$F_n^*(x) \approx F_X(x). \quad (16)$$

2.6 Оценки плотности вероятности

2.6.1 Определение

Оценкой плотности вероятности $f(x)$ называется функция $\hat{f}(x)$, построенная на основе выборки, приближённо равная $f(x)$

$$\hat{f}(x) \approx f(x). \quad (17)$$

2.6.2 Ядерные оценки

Представим оценку в виде суммы с числом слагаемых, равным объёму выборки:

$$\hat{f}_n(x) = \frac{1}{nh_n} \sum_{i=1}^n K\left(\frac{x-x_i}{h_n}\right). \quad (18)$$

Здесь функция $K(u)$, называемая ядерной (ядром), непрерывна и является плотностью вероятности, x_1, \dots, x_n — элементы выборки, $\{h_n\}$ — любая последовательность положительных чисел, обладающая свойствами

$$h_n \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0; \quad \frac{h_n}{n^{-1}} \xrightarrow{n \rightarrow \infty} \infty. \quad (19)$$

Такие оценки называются непрерывными ядерными [2, с. 421-423].

Замечание. Свойство, означающее сближение оценки с оцениваемой величиной при $n \rightarrow \infty$ в каком-либо смысле, называется состоятельностью оценки.

Если плотность $f(x)$ кусочно-непрерывная, то ядерная оценка плотности является состоятельной при соблюдении условий, накладываемых на параметр сглаживания h_n , а также на ядро $K(u)$.

Гауссово (нормальное) ядро [4, с. 38]

$$K(u) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{u^2}{2}}. \quad (20)$$

Правило Сильвермана [4, с. 44]

$$h_n = 1.06\hat{\sigma}n^{-1/5}, \quad (21)$$

где $\hat{\sigma}$ - выборочное стандартное отклонение.

2.6.3 Оценка качества ядерных приближений

После получения результатов возникает необходимость оценить качество ядерных приближений. Приведем в пример один из приемов количественных описаний сходства кривых - метод Фреше.

Расстояние Фреше — это мера сходства кривых, принимающая во внимание число и порядок точек вдоль кривых. Расстояние названо по имени французского математика Мориса Фреше. Метрика Фреше принимает во внимание течение двух кривых, поскольку пары точек, расстояние между которыми определяет расстояние Фреше, «пробегают» вдоль кривых. Расстояние Фреше между двумя кривыми — это не длина самого короткого поводка, с которым можно пройти все пути, а самый короткий, при котором можно пройти этот путь.

Определим кривую как непрерывное отображение $f : [a, b] \rightarrow V$, где $a, b \in R$ и $a \leq b$ и (V, d) — метрическое пространство. Даны две кривые $f : [a, b] \rightarrow V$ и $g : [a', b'] \rightarrow V$, их расстояние Фреше определено в виде:

$$\delta F(f, g) = \inf_{\alpha, \beta} \max_{t \in [0, 1]} \{d(f(\alpha(t)), g(\beta(t)))\} \quad (22)$$

где α (соответственно β) — произвольная непрерывная неубывающая функция из $[0, 1]$ на $[a, b]$ (соответственно $[a', b']$).

При вычислении расстояния Фреше между произвольными кривыми обычно аппроксимируют кривые многоугольными кривыми. Многоугольная кривая — это кривая $P : [0, n] \rightarrow V$, где n — натуральное число, такое, что для каждого $i \in [0, n - 1]$ ограничение P к интервалу $[i, i + 1]$ является аффинным, то есть $P(i + \lambda) = (1 - \lambda)P(i) + \lambda P(i + 1)$.

Для заданных многоугольных кривых P и Q их дискретное расстояние Фреше определяется как:

$$\delta_{dF}(P, Q) = \min ||L|| \quad (23)$$

где $L = PQ$.

Необязательно решение — пара точек, между которыми найдено расстояние Фреше, — является единственным.

Рассмотрим расстояние Фреше для двух кривых: ядерной оценки плотности для равномерного распределения и самого равномерного распределения

при $n = 100$: Здесь расстояние Фреше получается таким:
 для $h_n/2, \delta_{dF}(P, Q) = 2.2965233902629834$
 для $h_n, \delta_{dF}(P, Q) = 2.2948883897868826$
 для $2h_n, \delta_{dF}(P, Q) = 2.294546249392843$

3 Реализация

Лабораторная работа выполнена с помощью языка Python, включая библиотеки numpy, scipy, matplotlib, seaborn, statsmodels. Отчет написан на LaTeX в среде Overleaf.

4 Результаты

4.1 Гистограмма и график плотности распределения

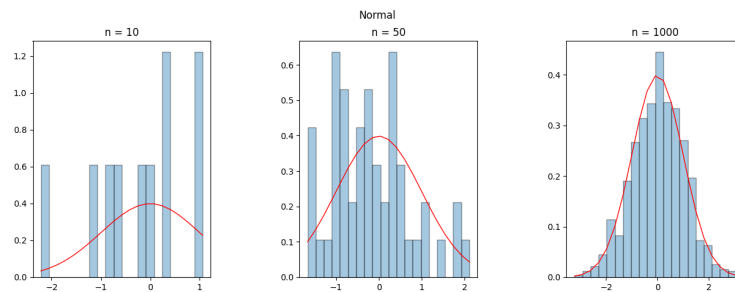


Рис. 1: Нормальное распределение.

