

中級統計学：宿題 5

村澤 康友

提出期限：2025 年 12 月 5 日

注意：すべての質問に解答しなければ提出とは認めない。授業の HP の解答例の結果を正確に再現すること（乱数は除く）。グループで取り組んでよいが、個別に提出すること。解答例をコピペした場合は提出点を 0 点とし、再提出も認めない。すべての結果を Word に貼り付けて印刷し（A4 縦・両面印刷可・手書き不可・写真不可・文字化け不可）、2 枚以上の場合は向きを揃えて問題番号順に重ね、左上隅をホッチキスで留めること。

1. gretl は代表的な確率分布の pdf や cdf をプロットできる。正規分布の pdf をプロットする手順は以下の通り。

- (1) 「ツール」 → 「分布グラフ」を選択。
- (2) 「正規分布」のタブを選択。
- (3) 「平均」と「標準偏差」を入力。
- (4) 「OK」をクリック。

グラフ上で右クリックして「曲線を追加する」を選択すれば、複数のグラフを重ねて表示できる。他の分布についても同様。

- (a) $N(0, 1)$, $N(1, 1)$, $N(2, 1)$ の pdf を重ねてプロットしなさい。
- (b) $N(0, 1)$, $N(0, 2)$, $N(0, 3)$ の pdf を重ねてプロットしなさい。
- (c) $\chi^2(1)$, $\chi^2(2)$, $\chi^2(3)$ の pdf を重ねてプロットしなさい。
- (d) $t(1)$, $t(2)$, $t(3)$ の pdf を重ねてプロットしなさい。
- (e) $F(1, 1)$, $F(1, 2)$, $F(1, 3)$ の pdf を重ねてプロットしなさい。
- (f) $F(1, 1)$, $F(2, 1)$, $F(3, 1)$ の pdf を重ねてプロットしなさい。

2. gretl は代表的な確率分布の擬似乱数を生成できる。 n 個の正規乱数を生成する手順は以下の通り。

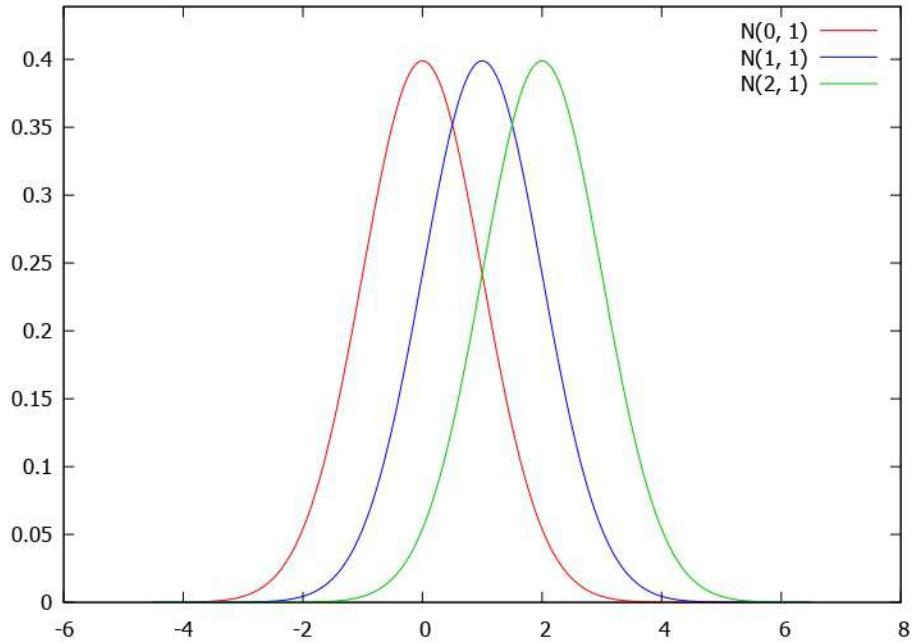
- (1) メニューから「ファイル」 → 「データセットの新規作成」で新しいデータセットを作成。
- (2) 観測数を n とし、その他の質問には適当に答える。
- (3) メニューから「追加」 → 「ランダムな変数」を選択。
- (4) 「正規分布」のタブを選択。
- (5) 「平均」「標準偏差」「名称」を入力。
- (6) 「OK」をクリック。

