
Ilkka Mellin

Tilastolliset menetelmät

Osa 1: Johdanto

Tilastollisten aineistojen kuvaaminen

Tilastollisten aineistojen kuvaaminen

>> Havaintoarvojen jakauma

Tunnusluvut

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Laatueroasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Havaintoarvojen jakauma

Tilastollinen aineisto

- Tilastollisen tutkimuksen *kaikki mahdolliset kohteet* muodostavat tutkimuksen (**kohde-**) **perusjoukon**.
- Tutkimuksen kohteiksi valittuja perusjoukon alkioita kutsutaan **havaintoyksiköiksi**.
- **Tilastollinen aineisto** koostuu havaintoyksiköitä kuvaavien muuttujien **havaituista arvoista**.
- Huomautuksia:
 - Tilastollinen aineisto voi syntyä *tilastollisen kokeen* tuloksena tai tekemällä *suoria havaintoja*.
 - Jos tutkimuksen kohteena on koko perusjoukko, tutkimusta kutsutaan *kokonaistutkimukseksi*, muuten kyseessä on *otantatutkimus*.

Havaintoarvojen jakauma

Havaintoarvot

- Olkoon tutkimuksen kohteiksi valittujen **havaintoyksiköiden lukumäärä** n .

- Olkoon

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

kohdeperusjoukon alkioden ominaisuutta kuvaavan muuttujan x **havaittu arvo** havaintoyksikössä i .

- Kutsumme muuttujan x havaittuja arvoja

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

tavallisesti **havaintoarvoiksi** tai **havainnoiksi**.

- Havaintoarvo x_i saadaan *mittaamalla* muuttujan x arvo havaintoyksikölle i .

Havaintoarvojen jakauma ja sen kuvaaminen 1/4

- Perusjoukon alkioden ominaisuutta kuvaavan muuttujan x *havaittujen arvojen*

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

vaihtelua havaintoyksiköiden joukossa kuvaa parhaiten havaintoarvojen **jakauma**.

Havaintoarvojen jakauma ja sen kuvaaminen 2/4

- Perusjoukon alkioiden ominaisuutta kuvaavan muuttujan x havaittujen arvojen

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

jakaumaa voidaan kuvailla ja esitellä *tiivistemällä* havaintoarvoihin sisältyvä *informaatio* sopivaan muotoon:

- Havaintoarvojen *jakaumaa kokonaisuutena* voidaan kuvata sopivasti valitulla **graafisella esityksellä**.
- *Jakauman karakteristisia ominaisuuksia* voidaan kuvata sopivasti valituilla **tunnusluvuilla**.

Havaintoarvojen jakauma ja sen kuvaaminen 3/4

- Perusjoukon alkioiden ominaisuutta kuvaavan muuttujan x (mitta-asteikolliset) ominaisuudet (ks. lukua **Tilastollisten aineistojen kerääminen ja mittaaminen**) määräävät muuttujan x havaittujen arvojen

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

jakaumalle parhaiten sopivan kuvaustavan; ks. seuraavaa kalvoa.

Havaintoarvojen jakauma ja sen kuvaaminen 4/4

- Jos muuttuja x on *diskreetti*, sen havaittujen arvojen jakaumaa voidaan kuvata **frekvenssijakaumalla** ja sitä vastaavalla graafisella esityksellä **pylväsdiagrammilla**.
- Jos muuttuja x on *jatkuva*, sen havaittujen arvojen jakaumaa voidaan kuvata **luokitellulla frekvenssi-jakaumalla** ja sitä vastaavalla graafisella esityksellä **histogrammilla**.

Havaintoarvojen jakauma

Frekvenssit

- Olkoon muuttuja x *diskreetti* ja olkoot

$$y_1, y_2, \dots, y_m$$

muuttujan x *mahdolliset arvot*.

- Olkoot

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

muuttujan x *havaitut arvot*.

- Muuttujan x *mahdollisen arvon* y_k , $k = 1, 2, \dots, m$
frekvenssi

$$f_k$$

kertoo *kuinka monta kertaa* y_k esiintyy havaintoarvojen x_1, x_2, \dots, x_n joukossa.

