## ADPS 20L — Ćwiczenie 1

### Gabriel R.

### Zadanie nr 1

Dane prezentowane dla dwóch spółek notowanych na giełdzie:

- zmiany zamknięcia kursów zależne od daty
- porównanie histogramów zmian kursów zamkniecia
- pudełkowy wykres zmian kursów zamknięcia

#### **ROZWIĄZANIE:**

- Znajduję i pobieram dane historyczne spółek giełdowych z portalu http://www.bossa.pl (zakładka Notowania & wykresy; Dane do programów AT -> Metastock -> Wszystkie grupy GPW -> baza danych w formacie tekstowym -> mstall.zip) http://bossa.pl/pub/metastock/mstall.zip
- Zapisuję plik mstall.zip do katalogu ADPS/Lab1.

```
if(!file.exists('mstall.zip')) {
  download.file('http://bossa.pl/pub/metastock/mstock/mstall.zip','mstall.zip')
}
```

#### Wybieram spółkę nr 1: 4MOBILITY

• Rozpakowuję w tym katalogu dane spółki 4MOBILITY:

```
unzip('mstall.zip', '4MOBILITY.mst')
```

• Wczytuję dane z pliku 4MOBILITY.mst do środowiska R:

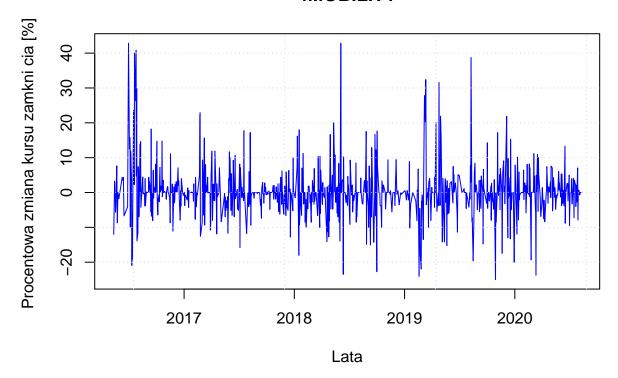
```
df_4MOBILITY = read.csv('4MOBILITY.mst')
```

• Zmieniam nazwy kolumn:

```
names(df_4MOBILITY) = c('ticker', 'date', 'open', 'high', 'low', 'close', 'vol')
```

• Wykres procentowych zmian kursu zamknięcia:

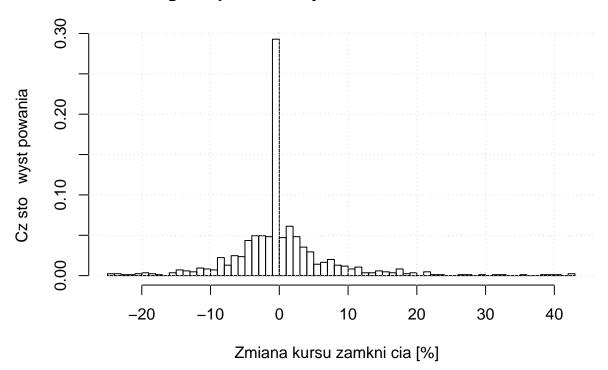
### **4MOBILITY**



• Histogram procentowych zmian kursu spółki 4MOBILITY:

```
hist(df_4MOBILITY$close_ch, breaks = 50, prob = T,
xlab = 'Zmiana kursu zamknięcia [%] ',
ylab = 'Częstość występowania',
main = 'Histogram procentowych zmian kursu 4MOBILITY' )
grid()
```

## Histogram procentowych zmian kursu 4MOBILITY



<sup>\*</sup>Przypisuję wartość close spółki 4MOBILITY do zmiennej SP1:

```
SP1 <- (df_4MOBILITY$close_ch= with(df_4MOBILITY, c(NA, 100*diff(close)/close[-length(close)])))
```

#### Wybieram spółkę nr 2: MBANK

• Rozpakowuję w tym katalogu dane spółki MBANK:

```
unzip('mstall.zip', 'MBANK.mst')
```

• Wczytuję dane z pliku MBANK.mst do środowiska R:

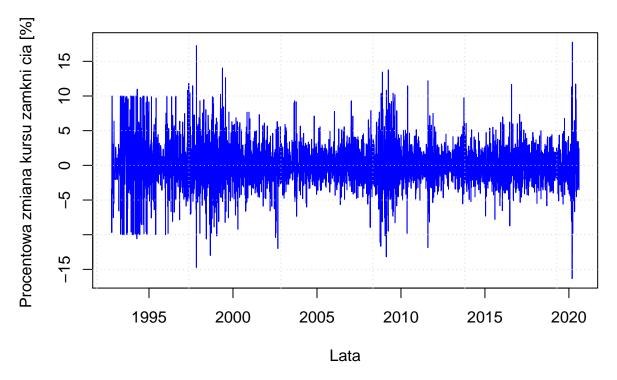
```
df_MBANK = read.csv('MBANK.mst')
```

• Zmieniam nazwy kolumn:

```
names(df_MBANK) = c('ticker', 'date', 'open', 'high', 'low', 'close', 'vol')
```

• Wykres procentowych zmian kursu zamknięcia:

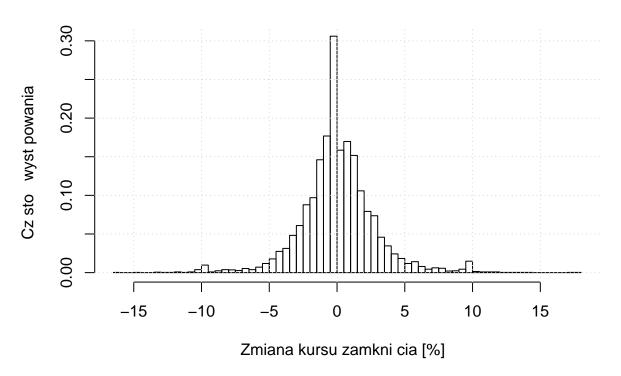
### **MBANK**



• Histogram procentowych zmian kursu spółki MBANK:

```
hist(df_MBANK$close_ch, breaks = 50, prob = T,
xlab = 'Zmiana kursu zamknięcia [%] ',
ylab = 'Częstość występowania',
main = 'Histogram procentowych zmian kursu MBANK' )
grid()
```

