確率統計と情報処理・演習（2008 年度後期）

1 変量データ分析

2008 年 10 月 03 日

日本女子大学理学部数物科学科　　今野 良彦

September 25, 2008

今日の講義の目的と概要

目的

（1）データが入力されたら，とりあえずデータにどんな値がどれくらいあるかを調べる．この様子をあらわしたものを「分布」という．表現法として，度数分布表や図（ヒストグラム）がある．

（2）分布を説明するために，分布の中央あたりの値を「分布の中心」として「分布の代表値」とする．

（3）つぎに，データのばらつきを表現する尺度を議論する．

今日の講義の目的と概要

目的

（1）データが入力されたら，とりあえずデータにどんな値がどれくらいかるかを調べる．この様子をあらわしたものを「分布」という．表現法として，度数分布表や図（ヒストグラム）がある．

（2）分布を説明するために，分布の中央あたりの値を「分布の中心」として「分布の代表値」とする．— 平均値と中央値．さらに，最小値と最大値，ボックスプロット（箱ひげ図）

（3）つぎに，データのばらつきを表現する尺度を議論する.. — 分散と標準偏差，平均偏差，範囲，四分位偏差

ヒストグラム

- 単峰型
  - 峰を中心に左右対称のもの
  - 左に偏ってもの（下段左）— 山の裾の部分に注目している！
  - 右に偏ったもの（下段右）
- 双峰型・多峰型 — 異種のデータが混在している場合が多い．

ヒストグラムの作成

ヒストグラムの作成

```
> a<-rnorm(100,10,10)
> hist(a)
> a<-round(rnorm(50,10,20))
> a
 [1]  -1  39  -4 -13  -2  40 -17   1  20  14
[11]   3  27   6  47  47 -23   6  -8  -5  16
[21] -17  -5  15   6   0   0  33 -16  23 -39
[31] 29  22   7 -10  26  16 -10  13  -1  -1
[41] 42 -23  -4   9  18 -34  14  13  -4   0
> hist(a)
```


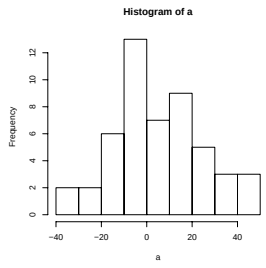

Figure 1: 作成されたヒストグラム

ヒストグラムの作成

```
>
> # コマンド hist のオプションを調べる
> ?hist
> # 割合で表示
> hist(a,freq=F)
>
```


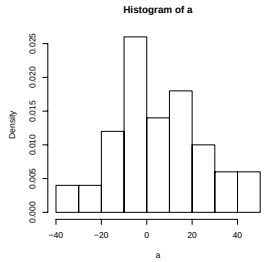

Figure 2: 作成されたヒストグラム

問題 1

- 以下のようにデータを発生させ，そのヒストグラムを作成し，そこからわかることを述べよ．

ヒストグラムの作成

```
>
>
> a1<-round(rnorm(500,0,1))*5+あなたの誕生日
>
> a2<-round(rt(50,10)*5)+あなたの誕生日
>
```

オブジェクト a1 と a2 のヒストグラムを作成し，それを pdf file で保存する．ファイル名は 学籍番号下3桁-a1.pdf と 学籍番号下3桁-a2.pdf とせよ．さらに，ファイル ローマ字の名前-締め切り.txt

（例：mejiro-hanako-081010.txt)

締め切り：2008 年 10 月 10 日（金）13 時

代表値 — 平均値と中央値

n 個のデータの値を

$$x_1, x_2, \cdots, x_n$$

とする．

平均値　　$\bar{x}_n = \frac{1}{n}\sum_{i=1}^{n} x_i$

中央値　　$x_1, x_2, \cdots, x_n$ を昇順に並び替えたものを $x_{(1)} \leq x_{(2)} \leq \cdots \leq x_{(n)}$ としたとき，

$$Me = \begin{cases} x_{(\frac{n+1}{2})} & n \text{ が奇数} \\ \frac{x_{(n/2)}+x_{(n/2)+1}}{2} & n \text{ が偶数} \end{cases}$$

たとえば，$x_1 = 20, x_2 = 10, x_3 = 0$ のとき，

$$x_{(1)} = 0, x_{(2)} = 10, x_{(3)} = 20$$

となる．したがって，$n = 3$ は奇数だから

$$Me = x_{(2)} = 10$$

また，たとえば，$x_1 = 20, x_2 = 10, x_3 = 0, x_4 = 30$ のとき，

$$x_{(1)} = 0, x_{(2)} = 10, x_{(3)} = 20, x_{(4)} = 30$$

となる．したがって，$n = 4$ は偶数だから

$$Me = \frac{x_{(2)} + x_{(3)}}{2} = \frac{10 + 20}{2} = 15$$

平均値の意味

$g(a) := \sum_{i=1}^{n}(x_i - a)^2$ とおく．このとき，$g(a)$ を最小にする a の値は何か？

$$\begin{aligned} g(a) &= \sum_{i=1}^{n}(x_i - \bar{x}_n + \bar{x}_n - a)^2 \\ &= \sum_{i=1}^{n}(x_i - \bar{x}_n)^2 + \sum_{i=1}^{n}(\bar{x}_n - a)^2 - 2(a - \bar{x}_n)\sum_{i=}^{n}(x_i - \bar{x}_n) \\ &= \sum_{i=1}^{n}(x_i - \bar{x}_n)^2 + \sum_{i=1}^{n}(\bar{x}_n - a)^2 \geq \sum_{i=1}^{n}(x_i - \bar{x}_n)^2 \end{aligned}$$

よって，$a = \bar{x}_n$ で最小.