Havaintoarvojen jakauma

Frekvenssijakauma

- Muuttujan x mahdolliset arvot

$$y_1, y_2, \dots, y_m$$

yhdessä niiden frekvenssien

$$f_1, f_2, \dots, f_m$$

kanssa muodostavat muuttujan x havaittujen arvojen

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

frekvenssijakauman.

- Huomaa, että

$$f_1 + f_2 + \dots + f_m = n$$

jossa n on havaintojen kokonaislukumäärä.

Havaintoarvojen jakauma

Pylväsdiagrammi

- *Frekvenssijakaumaa*

$$(y_k, f_k), k = 1, 2, \dots, m$$

voidaan kuvata graafisesti **pylväsdiagrammilla**, jossa muuttujan x mahdollisen arvon y_k frekvenssiä f_k havaintoarvojen x_1, x_2, \dots, x_n joukossa esittää pisteeseen y_k piirretty pylväs, jonka korkeus vastaa frekvenssiä f_k .

- Huomautus:

Pylväsdiagrammin tulkinta on analoginen *diskreetin todennäköisyysjakauman pistetodennäköisyysfunktion* tulkinnan kanssa; ks. lukua **Satunnaismuuttujat ja todennäköisyysjakaumat**.

Havaintoarvojen jakauma

Pylväsdiagrammin piirtäminen: Havainnollistus 1/2

- Olkoot

$$y_1, y_2, \dots, y_m$$

muuttujan x mahdolliset arvot ja
olkoon

$$(y_k, f_k)$$

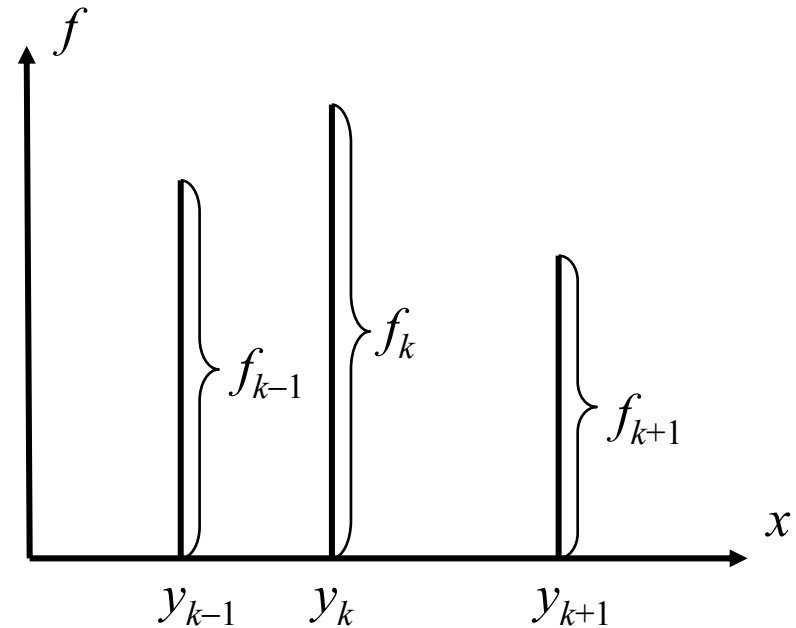
$$k = 1, 2, \dots, m$$

muuttujan x havaittujen arvojen

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

frekvenssijakauma.

