

Oppsummering for prosjekt i MA-223 for studenter høst 2024

Philip Haugen

August 22, 2024

1 Data

Data er en samlebetegnelse for informasjon som observeres i verden. Denne informasjonen kan være **kvantativ** (numerisk) eller **kvalitativ** (beskrivende og basert på ord). Data kan komme i mange former, som for eksempel:

- Diskret datatype: representert av heltall **Z**. Eksempler av diskret data er binære data, representert av 0 eller 1, og kategorisk data, representert av flere enn to grupper.
- Kontinuerlig datatype: representert av alle reelle tall **R**. Brukes for data som kan ta enhver verdi innenfor et intervall. Et eksempel på kontinuerlig data er overlevelsesanalyse.

Det finnes mange forskjellige datatyper, men alle er ofte utsatt for **tilfeldighet**. Tilfeldighet gjør det utfordrende å lage presise prediksjoner basert på data. Spørsmålet blir derfor: Hvordan kan man lære noe nytt fra data til tross for tilfeldighet?

Svaret er statistikk, som betyr å samle og analysere data for å finne tilnærminger. Selv om tilfeldighet kan virke kaotisk og ukontrollert, så går det an å anta at denne tilfeldigheten har en underliggende struktur så man kan lage statistiske tilnærminger.

2 Sannsynlighetsteori

Det sentrale objektet som brukes for å representere data er den stokastiske (tilfeldige) variabelen **X**. Denne variabelen kan ta forskjellige verdier med forskjellige sannsynligheter. Stokastiske variabler har spesielle funksjoner som beskriver sannsynligheten tilknyttet hver eneste verdi. Denne sannsynligheten kalles for **tetthetsfunksjon**.

Formen til en tetthetsfunksjon beskriver nettopp strukturen bak tilfeldigheten i dataen. Fordelingen kan ta mange former, men de mest vanlige er:

- Uniform fordeling: alle verdier har samme sannsynlighet. Dette betyr at hver mulig utfall har lik sannsynlighet for å skje, og fordelingen er derfor flat.
- Bernoulli-fordeling: beskriver en fordeling for binære data, og viser sannsynligheten for at 1 (suksess) skjer. Det vil si at den har kun to mulige utfall, 0 (fiasko) og 1 (suksess), med en gitt sannsynlighet for suksess.
- Binomisk fordeling: ligner på Bernoulli, men viser sannsynligheten for flere binære utfall over et fast antall forsøk. For eksempel kan man bruke en binomisk fordeling til å modellere antallet suksesser i en rekke uavhengige forsøk.
- Poissonfordeling: beskriver antall hendelser som inntreffer innenfor et fast tidsrom eller område, med en kjent gjennomsnittshyppighet. Brukes ofte til å modellere sjeldne hendelser.
- Normalfordeling: beskriver en kontinuerlig, symmetrisk fordeling som følger gausskurven. Den har sitt maksimum på gjennomsnittet, og varians og standardavvik bestemmer spredningen.

Nå er ikke tetthetsfunksjon den eneste måten å beskrive tilfeldigheten i dataen, det finnes også **kumulativ fordelingsfunksjon**. Denne brukes for å finne kvantiler eller prosentiler til en tilfeldig variabel.

Det finnes også andre nyttige verdier for å beskrive tilfeldig data. For eksempel, hva er en typisk verdi for en tilfeldig variabel? Det som er typisk blir funnet i målingen av **sentralmål**, som kan være:

- Gjennomsnitt: den forventende verdien av sentralmålet.

$$\bar{x} = \frac{S_x}{n}$$

- Median: midtpunktet i en kumulativ fordelingsfunksjon.
- Typetall: verdien som finnes på toppunktet av en tetthetsfunksjon.

Det som også er interessant er spredningen i verdier en tilfeldig variabel kan ha. Dette heter **spredningsmål**:

- Varians: gir en antydning på hvor spredningen til verdiene er fra det forventede gjennomsnittet. Det finnes to typer, som heter utvalgsvarians og populasjonsvarians.
- Standardavvik: spredningen til dataen utifra den originale dataen. Standardavviket er alltid kvadratroten av variansen.

