

2015年度秋学期 統計学 第12回

分布の平均を推測する — 区間推定

浅野 晃
関西大学総合情報学部



1

ちょっと前回までの復習

2

「統計的推測」とは

調べたい集団の、データ全体を調べられるか？

日本男性全員の身長を調べられるか？

データの一部を調べて

度数分布を推測する

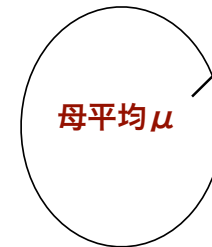
いや、せめて平均や分散を推測する

統計的推測

3

母平均の推定

母集団
(日本男性全体)



母平均 μ

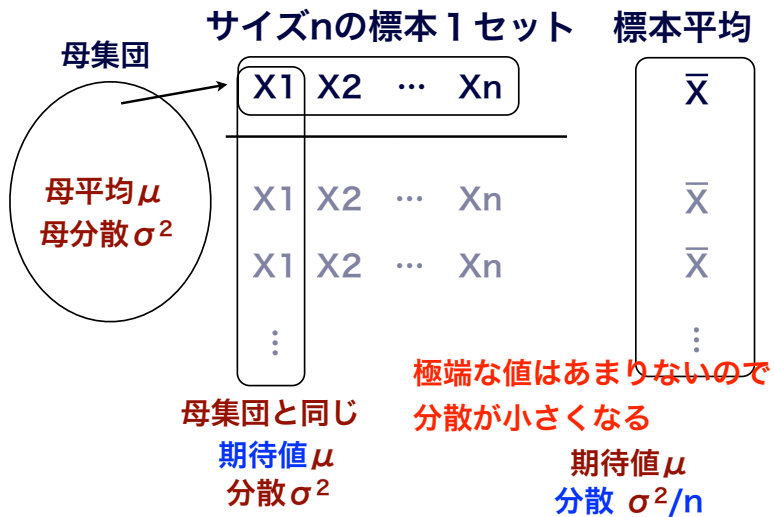
標本として数値を
いくつか取り出して、
それらの平均
[標本平均]

標本平均は母平均に
近い値になるか？

母平均が知りたい
が、日本男性全員は調べられない

4

母平均の推定



5

母平均の推定

いま1回だけ計算した標本平均も、
おそらく、ほぼ母平均に近い値だろう

どのくらい近い？

どのくらいの確率で？
はずれる確率は？

6

正規分布モデル

世の中には、[正規分布モデル]で表せる
ような母集団分布がたくさんある

長さの測定値の分布

センター試験の成績の分布 ...

[中心極限定理]

