



Тема лекции:

Статистическое изучение взаимосвязи показателей таможенной статистики

Учебные вопросы:

1. Понятие статистической зависимости. Постановка задачи корреляционно-регрессионного анализа.
2. Методы выявления взаимосвязи. Количественная оценка тесноты связи между показателями таможенной статистики.
3. Модель взаимосвязи между показателями таможенной статистики.

Два класса признаков

- Факторные (X)
- Результативные (Y)

Виды связей

- *Функциональная*
- *Статистическая*
- *Корреляционная*

Прикладные цели исследования зависимостей

1. Установление самого факта наличия или отсутствия статистически значимой связи между Y и X
2. Прогноз неизвестных значений результирующих показателей по заданным значениям X .
3. Выявление причинных связей между переменными X и результирующими показателями Y .

Методы выявления наличия связи, ее характера и направления

- *приведения параллельных рядов данных*
- *аналитических группировок*
- *графический*
- *метод корреляции*

Классификация связей

1. *по направлению связи:*

- прямые
- обратные

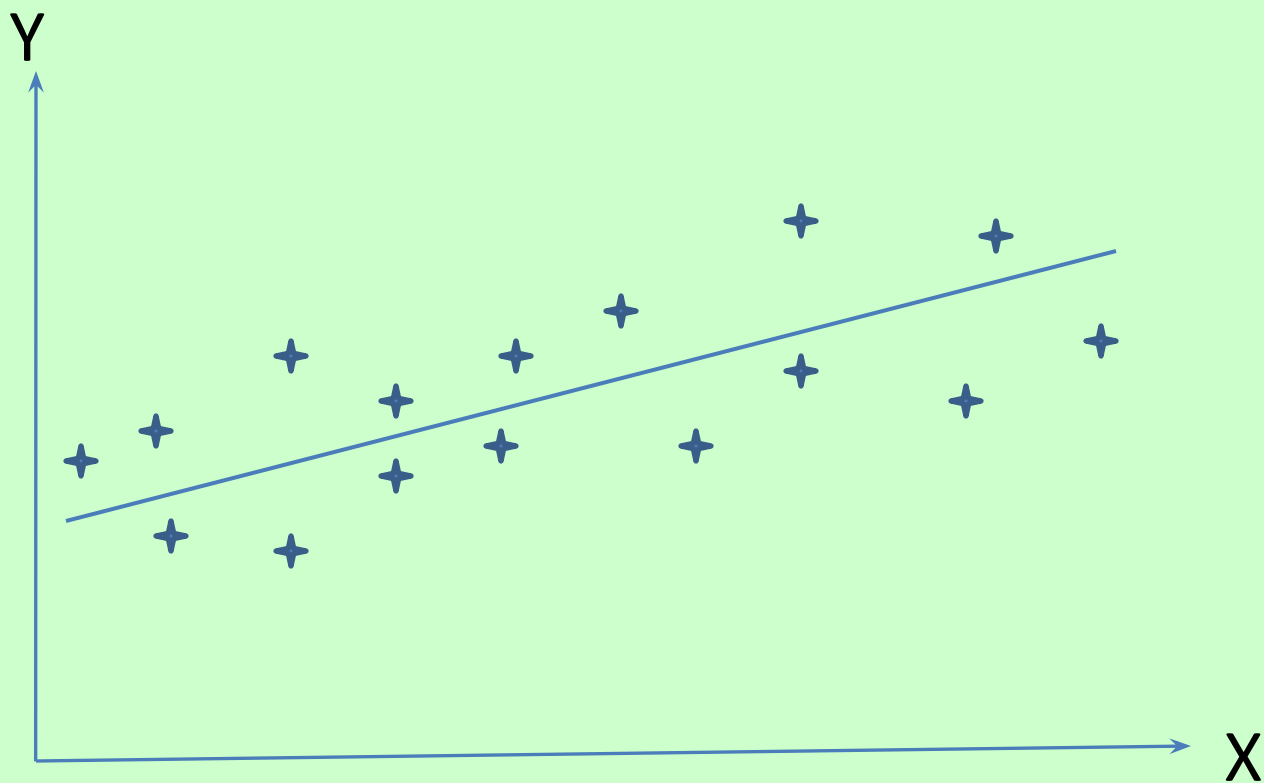
2. *по форме связи:*

- линейные
- нелинейные

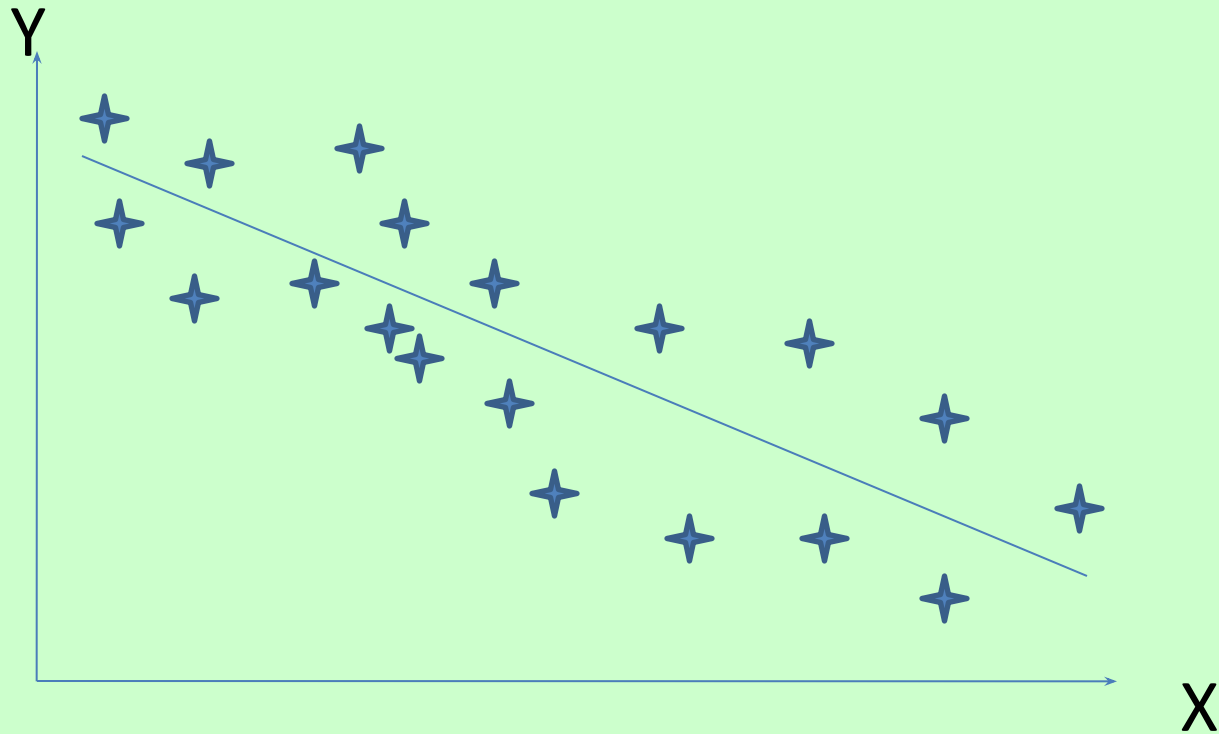
3. *по количеству факторов:*

- однофакторные
- многофакторные

Линейная корреляционная зависимость переменной Y от переменной X (положительная связь)



Отрицательная линейная зависимость



Линейный коэффициент корреляции

$$r_{xy} = \frac{\overline{xy} - \bar{x} \times \bar{y}}{\sigma_x \sigma_y}$$

$$r_{xy} = \frac{n \sum x_i y_i - \sum x_i \sum y_i}{\sqrt{(n \sum x_i^2 - (\sum x_i)^2) \cdot (n \sum y_i^2 - (\sum y_i)^2)}}$$