# Histogram procentowych zmian kursu MBANK



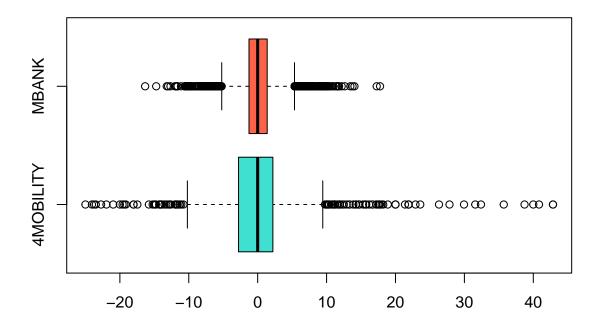
<sup>\*</sup>Przypisuję wartość close spółki MBANK do zmiennej SP2:

```
SP2 <- (df_MBANK$close_ch= with(df_MBANK, c(NA, 100*diff(close)/close[-length(close)])))
```

• Prównuję obie spółki na jednym wykresie w formie pudełkowej:

```
boxplot(SP1, SP2,
main = 'PORÓWNANIE',
horizontal = TRUE,
names = c("4MOBILITY", "MBANK"),
col = c('turquoise', 'tomato')
)
```

### **PORÓWNANIE**



### Zadanie nr 2

Wykresy katastrof lotniczych (zależnie od miesiąca, dnia, dni tygodnia). Prezentacja zmian dotyczących liczby osób, które przeżyły katastrofy.

#### **ROZWIĄZANIE:**

• Pobieram i zapisuję plik crashes.csv do katalogu ADPS/Lab1:

```
if(!file.exists('crashes.csv')) {
  download.file('http://elektron.elka.pw.edu.pl/~mrupniew/adps/crashes.csv', 'crashes.csv')
}
```

• Wczytuję dane do środowiska R:

```
kat = read.csv('crashes.csv')
```

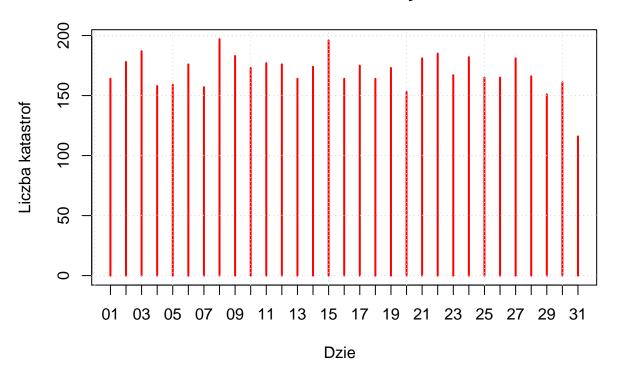
• Dodaję do danych kolumny z dniem:

```
kat$Day = strftime(as.Date(kat$Date, '%m/%d/%Y'), '%d')
```

• Prezentuję wykres liczby wypadków w danym dniu:

```
plot(table(kat$Day), type = 'h', col = 'red', xlab = 'Dzień',
ylab = 'Liczba katastrof', main = 'Liczba katastrof w danym dniu')
grid()
```

# Liczba katastrof w danym dniu



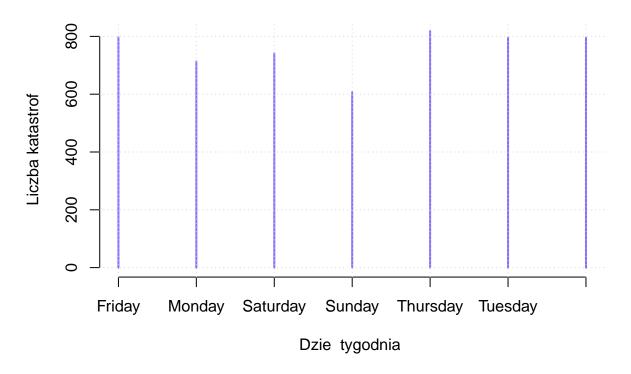
• Tworzę zmienną WeekDay. Dodaję do danych kolumny z dniem tygodnia:

```
kat$WeekDay <- strftime(as.Date(kat$Date, '%m/%d/%Y'), '%d')
kat$WeekDay = strftime(as.Date(kat$Date, '%m/%d/%Y'), '%A')</pre>
```

• Prezentuję wykres liczby wypadków w danym dniu tygodnia:

```
plot(table(kat$WeekDay), type = 'h', col = 'slateblue1', xlab = 'Dzień tygodnia',
ylab = 'Liczba katastrof', main = 'Liczba katastrof w danym dniu tygodnia')
grid()
```

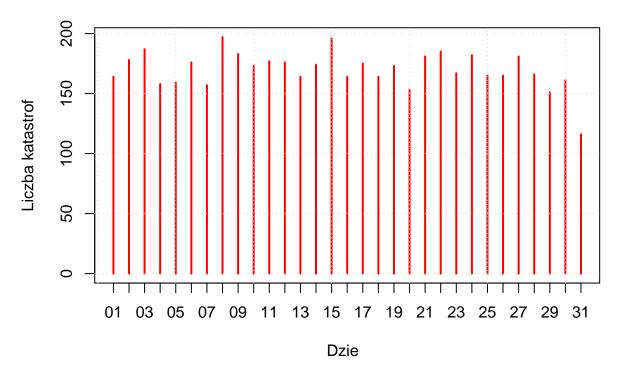
# Liczba katastrof w danym dniu tygodnia