他の分布についても同様。生成された乱数の度数分布は「変数」 → 「度数分布」で確認できる。

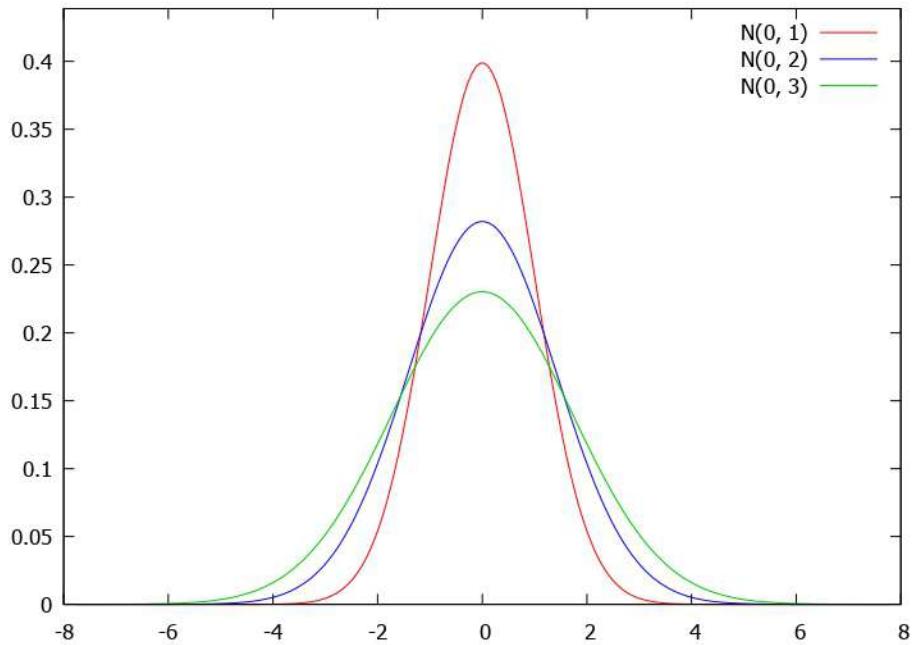
- (a) $N(0, 1)$ の乱数を 1000 個生成し、ヒストグラムを描きなさい。
- (b) $\chi^2(2)$ の乱数を 1000 個生成し、ヒストグラムを描きなさい。
- (c) $t(3)$ の乱数を 1000 個生成し、ヒストグラムを描きなさい。
- (d) $F(4, 5)$ の乱数を 1000 個生成し、ヒストグラムを描きなさい。

解答例

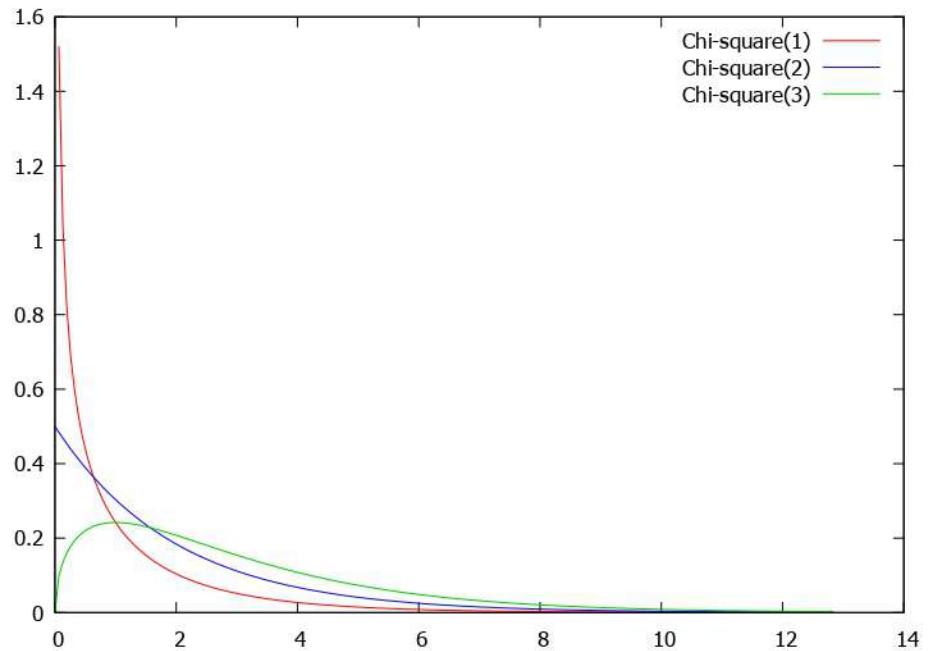
1. (a) $N(0, 1)$, $N(1, 1)$, $N(2, 1)$ の pdf