母集団のばらつきの原因が

無数の独立な原因の和のとき、

母集団分布は概ね正規分布になる

7

正規分布の性質 1

確率変数 X が $N(\mu, \sigma^2)$ にしたがう とき

$(X - \mu) / \sigma$ は $N(0, 1)$ にしたがう

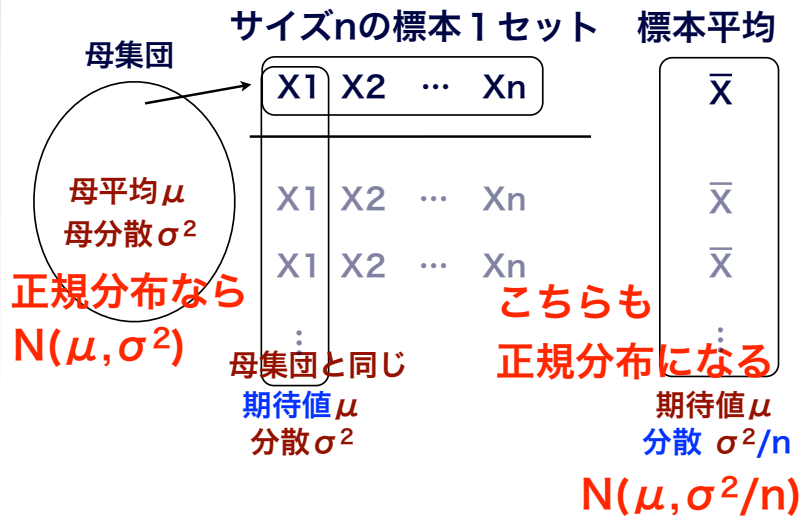
「標準得点」と同じ

変換しても、
やはり正規分布になる

$N(0, 1)$ を [標準正規分布] という

8

正規分布の性質 2



9

区間推定

10

区間推定

母平均を推測する。その答え方が、

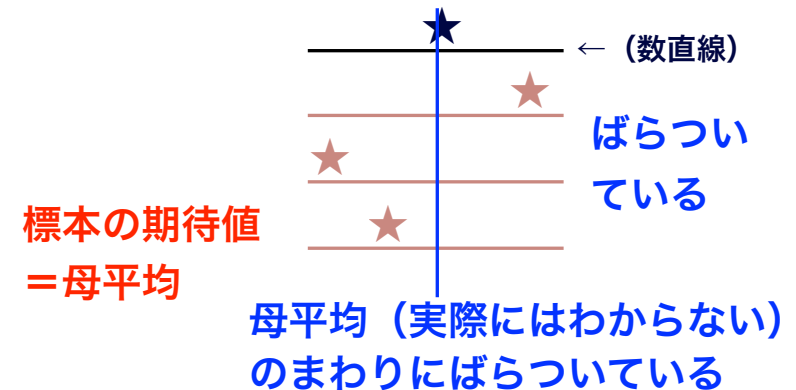
母平均は、50 から 60 の間にあると
推測する。

この推測が当たっている確率は 95%
である。

11

区間推定の考え方

標本として数値をひとつだけ抽出
仮に、何度も抽出したとすると



12

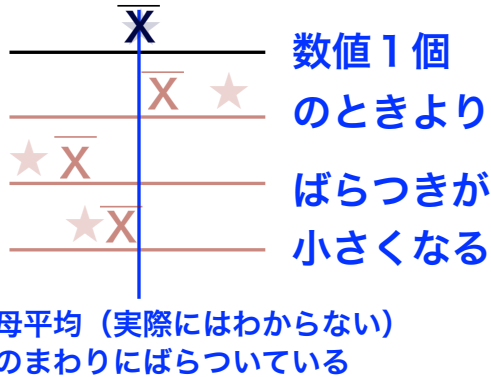
区間推定の考え方

数値をいくつか抽出して標本平均

仮に、何度も抽出したとすると

標本平均の期待値 = 母平均

標本平均の分散 = 母分散 ÷ 標本サイズ



区間推定の考え方

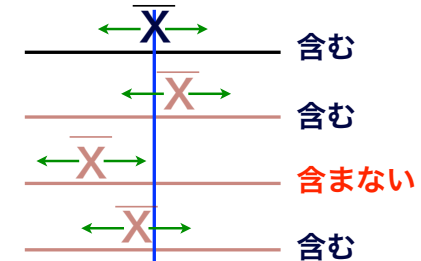
標本平均の左右に区間をつける

区間は母平均を

どの回の区間が母平均を含むか・含まないかはわからないが

確率95%で

母平均を含むように区間を設定できる

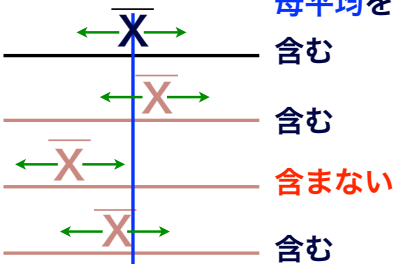


母平均 (実際にはわからない)

区間推定の考え方

確率95%で母平均を含むように区間を設定できる

区間は母平均を

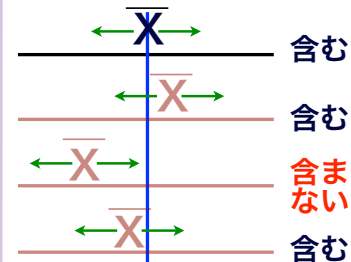


母平均 (実際にはわからない)