Величина показателя связи	Характер связи
До $\pm 0,3$	Практически отсутствует
$\pm 0,3 - \pm 0,5$	Слабая
$\pm 0,5 - \pm 0,7$	Умеренная
$\pm 0,7 - \pm 1,0$	сильная

Непараметрические методы корреляционного анализа

Коэффициенты, применяемые для характеристики тесноты связи между признаками разных типов

- Ранговый коэффициент Спирмена **кач/кол**
- Ранговый коэффициент Кендела **кач/кол**
- Коэффициент взаимной сопряженности Пирсона, Чупрова **кач**
- Коэффициент ассоциации и контингенции **кач**
- Бисериальный коэффициент **кач**
- Коэффициент конкордации **кач**

Коэффициент корреляции рангов Спирмена

$$\rho = 1 - \frac{6 \cdot \sum d_i^2}{n(n^2 - 1)}$$

Коэффициент корреляции рангов Кендела

$$\tau = \frac{2 \cdot S}{n(n-1)}$$

$$S = P - Q$$

Коэффициенты взаимной сопряженности Пирсона, Чупрова

$$K_{\Pi} = \sqrt{\frac{\varphi^2}{1 + \varphi^2}} \quad K_{\text{Ч}} = \sqrt{\frac{\varphi^2}{\sqrt{(K_1 - 1) * (K_2 - 1)}}}$$
$$\varphi^2 = \sum \frac{n_{xy}^2}{n_x n_y} - 1$$

n_{xy} - частота каждой клетки таблицы взаимной сопряженности
 n_x, n_y - итоговые частоты соответствующих строк и столбцов
 K_1, K_2 - число строк и столбцов

Коэффициент ассоциации и КОНТИНГЕНЦИИ

$$K_{асс} = \frac{ad - bc}{ad + bc}$$

$$K_{конт} = \frac{ad - bc}{\sqrt{(a + b) \cdot (b + d) \cdot (a + c) \cdot (c + d)}}$$

Пример

Группы сотрудников	Средний балл по сравнению с предыдущей аттестацией		Всего
	Не изменился и возрос	снизился	
Прошедшие квалификацию	163 (a)	77 (b)	240 (a+b)
Непрошедшие квалификацию	46 (c)	34 (d)	80 (c+d)
Всего:	209	111	320

Точечный бисериальный коэффициент корреляции

$$r_{pb} = \frac{\bar{x}_1 - \bar{x}_0}{s_x} \sqrt{\frac{n_1 n_2}{n(n-1)}}$$

\bar{x}_1 – среднее значение по X объектов со значением «единица» по Y ;

\bar{x}_0 – среднее значение по X объектов со значением «ноль» по Y ;

s_x – среднее квадратическое отклонение всех значений по X ;

n_1 – число объектов «единица» по Y , n_0 – число объектов «ноль» по Y ;

$n = n_1 + n_0$ – объем выборки.

Рангово-бисериальный коэффициент корреляции

$$r_{rb} = \frac{2}{n} (\bar{X}_1 - \bar{X}_0)$$

Здесь \bar{X}_1 – средний ранг объектов, имеющих единицу по Y ; \bar{X}_0 – средний ранг объектов с нулем по Y , n – объем выборки.

Коэффициент конкордации (согласованности) Кендалла

$$W = \frac{12 \cdot \sum_{i=1}^n D_i^2}{m^2 (n^3 - n)}$$

Модель взаимосвязи показателей таможенной статистики

$$Y_i = \varphi(X_i) + \epsilon_i,$$

где Y_i – значение результирующей переменной Y в i – том наблюдении;

X_i – значение фактора X в i – том наблюдении;

$X = (X_1, X_2, \dots, X_m)$ – в общем случае вектор фактор;

m – количество компонентов вектора - фактора;

ϵ_i – значение случайной составляющей ϵ в i – том наблюдении (остатки);

$i=1,2,\dots,n$.