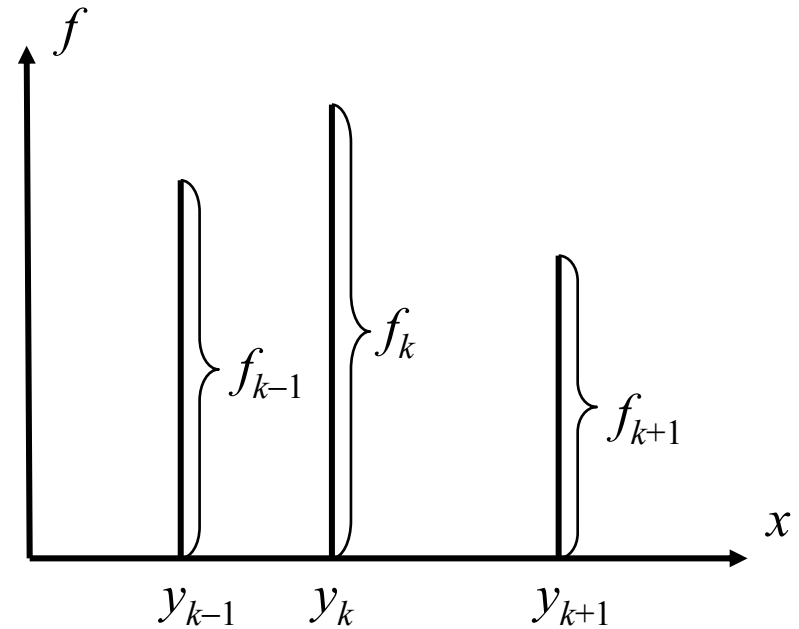
- *Frekvenssi* f_k kertoo kuinka
monta kertaa muuttujan x arvo y_k
esiintyy havaintoarvojen
joukossa.



Havaintoarvojen jakauma

Pylväsdiagrammin piirtäminen: Havainnollistus 2/2

- Tarkastellaan muuttujan x mahdollista arvoa y_k vastaavan *pylvään* piirtämistä pylväsdiagrammiin.
- Muuttujan x mahdolliset arvot y_k määräävät pylväiden *paikat*.
- Pylvään *korkeus* valitaan suhteessa arvon y_k frekvenssiin f_k .



Havaintoarvojen jakauma

Pylväsdiagrammi:

Esimerkki 1/2

- Matemaattisen tilastotieteen kurssille osallistui 20 opiskelijaa.
- Kurssin loppukokeen tehtävän 4 arvosteluasteikkona oli 0-6 pistettä niin, että
 - 0 = huonoin pistemäärä
 - 6 = paras pistemäärä
- Opiskelijoiden saamat pisteet on annettu ylemmässä taulukossa oikealla.
- Alemmassa taulukossa on annettu pisteiden *frekvenssi-jakauma*.

Pisteet; $n = 20$

0	0	0	0	0
0	1	1	1	2
5	5	5	5	5
6	6	6	6	6

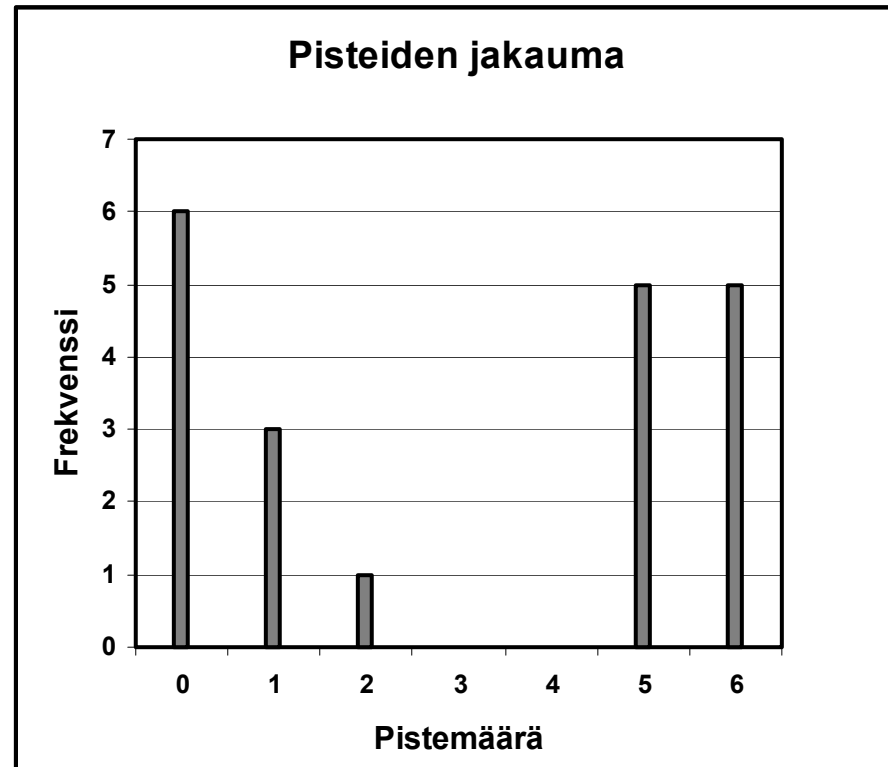
Pisteet	Frekvenssi
0	6
1	3
2	1
3	0
4	0
5	5
6	5