• Prezentuję wykres liczby wypadków w danym dniu:

```
plot(table(kat$Day), type = 'h', col = 'red', xlab = 'Dzień',
ylab = 'Liczba katastrof', main = 'Liczba katastrof w danym dniu')
grid()
```

# Liczba katastrof w danym dniu



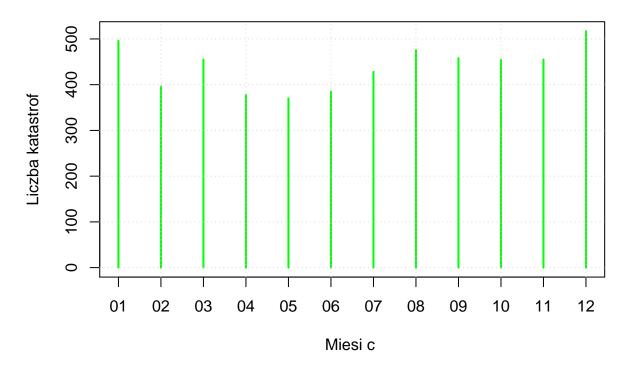
• Dodaję do danych kolumny z miesiącem:

```
kat$Month = strftime(as.Date(kat$Date, '%m/%d/%Y'), '%m')
```

• Prezentuję wykres liczby wypadków w danym miesiącu:

```
plot(table(kat$Month), type = 'h', col = 'green', xlab = 'Miesiąc',
ylab = 'Liczba katastrof', main = 'Liczba katastrof w danym miesiącu')
grid()
```

# Liczba katastrof w danym miesi cu



• Dodaję do danych kolumny z rokiem:

```
kat$Year = strftime(as.Date(kat$Date, '%m/%d/%Y'), '%Y')
```

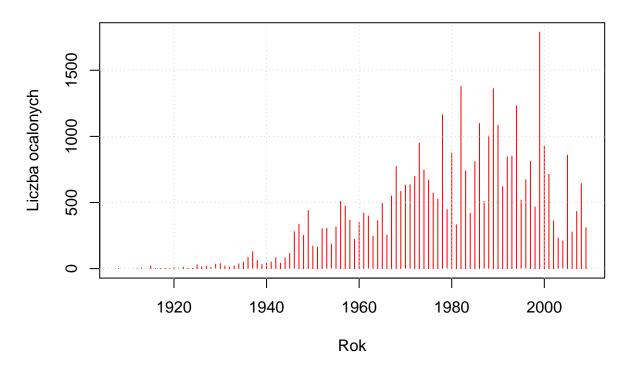
• Tworzę kategorię Saved i agreguję liczbę ocalałych osób:

```
kat$Saved = (kat$Aboard - kat$Fatalities)
Saved_agr = aggregate((Aboard-Fatalities) ~ Year, kat, FUN = sum)
Saved_perc = aggregate((Aboard-Fatalities)/Aboard ~ Year, kat, FUN = sum)
```

• Agreguję liczbę ocalonych osób w poszczególnych latach:

```
plot(Saved_agr, type = 'h', col = 'red', xlab = 'Rok',
ylab = 'Liczba ocalonych', main = 'Liczba osób ocaonych z katastrof w roku')
grid()
```

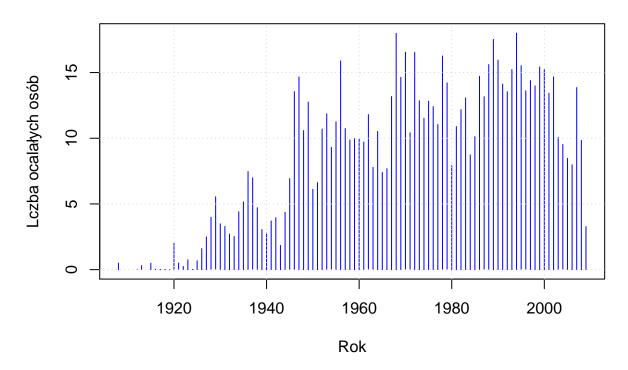
# Liczba osób ocaonych z katastrof w roku



• Wykres procentowych liczby osób ocalałych z katastrof w roku:

```
plot(Saved_perc, type = 'h', col = 'blue', xlab = 'Rok',
ylab = 'Lczba ocalałych osób', main = 'Liczba ocalałych osób w roku')
grid()
```

# Liczba ocalałych osób w roku



### Zadanie nr 3

Próby losowe złożone z M=1000 próbek dla dwoch różnych zestawów parametru rozkładu dwumianowego Prezentacja empirycznych i teorytycznych dystrybuant.

### ROZWIĄZANIE

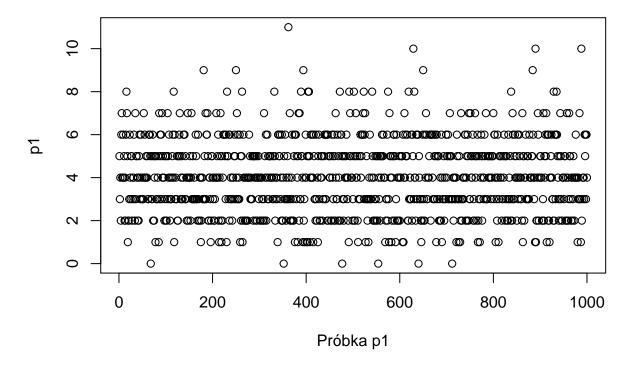
• M = 1000 próbek, rozkłady dwumianowe Binom(20, 0.2) i Binom(20, 0.8):

```
p1 = rbinom(1000, size = 20, prob = 0.2)
p2 = rbinom(1000, size = 20, prob = 0.8)
```

