

確率統計と情報処理・演習 (2008 年度後期)

2 変量データ分析

2008 年 10 月 10 日

日本女子大学理学部数物科学科 今野 良彦

September 25, 2008

今野 良彦

確率統計と情報処理・演習 (2008 年度後期)

今日の講義の目的と概要

- 2 変量のデータを各変量ごとに「1 変量のデータの分析」を行う。
 - ヒストグラム・箱ひげ図・分布の代表値・ばらつき
- 散布図 — 2 変量のデータとして分布を眺めること。
- 回帰直線 — 散布図をみて、全体として右上がりまたは右下がりの傾向があったときに、その傾向を示す直線を引くこと。
- 相関係数 — データの直線的な傾向の強弱を数値で示すこと。

1

今野 良彦

確率統計と情報処理・演習 (2008 年度後期)

身長と体重のデータ

番号	身長	体重	番号	身長	体重
1	148	41	9	137	31
2	160	49	9	149	47
3	159	45	10	160	47
4	153	43	11	151	42
5	151	42	12	157	39
6	140	49	13	157	48
7	156	49	14	144	36

Figure 1: 中学生 14 人の体格データ

2

今野 良彦

確率統計と情報処理・演習 (2008 年度後期)

```
cbind
> height
[1] 148 160 159 153 151 140 156 137 149 160 151 157 157 144
> weight
[1] 41 49 45 43 42 29 49 31 47 47 42 39 48 36
> length(weight) # オブジェクト weight のデータの個数を調べる
[1] 14
> length(height)
[1] 14
> bodydata<-cbind(height,weight) # データは行ベクトルを行列配置
> bodydata
  height weight
[1,] 148 41
[2,] 160 49
[3,] 159 45
[4,] 153 43
[5,] 151 42
[6,] 140 29
# 以下は略
> bodydata[1,]
height weight
148 41
> bodydata[2,]
height weight
160 49
```

3

今野 良彦

確率統計と情報処理・演習 (2008 年度後期)

```
matrix
> bodydata2<-matrix(
+ c(148,160,159,153,151,140,156,137,149,160,151,157,157,144,
+ 41,49,45,43,42,29,49,31,47,47,42,39,48,36
+ ),,2) # matrix(c(....),列の数,行の数)
> bodydata2
  [,1] [,2]
[1,] 148 41
[2,] 160 49
[3,] 159 45
[4,] 153 43
[5,] 151 42
[6,] 140 29
[7,] 156 49
[8,] 137 31
[9,] 149 47
[10,] 160 47
[11,] 151 42
[12,] 157 39
[13,] 157 48
[14,] 144 36
>
> mean(bodydata[,1]) # 身長の平均
[1] 151.5714
> mean(bodydata[,2]) # 体重の平均
[1] 42
```

4

今野 良彦

確率統計と情報処理・演習 (2008 年度後期)

グラフの同時表示

```
mfrow
> par(mfrow=c(2,1)) # グラフを 2 行に表示
> hist(height)
> boxplot(height)
> par(mfrow=c(1,1)) # 元の戻す
```

5

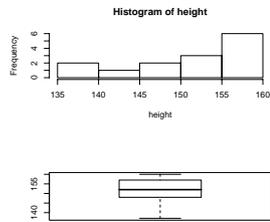


Figure 2: ヒストグラムと箱ひげ図

6

問題 1

- 身長と体重のデータを行列配置のオブジェクトに入力。ただし、1行目は身長で2行目は体重
- 身長と体重のデータについてそれぞれ
 - (1) ヒストグラム
 - (2) 平均と中央値
 - (3) 箱ひげ図 (mejiro-hanako-081024-boxplot.pdf)
 - (4) 範囲, 四分位偏差, 平均偏差, 分散, 標準偏差を求めよ
- 締め切りは 2008 年 10 月 24 日 (金) 13 時
- mejiro-hanako-081024.txt