Основные предпосылки применения регрессионного анализа:

- Достаточный объем наблюдений (не менее (8-10 единиц).
- Однородность изучаемых единиц.
- Случайная составляющая модели ϵ (остатки) имеет нормальное распределение с математическим ожиданием, равным нулю и постоянной дисперсией (Остатки ϵ не должны зависеть от значений фактора X .)
- Остатки ϵ_i должны быть некоррелированы между собой.

Формы регрессии

1. Регрессия парная.
2. Множественная регрессия.
3. Линейная регрессия.
4. Нелинейная регрессия относительно включенных в уравнение переменных, но линейная по параметрам.
5. Нелинейная регрессия, отличающаяся нелинейностью по оцениваемым параметрам.

Этапы построения регрессионных моделей

- 1. Выбор формулы связи переменных Y и X :
 $Y = \varphi(X)$ (спецификация уравнения регрессии).**
- 2. Оценка параметров уравнения регрессии и проверка надежности полученных оценок (параметризация уравнения регрессии).**
- 3. Статистический анализ модели: оценка точности и адекватности модели (определение статистической значимости коэффициента детерминации, исследование случайной составляющей ϵ).**

Анализ взаимосвязи

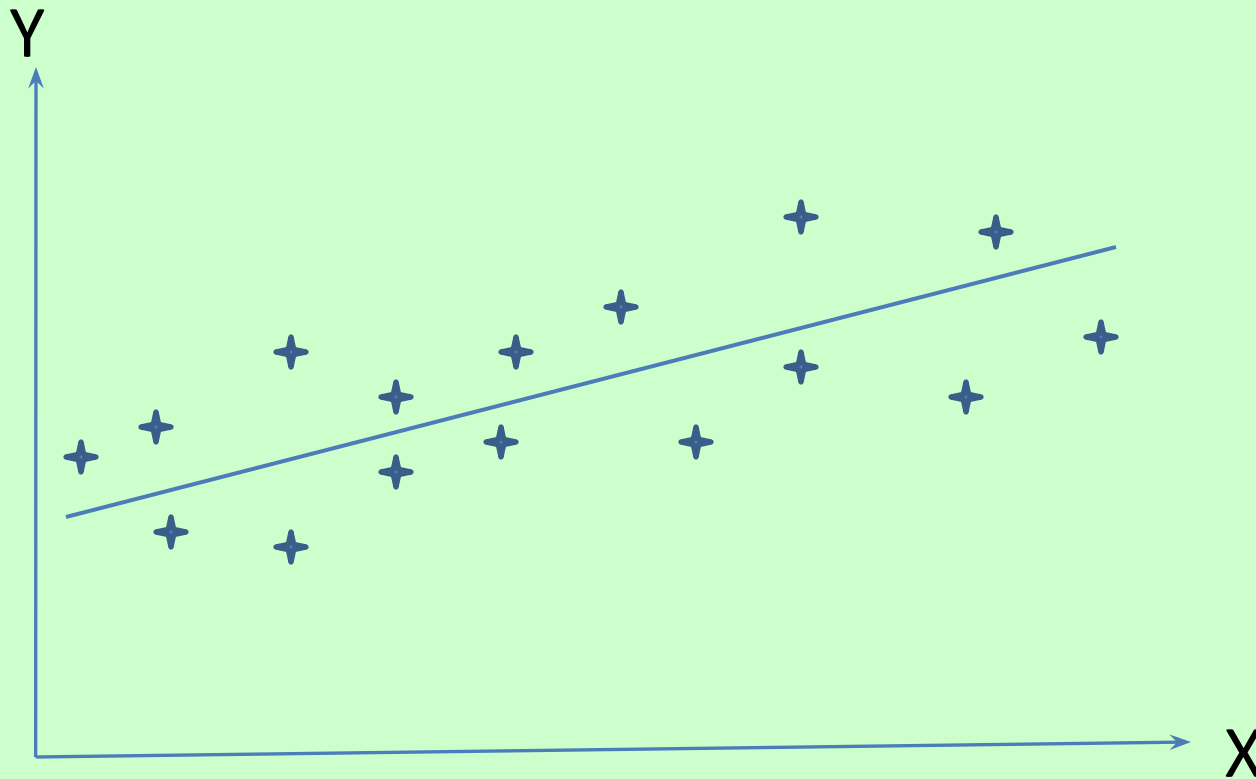
- 1. Изобразить диаграмму, сформулировать гипотезу о форме связи.
- 2. Найти параметры уравнения линейной регрессии
- 3. Оценить статистическую значимость коэффициента регрессии, используя t-критерий Стьюдента
- 4. Рассчитать границы доверительного интервала для b
- 5. Вычислить коэффициенты корреляции, детерминации.
- 6. Выполнить прогноз