• Wykres pierwszej próbki - p1:

```
plot(p1, main = 'Wartość próbki', xlab = 'Próbka p1')
```

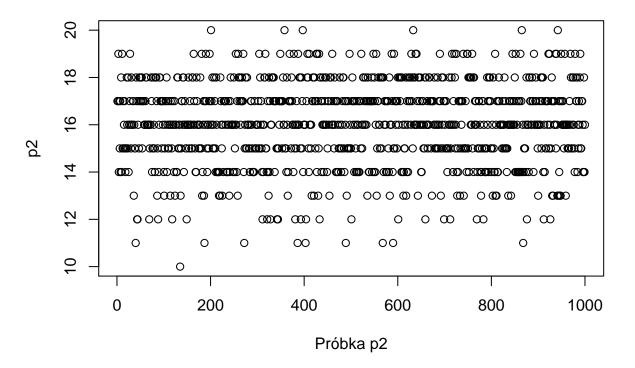
# Warto próbki



• Wykres drugiej próbki - p2:

```
plot(p2, main = 'Wartość próbki', xlab = 'Próbka p2')
```

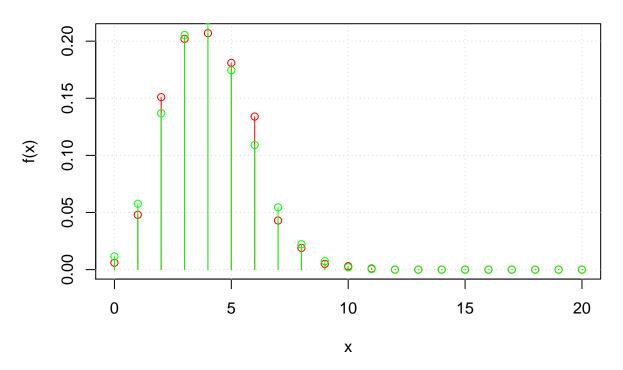
## Warto próbki



• Funkncja prawdopodobieństwa dla próbki p1:

```
Arg = 0:20
M = 1000
Arg = 0:20
Freq = as.numeric(table(factor(p1, levels = Arg))) / M
plot(Freq ~ Arg, type = 'h', col = 'red', xlab = 'x',
ylab = 'f(x)',
main = paste0('Funkcja prawdopodobieństwa dla p1'))
grid()
points(Freq ~ Arg, col = 'red')
lines(dbinom(Arg,20,0.2) ~ Arg, type = 'h', col = 'green', xlab = 'wartość x',
ylab = 'f(x)')
points(dbinom(Arg,20,0.2) ~ Arg, col = 'green')
```

# Funkcja prawdopodobie stwa dla p1

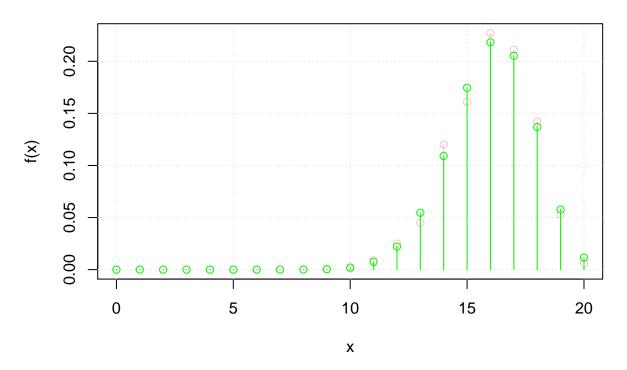


• Funkncja prawdopodobieństwa dla próbki p2:

```
Arg = 0:20
M = 1000
Freq = as.numeric(table(factor(p2, levels = Arg))) / M
plot(Freq ~ Arg, type = 'h', col = 'pink', xlab = 'x', ylab = 'f(x)',
main = paste0('Funkcja prawdopodobieństwa dla p2'))
grid()
points(Freq ~ Arg, col = 'pink')

lines(dbinom(Arg,20,0.8) ~ Arg, type = 'h', col = 'green', xlab = 'wartość x',
ylab = 'f(x)')
points(dbinom(Arg,20,0.8) ~ Arg, col = 'green')
```

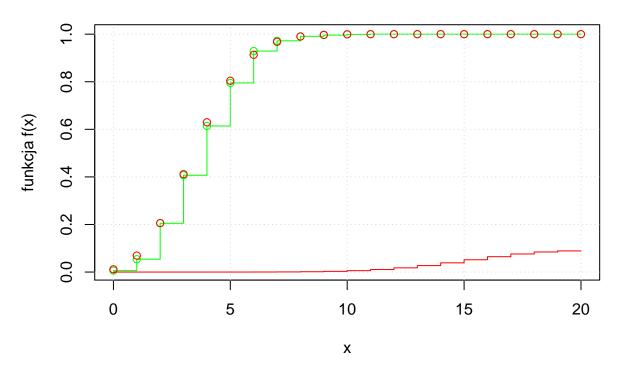
# Funkcja prawdopodobie stwa dla p2



• Wyznaczam dystrybuantę teorytyczną i empiryczną dla próbki p1:

```
Arg = 0:20
Freq = as.numeric(table(factor(p1, levels = Arg))) / M
plot(cumsum(Freq) ~ Arg, type = 's', col = 'green', xlab = 'x',
ylab = 'funkcja f(x)',
main = 'Dystrybuanta empiryczna i teorytyczna dla próbki p1')
grid()
points(cumsum(Freq) ~ Arg, col = 'green')
lines(dpois(Arg,20,0.2) ~ Arg, type = 's', col = 'red',
xlab = 'wartość x', ylab = 'funkcja f(x)')
points(pbinom(Arg,20,0.2) ~ Arg, col = 'red')
```