7

テキストデータの読み込み

エディターを使い data1.txt を作成する。R の「ファイル」から「ディレクトリの変更」を選択し、「Browse」をクリックして、data1.txt のあるディレクトリを指定する。

data1.txt

```
148 41
160 49
153 45
```

8

read.table

```
> x<-read.table("data1.txt")
> x
  V1 V2
1 148 41
2 160 49
3 153 45
>
```

9

データエディタ

data1.txt

```
> bodydata
  height weight
[1,] 148 41
[2,] 160 49
[3,] 159 45
[4,] 153 43
[5,] 151 42
[6,] 140 29
[7,] 156 49
# 以下は省略
> fix(bodydata) # データエディタが表示される
> data.entry(bodydata) # データエディタが表示される
> iris # データ iris の表示
> fix(iris) # データエディタが表示される
>
```

10

11

散布図

身長と体重の散布図を作成

```
data1.txt
>
> plot(height,weight)
>
```

13

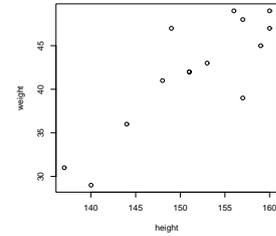


Figure 3: 身長と体重の散布図

14

散布図から調べることができること

- データは右上がり, 右下がり, またはいずれでもない
- 外れ値があるか?

15

外れ値とは

```
data1.txt
> height2<-c(height,140)
> weight2<-c(weight,60)
> height2
[1] 148 160 159 153 151 140 156 137 149 160 151 157 157 144 140
> weight2
[1] 41 49 45 43 42 29 49 31 47 47 42 39 48 36 60
> plot(height2,weight2)
```

16

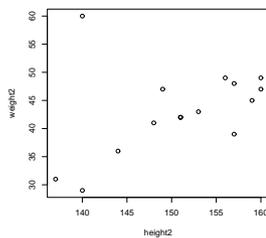


Figure 4: 身長と体重の散布図(外れ値のある場合)

17

回帰直線

* 散布図を見て, 全体が右下がりまたは右上がりの傾向があったとき, その傾向を示す直線

$$y = a + bx$$

を散布図に引くことを考える .

* データに基づいて傾き b と切片 a をどうきめるか?

* 最小 2 乗法 (最小自乗法) をつかおう ! (他の方法もある !)

18

最小 2 乗法

* データを $(x_1, y_1), (x_2, y_2), \dots, (x_n, y_n)$ とする .

* i ($i = 1, 2, \dots, n$) 番目のデータが x_i に対して ,

$$\frac{\text{データの } y \text{ 変量の値 } y_i}{\text{直線上の } y \text{ の値 } \hat{y}_i = a + bx_i} = \frac{y_i}{y_i - \hat{y}_i}$$

* 「誤差」が少ないほどよいと考える . すなわち「誤差」が零に近いほどよい!

* 符号の影響をなくして, データ全体の「誤差」を合計する! すわわち

$$Q(a, b) = \sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2 = \sum_{i=1}^n \{y_i - (a + bx_i)\}^2$$

を最小にする a と b を求める!

最小 2 乗法

* a と b について Q を偏微分すると

$$\begin{cases} \frac{\partial Q}{\partial a} = -2 \sum_{i=1}^n \{y_i - (a + bx_i)\} = -2n\bar{y}_n + 2an + 2nb\bar{x}_n = 0 \\ \frac{\partial Q}{\partial b} = -2 \sum_{i=1}^n x_i \{y_i - (a + bx_i)\} = -2 \sum_{i=1}^n x_i y_i + 2na\bar{x}_n + 2b \sum_{i=1}^n x_i^2 = 0 \end{cases}$$

