

Homework 3

姓名: 方嘉聪 学号: 2200017849 得分: 98

Problem 1. 表 1 是 2016 年美国大选后 CNN 网站发布的出口民调 (exit polls) 的数据统计. 出口民调是对一部分已投票选民所做的问卷调查, 调查内容包括选民的社会人口特征、政治态度和投票结果等信息, 出口民调的数据可以用来预测总体或某些群体的选民的投票结果, 也可以用于分析选民特征与投票的关系. 比如, 根据出口民调的数据, 我们可以推断 2016 年美国大选中什么特征的选民会支持希拉里·克林顿 (Clinton), 什么特征的选民会支持唐纳德·特朗普 (Trump).

表 1: 选民受教育程度与投票对象 (%) ($N = 24558$)

	Clinton %	Trump %	其他/不回答%
高中或以下 high school or less (18%)	46	51	3
大学未毕业 some college (32%)	43	52	6
大学毕业 college graduate (32%)	49	44	7
研究生 postgraduate (18%)	58	37	5

根据表 1, 请回答以下问题:

- (1) 简要陈述表 1 所描述的统计关系, 并指出这组关系中暗含的自变量是什么?
- (2) 将表 1 还原为列联频次表, 要求这张表仅统计支持了 Clinton 或 Trump 的受访选民 (即排除掉不回答或者支持“其他”的受访者), 表中应展示行和列的合计频次. (提示: 如遇人数非整数的情况, 请四舍五入保留整数)
- (3) 如果以受教育程度反映选民的社会经济地位, 基于 (2) 构造的列联表, 请检验美国选民在支持 Clinton 和 Trump 上是否存在精英选民和底层选民之间的差异? 针对这一研究问题, 写出原假设和备择假设、期望频次分布、卡方值、自由度和统计显著性检验的结果 (设显著性水平为 0.01).

Solution. (1) 表 1 描述了 2016 年美国大选选民受教育程度与投票对象的关系. 暗含的自变量是选民受教育程度. 注意: 表格中已经给出数据, 我们需要明确地给出自变量和因变量之间具体存在什么关系, 正/负相关, 或什么倾向.

(2) 列联频次表见表 2 (表中数据保留整数).

(3) 为检验题述问题, 原假设与备择假设如下:

H_0 : 美国选民在支持 Clinton 和 Trump 上 不存在 精英选民和底层选民之间的差异

H_1 : 美国选民在支持 Clinton 和 Trump 上 存在 精英选民和底层选民之间的差异

期望联合频次分布表见表 3.

表 2: 选民受教育程度与投票对象的列联频次表 (人), 美国总统大选, 2016

	Clinton	Trump	合计
高中或以下	2033	2254	4287
high school or less			
大学未毕业	3379	4086	7465
some college			
大学毕业	3851	3458	7309
college graduate			
研究生	2564	1636	4200
postgraduate			
合计	11827	11434	23261

表 3: 选民受教育程度与投票对象的期望频次分布表 (人), 美国总统大选, 2016

	Clinton	Trump	合计
高中或以下	2180	2107	4287
high school or less			
大学未毕业	3796	3670	7465
some college			
大学毕业	3716	3593	7309
college graduate			
研究生	2135	2065	4200
postgraduate			
合计	11827	11434	23261

那么

$$\chi^2 = \sum_i \sum_j \frac{(F_{ij} - E_{ij})^2}{E_{ij}} \approx 298.17$$
$$df = (r - 1)(c - 1) = 3, \implies \chi^2_{0.01}(3) = 11.345 < \chi^2$$

故拒绝原假设, 即在显著性水平 0.01 下, 美国选民在支持 Clinton 和 Trump 上存在精英选民和底层选民之间的显著差异.

