

中級統計学／経済統計 II：宿題 5

村澤 康友

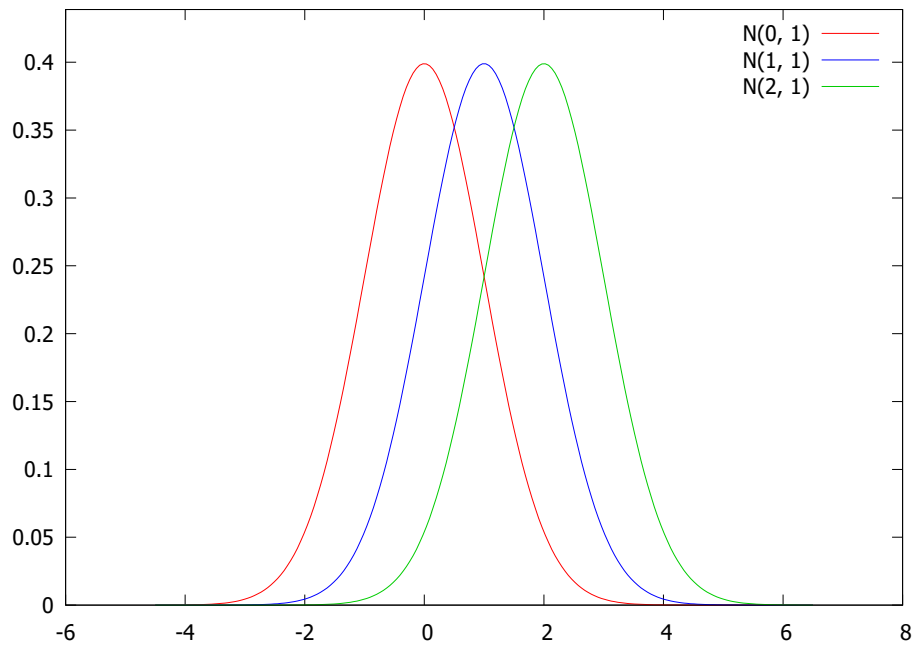
提出期限：2021 年 6 月 25 日（甲南）／28 日（府大）

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）。解答例をコピーした場合は提出点を 0 点とし、再提出も認めない。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。