1.Графический анализ

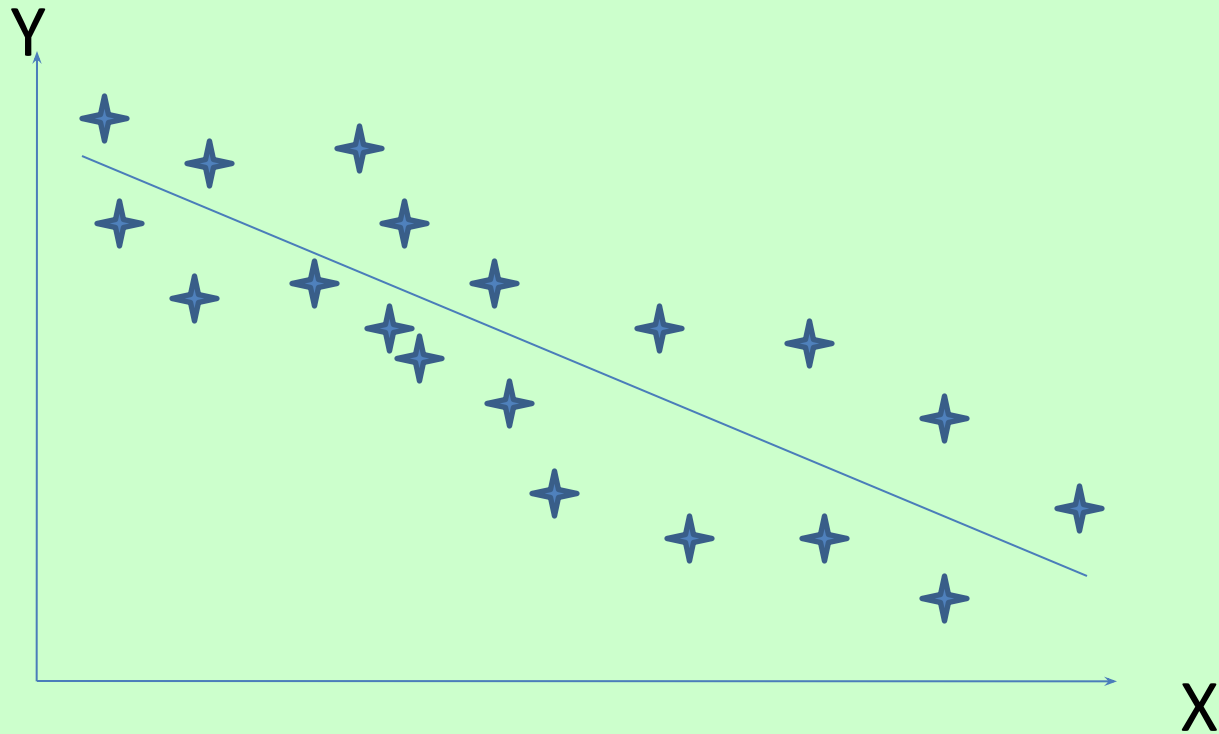
Линейная корреляционная зависимость

переменной Y от переменной X

(положительная связь)