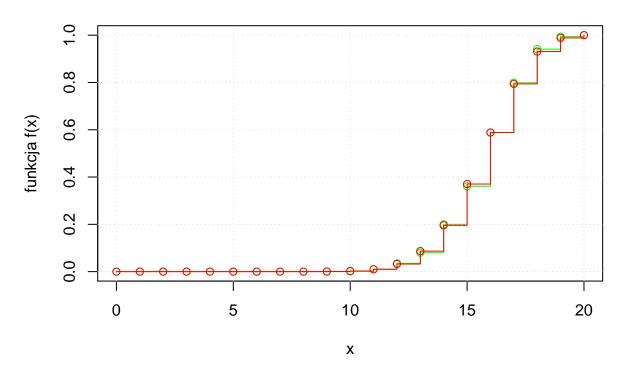
# Dystrybuanta empiryczna i teorytyczna dla próbki p1



• Wyznaczam dystrybuantę teorytyczną i empiryczną dla próbki p2:

```
Arg = 0:20
Freq = as.numeric(table(factor(p2, levels = Arg))) / M
plot(cumsum(Freq) ~ Arg, type = 's', col = 'green', xlab = 'x',
ylab = 'funkcja f(x)',
main = 'Dystrybuanta empiryczna i teorytyczna dla próbki p2')
grid()
points(cumsum(Freq) ~ Arg, col = 'green')
lines(pbinom(Arg,20,0.8) ~ Arg, type = 's', col = 'red',
xlab = 'wartość x', ylab = 'funkcja f(x)')
points(pbinom(Arg,20,0.8) ~ Arg, col = 'red')
```

## Dystrybuanta empiryczna i teorytyczna dla próbki p2



### Zadanie nr 4

Próby losowe dla rozkładu dwumianowego złożone z binom<br/>(20, 0.8), M = 100, M = 1000 oraz M = 10000. Obliczenie wartości średnich oraz wriancji. Empiryczne oraz teorytyczne: - dystrybu<br/>anty - funkcje prawdopodobieństwa

#### ROZWIĄZANIE

- Próba losowa dla M = 100 próbek

```
p3 = rbinom(100, size = 20, prob = 0.8)
```

- Próba losowa dla M=1000 próbek

```
p4 = rbinom(1000, size = 20, prob = 0.8)
```

- Próba losowa dla M = 10000 próbek

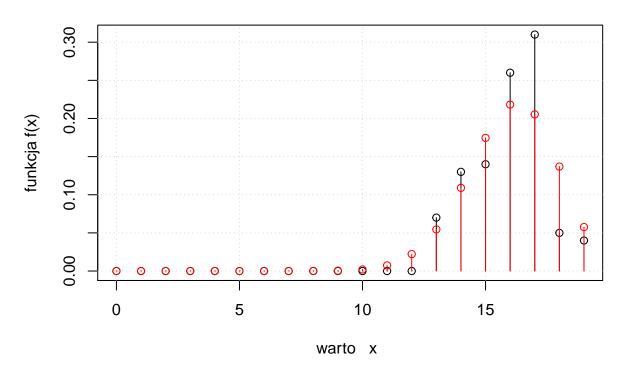
```
p5 = rbinom(10000, size = 20, prob = 0.8)
```

• Funckja prawdopodobieństwa (empiryczna i teorytyczna) M = 100 dla próbki p3:

```
M=100
Arg = 0:max(p3)
Freq = as.numeric(table(factor(p3, levels = Arg))) / M
plot(Freq ~ Arg, type = 'h', col = 'black', xlab = 'wartość x',
```

```
ylab = 'funkcja f(x)',
main = 'Funkcje prawdopodobieństwa dla M = 100 próbki p3 ')
grid()
points(Freq ~ Arg, col = 'black')
lines(dbinom(Arg, size = 20, prob = 0.8) ~ Arg, type = 'h', col = 'red',
xlab = 'wartość x', ylab = 'funkcja f(x)')
points(dbinom(Arg, size = 20, prob = 0.8) ~ Arg, col = 'red')
```

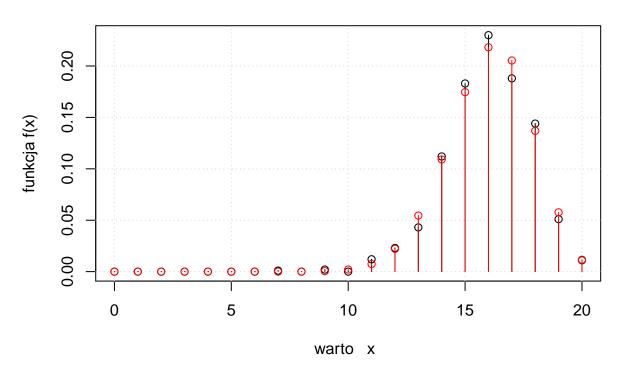
### Funkcje prawdopodobie stwa dla M = 100 próbki p3



- Funckja prawdopodobieństwa (empiryczna i teorytyczna) M=1000 dla próbki p3:

```
M=1000
Arg = 0:max(p4)
Freq = as.numeric(table(factor(p4, levels = Arg))) / M
plot(Freq ~ Arg, type = 'h', col = 'black', xlab = 'wartość x',
ylab = 'funkcja f(x)',
main = 'Funkcje prawdopodobieństwa dla M = 1000 próbki p4 ')
grid()
points(Freq ~ Arg, col = 'black')
lines(dbinom(Arg, size = 20, prob = 0.8) ~ Arg, type = 'h', col = 'red',
xlab = 'wartość x', ylab = 'funkcja f(x)')
points(dbinom(Arg, size = 20, prob = 0.8) ~ Arg, col = 'red')
```

