

中級統計学／経済統計 I：宿題 4

村澤 康友

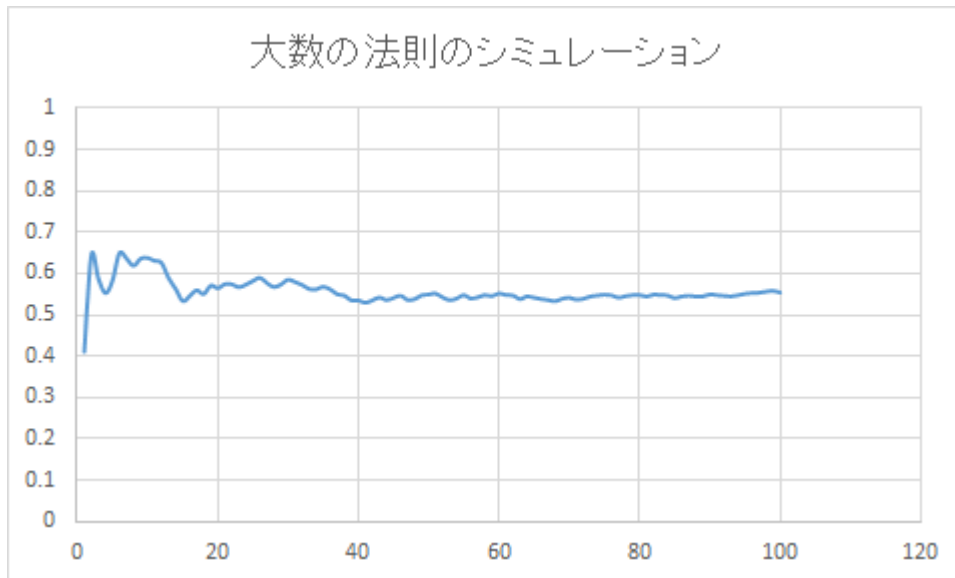
提出期限：2021 年 6 月 7 日（府大）／8 日（甲南）

注意：すべての質問に解答しなければ提出とは認めない。グループで取り組んでよいが、個別に提出すること。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。

- Excel の統計関数 `rand()` は一様乱数を生成する。使用方法は Excel のヘルプを参照。これを用いてシミュレーションで**大数の法則**を確認しなさい。手順は以下の通り（教科書 pp. 157–159 も参照）：
 - 一様乱数 U_1, \dots, U_N を生成（ N は 100 以上）。
 - n 個の一様乱数の平均 $\bar{U}_n := (U_1 + \dots + U_n)/n$ を $n = 1, \dots, N$ について計算。
 - \bar{U}_n の推移を折れ線グラフで示す。※ Excel は他のフリーソフト（OpenOffice Calc など）でも代替可。
- gretl も一様乱数を生成できる。方法は宿題 2 の問 4 を参照。これを用いてシミュレーションで**中心極限定理**を確認しなさい。手順は以下の通り（教科書 pp. 165–170 も参照）：
 - 「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（観測数は 1000 とし、その他の質問には適当に答える）。
 - 一様乱数を N 系列生成（ N は 5 程度で OK）。
 - 「追加」→「新規変数の定義」で n 個の一様乱数の平均 \bar{U}_n の系列を $n = 1, \dots, N$ について生成（ \bar{U}_n の定義式をウィンドウに入力する）。
 - 「変数」→「度数分布」でヒストグラムを作成。「正規分布であるか検定する」を選んで正規分布と比較する。

解答例

1. 大数の法則



2. 中心極限定理