標本平均のばらつきは小さくなっているので区間の幅はそこそ狭くてよい

区間推定の考え方

区間は母平均を



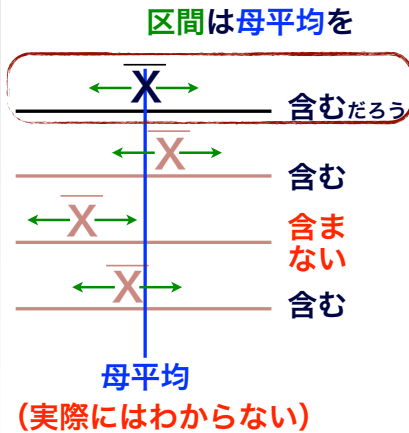
母平均 (実際にはわからない)

実際には、標本平均と区間は1度しか計算しない

その区間が、母平均を含むかどうかは実際にはわからない

しかし、確率95%で母平均を含むように計算した区間だから、その1回も含むと信じる

信頼区間



95%という大きな確率
で母平均を含むように
計算した区間だから、
その1回も含むと信じ
る

母平均の
[信頼係数] 95%の
[信頼区間] という
([95%信頼区間])

2015

17

「信頼」ということば

私は、予言者です。
私の予言は、確率95%で当たります。

いまから、来年おきることを
予言します。「来年は、…」

このひとつの予言が正しいかどうかは
わからない

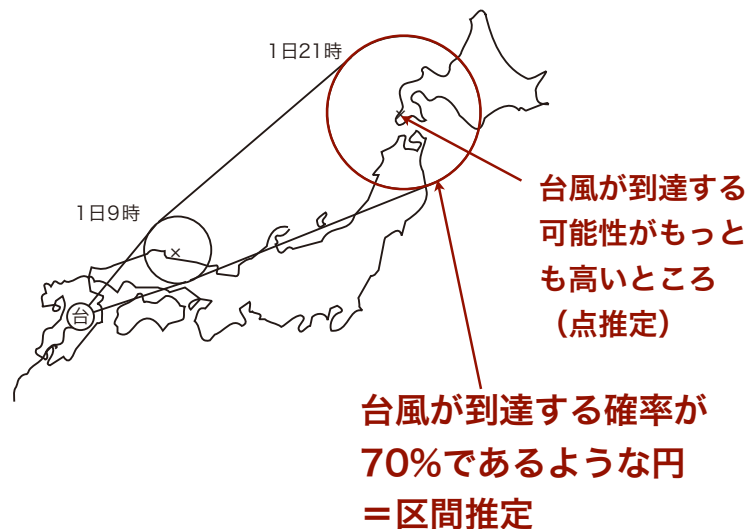
しかし、十分多くの予言をすれば95%は
当たるのだから、この予言も
信じる価値はある **これが「信頼」**

A.Asano, Kansai Univ.

2015

18

台風情報と信頼区間



2015

19

正規分布の場合の
信頼区間の計算

A.Asano, Kansai Univ.

20

正規分布の場合の区間推定

例題

母集団
(受験者全体)

標本 X_1, \dots, X_n をとりだす
サイズ n

標本平均 \bar{X}

母平均 μ

母平均 μ の95%信頼区間が
知りたい

正規分布
と仮定する

(説明の都合です)