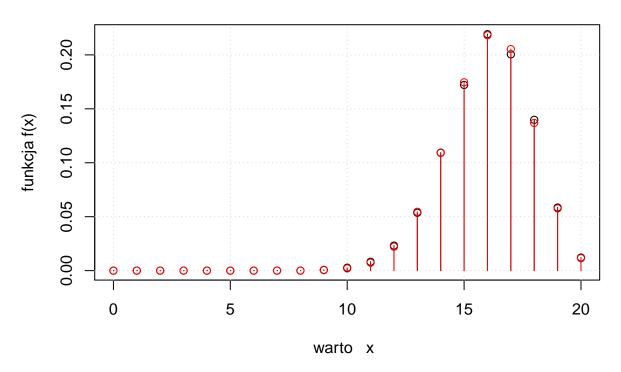
## Funkcje prawdopodobie stwa dla M = 1000 próbki p4



• Funckja prawdopodobieństwa (empiryczna i teorytyczna) M = 100 dla próbki p3:

```
M=10000
Arg = 0:max(p5)
Freq = as.numeric(table(factor(p5, levels = Arg))) / M
plot(Freq ~ Arg, type = 'h', col = 'black', xlab = 'wartość x',
ylab = 'funkcja f(x)',
main = 'Funkcje prawdopodobieństwa dla M = 10000 próbki p5 ')
grid()
points(Freq ~ Arg, col = 'black')
lines(dbinom(Arg, size = 20, prob = 0.8) ~ Arg, type = 'h', col = 'red',
xlab = 'wartość x', ylab = 'funkcja f(x)')
points(dbinom(Arg, size = 20, prob = 0.8) ~ Arg, col = 'red')
```

# Funkcje prawdopodobie stwa dla M = 10000 próbki p5

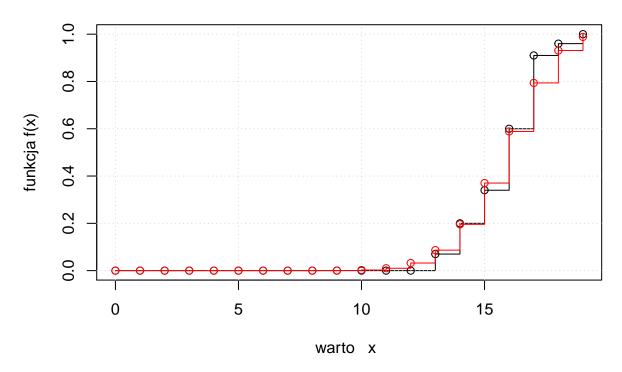


• Dystrybuanta (empiryczna i teorytyczna) M = 100 dla próbki p3:

```
M = 100
Arg = 0:max(p3)
Freq = as.numeric(table(factor(p3, levels = Arg))) / M
plot(cumsum(Freq) ~ Arg, type = 's', col = 'black',
    xlab = 'wartość x', ylab = 'funkcja f(x)',
    main = 'Dystrybuanta dla M = 100 próbki p3')
grid()
points(cumsum(Freq) ~ Arg, col = 'black')

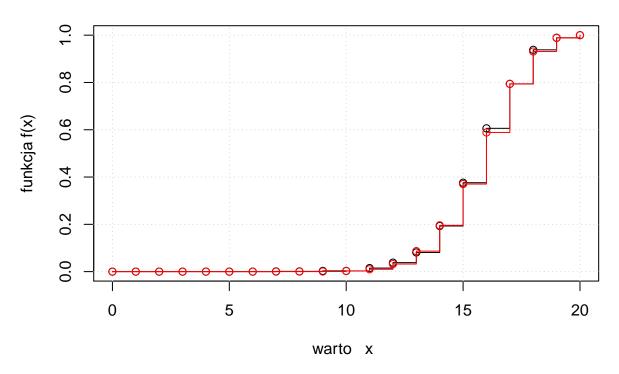
lines(pbinom(Arg, size = 20, prob = 0.8) ~ Arg, type = 's', col = 'red',
    xlab = 'wartość x', ylab = 'funkcja f(x)')
points(pbinom(Arg, size = 20, prob = 0.8) ~ Arg, col = 'red')
```

## Dystrybuanta dla M = 100 próbki p3



• Dystrybuanta (empiryczna i teorytyczna) M = 100 dla próbki p4:

## Dystrybuanta dla M = 1000 próbki p4

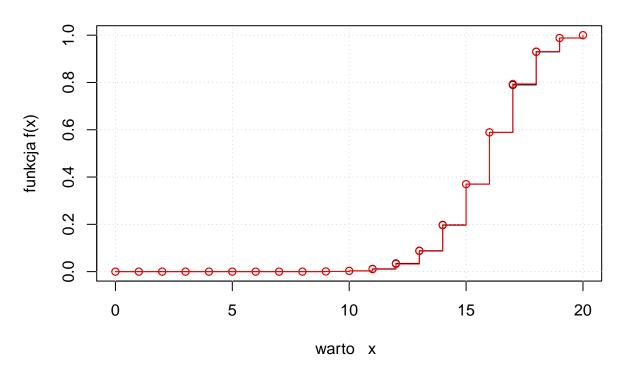


• Dystrybuanta (empiryczna i teorytyczna) M = 100 dla próbki p5:

```
M = 10000
Arg = 0:max(p5)
Freq = as.numeric(table(factor(p5, levels = Arg))) / M
plot(cumsum(Freq) ~ Arg, type = 's', col = 'black',
xlab = 'wartość x', ylab = 'funkcja f(x)',
main = 'Dystrybuanta dla M = 10000 próbki p5')
grid()
points(cumsum(Freq) ~ Arg, col = 'black')

lines(pbinom(Arg, size = 20, prob = 0.8) ~ Arg, type = 's', col = 'red',
xlab = 'wartość x', ylab = 'funkcja f(x)')
points(pbinom(Arg, size = 20, prob = 0.8) ~ Arg, col = 'red')
```