Отрицательная линейная зависимость



**Связи нелинейного характера могут быть
отображены функциями разного вида:**

$$\hat{y} = ax^b \quad \text{- степенной ;}$$

$$\hat{y} = a + b \cdot \log x \quad \text{- логарифмической;}$$

$$\hat{y} = ab^x \quad \text{- показательной ;}$$

$$\hat{y} = a + \frac{b}{x} \quad \text{- гиперболической и др.}$$

2. Линейное уравнение регрессии

$$y = a + bx$$

Метод наименьших квадратов

$$S = \sum_{i=1}^n (y_i - \tilde{y}_i)^2 \Rightarrow \min$$

$$\sum_{i=1}^n (y_i - (\tilde{a} + \tilde{b}x_i))^2 \Rightarrow \min$$

Система нормальных уравнений

$$\sum_{i=1}^n y_i = \tilde{a}n + \tilde{b} \sum_{i=1}^n x_i$$

$$\sum_{i=1}^n y_i x_i = \tilde{a} \sum_{i=1}^n x_i + \tilde{b} \sum_{i=1}^n x_i^2$$

Расчетная таблица:

	Месяц	Оборот млрд. долл. x	Таможенн ые платежи млрд. долл. y	xу	x²	y²	y(x)
1	январь						
2	февраль						
3	март						
4	апрель						
5	май						
6	июнь						
7	июль						
8	август						
9	сентябрь						
10	октябрь						
11	ноябрь						
12	декабрь						

Оценки

параметров

$$b = \frac{\overline{yx} - \bar{y} \cdot \bar{x}}{\overline{x^2} - (\bar{x})^2} \quad - \text{Коэффициент регрессии}$$

$$a = \bar{y} - b \cdot \bar{x}$$

4. Оценка статистической значимости коэффициента регрессии

Выдвигаем гипотезу $H_0: b=0$ об
отсутствии влияния фактора на

ОТКЛИК

1) Стандартная
ошибка

$$SE_b = \sqrt{\frac{\sum e^2}{(N-1)(N-2) \cdot \delta_x^2}}$$

$$\delta_x = \sqrt{\frac{N}{(N-1)} \cdot (\overline{x^2} - \bar{x}^2)}$$

N – число
наблюдений

- Рассчитываем фактическое значение t -критерия Стьюдента и сравниваем с табличным значением на уровне значимости $\alpha=0,05$ и числа степеней свободы $N-2=12-2=10$