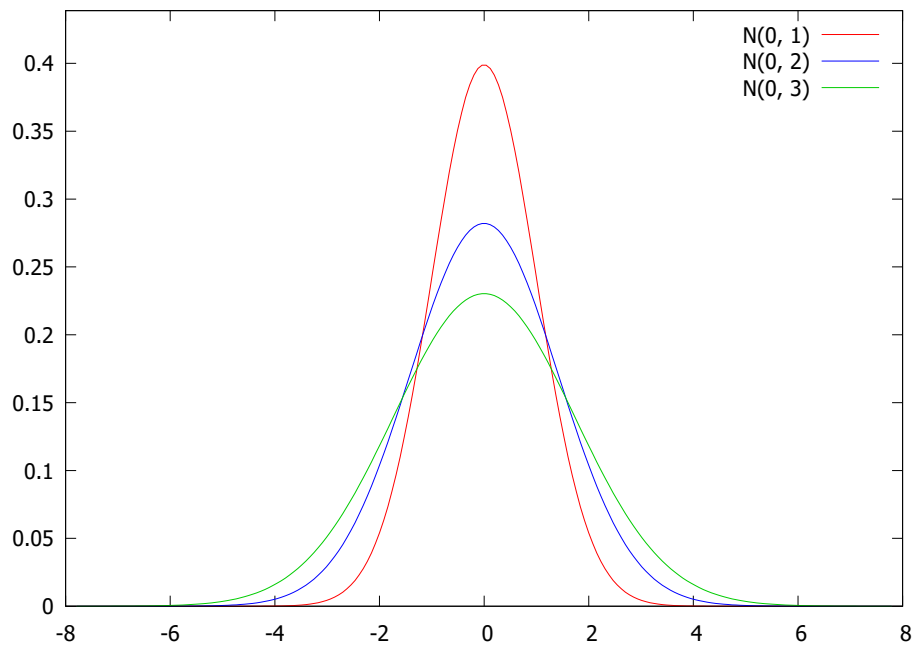
1. gretl は代表的な確率分布の pdf や cdf をプロットできる。正規分布の pdf をプロットする手順は以下の通り。
 - (1) 「ツール」→「分布グラフ」を選択。
 - (2) 「正規分布」のタブを選択。
 - (3) 「平均」と「標準偏差」を入力。
 - (4) 「OK」をクリック。グラフ上で右クリックして「曲線を追加する」を選択すれば、複数のグラフを重ねて表示できる。他の分布についても同様。
 - (a) $N(0, 1)$, $N(1, 1)$, $N(2, 1)$ の pdf を重ねてプロットしなさい。
 - (b) $N(0, 1)$, $N(0, 2)$, $N(0, 3)$ の pdf を重ねてプロットしなさい。
 - (c) $\chi^2(1)$, $\chi^2(2)$, $\chi^2(3)$ の pdf を重ねてプロットしなさい。
 - (d) $t(1)$, $t(2)$, $t(3)$ の pdf を重ねてプロットしなさい。
 - (e) $F(1, 1)$, $F(1, 2)$, $F(1, 3)$ の pdf を重ねてプロットしなさい。
 - (f) $F(1, 1)$, $F(2, 1)$, $F(3, 1)$ の pdf を重ねてプロットしなさい。
2. gretl は代表的な確率分布の擬似乱数を生成できる。 n 個の正規乱数を生成する手順は以下の通り。
 - (1) メニューから「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。
 - (2) 観測数を n とし、その他の質問には適当に答える。
 - (3) メニューから「追加」→「ランダムな変数」を選択。
 - (4) 「正規分布」のタブを選択。
 - (5) 「平均」「標準偏差」「名称」を入力。
 - (6) 「OK」をクリック。他の分布についても同様。生成された乱数の度数分布は「変数」→「度数分布」で確認できる。
 - (a) $N(0, 1)$ の乱数を 1000 個生成し、ヒストグラムを描きなさい。
 - (b) $\chi^2(1)$ の乱数を 1000 個生成し、ヒストグラムを描きなさい。
 - (c) $t(1)$ の乱数を 1000 個生成し、ヒストグラムを描きなさい。
 - (d) $F(1, 1)$ の乱数を 1000 個生成し、ヒストグラムを描きなさい。

解答例

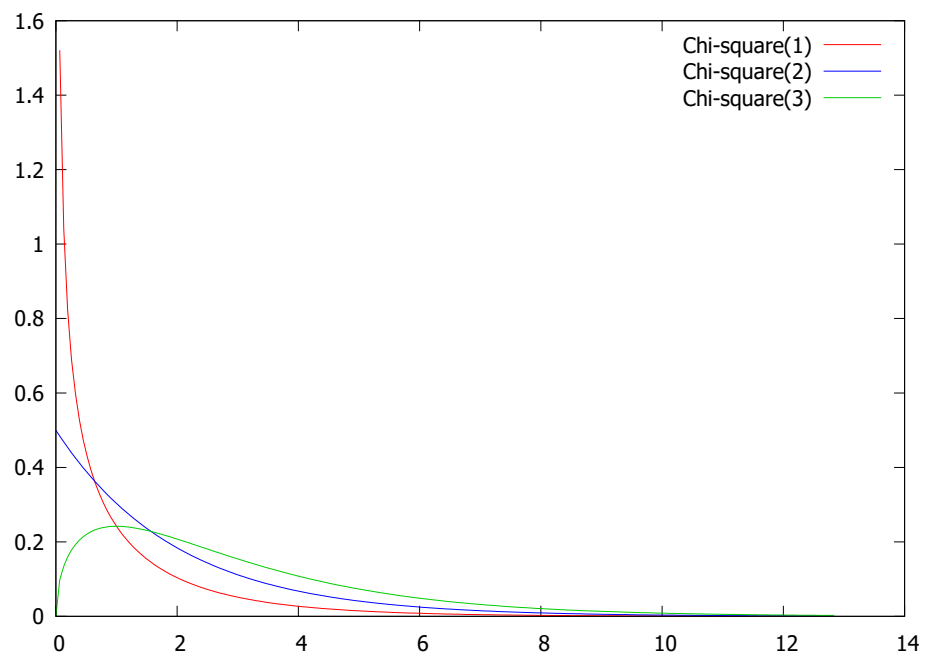
1. (a) $N(0, 1)$, $N(1, 1)$, $N(2, 1)$ の pdf