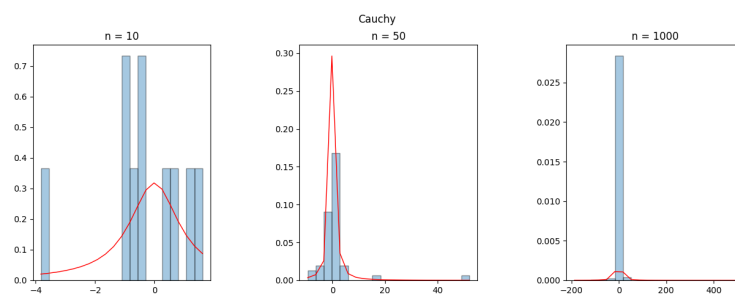


Рис. 2: Распределение Коши.

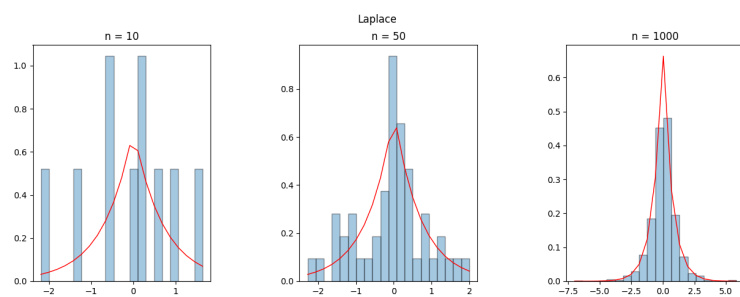


Рис. 3: Распределение Лапласа.

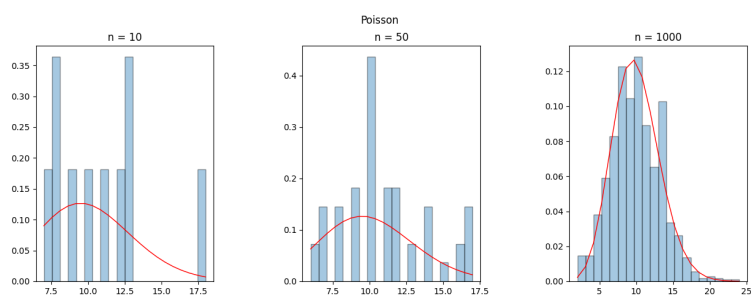


Рис. 4: Распределение Пуассона.

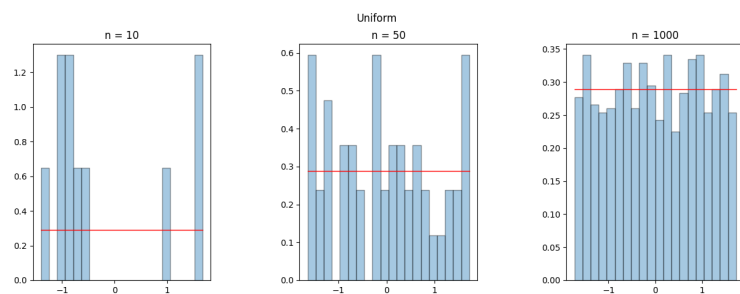


Рис. 5: Равномерное распределение.

4.2 Характеристики положения и рассеяния

	\bar{x}	$med x$	z_R	z_Q	z_{tr}
n =10					
$E(z)$	-0.0089	-0.0075	-0.0138	0.3122	0.1016
$D(z)$	0.1017	0.1338	0.1926	0.124	0.081
$E(z) - \sqrt{D(z)}$	-0.3278	-0.3733	-0.4527	-0.0399	-0.183
$E(z) + \sqrt{D(z)}$	0.31	0.3583	0.4251	0.6643	0.3862
E	0	0	0	0	0
n =100					
$E(z)$	0.0032	0.0042	-0.0021	0.0189	0.0169
$D(z)$	0.0101	0.0159	0.0928	0.0125	0.0118
$E(z) - \sqrt{D(z)}$	-0.0973	-0.1219	-0.3067	-0.0929	-0.0917
$E(z) + \sqrt{D(z)}$	0.1037	0.1303	0.3025	0.1307	0.1255
E	0	0	0	0	0
n =1000					
$E(z)$	0.0013	0.0005	-0.001	0.0024	0.002
$D(z)$	0.001	0.0015	0.0611	0.0012	0.0011
$E(z) - \sqrt{D(z)}$	-0.0303	-0.0382	-0.2482	-0.0322	-0.0312
$E(z) + \sqrt{D(z)}$	0.0329	0.0392	0.2462	0.037	0.0352
E	0	0	0	0	0

Таблица 3: Нормальное распределение.