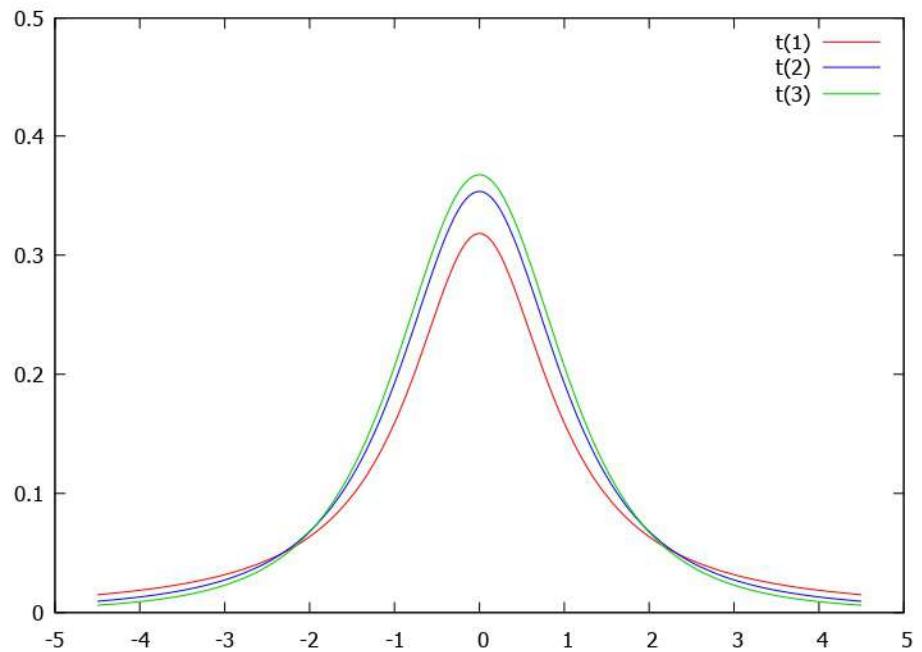
- (b) $N(0, 1)$, $N(0, 2)$, $N(0, 3)$ の pdf



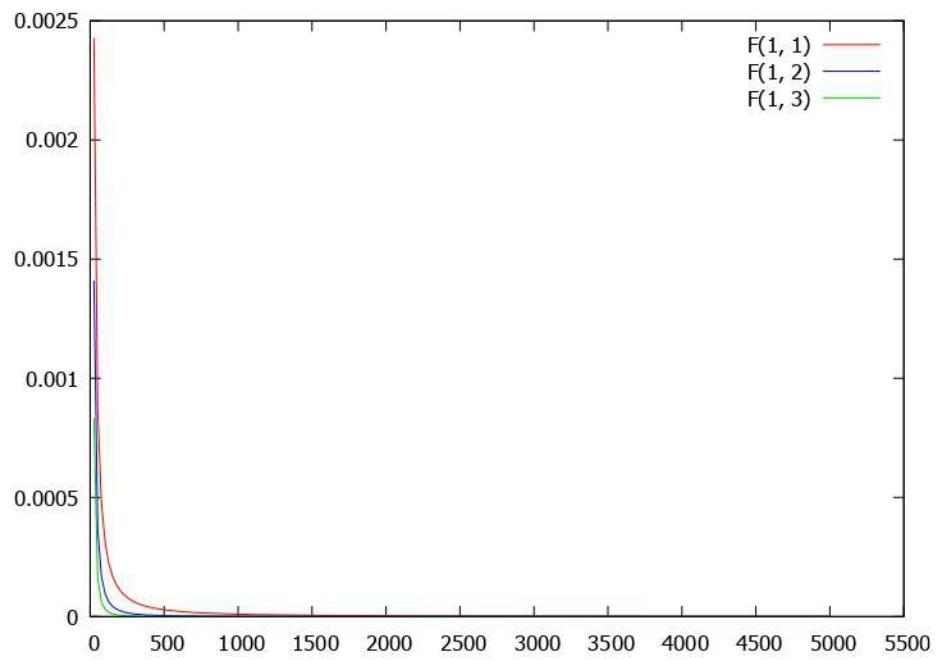
(c) $\chi^2(1)$, $\chi^2(2)$, $\chi^2(3)$ \otimes pdf