母分散 σ^2 がわかっているものとする

2015

21

正規分布の場合の区間推定

考え方

標本は、母集団分布と同じ確率分布にしたがう
正規分布 $N(\mu, \sigma^2)$

標本平均は、やはり正規分布にしたがうが、分散が $1/n$ になる **【性質2】**
正規分布 $N(\mu, \sigma^2/n)$

2015

22

正規分布の場合の区間推定

考え方

標本は、母集団分布と同じ確率分布にしたがう

正規分布 $N(\mu, \sigma^2)$

標本平均 \bar{X} は、やはり正規分布にしたがうが、分散が $1/n$ になる
正規分布 $N(\mu, \sigma^2/n)$ **【性質2】**

正規分布の **【性質1】** により

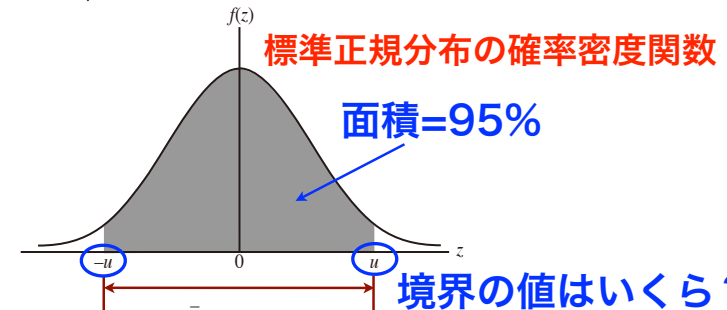
$Z = \frac{\bar{X} - \mu}{\sqrt{\sigma^2/n}}$ は標準正規分布にしたがう
 $N(0, 1)$

2015

23

正規分布の場合の区間推定

$Z = \frac{\bar{X} - \mu}{\sqrt{\sigma^2/n}}$ は標準正規分布にしたがう

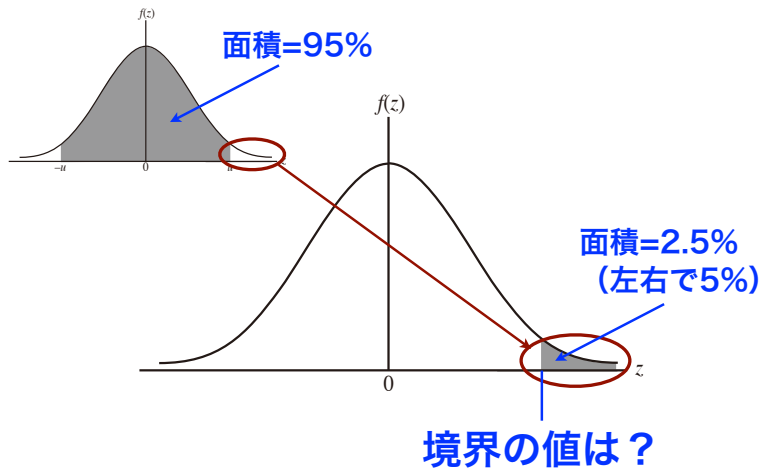


$Z = \frac{\bar{X} - \mu}{\sqrt{\sigma^2/n}}$ が
この区間に入っている確率=95%とすると

2015

24

正規分布の場合の区間推定

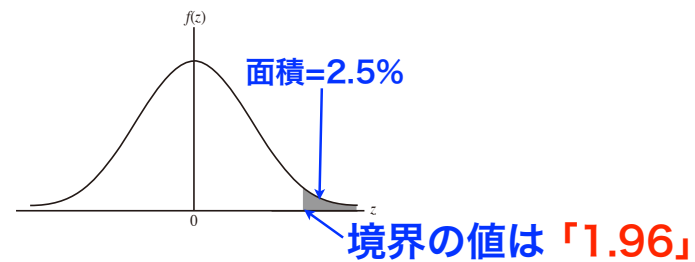


境界の値は？

2015

25

正規分布の場合の区間推定



うまいぐあいに、正規分布表で

0.06

	0.00	0.01	0.02	0.03	0.04	0.05	0.06	0.07	0.08	0.09
0.0	0.50000	0.49601	0.49202	0.48803	0.48405	0.48006	0.47608	0.47210	0.46812	0.46414
0.1	0.46017	0.45620	0.45224	0.44828	0.44433	0.44038	0.43644	0.43251	0.42858	0.42465

...

1.9	0.028717	0.028067	0.027429	0.026803	0.026190	0.025588	0.024998	0.024419	0.023852	0.023295
-----	----------	----------	----------	----------	----------	----------	----------	----------	----------	----------