	\bar{x}	$med\ x$	z_R	z_Q	z_{tr}
n =10					
$E(z)$	-3.3164	-0.0086	-16.7147	1.2642	0.2065
$D(z)$	41731.208	0.3237	1042835.4086	13.2937	0.2994
$E(z) - \sqrt{D(z)}$	-207.5986	-0.5775	-1037.9078	-2.3819	-0.3407
$E(z) + \sqrt{D(z)}$	200.9658	0.5603	1004.4784	4.9103	0.7537
\hat{E}	-	0	-	-	0
n =100					
$E(z)$	-2.5319	-0.0002	-125.0052	0.0309	0.0195
$D(z)$	14002.0969	0.0271	34963386.457	0.0548	0.0261
$E(z) - \sqrt{D(z)}$	-120.8624	-0.1648	-6037.9898	-0.2032	-0.1421
$E(z) + \sqrt{D(z)}$	115.7986	0.1644	5787.9794	0.265	0.1811
\hat{E}	-	0	-	0	0
n =1000					
$E(z)$	-1.4412	0.002	-694.7175	0.0061	0.0039
$D(z)$	2388.2313	0.0026	591424881.9827	0.0053	0.0027
$E(z) - \sqrt{D(z)}$	-50.3107	-0.049	-25013.9461	-0.0667	-0.0481
$E(z) + \sqrt{D(z)}$	47.4283	0.053	23624.5111	0.0789	0.0559
\hat{E}	-	0	-	0	0

Таблица 4: Распределение Коши.

	\bar{x}	$med x$	z_R	z_Q	z_{tr}
n =10					
$E(z)$	0.0046	0.0051	0.0182	0.3074	0.0889
$D(z)$	0.1065	0.076	0.4138	0.1247	0.0536
$E(z) - \sqrt{(D(z))}$	-0.3217	-0.2706	-0.6251	-0.0457	-0.1426
$E(z) + \sqrt{(D(z))}$	0.3309	0.2808	0.6615	0.6605	0.3204
\hat{E}	0	0	0	0	0
n =100					
$E(z)$	0.0035	0.001	-0.0154	0.0169	0.012
$D(z)$	0.0102	0.0058	0.4336	0.0104	0.0061
$E(z) - \sqrt{(D(z))}$	-0.0975	-0.0752	-0.6739	-0.0851	-0.0661
$E(z) + \sqrt{(D(z))}$	0.1045	0.0772	0.6431	0.1189	0.0901
\hat{E}	0	0	0	0	0
n =1000					
$E(z)$	-0.001	-0.0007	0.003	0.0001	0.0001
$D(z)$	0.001	0.0005	0.4023	0.001	0.0006
$E(z) - \sqrt{(D(z))}$	-0.0326	-0.0231	-0.6313	-0.0315	-0.0244
$E(z) + \sqrt{(D(z))}$	0.0306	0.0217	0.6373	0.0317	0.0246
\hat{E}	0	0	0	0	0

Таблица 5: Распределение Лапласа.

	\bar{x}	$med x$	z_R	z_Q	z_{tr}
n =10					
$E(z)$	10.0117	9.8775	10.286	10.941	8.5883
$D(z)$	1.0195	1.4362	1.8737	1.401	0.8766
$E(z) - \sqrt{D(z)}$	9.002	8.6791	8.9172	9.7574	7.652
$E(z) + \sqrt{D(z)}$	11.0214	11.0759	11.6548	12.1246	9.5246
\hat{E}	10	10 ± 1	10 ± 1	11 ± 1	8
n =100					
$E(z)$	10.0162	9.8595	10.9425	9.987	9.7158
$D(z)$	0.1042	0.2095	0.9709	0.1548	0.1242
$E(z) - \sqrt{D(z)}$	9.6934	9.4018	9.9572	9.5936	9.3634
$E(z) + \sqrt{D(z)}$	10.339	10.3172	11.9278	10.3804	10.0682
\hat{E}	10	10	10	10	10
n =1000					
$E(z)$	10.0045	9.997	11.6745	9.994	9.8472
$D(z)$	0.0103	0.0025	0.6453	0.0035	0.0113
$E(z) - \sqrt{D(z)}$	9.903	9.947	10.8712	9.9348	9.7409
$E(z) + \sqrt{D(z)}$	10.106	10.047	12.4778	10.0532	9.9535
\hat{E}	10	10	11 ± 1	10	9 ± 0.1

Таблица 6: Распределение Пуассона.

	\bar{x}	$med\ x$	z_R	z_Q	z_{tr}
n = 10					
$E(z)$	0.0173	0.0249	0.0106	0.3284	0.1486
$D(z)$	0.1014	0.2384	0.0479	0.1255	0.12
$E(z) - \sqrt{D(z)}$	-0.3011	-0.4634	-0.2083	-0.0259	-0.1978
$E(z) + \sqrt{D(z)}$	0.3357	0.5132	0.2295	0.6827	0.495
\hat{E}	0	0	0	0	0
n = 100					
$E(z)$	-0.0026	-0.0039	-0.0001	0.0138	0.014
$D(z)$	0.0102	0.0293	0.0006	0.0149	0.0196
$E(z) - \sqrt{D(z)}$	-0.1036	-0.1751	-0.0246	-0.1083	-0.126
$E(z) + \sqrt{D(z)}$	0.0984	0.1673	0.0244	0.1359	0.154
\hat{E}	0	0	0	0	0
n = 1000					
$E(z)$	0.0005	-0.0003	-0.0001	0.0029	0.0016
$D(z)$	0.001	0.0029	0.0	0.0014	0.0019
$E(z) - \sqrt{D(z)}$	-0.0311	-0.0542	-0.0001	-0.0345	-0.042
$E(z) + \sqrt{D(z)}$	0.0321	0.0536	-0.0001	0.0403	0.0452
\hat{E}	0	0	0	0	0

Таблица 7: Равномерное распределение.