$$t_b = \frac{|b|}{SE_b}$$

$t_b > t_{\text{табл}}$ – гипотеза H_0 отклоняется

Критические значения критерия t-Стьюдента

df	α				df	α				df	α			
	0,10	0,05	0,01	0,001		0,10	0,05	0,01	0,001		0,10	0,05	0,01	0,001
1	6,314	12,70	63,65	636,6	31	1,696	2,040	2,744	3,633	61	1,670	2,000	2,659	3,457
2	2,920	4,303	9,925	31,60	32	1,694	2,037	2,738	3,622	62	1,670	1,999	2,657	3,454
3	2,353	3,182	5,841	12,92	33	1,692	2,035	2,733	3,611	63	1,669	1,998	2,656	3,452
4	2,132	2,776	4,604	8,610	34	1,691	2,032	2,728	3,601	64	1,669	1,998	2,655	3,449
5	2,015	2,571	4,032	6,869	35	1,690	2,030	2,724	3,591	65	1,669	1,997	2,654	3,447
6	1,943	2,447	3,707	5,959	36	1,688	2,028	2,719	3,582	66	1,668	1,997	2,652	3,444
7	1,895	2,365	3,499	5,408	37	1,687	2,026	2,715	3,574	67	1,668	1,996	2,651	3,442
8	1,860	2,306	3,355	5,041	38	1,686	2,024	2,712	3,566	68	1,668	1,995	2,650	3,439
9	1,833	2,262	3,250	4,781	39	1,685	2,023	2,708	3,558	69	1,667	1,995	2,649	3,437
10	1,812	2,228	3,169	4,587	40	1,684	2,021	2,704	3,551	70	1,667	1,994	2,648	3,435
11	1,796	2,201	3,106	4,437	41	1,683	2,020	2,701	3,544	71	1,667	1,994	2,647	3,433
12	1,782	2,179	3,055	4,318	42	1,682	2,018	2,698	3,538	72	1,666	1,993	2,646	3,431
13	1,771	2,160	3,012	4,221	43	1,681	2,017	2,695	3,532	73	1,666	1,993	2,645	3,429
14	1,761	2,145	2,977	4,140	44	1,680	2,015	2,692	3,526	74	1,666	1,993	2,644	3,427
15	1,753	2,131	2,947	4,073	45	1,679	2,014	2,690	3,520	75	1,665	1,992	2,643	3,425
16	1,746	2,120	2,921	4,015	46	1,679	2,013	2,687	3,515	76	1,665	1,992	2,642	3,423
17	1,740	2,110	2,898	3,965	47	1,678	2,012	2,685	3,510	78	1,665	1,991	2,640	3,420
18	1,734	2,101	2,878	3,922	48	1,677	2,011	2,682	3,505	79	1,664	1,990	2,639	3,418
19	1,729	2,093	2,861	3,883	49	1,677	2,010	2,680	3,500	80	1,664	1,990	2,639	3,416
20	1,725	2,086	2,845	3,850	50	1,676	2,009	2,678	3,496	90	1,662	1,987	2,632	3,402
21	1,721	2,080	2,831	3,819	51	1,675	2,008	2,676	3,492	100	1,660	1,984	2,626	3,390
22	1,717	2,074	2,819	3,792	52	1,675	2,007	2,674	3,488	110	1,659	1,982	2,621	3,381
23	1,714	2,069	2,807	3,768	53	1,674	2,006	2,672	3,484	120	1,658	1,980	2,617	3,373
24	1,711	2,064	2,797	3,745	54	1,674	2,005	2,670	3,480	130	1,657	1,978	2,614	3,367
25	1,708	2,060	2,787	3,725	55	1,673	2,004	2,668	3,476	140	1,656	1,977	2,611	3,361
26	1,706	2,056	2,779	3,707	56	1,673	2,003	2,667	3,473	150	1,655	1,976	2,609	3,357

5. Рассчитываем Границы 95-процентного доверительного интервала для коэффициента регрессии

$$\text{Н.гр.} = b - t_{\text{табл}} * SE_b$$

$$\text{В.гр.} = b + t_{\text{табл}} * SE_b$$

6. Рассчитываем Коэффициент корреляции

$$r = b \frac{\delta_x}{\delta_y}$$

$$\delta_x = \sqrt{\frac{N}{(N-1)} \cdot (\overline{x^2} - \bar{x}^2)}$$

$$\delta_y = \sqrt{\frac{N}{(N-1)} \cdot (\overline{y^2} - \bar{y}^2)}$$

Степень тесноты связи

Величина показателя связи	Характер связи
До $\pm 0,3$	Практически отсутствует
$\pm 0,3 - \pm 0,5$	Слабая
$\pm 0,5 - \pm 0,7$	Умеренная
$\pm 0,7 - \pm 1,0$	сильная