絶対偏差

では，

$$f(a) := \sum_{i=1}^{n}|x_i - a|$$

とおく．このとき，$f(a)$ を最小にする a の値は統計的意味をもつか？

すわなち，分布の位置を表す代表値として用いることができるか？

答えは Yes!　しかし，明示的な表現はできない！

平均値と中央値の違い

⋆　平均値と中央値が近い場合 ⟶ 概ねその値を中心として左右対称であることが多い.

⋆　平均値と中央値が離れている場合 ⟶ 対称性が崩れて右ないし左に歪んでいるか，離れた「**外れ値**」があることがおおい.

注意：ヒストグラムなどで確認できること！

垂水共之・飯塚誠也　著「R/S-PLUSによる統計解析入門」(共立出版，2006年4月25日のサポートのページ

`http://www.mikawaya.to/appstat/`

の boxplot_interactive.r を使い説明せよ！

最大値と最小値

n 個のデータの値を

$$x_1, x_2, \cdots, x_n$$

としたとき，

$x_{(1)}$：最小値,　　$x_{(n)}$：最大値

最大値と最小値

```
> height
 [1] 166 154 165 169 155 158 168 154 162 153
> min(height)
[1] 153
> max(height)
[1] 169
>
```


箱ひげ図（ボックスプロット）

もとのデータ $x_1, x_2, \ldots, x_n$ を並び替えたものを

$$x_{(1)} \leq x_{(2)} \leq \cdots \leq x_{(n)}$$

とする.

- 第1四分位点（しぶんい） —- データの下から $n/4$ 個の値
- 中央値（第2四分位点） —- データの下から $n/2$ 個の値
- 第3四分位点 —- データの下から $3n/4$ 個の値

summary と boxplot.stats

```
> x<-1:12
> summary(x)
   Min. 1st Qu.  Median    Mean 3rd Qu.    Max.
   1.00    3.75    6.50    6.50    9.25   12.00
>
#
> boxplot.stats(x)
$stats
[1]  1.0  3.5  6.5  9.5 12.0
$n
[1] 12
$conf
[1] 3.76336 9.23664
$out
numeric(0)
# stats のみを出力
> boxplot.stats(x)$stats
[1]  1.0  3.5  6.5  9.5 12.0
> boxplot.stats$conf
NULL
> boxplot.stats(x)$conf
[1] 3.76336 9.23664
```

boxplot：箱ひげ図の出力

```
> x<-1:12
> boxplot(x)
>
```


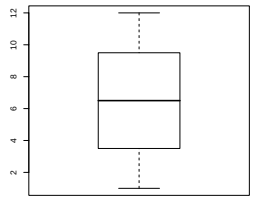

Figure 3: 箱ひげ図

ばらつきの尺度：分散と標準偏差

2 つのデータの比較

```
> height
 [1] 148 160 159 153 151 140 156 137 149 160 151 157 157 144
> height2
 [1] 138 162 158 151 145 134 160 137 151 163 152 163 158 147
> mean(height)
[1] 151.5714
> mean(height2)
[1] 151.3571
> median(height)
[1] 152
> median(height2)
[1] 151.5
> boxplot(height,height2,names=c("height","height2"))
```


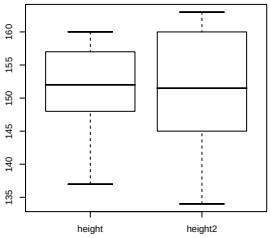

Figure 4: 2 つの箱ひげ図

代表値（分布の位置）は似ているが，値のばらつき具合が違う！

- 範囲 —- diff(range(x))

$$x_{(n)} - x_{(1)}$$

- 四分位（しぶんい）範囲 —- diff(quantile(x,c(0.25,0.75),names=F))

$$x_{(3n/4)} - x_{(n/4)}$$

- 平均偏差 — sum(abs(x-mean(x))/length(x)

$$(1/n)\sum_{i=1}^{n} |x_i - \bar{x}_n|$$

- 分散 —- var(x) または

```
sum((x-mean(x))^2)/(length(x)-1)
```

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

- 標準偏差 — sd(x) または

```
sqrt(sum((x-mean(x))^2)/(length(x)-1))
```

これらの値は大きいほどばらつく！

問題２

co2 と入力すると Mauna Loa Atmospheric での 1959 年から 1997 年までの毎月の CO_2 の濃度のデータが利用できる．

```
> cc<-seq(1,length(co2),by=12)
> cc
  [1]   1  13  25  37  49  61  73  85  97 109 121 133 145 157 169 181
 [20] 229 241 253 265 277 289 301 313 325 337 349 361 373 385 397 409
 [39] 457
> # オブジェクト y にあたたの誕生月のデータを入力
> apr<-co2[cc+(あなたの誕生月マイナス１を入力)]
>
> apr<-co2[cc+3]
> apr
  [1] 317.56 318.87 319.31 320.42 321.22 321.40 321.97 323.54 324.25 3
 [12] 327.97 327.62 329.56 331.33 332.48 333.14 334.41 335.90 337.59 3
 [23] 342.33 343.39 344.77 346.88 348.17 349.37 350.80 353.41 355.26 3
 [34] 359.07 359.41 361.25 363.48 364.76 366.40
>
```


(1) 誕生月のデータの平均と中央値を求めよ．

(2) 箱ひげ図を作成せよ．

(3) 範囲，四分位範囲，平均偏差，分散，標準偏差を求めよ．

テキストファイルに実行文と結果を貼り付け，箱ひげ図は pdf file （学籍番号下3桁-boxplot.pdf）で添付すること．

テキストファイル：Mejiro-Hanako-081010.txt

締め切り：2008 年 10 月 10 日（金）13 時