Havaintoarvojen jakauma

Pylväsdiagrammi:

Esimerkki 2/2

- Kuva oikealla esittää pisteiden frekvenssijakaumaa vastaavaa *pylväsdiagrammia*.
- Muuttujan
 $x = \text{pistemäärä}$
mahdolliset arvot määräävät pylväiden *paikan*.
- Pylväät on piirretty niin, että niiden *korkeudet* vastaavat muuttujan x mahdollisten arvojen *frekvenssejä*.



Havaintoarvojen jakauma

Luokkafrekvenssit 1/2

- Olkoon muuttuja x *jatkuva* ja oletetaan, että sen *mahdolliset arvot* ovat välillä

$$(a, b)$$

jossa voi olla $a = -\infty$, $b = +\infty$.

- Jaetaan väli (a, b) pisteillä

$$a = a_0 < a_1 < a_2 < \dots < a_{m-1} < a_m = b$$

pistevieraisiin *osaväleihin*

$$(a_{k-1}, a_k], k = 1, 2, \dots, m$$

Havaintoarvojen jakauma

Luokkafrekvenssit 2/2

- Olkoot

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

muuttujan x *havaitut arvot*.

- Muuttujan x havaittujen arvojen **frekvenssi**

$$f_k$$

luokassa k kertoo niiden havaintoarvojen x_1, x_2, \dots, x_n *lukumäärän*, jotka kuuluvat väliin

$$(a_{k-1}, a_k], k = 1, 2, \dots, m$$

Luokiteltu frekvenssijakauma

- *Luokkavälit*

$$(a_{k-1}, a_k], k = 1, 2, \dots, m$$

yhdessä vastaavien *luokkafrekvenssien*

$$f_1, f_2, \dots, f_m$$

kanssa muodostavat muuttujan x *havaittujen arvojen*

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

luokitellun frekvenssijakauman.

- Huomaa, että

$$f_1 + f_2 + \dots + f_m = n$$

jossa n on havaintojen kokonaislukumäärä.

Havaintoarvojen jakauma

Histogrammi

- *Luokiteltua frekvenssijakaumaa*

$$((a_{k-1}, a_k], f_k), k = 1, 2, \dots, m$$

voidaan kuvata graafisesti **histogrammilla**, jossa muuttujan x havaittujen arvojen x_1, x_2, \dots, x_n frekvenssiä f_k luokassa $(a_{k-1}, a_k]$ esittää *suorakaide*, jonka *kantana* on väli

$$(a_{k-1}, a_k]$$

ja jonka *pinta-ala vastaa luokkafrekvenssiä* f_k .

- Huomautus:

Histogrammin tulkinta on analoginen *jatkuvan todennäköisyysjakauman tiheysfunktion* tulkinnan kanssa; ks. lukua **Satunnaismuuttujat ja todennäköisyysjakaumat**.

Havaintoarvojen jakauma

Histogrammin piirtäminen:

Havainnollistus 1/2

- Olkoon

$$((a_{k-1}, a_k], f_k)$$

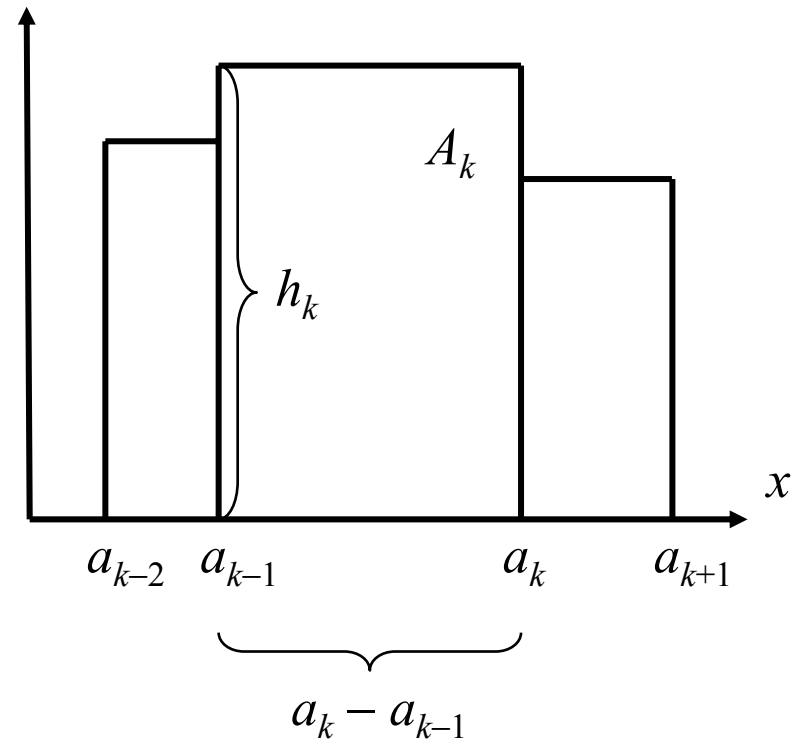
$$k = 1, 2, \dots, m$$

muuttujan x havaittujen arvojen

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

luokiteltu frekvenssijakauma.

- *Luokkafrekvenssi* f_k kertoo niiden havaintoarvojen lukumäärän, jotka kuuluvat *luokkaväliin* $(a_{k-1}, a_k]$.



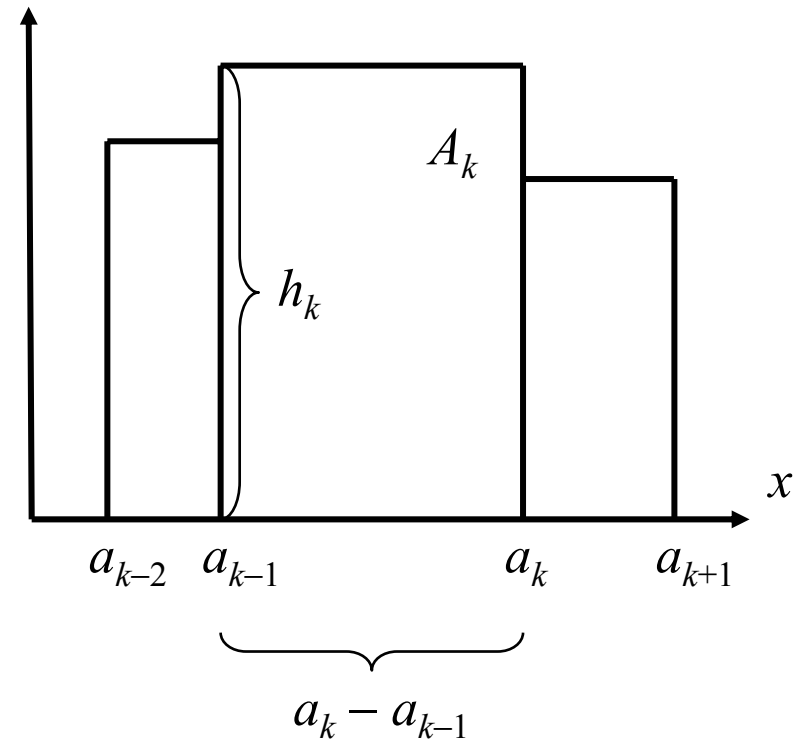
Havaintoarvojen jakauma

Histogrammin piirtäminen:

Havainnollistus 2/2

- Tarkastellaan k . luokkaa vastaavan suorakaiteen piirtämistä histogrammiin.
- Luokkaväli $(a_{k-1}, a_k]$ muodostaa suorakaiteen kannan.
- Suorakaiteen korkeus h_k saadaan ehdosta

$$\begin{aligned} A_k &= k. \text{ luokkaa vastaavan suorakaiteen pinta-ala} \\ &= (a_k - a_{k-1}) \times h_k \\ &= f_k \end{aligned}$$



Havaintoarvojen jakauma

Histogrammi:

Esimerkki 1/3

- Kone tekee *ruuveja*, joiden *pituudet vaihtelevat satunnaisesti*.
- Poimitaan ruuvien joukosta *yksinkertainen satunnaisotos*, jonka *koko*

$$n = 30$$

ja mitataan otokseen poimittujen ruuvien pituudet.

