

Математические и статистические методы в психологии

Выборки и их описание. (1 апреля 2019 г.)

А. А. Тамбовцева

Базовые определения

- **Выборка** – последовательность независимых одинаково распределенных случайных величин:

$$x_1, x_2, \dots, x_i, \dots, x_n,$$

где x_i – i -тое наблюдение в выборке (i -тый элемент), а n – число наблюдений в выборке.

- **Вариационный ряд** – упорядоченная выборка (обычно упорядоченная по возрастанию, от меньшего значения к большему):

$$x_{(1)} \leq x_{(2)} \leq \dots \leq x_{(i)} \leq \dots \leq x_{(n)},$$

где $x_{(1)}$ – наименьшее значение в выборке, а $x_{(n)}$ – наибольшее значение в выборке.

Выборочные квантили

1. Медиана

Медиана выборки – это оценка квантиля распределения уровня 0.5, то есть значение, которое 50% значений в выборке не превышают. Другими словами, **медиана** – это центральное значение в вариационном ряду; значение, которое делит упорядоченную выборку на две половины – нижнюю и верхнюю.

Найти значение, которое находится ровно в середине последовательности чисел, просто, но есть проблема: не всегда в центре ряда может оказаться одно число. Возможны два случая: а) число наблюдений в выборке нечётно; б) число наблюдений в выборке чётно.

Число наблюдений в выборке нечётно

Если в выборке нечётное число наблюдений, медиана – это просто значение, которое находится ровно посередине вариационного ряда.

Пример 1. Дана выборка из 7 наблюдений:

20 10 70 60 80 5 100

Запишем вариационный ряд (упорядочим выборку по возрастанию):

5 10 20 60 70 80 100

Чтобы найти значение, которое находится посередине, отсчитаем справа и слева одинаковое число наблюдений (в данном случае 3):

5 10 20 60 70 80 100

Значение, до которого мы таким образом дошли, 60. Оно и является медианой выборки. Можем записать $\text{med}(x_1 \dots x_7) = 60$.

Выше было сказано, что медиана делит выборку на две половины. Но нечётное число наблюдений на два не делится. Как быть? Как делить выборку на половины и куда включать медиану? Всё просто: медиану нужно включать в **обе** половины выборки. В нашем примере нижняя половина выборки содержит числа 5, 10, 20, 60, а верхняя половина – 60, 70, 80, 100. В обеих частях одинаковое число наблюдений, значит, они точно являются половинами, мы ничего не перепутали.

Число наблюдений в выборке чётно

Если число наблюдений в выборке чётно, то для определения медианы понадобится рассчитывать среднее арифметическое двух центральных чисел в вариационном ряду.

Пример 2. Дана выборка из 8 наблюдений:

20 10 70 60 80 5 100 55

Запишем вариационный ряд:

5 10 20 55 60 70 80 100

Если мы отсчитаем одинаковое число наблюдений справа и слева (по 3), то дойдем до двух центральных значений в вариационном ряду – 55 и 60:

5 10 20 55 60 70 80 100

Медианой в таком случае будет среднее арифметическое этих двух чисел. Можем записать:

$$\text{med}(x_1 \dots x_8) = \frac{55 + 60}{2} = 57.5.$$

Медиану нашли, а как теперь поделить выборку на две половины и куда включить медиану? Всё просто: раз наблюдений в выборке чётное количество, то можем спокойно поделить вариационный ряд на две половины, по $n/2$ наблюдений в каждой. В нашем случае в нижнюю половину выборки входят значения 5, 10, 20, 55, а в верхнюю половину – значения 60, 70, 80, 100. Медиана при этом не входит **ни в одну** половину – она же не принадлежит вариационному ряду (в нем нет значения 57.5), так зачем её тогда куда-то включать?

2. Квартили

Квартили – значения, которые делят упорядоченную выборку на четыре примерно равные части. В первую часть входят первые 25% наблюдений, во вторую часть входят следующие 25% наблюдений и так далее. Таким образом, первый квартиль отделяет первые 25% значений в вариационном ряду, второй квартиль – первые 50% значений в вариационном ряду, третий квартиль – первые 75% значений, и наконец, четвертый квартиль отделяет 100% значений, то есть все наблюдения в выборке.

Нетрудно заметить, что медиана – это второй квартиль, то есть значение, которое отделяет первую половину значений (0 – 50%) в упорядоченной выборке от второй половины значений (50 – 100%).

Квартили – это оценки квантилей распределения уровней 0.25, 0.5, 0.75 и 1 ($x_{0.25}$, $x_{0.5}$, $x_{0.75}$, x_1). Для описания выборок нам будут нужны квантили уровней 0.25 и 0.75, первый и третий квартиль или нижний и верхний квартиль. Обозначать их будем следующим образом:

$$Q_1 = x_{0.25}, \text{ нижний квартиль}$$

$$Q_3 = x_{0.75}, \text{ верхний квартиль}$$

Как находить нижний и верхний квартили? Просто: нижний квартиль – это медиана нижней половины выборки, а верхний квартиль – это медиана верхней половины выборки. А как находить медиану мы уже разобрали. Рассмотрим следующий пример.

Дана выборка из 9 наблюдений:

25 15 7 6 75 15 10 12 18

Запишем вариационный ряд:

6 7 10 12 15 15 18 25 75

Медиана выборки – значение 15. Тогда нижняя половина выборки выглядит следующим образом:

6 7 10 12 15

Находим медиану нижней половины выборки. Это число 10. Следовательно, $Q_1 = 10$. Верхняя половина выборки выглядит следующим образом:

15 15 18 25 75

Находим медиану верхней половины выборки. Это число 18. $Q_3 = 18$.

С описанием выборок связано ещё одно понятие – **межквартильный размах**. Будем обозначать его IRQ , а определяется он следующим образом:

$$IRQ = Q_3 - Q_1$$

Так, в нашем примере, разобранном выше, $IRQ = 18 - 10 = 8$. Содержательно межквартильный размах – это одна из мер разброса значений в выборке. Но межквартильный размах очень важен и в «техническом» отношении – именно он используется для поиска нетипичных значений в выборке.

Поиск нетипичных наблюдений

Нетипичные наблюдения в выборке – наблюдения, которые сильно удалены от медианного значения. Иногда нетипичные наблюдения в выборке имеют «естественное» происхождение (существуют объекты, которые сильно отличаются от остальных), а иногда такие наблюдения – просто следствия ошибок (опечатки в данных, неверные единицы измерения и прочее). Нетипичные наблюдения также называют *нехарактерными наблюдениями* или *выбросами* (*outliers*).

Вопрос: как определить нетипичные наблюдения в выборке? Ответ: найти границы типичных значений, и все значения, которые выходят за эти границы, считать нетипичными. Границы типичных значений:

$$[Q_1 - 1.5 \times \text{IRQ}; Q_3 + 1.5 \times \text{IRQ}]$$

Проверим, есть ли в выборке из нашего примера нетипичные наблюдения. Мы определили, что $Q_1 = 10$, $Q_3 = 18$, $\text{IRQ} = 8$. Подставим все значения в формулы:

$$[10 - 1.5 \times 8; 18 + 1.5 \times 8]$$

$$[-2; 30]$$

Видно, что одно наблюдение в этот интервал не входит – это значение 75. Следовательно, в нашей выборке есть одно нетипичное наблюдение – 75.