4.3 Боксплот Тьюки

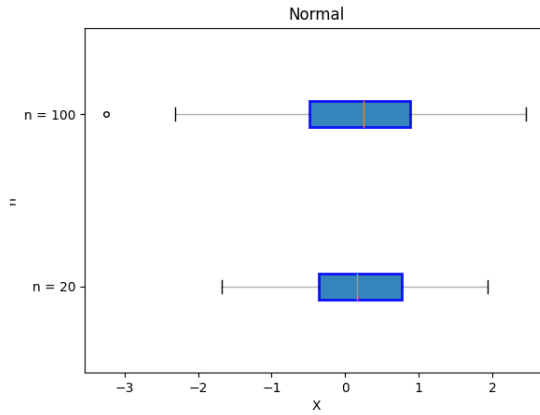


Рис. 6: Нормальное распределение.

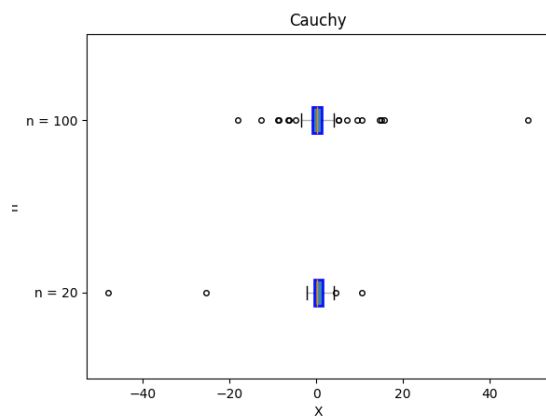


Рис. 7: Распределение Коши.

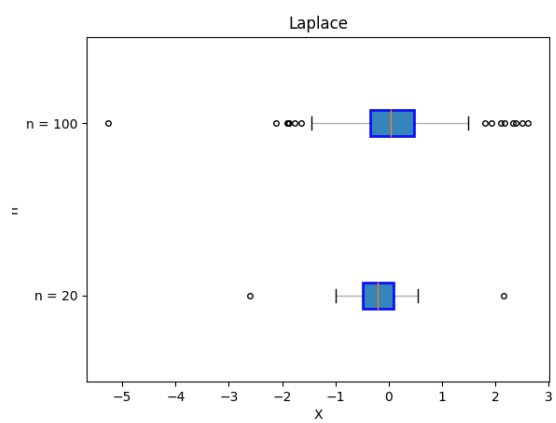


Рис. 8: Распределение Лапласа.

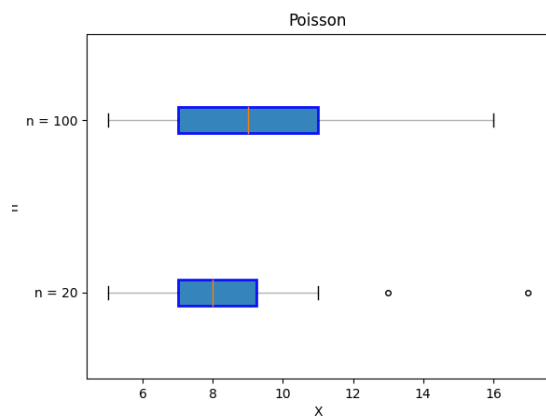


Рис. 9: Распределение Пуассона.

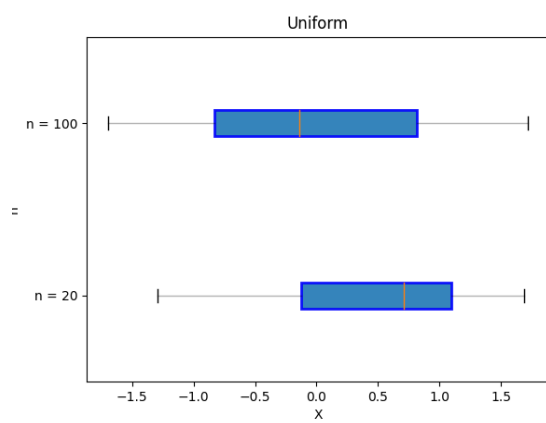


Рис. 10: Равномерное распределение.

4.4 Доля выбросов

Sample	Share of emissions
Normal n = 20	0.02
Normal n = 100	0.01
Cauchy n = 20	0.15
Cauchy n = 100	0.15
Laplace n = 20	0.07
Laplace n = 100	0.07
Poisson n = 20	0.02
Poisson n = 100	0.01
Uniform n = 20	0.0
Uniform n = 100	0.0

Таблица 8: Экспериментальная доля выбросов.

4.5 Теоретическая вероятность выбросов

Распределение	Q_1^T	Q_3^T	X_1^T	X_2^T	P_B^T
Нормальное распределение	-0.674	0.674	-2.698	2.698	0.007
Распределение Коши	-1	1	-4	4	0.156
Распределение Лапласа	-0.49	0.49	-1.961	1.961	0.063
Распределение Пуассона	8	12	2	18	0.008
Равномерное распределение	-0.866	0.866	-3.464	3.464	0

Таблица 9: Теоретическая вероятность выбросов.