- Otokseen poimittujen 30:n ruuvien pituudet (yksikkö = cm) on annettu oikealla olevassa taulukossa.

Ruuvien pituudet; $n = 30$

10.05	10.23	10.02	10.24	10.14
10.06	10.07	10.09	10.00	10.09
10.30	10.17	10.18	10.00	10.01
10.00	9.93	10.16	10.21	10.20
9.99	10.13	9.88	9.99	10.12
10.20	9.93	10.00	10.07	10.13

Havaintoarvojen jakauma

Histogrammi: Esimerkki 2/3

- Muodostetaan otokseen poimittujen ruuvien pituuksien *luokiteltu frekvenssijakauma*.
- Järjestetään sitä varten havaintoarvot *suuruusjärjestykseen*; ks. ylempää taulukkoa oikealla.
- Pituuksien *luokiteltu frekvenssijakauma* on annettu alemmassa taulukossa.
- Esimerkiksi luokkaan, jonka määrää puoliavoin väli
(10.10, 10.15]
kuuluu 4 ruuvia.

Ruuvien pituudet; $n = 30$

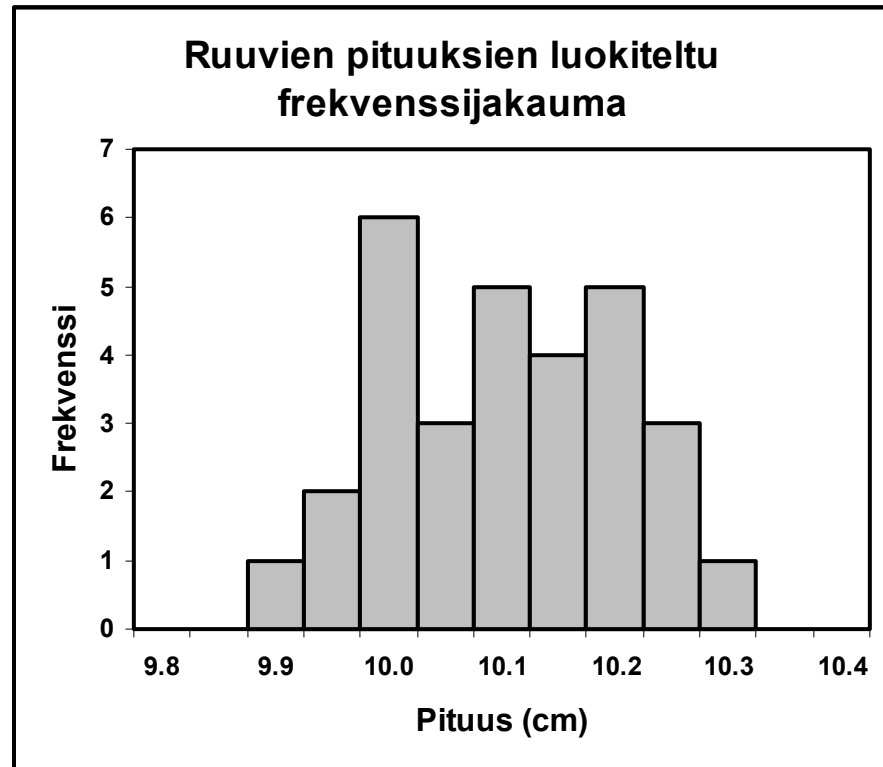
9.88	9.93	9.93	9.99	9.99
10.00	10.00	10.00	10.00	10.01
10.02	10.05	10.06	10.07	10.07
10.09	10.09	10.12	10.13	10.13
10.14	10.16	10.17	10.18	10.20
10.20	10.21	10.23	10.24	10.30

Luokkavälit	Luokkafrekvenssit
(9.85,9.90]	1
(9.90,9.95]	2
(9.95,10.00]	6
(10.00,10.05]	3
(10.05,10.10]	5
(10.10,10.15]	4
(10.15,10.20]	5
(10.20,10.25]	3
(10.25,10.30]	1

Havaintoarvojen jakauma

Histogrammi: Esimerkki 3/3

- Kuva oikealla esittää otokseen poimittujen ruuvien pituuksien luokiteltua frekvenssijakaumaa vastaavaa *histogrammia*.
- *Luokkavälit* määräävät histogrammin suorakaiteiden *kannat*.
- Suorakaiteet on piirretty niin, että niiden *pinta-alat* vastaavat *luokkafrekvenssejä*.