となる . ただし , $\bar{x}_n = (1/n) \sum_{i=1}^n x_i$ と $\bar{y}_n = (1/n) \sum_{i=1}^n y_i$

$$\begin{cases} n\bar{y}_n - an - n\bar{x}_n b = 0 \\ \sum_{i=1}^n x_i y_i - n\bar{x}_n a - \sum_{i=1}^n x_i^2 b = 0 \end{cases}$$

よって ,

$$\begin{cases} n\bar{x}_n \bar{y}_n - n\bar{x}_n a - n\bar{x}_n^2 b = 0 \\ \sum x_i y_i - n\bar{x}_n a - \sum x_i^2 b = 0 \end{cases} \quad (1)$$

よって , $\sum_{i=1}^n x_i^2 - n\bar{x}_n^2 \neq 0$ ならば ,

$$\begin{aligned} b &= \frac{\sum_{i=1}^n x_i y_i - n\bar{x}_n \bar{y}_n}{\sum_{i=1}^n x_i^2 - n\bar{x}_n^2} = \frac{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x}_n)(y_i - \bar{y}_n)}{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x}_n)^2} \quad (2) \\ &= \frac{(1/n) \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x}_n)(y_i - \bar{y}_n)}{(1/n) \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x}_n)^2} \\ &=: \frac{s_{xy}}{s_x^2} \\ a &= \bar{y}_n - b\bar{x}_n = \bar{y}_n - \frac{s_{xy}}{s_x^2} \bar{y}_n \end{aligned}$$

以後は , $\hat{b} = s_{xy}/s_x^2$ と $\hat{a} = \bar{y}_n - \hat{b}\bar{x}_n$ と書くことにする . (データから求めた回帰直線の傾き \hat{b} と切片 \hat{a} という意味)

データより求めた回帰直線の方程式

$s_x^2 \neq 0$ のとき ,

$$y - \bar{y}_n = \frac{s_{xy}}{s_x^2} (x - \bar{x}_n)$$

ただし ,

$$\bar{x}_n = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i, \quad \bar{y}_n = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n y_i$$

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

$$s_{xy} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x}_n)(y_i - \bar{y}_n)$$

lm : 回帰直線を求める

lm と abline 身長と体重の散布図を作成

```
> height
[1] 148 160 159 153 151 140 156 137 149 160 151 157 157 144
> weight
[1] 41 49 45 43 42 29 49 31 47 47 42 39 48 36
> lm(weight~height) # x 軸を身長, y 軸を体重として回帰直線を求める
Call:
lm(formula = weight ~ height)
Coefficients:
(Intercept)      height
      -70.1505      0.7399 # 切片と傾き
> bodylm<-lm(weight~height)
> plot(height,weight) # 散布図を作成, 身長を $ x $ 軸
> abline(bodylm) # 散布図に回帰直線を書き入れる
>
```

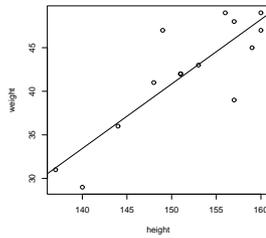


Figure 5: 散布図に回帰直線を書き入れたもの

lm : 回帰直線を求める (体重を x 軸で身長を y 軸)

```

lm と abline 身長と体重の散布図を作成
> lm(height~weight)
Call:
lm(formula = height ~ weight)
Coefficients:
(Intercept)      weight
    110.4431      0.9792 # 切片と傾き
> bodylm2<-lm(height~weight)
> plot(weight,height) # 散布図を作成. 体重を x 軸
> abline(bodylm2) # 散布図に回帰直線を書き入れる
>
    
```

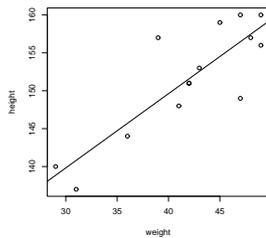


Figure 6: 散布図に回帰直線を書き入れたもの(体重が x 軸)

問題 2

(a) $Q(a, b)$ を a と b について偏微分した式を確認せよ. また,

$$\begin{cases} \frac{\partial Q}{\partial a} = 0 \\ \frac{\partial Q}{\partial b} = 0 \end{cases}$$

の解が Q を最小にする a と b の値になるのはなぜか?