<

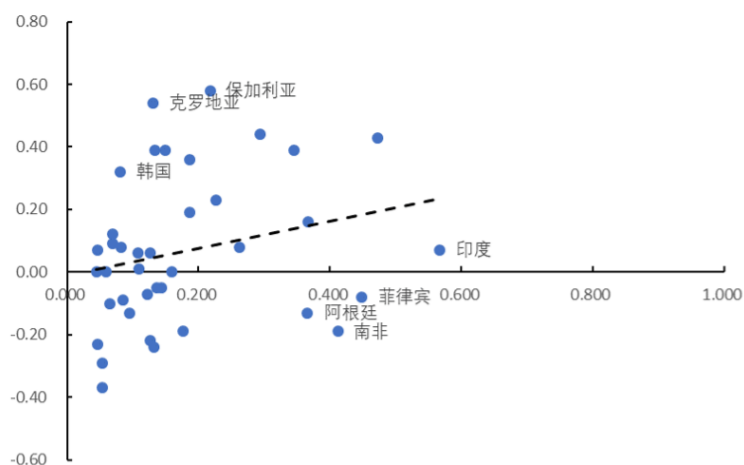
Problem 2. 工作-家庭冲突 (work-family conflict) 是指工作与家庭生活之间不协调造成的角色冲突和压力, 包括工作对家庭的干扰 (work Interfering family, WIF) 和家庭对工作的干扰 (family Interfering work, FIW). 个体承受的 WIF 或 FIW 水平均可通过量表测量. 过往研究发现, 女性比男性承受了更高的工作-家庭冲突水平. 以往研究还发现, 工作-家庭冲突水平不仅与个体或家庭特征有关, 还可能与社会环境中的性别不平等程度有关. 在国家/地区层次, 衡量一国/地区性别不平等状况通常使用

联合国开发计划署 (UNDP) 的性别不平等指数 (Gender Inequality Index, 简称 GII) 这一综合性指标, 该指标取值从 0 到 1, 得分越高表示该国家/地区性别不平等程度越高 (即女性相对于男性处于不利地位).

现有一项研究试图探讨和检验国家/地区层次的性别平等环境与女性承受的工作-家庭冲突水平之间的关系. 表 2(见 excel 数据) 是参加 2012 年国际社会调查项目 (ISSP) 的 39 个国家的 GII 得分 (设为 X) 和根据各国 ISSP 调查数据分别汇总的女性平均 WIF 评分的标准化得分 (设为 Y).

根据表 2 数据, 请回答:

- (1) 分布别计算 $\sum X, \sum Y, \sum XY, \sum X^2, \sum Y^2$.
- (2) 根据 (1) 分别计算 X, Y 的均值和方差, 以及两者的协方差 $\text{Cov}(X, Y)$.
- (3) 计算及解读两者的相关系数和判定系数, 并检验总体中国家/地区性别不平等指数与女性工作-冲突平均水平之间是否存在正相关 (设显著性水平为 0.05).
- (4) 根据题意, 以 GII 得分和女性 WIF 得分两个变量建立一元线性回归方程, 估计该方程的回归系数, 以公式形式表达.
- (5) 将 GII 得分按照 $[0, 0.1)$ $[0.1, 0.2)$ $[0.2, 1]$ 分成三组, 分别表示国家/地区性别不平等程度的低、中、高三个水平, 计算各水平组别的样本数、女性 WIF 得分的均值和方差, 以表格形式报告.
- (6) 根据 (5), 用方差分析检验性别不平等水平为低、中、高三个组别的国家/地区是否在女性工作-家庭冲突水平上存在显著差异 (设显著性水平为 0.05).
- (7) 图 1 是 39 个国家 GII 指数 (横轴) 和女性 WIF 平均得分 (纵轴) 的散点图, 根据上述一系列分析及结合该散点图, 简要总结研究发现, 并尝试评论为何这两个变量之间的判定系数较小 (提示: 言多必失, 意思表达清楚即可)



注: 每个散点代表一个国家, 有少数国家标记了国家名称, 其余未标记. 虚线为估计的回归直线

图 1: 各国 GII 和女性平均 WIF 得分的散点图及回归直线

Solution. (1) 计算结果如下:

$$\sum X = 6.96, \quad \sum Y = 2.63, \quad \sum XY = 0.76, \quad \sum X^2 = 1.93, \quad \sum Y^2 = 2.38.$$