Havaintoarvojen jakauma

Mitta-asteikot ja havaintoarvojen jakauman kuvaaminen

- **Laatuero- tai järjestysasteikollisten muuttujien** havaittujen arvojen kuvaamiseen käytettävät välineet:
 - **Frekvenssijakauma**
 - **Pylväsdiagrammi**
- **Välimatka- tai suhdeasteikollisten muuttujien** havaittujen arvojen kuvaamiseen käytettävät välineet:
 - **Luokiteltu frekvenssijakauma**
 - **Histogrammi**

Mitta-asteikot: ks. lukua **Tilastollisten aineistojen kerääminen ja mittaaminen**.

Tilastollisten aineistojen kuvaaminen

Havaintoarvojen jakauma

>> Tunnusluvut

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Laatueroasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Tunnusluvut havaintoaineiston kuvaajina 1/4

- Olkoot

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

muuttujan x havaittuja arvoja.

- Muuttujan x havaittujen arvojen jakaumaa voidaan kuvailla ja esitellä *tiivistemällä* havaintoarvoihin sisältyvä *informaatio* sopivaan muotoon:
 - *Jakaumaa kokonaisuutena* voidaan kuvata sopivasti valitulla **graafisella esityksellä**.
 - *Jakauman karakteristisia ominaisuuksia* voidaan kuvata sopivasti valituilla **tunnusluvuilla**.

Tunnusluvut havaintoaineiston kuvaajina 2/4

- Tunnuslukujen tehtävänä on kuvata havaintoarvojen jakauman keskeisiä *karakteristisia ominaisuuksia*:
 - *Keskimääräisten, tyypillisten tai yleisten havaintoarvojen sijaintia* kuvataan **keskiluvuilla**.
 - Havaintoarvojen *hajaantuneisuutta* tai *keskittyneisyyttä* kuvataan **hajontaluvuilla**.
 - Myös havaintoarvojen jakauman **vinoutta** ja **huipukkuutta** voidaan kuvata sopivasti valituilla tunnusluvuilla.

Tunnusluvut

Tunnusluvut havaintoaineiston kuvaajina 3/4

- Havaintoarvojen jakauman *karakteristisia ominaisuuksia* on aina syytä kuvata usealla erilaisella tunnusluvulla.
- Havaintoaineiston *jakauma ja kuvauksen tavoitteet* määräävät mitä tunnuslukuja havaintoaineistosta *kannattaa* laskea.
- Tutkittavan muuttujan *mitta-asteikolliset ominaisuudet* määräävät mitä tunnuslukuja havaintoaineistosta *saa* laskea.

Tunnusluvut havaintoaineiston kuvaajina 4/4

- Huomautuksia:
 - Tunnuslukujen antama kuvaus havaintoarvojen jakaumasta jää *puutteelliseksi* ja saattaa olla jopa *harhaanjohtava*, ellei sitä *täydennetä* sopivilla jakaumaa kuvaavilla *graafisilla esityksillä* kuten *pylväsdiagrammilla* tai *histogrammilla*.
 - Havaintoarvojen jakaumaa on tavallisesti syytä kuvata *usealla eri tavalla*.

Tunnusluvut ja mitta-asteikot

- Tarkasteltavan muuttujan *mitta-asteikolliset ominaisuudet ohjaavat* havaintoaineiston kuvaamisessa käytettävien *tunnuslukujen valintaa*.

Mitta-asteikot: ks. lukua **Tilastollisten aineistojen kerääminen ja mittaaminen**.

