

中級統計学／経済統計 I：宿題 2

村澤 康友

2021 年 5 月 17 日（府大）／ 18 日（甲南）

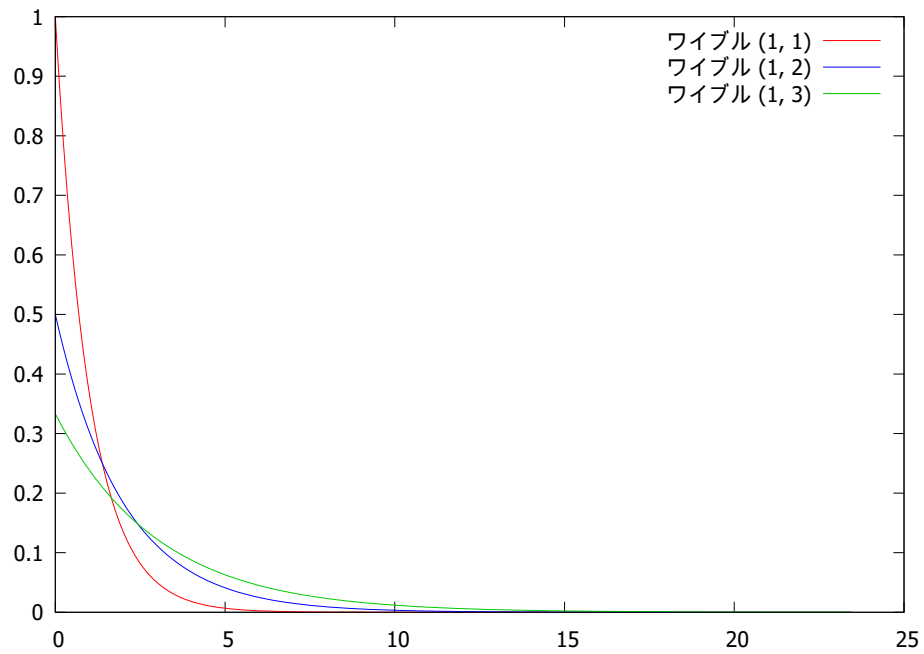
注意：すべての質問に解答しなければ提出とは認めない。授業の HP の解答例を正確に再現すること（乱数は除く）。グループで取り組んでよいが、個別に提出すること。解答例をコピーしたり、他人の名前で提出した場合は、提出点を 0 点とし、再提出も認めない。2 枚以上になる場合は、必ず左上隅をホッチキスで留めること。

1. gretl は代表的な分布の pdf を簡単にプロットできる。指数分布（＝形状母数 1 のワイブル分布）の pdf をプロットする手順は以下の通り。
 - (a) メニューから「ツール」→「分布グラフ」を選択。
 - (b) 「ワイブル分布」のタブを選択し、形状母数と尺度母数を入力。
 - (c) 「OK」をクリック。プロット上の右クリックから「曲線を追加する」を選択すれば、別の pdf を重ねることもできる。尺度母数 $1 \cdot 2 \cdot 3$ の指数分布の pdf を 1 つのグラフにプロットして比較しなさい。
2. gretl は代表的な分布から乱数を簡単に生成できる。指数乱数を生成する手順は以下の通り。
 - (a) メニューから「ファイル」→「データセットの新規作成」を選択。
 - (b) 観測数を入力し、「OK」をクリック。
 - (c) 幾つかの質問には適当に回答。
 - (d) メニューから「追加」→「ランダムな変数」を選択。
 - (e) 「ワイブル分布」のタブを選択し、形状母数・尺度母数・変数名を入力。
 - (f) 「OK」をクリック。観測数を 1000 として尺度母数 1 の指数乱数を生成し、ヒストグラムを描きなさい（メニューから「変数」→「度数分布」）。
3. 逆関数法で指数乱数を生成する手順は以下の通り。
 - (a) 上記と同様の方法で区間 $(0, 1)$ 上の一様乱数 U を生成。
 - (b) 指数分布の cdf の逆関数で $Y = -\log(1 - U)$ と変換（メニューから「追加」→「新規変数の定義」で定義式を入力）。観測数を 1000 として尺度母数 1 の指数乱数を逆関数法で生成し、ヒストグラムを描きなさい。

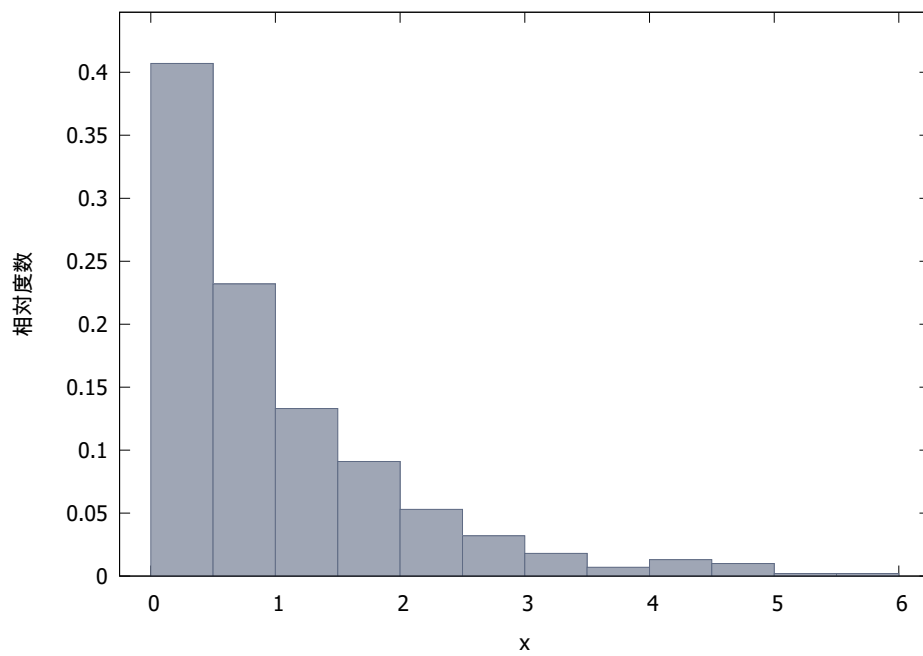
※ gretl の実行結果は右クリックのメニューからコピー・保存できる。作業結果をワードに貼り付け、1 つのファイルにまとめて提出すること。

解答例

1. 指数分布



2. 指数乱数



3. 逆関数法