(2) 以下计算均为为样本数值, $n = 39$:

$$\begin{aligned}\bar{X} &= \frac{\sum X}{n} = 0.18, & S_X^2 &= \frac{1}{n-1} \left(\sum X^2 - n\bar{X}^2 \right) = 0.02, \\ \bar{Y} &= \frac{\sum Y}{n} = 0.07, & S_Y^2 &= \frac{1}{n-1} \left(\sum Y^2 - n\bar{Y}^2 \right) = 0.06, \\ \text{Cov}(X, Y) &= \frac{1}{n-1} \sum (X_i - \bar{X})(Y_i - \bar{Y}) = 0.01.\end{aligned}$$

(3) 相关系数和判定系数计算如下:

$$r = \frac{\text{Cov}(X, Y)}{\sqrt{S_X^2 S_Y^2}} = 0.24, \quad r^2 = 0.06.$$

(注意: 要具体给出解释, 认真审题!) 说明国家/地区性别不平等指数与女性工作-冲突平均水平两个变量之间可以相互解释 6% 的方差. 在总体中是否存在正相关, 需进一步检验, 原假设与备择假设如下:

H_0 : 总体中国家/地区性别不平等指数与女性工作-冲突平均水平之间 不存在 正相关(这里应该是相关)

H_1 : 总体中国家/地区性别不平等指数与女性工作-冲突平均水平之间 存在 正相关

计算 t 统计量如下:

$$t = r\sqrt{\frac{n-2}{1-r^2}} = 1.50, \quad \text{df} = n-2 = 37 \implies t_{0.05}(37) = 1.687 > t.$$

故在显著性水平 0.05 下, 不能拒绝原假设, 即在显著性水平 0.05 下, 总体中国家/地区性别不平等指数与女性工作-冲突平均水平之间不存在正相关.

(4) 计算结果如下

$$b_1 = \frac{\text{Cov}(X, Y)}{S_X^2} = 0.43, \quad b_0 = \bar{Y} - b_1\bar{X} = -0.01, \quad \hat{Y} = b_0 + b_1X = -0.01 + 0.43X.$$

(5) 见表 4.

表 4: 国家/地区性别不平等程度的低、中、高水平样本分布及女性 WIF 得分的均值和方差

国家/地区性别不平等程度	样本数 (个)	WIF 均值	WIF 方差
低水平, $\text{GII} \in [0, 0.1)$	13	-0.04	0.04
中水平, $\text{GII} \in [0.1, 0.2)$	15	0.08	0.06
高水平, $\text{GII} \in [0.2, 1]$	11	0.18	0.07

(6) 原假设与备择假设如下:

H_0 : 性别不平等水平这三个组别的国家/地区在女性工作-家庭冲突水平上 不存在 显著差异

H_1 : 性别不平等水平这三个组别的国家/地区在女性工作-家庭冲突水平上 存在 显著差异

我们先来计算 BSS 和 WSS:

$$\text{TSS} = 2.20, \quad \text{BSS} = \sum_{g=1}^3 n_g(\bar{y}_g - \bar{Y})^2 = 0.29, \quad \text{WSS} = \sum_{g=1}^3 (n_g - 1)s_g^2 = 1.91.$$

进而计算 F 统计量:

$$F = \frac{BSS/(G-1)}{WSS/(n-G)} = 2.76 < F_{0.05}(2, 36) = 3.259.$$

故在显著性水平 0.05 下, 不能拒绝原假设, 即在显著性水平 0.05 下, 性别不平等水平为低、中、高三个组别的国家/地区是否在女性工作-家庭冲突水平上不存在显著差异.

- (7) 总结: 从上述计算可知, 在抽取的 39 个国家样本中, 国家/地区层次的性别平等环境与女性承受的工作-家庭冲突水平之间的存在较弱线性正相关关系. 但通过假设检验与方差分析的结果, 二者的这种线性正相关性在总体中并不显著.

判定系数较小的原因猜测: 观察散点图, 发现大部分数据点均偏离回归直线, 说明我们得到的这一回归方程并不能很好地解释数据的变异 (欠拟合), 在总体上的线性正相关性不显著, 对应的判定系数较小.

女性工作-家庭冲突水平可能受到多种因素的影响, 例如女性收入, 家庭角色等, 不完全受到国家/地区性别不平等指数的影响. 此外散点图说明相关关系可能是 非线性的, 也可能是多元的, 仅通过一个变量的线性回归模型难以很好地解释数据的变异.

<