7. Оценка адекватности уравнения регрессии

- Теоретический коэффициент детерминации

$$R_{yx}^2 = r^2$$

$R^2 > 30\%$ - прогнозировать по модели целесообразно

8. Оценка значимости уравнения регрессии

Выдвигаем гипотезу $H_0: b=0$ о статистической незначимости уравнения регрессии и коэффициента детерминации

Рассчитываем фактическое значение F-критерия Фишера и сравниваем с табличным значением на уровне значимости $\alpha=0,05$ и числе степеней свободы 1 и $N-2=12-2=10$

$$F_{\text{факт}} = \frac{R^2}{1 - R^2} \cdot (N - 2)$$

$F_{\text{факт}} > F_{\text{табл}}$ – гипотеза
отклоняется

Критические значения критерия F-Фишера

$\alpha=0,05$

	Степени свободы для числителя											
	1	2	3	4	5	6	7	8	10	12	24	?
3	10,128	9,552	9,277	9,117	9,013	8,941	8,887	8,845	8,785	8,745	8,638	8,527
5	6,608	5,786	5,409	5,192	5,050	4,950	4,876	4,818	4,735	4,678	4,527	4,366
7	5,591	4,737	4,347	4,120	3,972	3,866	3,787	3,726	3,637	3,575	3,410	3,231
10	4,965	4,103	3,708	3,478	3,326	3,217	3,135	3,072	2,978	2,913	2,737	2,539
11	4,844	3,982	3,587	3,357	3,204	3,095	3,012	2,948	2,854	2,788	2,609	2,406
12	4,747	3,885	3,490	3,259	3,106	2,996	2,913	2,849	2,753	2,687	2,505	2,297
13	4,667	3,806	3,411	3,179	3,025	2,915	2,832	2,767	2,671	2,604	2,420	2,208
14	4,600	3,739	3,344	3,112	2,958	2,848	2,764	2,699	2,602	2,534	2,349	2,132
15	4,543	3,682	3,287	3,056	2,901	2,790	2,707	2,641	2,544	2,475	2,288	2,067
16	4,494	3,634	3,239	3,007	2,852	2,741	2,657	2,591	2,494	2,425	2,235	2,011
18	4,414	3,555	3,160	2,928	2,773	2,661	2,577	2,510	2,412	2,342	2,150	1,918
20	4,351	3,493	3,098	2,866	2,711	2,599	2,514	2,447	2,348	2,278	2,082	1,844
30	4,171	3,316	2,922	2,690	2,534	2,421	2,334	2,266	2,165	2,092	1,887	1,624
40	4,085	3,232	2,839	2,606	2,449	2,336	2,249	2,180	2,077	2,003	1,793	1,511
50	4,034	3,183	2,790	2,557	2,400	2,286	2,199	2,130	2,026	1,952	1,737	1,440
70	3,978	3,128	2,736	2,503	2,346	2,231	2,143	2,074	1,969	1,893	1,674	1,355
100	3,936	3,087	2,696	2,463	2,305	2,191	2,103	2,032	1,927	1,850	1,627	1,286
200	3,888	3,041	2,650	2,417	2,259	2,144	2,056	1,985	1,878	1,801	1,572	1,192
∞	3,843	2,998	2,607	2,374	2,216	2,100	2,011	1,940	1,833	1,754	1,519	

9. Прогноз ожидаемого значения y по уравнению регрессии

- Средняя абсолютная ошибка прогноза

$$\text{MAPE} = (|e/y| * 100)/N$$

9. Прогноз ожидаемого значения y по уравнению регрессии

- Точечный

$$y_f = a + bx_f$$

- Интервальный

$$\text{Н.гр.} = y_f - t_{\text{табл}} * SE_f$$

$$\text{В.гр.} = y_f + t_{\text{табл}} * SE_f$$

Стандартная ошибка прогноза

$$SE_f = \sqrt{\frac{\sum e^2}{N-2} \left(1 + \frac{1}{N} + \frac{(x_f - \bar{x})^2}{(N-1) \cdot \delta_x^2}\right)}$$