4.6 Эмпирическая функция распределения

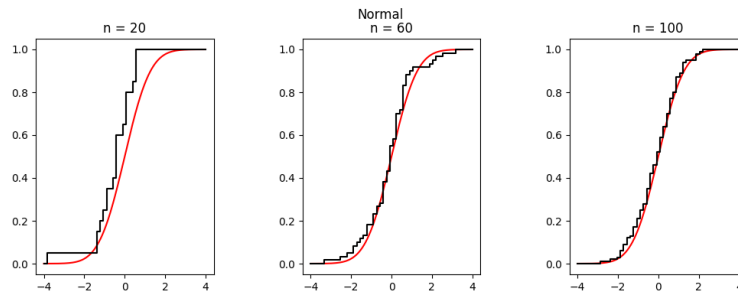


Рис. 11: Нормальное распределение.

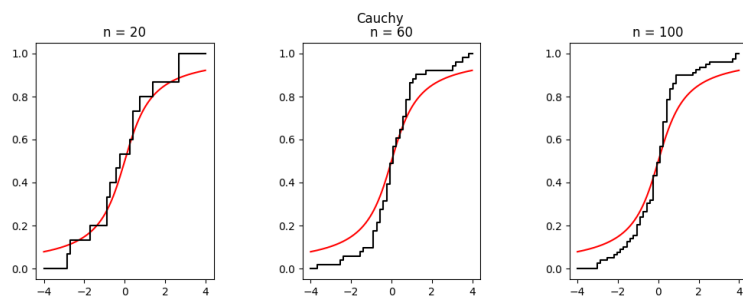


Рис. 12: Распределение Коши.

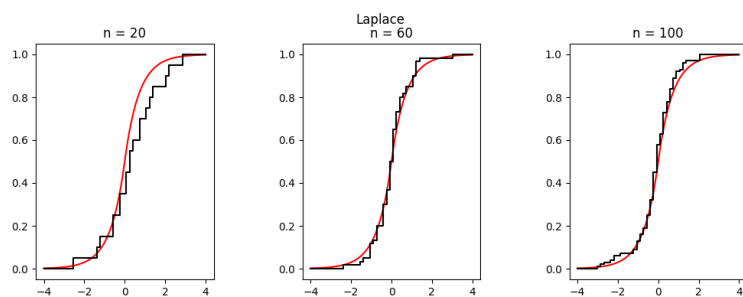


Рис. 13: Распределение Лапласа.

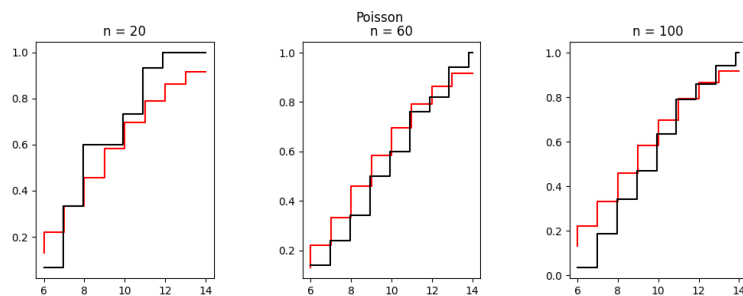


Рис. 14: Распределение Пуассона.

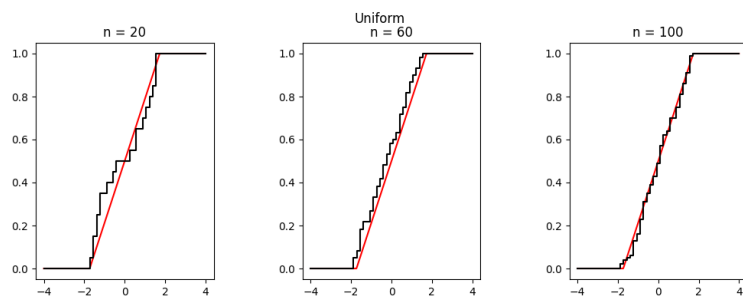


Рис. 15: Равномерное распределение.

4.7 Ядерные оценки плотности распределения

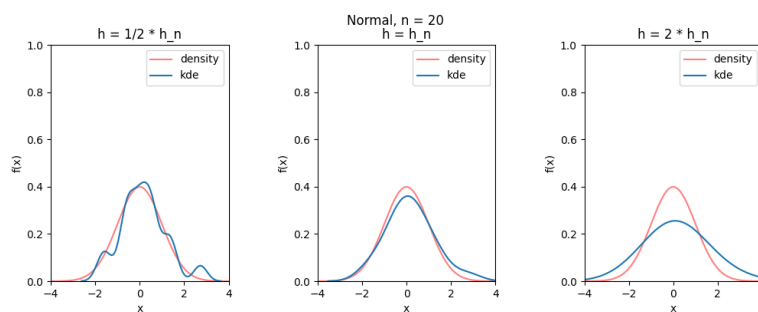


Рис. 16: Нормальное распределение $n = 20$.