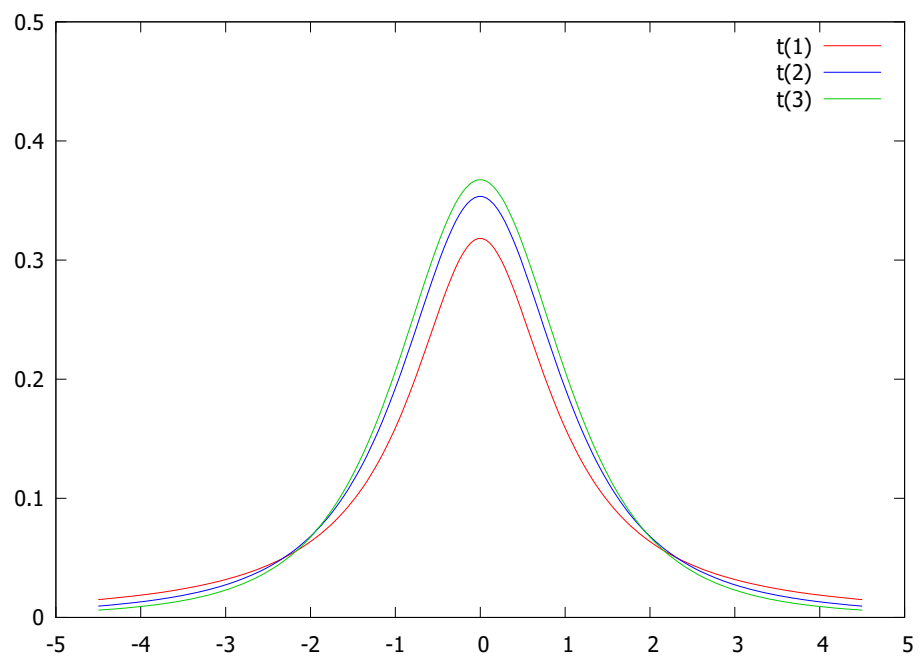
(b) $N(0, 1)$, $N(0, 2)$, $N(0, 3)$ の pdf



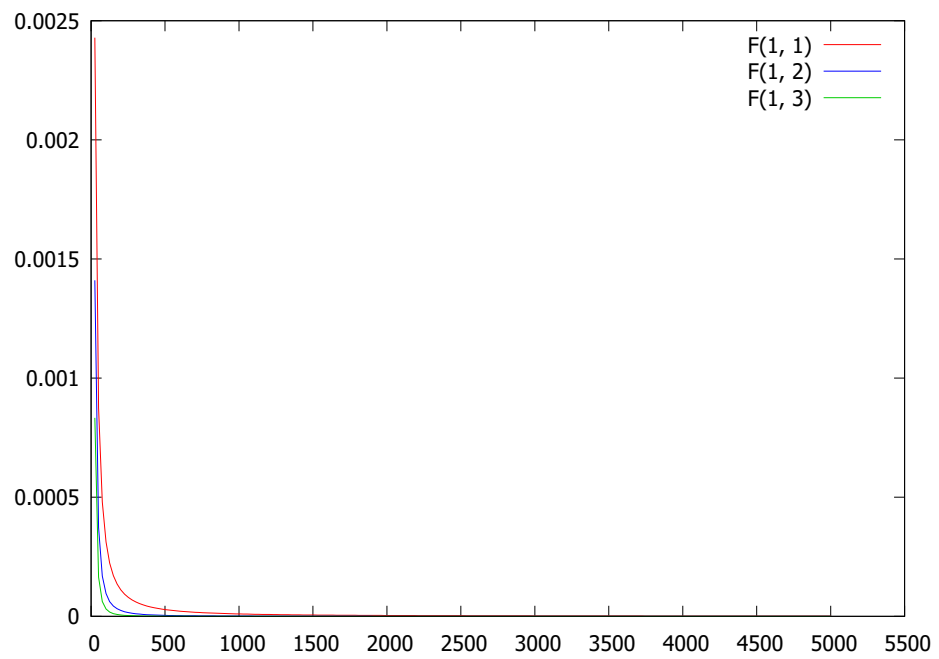
(c) $\chi^2(1), \chi^2(2), \chi^2(3)$ の pdf