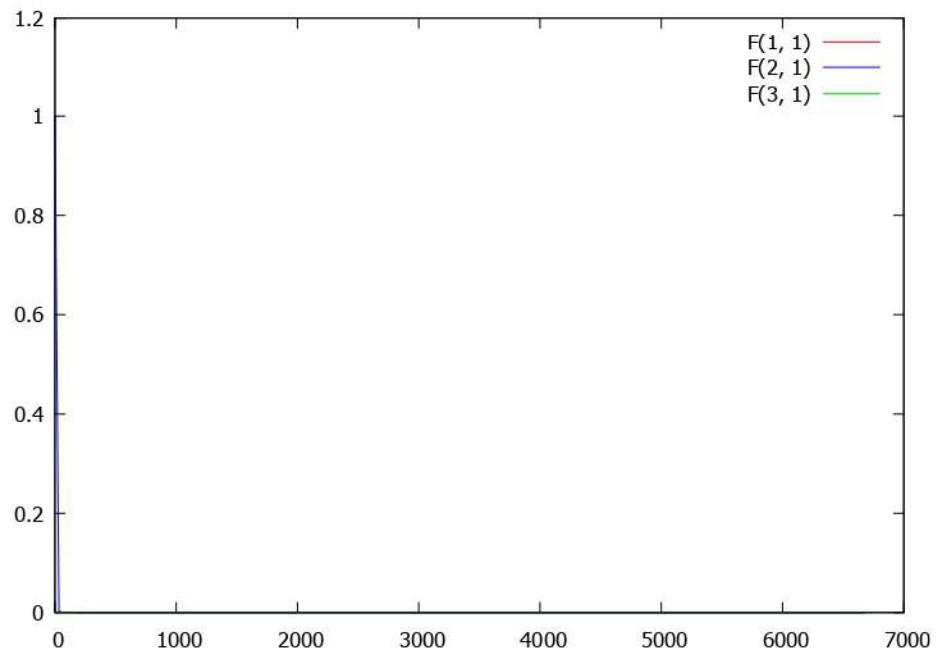
(d) $t(1)$, $t(2)$, $t(3)$ \otimes pdf



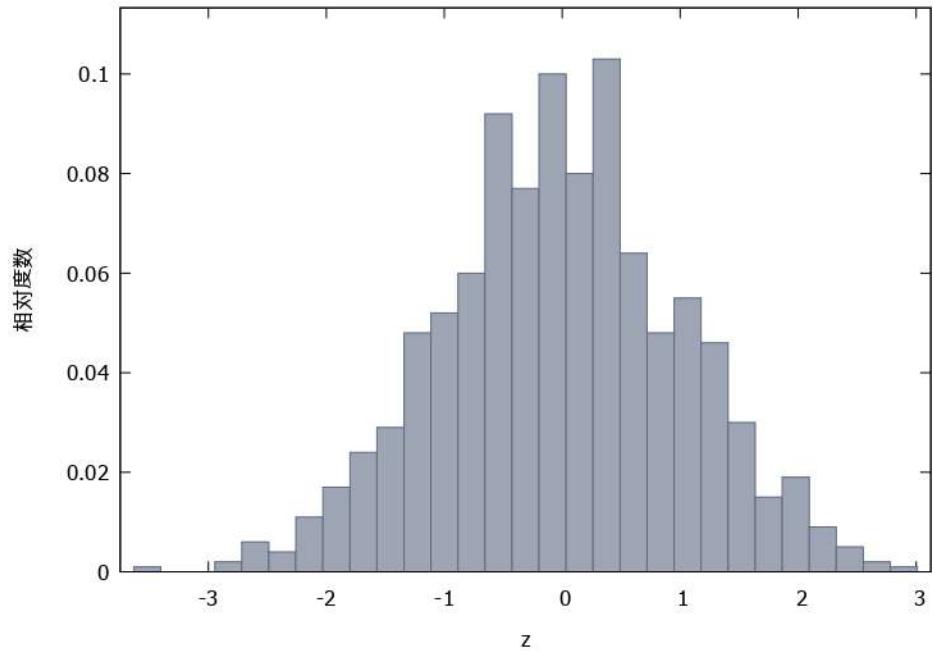
(e) $F(1, 1)$, $F(1, 2)$, $F(1, 3) \oslash$ pdf