Formmål forteller mer spesifikke detaljer om formen til en sannsynlighetsfordeling. Skjevheten viser hvor ubalansert fordelingen mot en side eller annen. Skjevheten antyder at det finnes **ekstremverdier** i en fordeling.

3 Bayes' teorem

Bayes' teorem er et grunnleggende prinsipp i sannsynlighetsteori som gir en metode for å oppdatere sannsynligheten for en hendelse basert på ny informasjon. De sentrale begrepene er:

- **Betinget sannsynlighet** $P(A|B)$: Sannsynligheten for hendelse A , gitt hendelse B .
- **Prior sannsynlighet** $P(A)$: Sannsynligheten for at hendelse A skjer før ny informasjon.
- **Posterior sannsynlighet** $P(A|B)$: Sannsynligheten for hendelse A etter hensyn til informasjonen om hendelse B .
- **Likelihood** $P(B|A)$: Sannsynligheten for at hendelse B observeres, gitt A .
- **Marginal sannsynlighet** $P(B)$: Sannsynligheten for hendelse B , uavhengig av A .

Bayes' teorem er som følger:

$$P(A|B) = \frac{P(B|A) \cdot P(A)}{P(B)}$$

Dette teoremet gir en måte å oppdatere **priorer**, altså tidligere antakelser, basert på ny data. Hvis ny informasjon oppstår som endrer oppfatningen av sannsynligheten, kan Bayes' teorem brukes til å beregne den **posterior sannsynligheten**, som er en oppdatert sannsynlighet etter å ha observert dataen.

En av de viktigste bruksområdene for Bayes' teorem i statistikk er i **Bayesiansk inferens**. I motsetning til klassisk statistikk, hvor det brukes punktestimater og intervallestimater for å gjøre estimeringer om ukjente parametere, bruker Bayesiansk statistikk teoremet til å oppdatere sannsynligheten for en hypotese etter hvert som mer data oppstår. Her blir både parametere og data sett på som stokastiske variabler, og inferens gjøres gjennom å beregne en **posterior fordeling** over parametrene basert på tidligere informasjon og ny data.

4 Inferens og hypotesetesting

I statistikk begynnes det med å definere en populasjon, som er en delmengde av en større superpopulasjon som undersøkes. Siden populasjonen ofte er vanskelig å observere direkte, samles data fra et utvalg. Deretter antas det at dataene følger en sannsynlighetsfordeling eller en matematisk formel. Målet er å "oversette" et aspekt av populasjonen til en parameter innenfor denne modellen. Siden populasjonen ikke kan observeres direkte, er også denne parameteren

ukjent. Prosessen med å estimere denne parameteren kalles inferens, da det forsøkes å trekke slutninger om den ukjente populasjonen basert på utvalgsdata.

4.1 Estimatorer

En estimator er en funksjon av utvalgsdataen som gir et anslag for en ukjent parameter. En god estimator er:

- **Utvalgsgjennomsnitt**: Denne har mange gode kvaliteter som estimator. Ifølge **store talls lov** vil utvalgsgjennomsnittet nærme seg gjennomsnittet for populasjonen når det samles store nok mengder data, noe som betegnes som **consistency**.

Ettersom utvalg er tilfeldig, er også utvalgsgjennomsnittet tilfeldig, og dermed er estimatorer i tillegg også tilfeldige. For å forstå egenskapene til en estimator, er det viktig å forstå dens fordeling, kjent som **utvalgsfordeling**. Denne fordelingen lar sannsynligheten bli vurdert for at en gitt estimator oppnår en bestemt verdi.

4.2 Asymptotiske teoremer

To viktige teoremer i statistikk er **sentralgrenseteoremet** og **store talls lov**. Sentralgrenseteoremet sier at en funksjon av utvalgsgjennomsnittet er normalfordelt når utvalget er stort nok. Begge disse teoremene er asymptotiske, som betyr store utvalgsstørrelser er viktig.