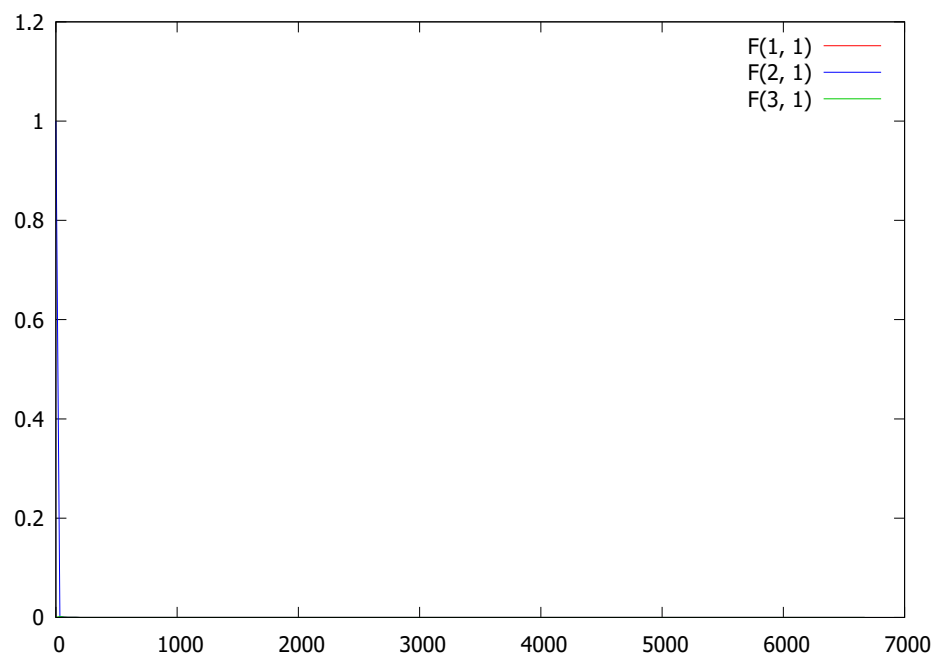
(d) $t(1), t(2), t(3)$ の pdf



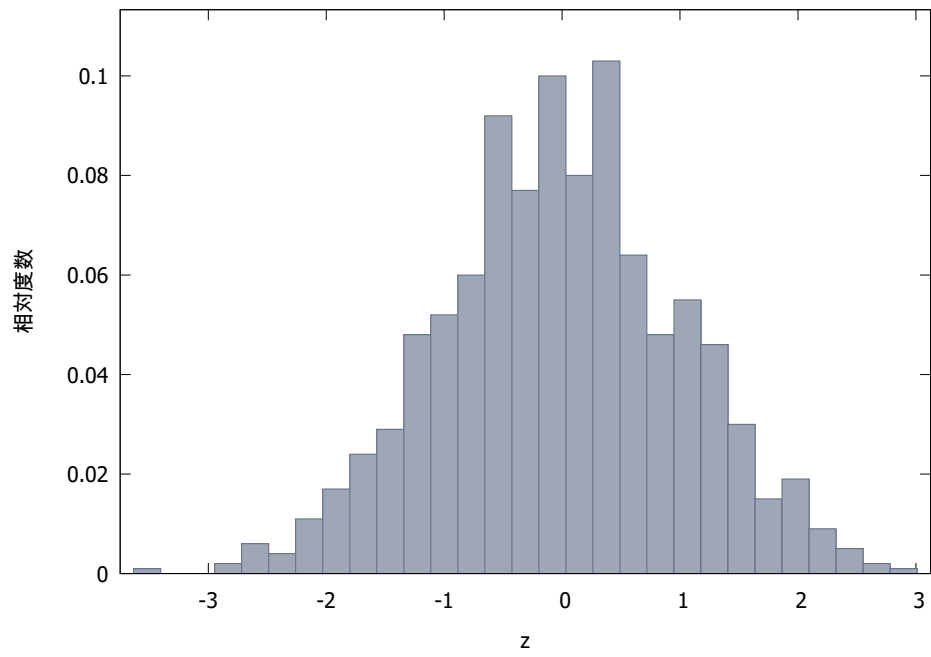
(e) $F(1, 1)$, $F(1, 2)$, $F(1, 3)$ の pdf