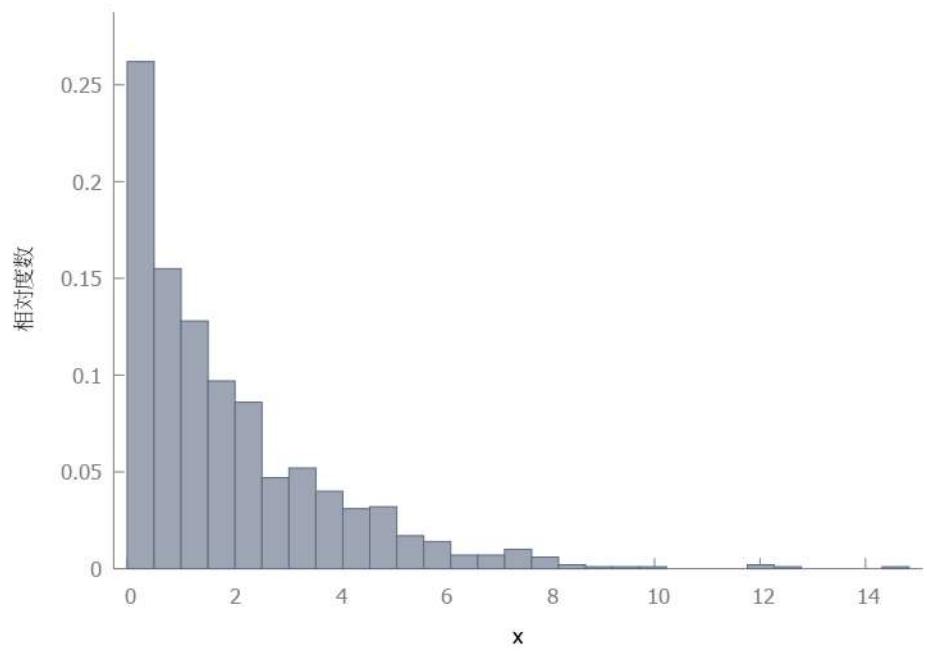
(f) $F(1, 1)$, $F(2, 1)$, $F(3, 1) \oslash$ pdf



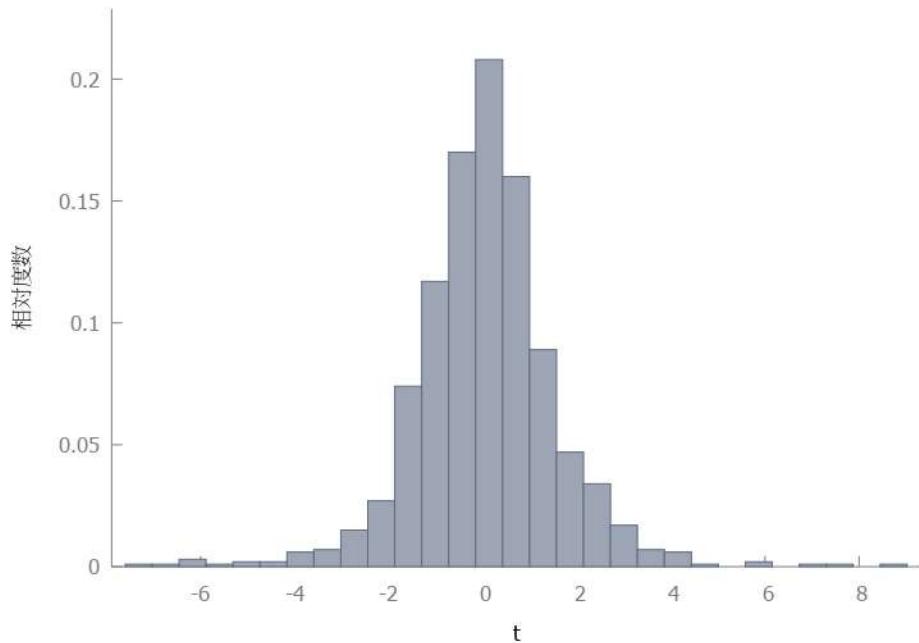
2. (a) $N(0,1)$ の乱数のヒストグラム



(b) $\chi^2(2)$ の乱数のヒストグラム



(c) $t(3)$ の乱数のヒストグラム



(d) $F(4, 5)$ の乱数のヒストグラム