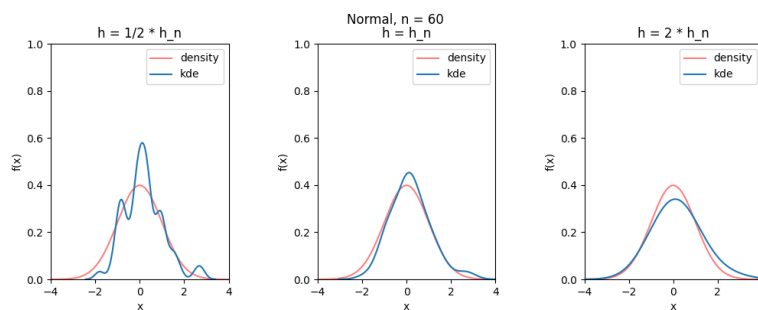


Рис. 17: Нормальное распределение $n = 60$.

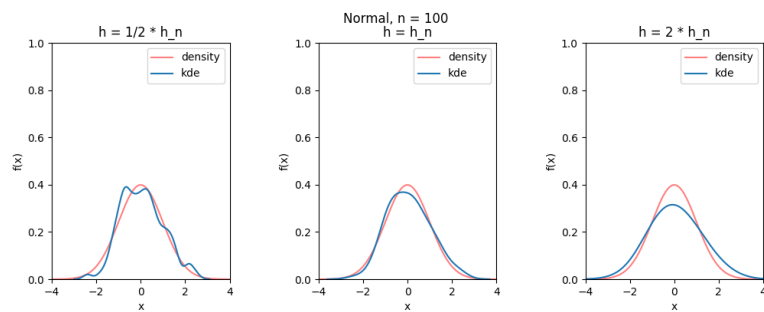


Рис. 18: Нормальное распределение $n = 100$.

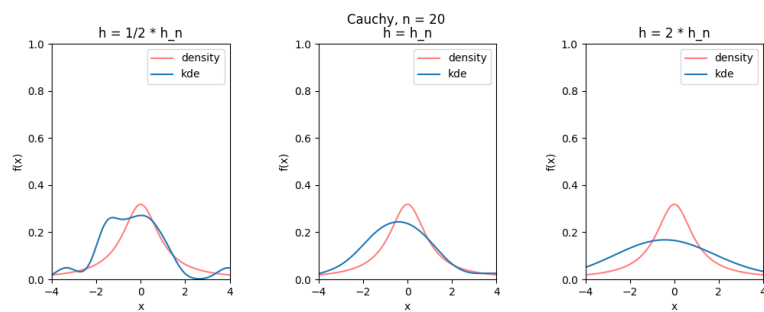


Рис. 19: Распределение Коши $n = 20$.

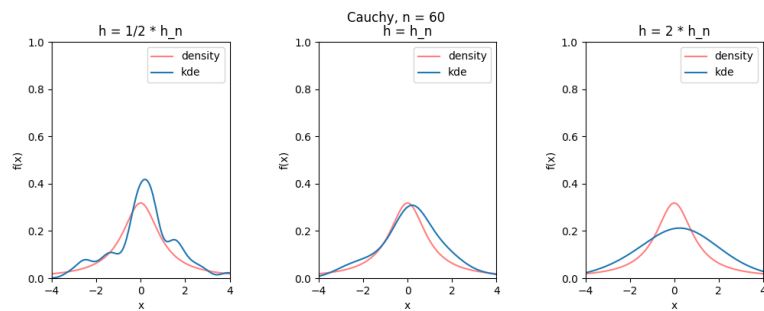


Рис. 20: Распределение Коши $n = 60$.

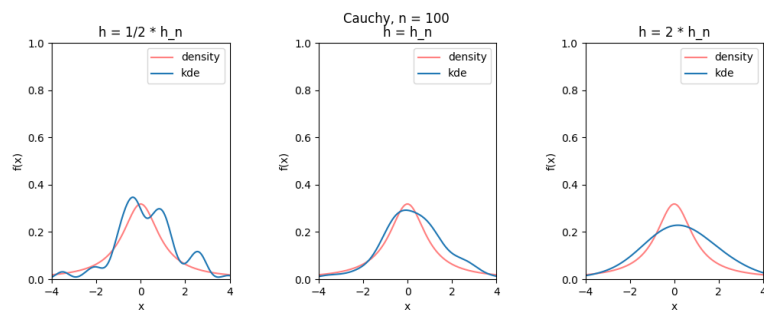


Рис. 21: Распределение Коши $n = 100$.

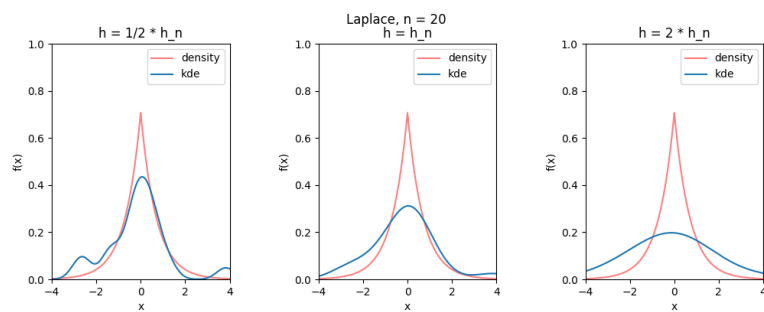


Рис. 22: Распределение Лапласа $n = 20$.