1.9

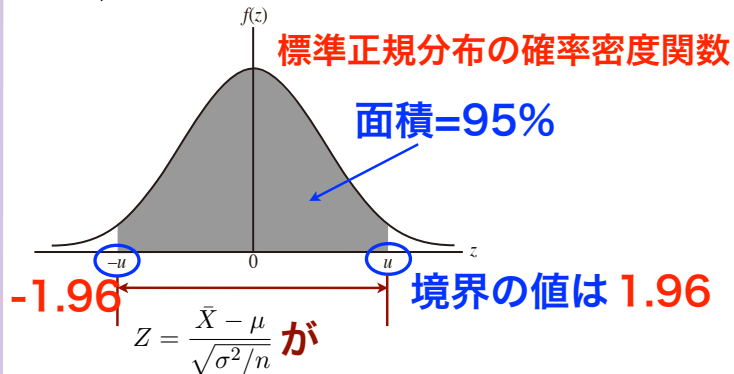
0.024998

2015

26

正規分布の場合の区間推定

$Z = \frac{\bar{X} - \mu}{\sqrt{\sigma^2/n}}$ は標準正規分布にしたがう



標準正規分布の確率密度関数

面積=95%

境界の値は 1.96

$Z = \frac{\bar{X} - \mu}{\sqrt{\sigma^2/n}}$ が

この区間に入っている確率=95%とする

2015

27

正規分布の場合の区間推定

$Z = \frac{\bar{X} - \mu}{\sqrt{\sigma^2/n}}$ が -1.96と1.96の間に入っている確率が95%

式で書くと

$$P(-1.96 \leq \frac{\bar{X} - \mu}{\sqrt{\sigma^2/n}} \leq 1.96) = 0.95$$

μ の式に直すと

$$P(\bar{X} - 1.96\sqrt{\sigma^2/n} \leq \mu \leq \bar{X} + 1.96\sqrt{\sigma^2/n}) = 0.95$$

2015

28

正規分布の場合の区間推定

例題では

標本平均=50 母分散=25 標本サイズ=10

$$P(\bar{X} - 1.96\sqrt{\sigma^2/n} \leq \mu \leq \bar{X} + 1.96\sqrt{\sigma^2/n}) = 0.95$$

μ の95%
信頼区間の
下限

μ の95%
信頼区間の
上限

計算すると、例題の答は

「46.9以上53.1以下」 [46.9, 53.1]

信頼区間の答え方

$$P(\bar{X} - 1.96\sqrt{\sigma^2/n} \leq \mu \leq \bar{X} + 1.96\sqrt{\sigma^2/n}) = 0.95$$

μ の95%信頼区間の下限 μ の95%信頼区間の上限

計算すると、例題の答は [46.9, 53.1]

これを

$$P(46.9 \leq \mu \leq 53.1) = 0.95$$

と書いてはいけないの？

だめです。なぜ？

信頼区間の答え方

$$P(46.9 \leq \mu \leq 53.1) = 0.95$$

と書いてはいけないの？ だめ。

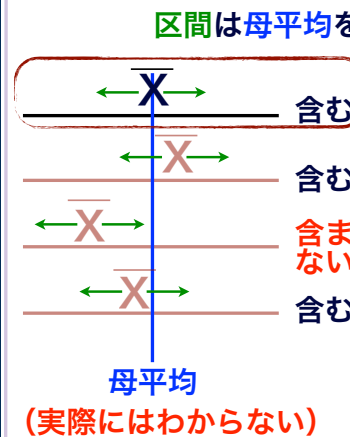
確率の式なのに、()内にランダムなものが入っていないから

$$P(\bar{X} - 1.96\sqrt{\sigma^2/n} \leq \mu \leq \bar{X} + 1.96\sqrt{\sigma^2/n}) = 0.95$$

こう書いたとき、

μ (母平均) はランダムではない
ランダムなのは \bar{X} (標本平均)

これを思いだしてください



実際には、[46.9, 53.1]
標本平均と区間は
1度しか計算しない

その区間が、母平均を
含むかどうかは
実際にはわからない

しかし、確率95%で
母平均を含むように計
算した区間だから、そ
の1回も含むと信じる

区間推定についての注意

$$P(\bar{X} - 1.96\sqrt{\sigma^2/n} \leq \mu \leq \bar{X} + 1.96\sqrt{\sigma^2/n}) = 0.95$$

1. 母集団の大きさは関係ない

復元抽出なら、母集団分布は
標本抽出によって変化しない

2. 「95%」を選ぶ根拠はない

「確率5%なら、推測がはずれ
て失敗しても、まあいいか」と
思っているだけ