4.3 Hypotesetesting

I statistikk så oversettes antagelser om en populasjon til en påstand om verdien til en parameter. Utvalgsfordeling er viktig for å forstå hypotesetester. For å teste disse påstandene, brukes det hypotesetester:

- **Nullhypotese** (H_0): Antydning om at det ikke er noen forskjell.
- **Alternativ hypotese** (H_1 eller H_a): Antydning om at det finnes en forskjell.

Eksempel: I en studie som sammenligner en gruppe med pasienter som får placebo med en gruppe som får medisiner, vil nullhypotesen være at det ikke er noen forskjell mellom gruppene.

$$H_0 : \theta = 0$$

Når mer data blir samlet inn, må det avgjøres om nullhypotesen skal forkastes eller ei. Dette blir gjort ved å beregne en p-verdi, som er sannsynligheten for å observere utvalgsgjennomsnittet eller mer ekstreme verdier gitt at nullhypotesen er sann. Hvis p-verdien er lav nok, for eksempel under et signifikansnivå på

0.05 eller 0.01, antyder det at nullhypotesen sannsynligvis er feil. Her kan man også bruke konfidensintervaller, som er et "spekter" av parameterverdier som realistisk kan ha fått utvalgsgjennomsnittet. Hvis dette intervallet ikke inkluderer verdien foreslått av nullhypotesen, kan nullhypotesen forkastes.

Rent konkret for dette eksempelet, anta at det er 100 pasienter, hvor 50 får placebo og 50 får medisiner. Hvis 5 av de 50 som fikk medisinen, har en positiv respons, mens ingen av de 50 som fikk placebo gjør det, vil en statistisk test som for eksempel kjikvadrattest gi en p-verdi på omtrent 0.02.

Siden p-verdien er lavere enn signifikansnivået på 0.05, kan nullhypotesen forkastes. Konfidensintervallet for forskjellen i responsen mellom gruppene kan være (0.02, 0.10), som ikke inkluderer 0. Dette viser også at nullhypotesen kan forkastes.

Etter at det har blitt tatt en beslutning om nullhypotesen, kan det skje to typer feil:

- **Type I feil:** Nullhypotesen er korrekt, men den blir forkastet (falsk positiv).
- **Type II feil:** Det omvendte; nullhypotesen er feil, men blir ikke forkastet (falsk negativ).

Paradokset her er at når sannsynligheten av en av disse feilene minimeres, så øker den andre. Løsningen på dette er å definere en så lav sannsynlighet (0.05 eller 0.01) som kan tolereres. Som sagt er denne sannsynligheten er kjent som signifikansnivået for p-verdi.

4.4 Statistiske tester

Valg av statistisk test avhenger av hypotesens natur:

- **One-sample test:** Brukes for å karakterisere en enkelt populasjon.
- **Two-sample test:** Brukes for å sammenligne to populasjoner.

Ifølge sentralgrenseteoremet vil utvalgsfordelingene for slike tester være normalfordelte, og derfor kan brukes z-statistikk. Z-statistikk blir brukt for å betegne en standard normalvariabel med null i gjennomsnitt og enhetsvarians. Z-statistikk antyder at populasjonsvariansen er kjent, men dette er urealistisk i praksis. Hvis denne variansen må estimeres så konverteres Z-statistikken til t-statistikken som kommer fra t-fordeling. Hvis det sammenlignes tre grupper så bruker man variansanalyse, også kjent som ANOVA, for å sjekke om alle har samme gjennomsnitt. Hypotesetestene Z, t, og ANOVA vil at man bruker kontinuerlig data eller store nok utvalgsstørrelser.

Når det gjelder binær data så kan man bruke en krystabell og utføre en kjikvadrattest. De tre nevnte hypotesetestene er univariate analyser siden de

fokuserer på single, tilfeldige variabler. For å undersøke forhold mellom variabler brukes regresjonsanalyser. Lineær regresjon viser hvordan en variabel påvirker en annen, mens en generalisert lineær modell kan brukes hvis utdataen er binær. Estimering av parametere i regresjonsmodeller gjøres ofte ved **sannsynlighetsmaksimering**.