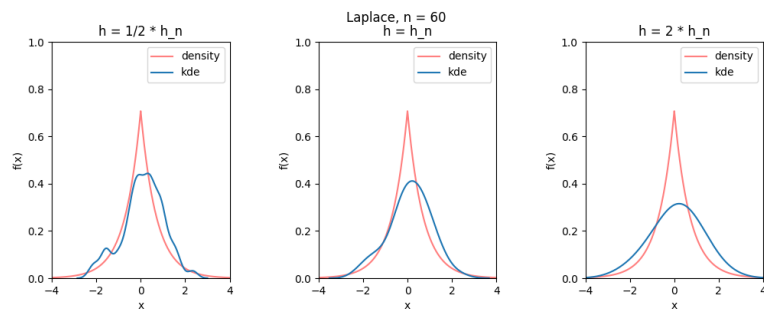


Рис. 23: Распределение Лапласа $n = 60$.

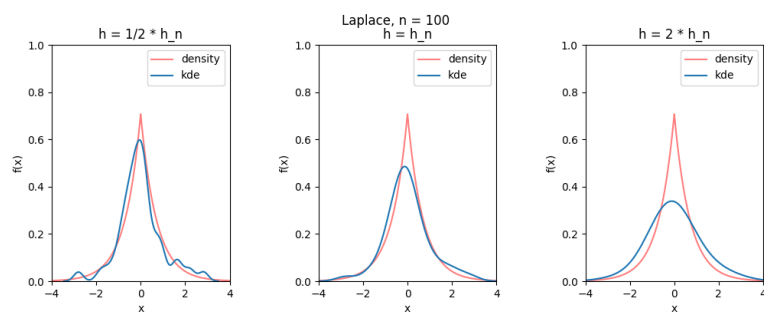


Рис. 24: Распределение Лапласа $n = 100$.

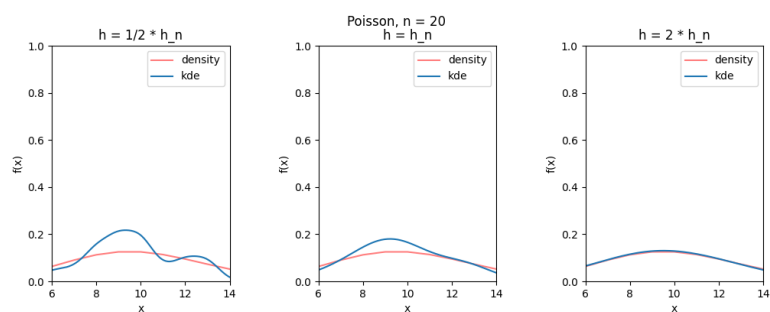


Рис. 25: Распределение Пуассона $n = 20$.

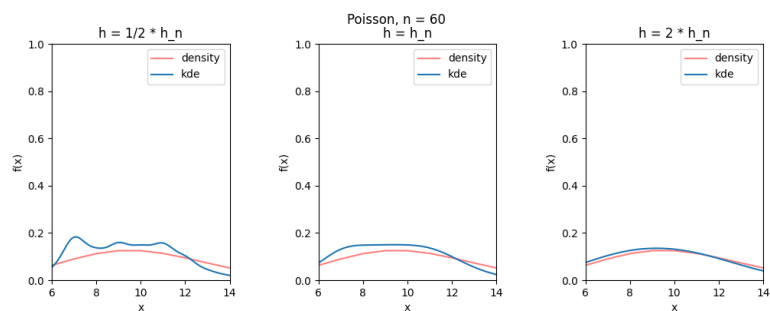


Рис. 26: Распределение Пуассона $n = 60$.

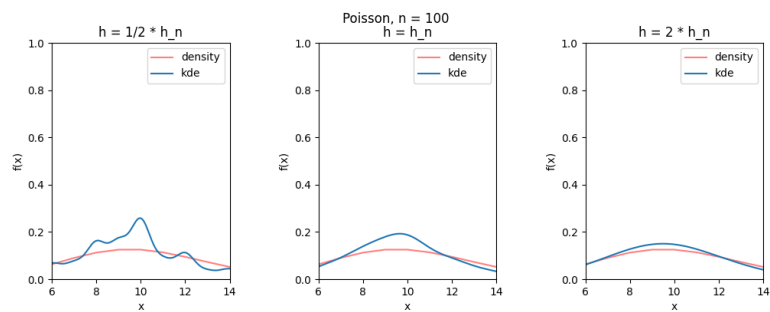


Рис. 27: Распределение Пуассона $n = 100$.

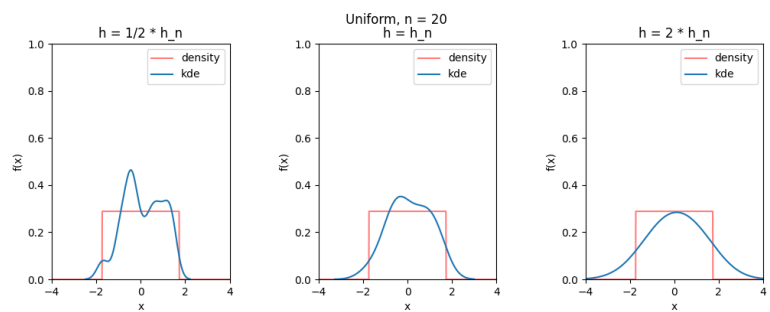


Рис. 28: Равномерное распределение $n = 20$.