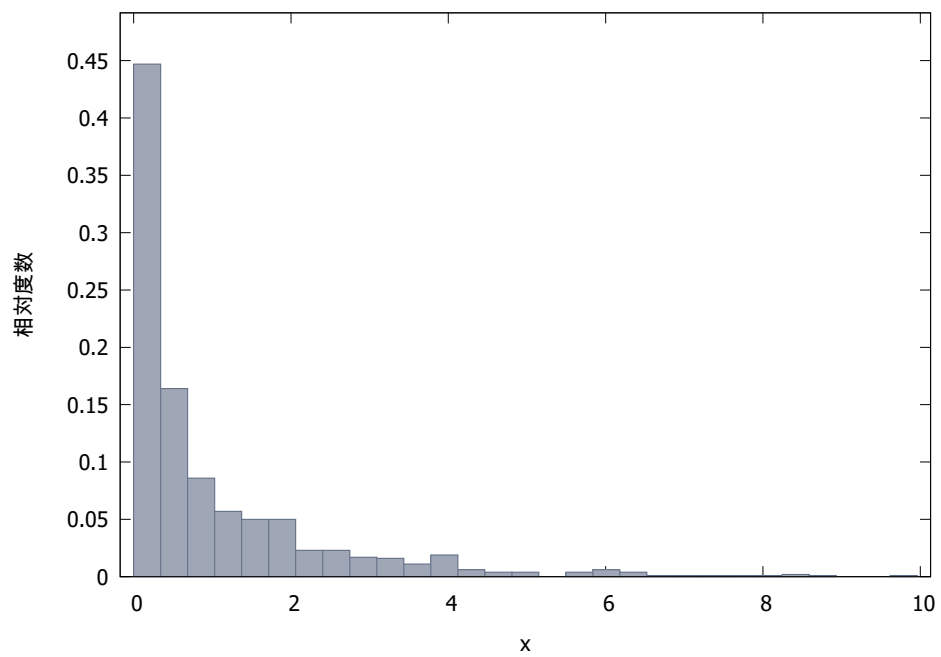
(f) $F(1, 1)$, $F(2, 1)$, $F(3, 1)$ の pdf



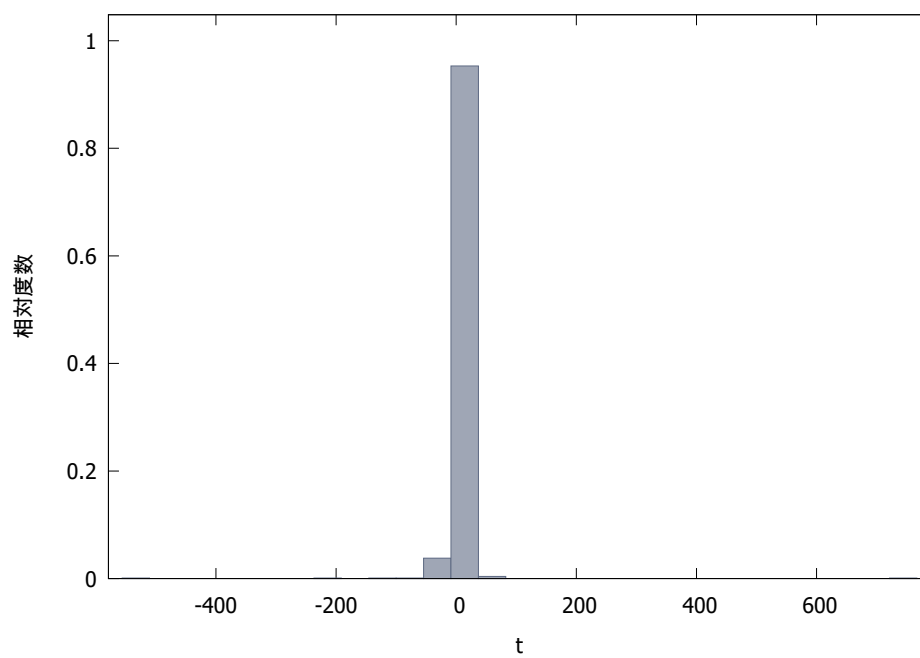
2. (a) $N(0, 1)$ の乱数のヒストグラム



(b) $\chi^2(1)$ の乱数のヒストグラム



(c) $t(1)$ の乱数のヒストグラム



(d) $F(1,1)$ の乱数のヒストグラム