## Dystrybuanta dla M = 10000 próbki p5



### AD. 3

\*Obliczenia dla wartości średniej z prób p3, p4 i p5:

```
c(100,1000,10000)->M
c(mean(p3), mean(p4), mean(p5))->wartosc_oczekiwana
c(var(p3), var(p4), var(p5))->wariancja
data.frame(M,wartosc_oczekiwana,wariancja)->parametry
print(parametry)
```

- Obliczam wartości teoretycznymi dla rozkładu Binom(20, 0.8):
- 1) wartość oczekiwana: EX = n \* p, stąd: EX = 20 \* 0.8 = 16
- 2) wariancja: VarX = n \* p \* (1 p), stąd VarX = 20 \* 0.8 \* 0.2 = 3.2
- Wniosek: Im większa wartość M tym wynik wartości empirycznej bardziej zbiżony do wartości teorytycznej.

### Zadanie nr 5

K prób losowych złożonych z M=100 z rozkładu binom(20, 0.8) (a także M=1000, M=10000). Obliczenie wartości średnich i wariancji.

#### ROZWIĄZANIE

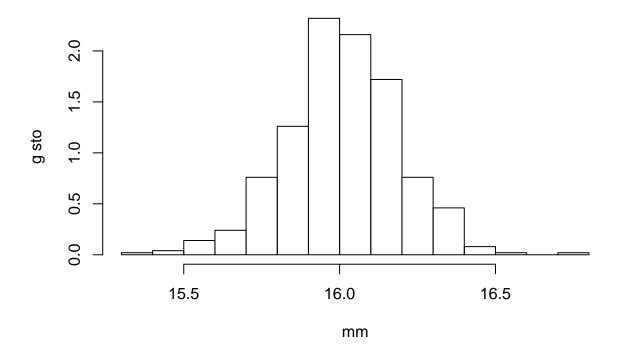
• Generuję K = 500 prób losowych złożonych z M = 100 próbek Binom(20, 0.8), w tym wartość średnią i wariancję dla wszysktkich realizacji:

```
M = 100
mm = replicate(500, mean(rbinom(M, 20, 0.8)))
mv = replicate (500, var(rbinom(M, 20, 0.8)))
```

• Tworzę histogram dla wartości średniej:

```
hist(mm, breaks = 20, prob = T, ylab = 'gęstość',
main = 'histogram wartości średniej z 500 prób dla M = 100')
```

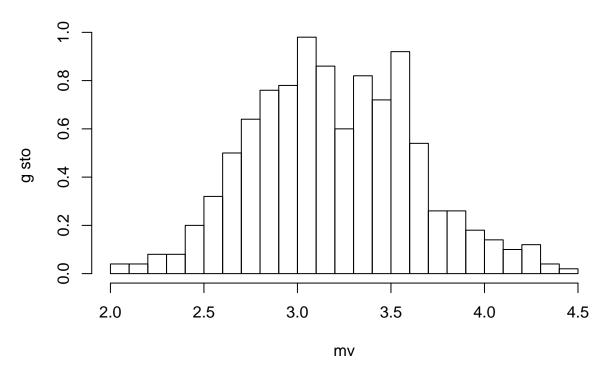
## histogram warto ci redniej z 500 prób dla M = 100



• Tworzę histogram dla wariancji:

```
hist(mv, breaks = 20, prob = T, ylab = 'gęstość',
main = 'histogram wartości wariancji z 500 prób dla M = 100')
```

# histogram warto ci wariancji z 500 prób dla M = 100



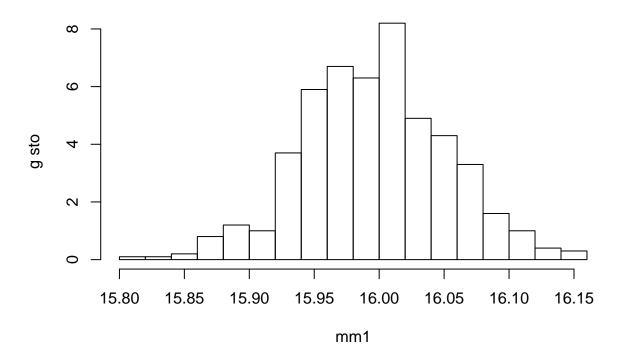
• Generuję K=500 prób losowych złożonych z M=1000 próbek Binom(20, 0.8), w tym wartość średnią i wariancję dla wszysktkich realizacji:

```
M = 1000
mm1 = replicate(500, mean(rbinom(M, 20, 0.8)))
mv1 = replicate (500, var(rbinom(M, 20, 0.8)))
```

• Tworzę histogram dla wartości średniej:

```
hist(mm1, breaks = 20, prob = T, ylab = 'gęstość',
main = 'histogram wartości średniej z 500 prób dla M = 1000')
```

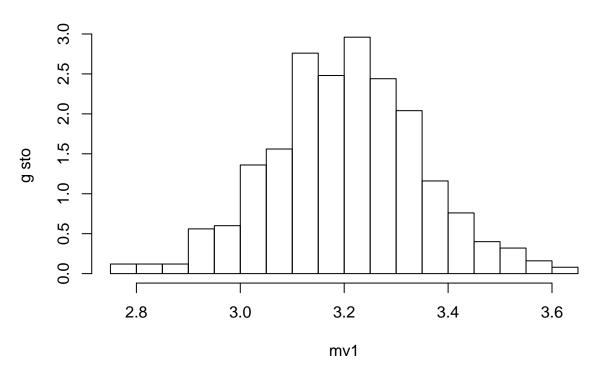
# histogram warto ci redniej z 500 prób dla M = 1000