(b) 連立方程式 (1) の解が

$$b = \frac{\sum_{i=1}^n x_i y_i - n \bar{x}_n \bar{y}_n}{\sum_{i=1}^n x_i^2 - n \bar{x}_n^2}, \quad a = \bar{y}_n - \frac{s_{xy}}{s_x^2} \bar{x}_n$$

(c) (2) の一番右の等号を確認せよ.

- 締め切りは 2008 年 10 月 24 日 (金) 13 時
- このレポートは A4 の紙にかき, 数研前のレポート入れに提出すること.

データより求めた回帰直線の方程式

* 「第 I と第 III 象限にあるデータ数」 > 「第 II と第 IV 象限にあるデータ数」
 ならば,
 データの全体は右上がりの傾向

* 「第 I と第 III 象限にあるデータ数」 < 「第 II と第 IV 象限にあるデータ数」
 ならば,
 データの全体は右下がりの傾向

	$x_i - \bar{x}_n$	$y_i - \bar{y}_n$	$(x_i - \bar{x}_n)(y_i - \bar{y}_n)$
I	+	+	+
III	-	-	+
II	-	+	-
IV	+	-	-

* 「第 I と第 III 象限にあるデータ数」 > 「第 II と第 IV 象限にあるデータ数」ならば、

$$s_{xy} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x}_n)(y_i - \bar{y}_n) \quad \text{は正}$$

* 「第 I と第 III 象限にあるデータ数」 < 「第 II と第 IV 象限にあるデータ数」ならば、

$$s_{xy} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x}_n)(y_i - \bar{y}_n) \quad \text{は負}$$

x と y の共分散と分散

$$s_{xy} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x}_n)(y_i - \bar{y}_n)$$

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

$$s_y^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y}_n)^2$$

また、 s_x^2 の正の平方根を s_x 、 s_y^2 の正の平方根を s_y と書く。

x と y の相関係数の定義

$$r = \frac{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x}_n)(y_i - \bar{y}_n)}{\sqrt{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x}_n)^2} \sqrt{\sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y}_n)^2}} = \frac{s_{xy}}{s_x s_y}$$

また、 s_x^2 の正の平方根を s_x 、 s_y^2 の正の平方根を s_y と書く。

x と y の相関係数の性質

- $-1 \leq r \leq 1$
- r の値が 1 に近いとき、データの全体は右上がり (正の相関が強い)
- r の値が -1 に近いとき、データの全体は右下がり (負の相関が強い)
- r の値が 0 に近いとき、無相関

相関係数を求める

cor : データ iris の散布図と相関係数

```
> x1<-iris$ Sepal.Length # データ iris
> x2<-iris$ Sepal.Width
> x3<-iris$Petal.Length
> x4<-iris$Petal.Width
> op<-par(mfrow=c(2,2)) # 4つの散布図を同時に各コマンド
> plot(x1,x2)
> plot(x1,x3)
> plot(x1,x4)
> plot(x2,x3)
> cor(x1,x2)
[1] -0.1175698
> cor(x1,x3)
[1] 0.8717538
> cor(x1,x4)
[1] 0.8179411
> cor(x2,x3)
[1] -0.4284401
```

問題 3

- (a) 50m 走と走り幅跳びのデータを 10 に選び出し, それぞれをオブジェクト x と y に入力せよ .
- (b) オブジェクト x と y の散布図を作成せよ .
- (c) 回帰直線 $y = \hat{a} + \hat{b}x$ を求め, 散布図 ((mejiro-hanako-081024-scatter.pdf) に描きいれよ .
- (d) 相関係数を計算せよ .
- mejiro-hanako-081024.txt