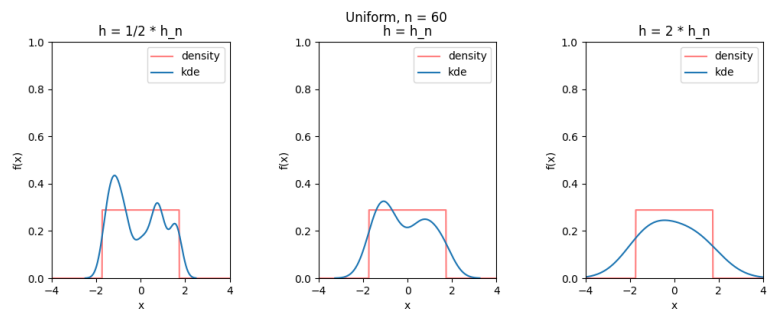


Рис. 29: Равномерное распределение $n = 60$.

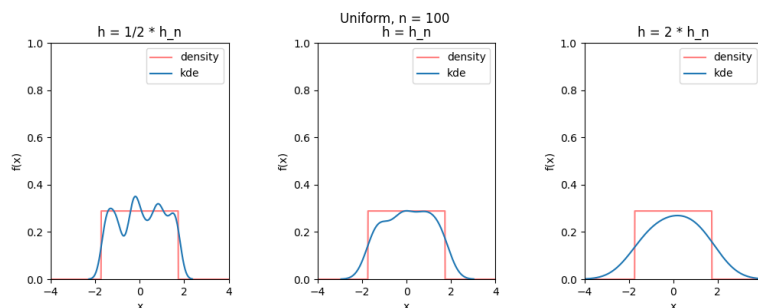


Рис. 30: Равномерное распределение $n = 100$.

5 Обсуждение

5.1 Гистограмма и график плотности распределения

По результатам проделанной работы можем сделать вывод о том, что чем больше выборка для каждого из распределений, тем ближе ее гистограмма к графику плотности вероятности того закона, по которому распределены величины сгенерированной выборки. Чем меньше выборка, тем менее она показательна — тем хуже по ней определяется характер распределения величины.

Также можно заметить, что максимумы гистограмм и плотностей распределения почти нигде не совпали. Также наблюдаются всплески гистограмм, что наиболее хорошо прослеживается на распределении Коши.

5.2 Характеристики положения и рассеяния

Исходя из данных, приведенных в таблицах, можно судить о том, что дисперсия характеристик рассеяния для распределения Коши является некой аномалией: значения слишком большие даже при увеличении размера выборки — понятно, что это результат выбросов, которые мы могли наблюдать в результатах предыдущего задания.

5.3 Доля и теоретическая вероятность выбросов

По данным, приведенным в таблице, можно сказать, что чем больше выборка, тем ближе доля выбросов будет к теоретической оценке. Снова доля выбросов для распределения Коши значительно выше, чем для остальных распределений. Равномерное распределение же в точности повторяет теоретическую оценку — выбросов мы не получали.

Боксплоты Тьюки действительно позволяют более наглядно и с меньшими усилиями оценивать важные характеристики распределений. Так, исходя

из полученных рисунков, наглядно видно то, что мы довольно трудоёмко анализировали в предыдущих частях.

5.4 Эмпирическая функция и ядерные оценки плотности распределения

Можем наблюдать на иллюстрациях с э. ф. р., что ступенчатая эмпирическая функция распределения тем лучше приближает функцию распределения реальной выборки, чем мощнее эта выборка. Заметим так же, что для распределения Пуассона и распределения Коши отклонение функций друг от друга наибольшее.

Рисунки, посвященные ядерным оценкам, иллюстрируют сближение ядерной оценки и функции плотности вероятности для всех h с ростом размера выборки. Для распределения Пуассона наиболее ярко видно, как сглаживает отклонения увеличение параметра сглаживания h .

В зависимости от особенностей распределений для их описания лучше подходят разные параметры h в ядерной оценке: для равномерного распределения и распределения Пуассона лучше подойдет параметр $h = 2h_n$, для распределения Лапласа — $h = \frac{h_n}{2}$, а для нормального и Коши — $h = h_n$. Такие значения дают вид ядерной оценки наиболее близкий к плотности, характерной данным распределениям.

Также можно увидеть, что чем больше коэффициент при параметре сглаживания \hat{h}_n , тем меньше изменений знака производной у аппроксимирующей функции, вплоть до того, что при $h = 2h_n$ функция становится унимодальной на рассматриваемом промежутке. Также видно, что при $h = 2h_n$ по полученным приближениям становится сложно сказать плотность вероятности какого распределения они должны повторять, так как они очень похожи между собой.

Литература

- [1] Histogram. URL: <https://en.wikipedia.org/wiki/Histogram>
- [2] Вероятностные разделы математики. Учебник для бакалавров технических направлений. // Под ред. Максимова Ю.Д. — Спб.: «Иван Федоров», 2001. — 592 с., илл.
- [3] Box plot. URL: https://en.wikipedia.org/wiki/Box_plot
- [4] Анатольев, Станислав (2009) «Непараметрическая регрессия», Квантиль, №7, стр. 37-52.