• Tworzę histogram dla wariancji:

```
hist(mv1, breaks = 20, prob = T, ylab = 'gestość',
main = 'histogram wartości wariancji z 500 prób dla M = 1000')
```

# histogram warto ci wariancji z 500 prób dla M = 1000



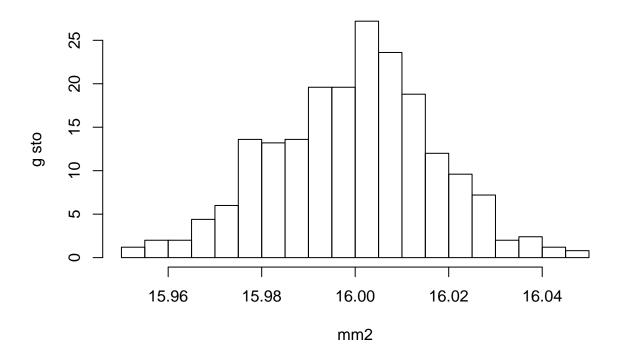
• Generuję K=500 prób losowych złożonych z M=1000 próbek Binom(20, 0.8), w tym wartość średnią i wariancję dla wszysktkich realizacji:

```
M = 10000
mm2 = replicate(500, mean(rbinom(M, 20, 0.8)))
mv2 = replicate (500, var(rbinom(M, 20, 0.8)))
```

• Tworzę histogram dla wartości średniej:

```
hist(mm2, breaks = 20, prob = T, ylab = 'gęstość',
main = 'histogram wartości średniej z 500 prób dla M = 10000')
```

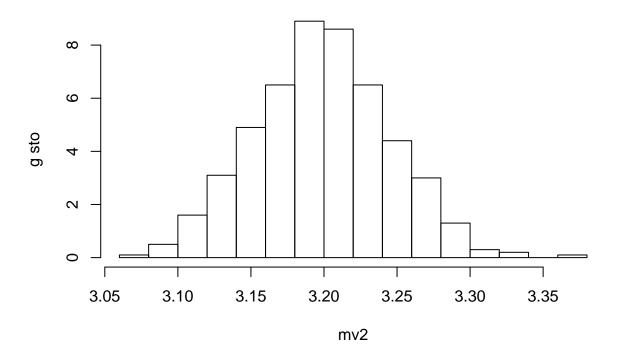
# histogram warto ci redniej z 500 prób dla M = 10000



• Tworzę histogram dla wariancji:

```
hist(mv2, breaks = 20, prob = T, ylab = 'gęstość',
main = 'histogram wartości wariancji z 500 prób dla M = 10000')
```

## histogram warto ci wariancji z 500 prób dla M = 10000



• Obliczenia (podsumowanie):

```
sredniaMM <- mean(mm)
wariancjaMV <- var(mv)

sredniaMM1 <- mean(mm1)
wariancjaMV1 <- var(mv1)

sredniaMM2 <- mean(mm2)
wariancjaMV2 <- var(mv2)

srednia <- c(sredniaMM, sredniaMM1, sredniaMM2)
wariancja <- c(wariancjaMV, wariancjaMV1, wariancjaMV2)

M = c(100,1000,10000)

PODSUMOWANIE <- data.frame(M, srednia, wariancja)
print(PODSUMOWANIE)</pre>
```

- - Jak zmieniają się histogramy ze zmianą liczby próbek:
  - a) M = 100 dla średniej (mm):

```
skala x ma rozpiętość od 15.6 fo 16.4 (różnica: 0.8)
                     skala y ma rozpiętość od 0.0 do 2.0 (różnica: 2.0)
dla wariancji (mv):
                skala x ma rozpiętość od 2.0 do 4.5 (różnica: 2.5)
                 skala y ma rozpiętośc od 0.0. do 0.8 (różnica: 0.8)
  b) M = 1000 \text{ dla średniej (mm1)}:
                  skala x ma rozpiętość od 15.8 fo 16.1 (różnica: 0.3)
                     skala y ma rozpiętość od 0.0 do 7.0 (różnica: 7.0)
dla wariancji (mv1):
                  skala x ma rozpiętość od 2.8 do 3.6 (różnica: 0.8)
                    skala y ma rozpiętośc od 0.0. do 2.5 (różnica: 2.5)
  c) M = 10000 dla średniej (mm2):
                  skala x ma rozpiętość od 15.94 fo 16.06 (różnica: 0.12)
                     skala y ma rozpiętość od 0.0 do 20.0 (różnica: 20.0)
dla wariancji (mv2):
                   skala x ma rozpiętość od 3.10 do 3.35 (różnica: 0.25)
                   skala y ma rozpiętośc od 0.0 do 10.0 (różnica: 10.0)
M = c(100, 1000, 10000)
srednie_podsumowanie <- c(0.8, 0.3, 0.12)</pre>
srednie_zageszczenie <- c(2.0, 7.0, 20.0)</pre>
wariancja_podsumowanie <- c(2.5, 0.8, 0.25)
wariancja_zageszczenie <- c(0.8, 2.5, 10.0)
PODSUMOWANIE_2 <- data.frame(M, srednie_podsumowanie, srednie_zageszczenie, wariancja_podsumowanie, war
print(PODSUMOWANIE_2)
         M srednie_podsumowanie srednie_zageszczenie wariancja_podsumowanie
## 1
       100
                            0.80
                                                     2
                                                                          2.50
                                                     7
## 2 1000
                            0.30
                                                                          0.80
## 3 10000
                                                    20
                                                                          0.25
                            0.12
##
     wariancja_zageszczenie
## 1
                         0.8
                         2.5
## 2
```

- Wnioski: Zarówno w przypadku średniej jak i wariancji wraz ze zwrostem wartości M:
- wartości przedziałów na osi X maleją,

## 3

• wartości przedziałów na osi Y (gęśtości) rosną.

10.0