- Tunnusluvut voidaan ryhmitellä tarkastelun kohteena olevien muuttujien mitta-asteikollisten ominaisuuksien perusteella seuraavalla tavalla:
 - **Tunnusluvut välimatka- ja suhdeasteikollisille muuttujille**
 - **Tunnusluvut järjestysasteikollisille muuttujille**
 - **Tunnusluvut laatueroasteikollisille muuttujille**

Tunnusluvut

Välimatka- ja suhdeasteikollisten muuttujien tunnuslukuja

- Tunnuslukuja välimatka- ja suhdeasteikollisten muuttujien havaituille arvoille:
 - **Aritmeettinen keskiarvo** keskilukuna
 - **Varianssi ja keskihajonta** hajontalukuina
 - **Origomomentit**
 - **Keskusmomentit**
 - **Vinous**
 - **Huipukkuus**
 - **Harmoninen keskiarvo**
 - **Geometrinen keskiarvo**

Tunnusluvut

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnuslukuja

- Tunnuslukuja **järjestysasteikollisten muuttujien** havaituille arvoille:
 - **Järjestystunnusluvut**
 - **Mimimi ja maksimi**
 - **Vaihteluväli ja vaihteluvälin pituus**
 - **Prosenttipisteet**
 - **Mediaani** keskilukuna
 - **Kvartiilit**
 - **Kvartiiliväli ja kvartiilivälin pituus**
 - **Kvartiilipoikkeama** hajontalukuna

Tunnusluvut

Laatueroasteikollisten muuttujien tunnuslukuja

- Tunnuslukuja **laatueroasteikollisten muuttujien** havaituille arvoille:
 - **Suhteellinen frekvenssi**
 - **Moodi** keskilukuna

Mitta-asteikot ja niille sallitut tunnusluvut 1/3

- **Välimatka- ja suhdeasteikollisille muuttujille** sallitut tunnusluvut:
 - **Origo- ja keskusmomentit** ja niistä johdetut tunnusluvut
 - Kaikki *laatuero- ja järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut*
 - *Keskilukuna* käytetään tavallisesti **aritmeettista keskiarvoa**, mutta monissa tilanteissa keskilukuna on syytä käyttää **mediaania** tai **moodia**
 - *Hajontalukuna* käytetään tavallisesti **keskihajontaa** tai **varianssia**

Mitta-asteikot ja niille sallitut tunnusluvut 2/3

- **Järjestysasteikollisille muuttujille** sallitut tunnusluvut:
 - **Järjestystunnusluvut** ja niistä johdetut tunnusluvut
 - Kaikki *laatueroasteikollisten muuttujien tunnusluvut*
 - *Keskilukuna* käytetään tavallisesti **mediaania**, mutta monissa tilanteissa keskilukuna on syytä käyttää **moodia**
 - *Hajontalukuna* käytetään usein **kvartiilipoikkeamaa**
- Huomautus:

Välimatka- tai suhdeasteikollisten muuttujien tunnuslukuja ei ole mielekästä laskea järjestysasteikollisten muuttujien havaituille arvoille.

Mitta-asteikot ja niille sallitut tunnusluvut 3/3

- **Laatueroasteikollisille muuttujille** sallitut tunnusluvut:
 - **Suhteelliset frekvenssit**
 - *Keskilukuna* käytetään **moodia**
- Huomautus:

Järjestys-, välimatka- tai suhdeasteikollisten muuttujien tunnuslukuja ei ole mielekästä laskea laatueroasteikollisten muuttujien havaituille arvoille.

Tilastollisten aineistojen kuvaaminen

Havaintoarvojen jakauma

Tunnusluvut

>> Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Laatueroasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Tunnusluvut suhdeasteikollisille muuttujille

- Tavallisimmat tunnusluvut *suhdeasteikollisten* muuttujien havaituille arvoille:
 - **Aritmeettinen keskiarvo** keskilukuna
 - **Varianssi ja keskihajonta** hajontalukuina
 - **Origomomentit**
 - **Keskusmomentit**
 - **Vinous**
 - **Huipukkuus**
 - **Harmoninen keskiarvo**
 - **Geometrinen keskiarvo**

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Aritmeettinen keskiarvo

- Olkoot

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

välimatka- tai *suhdeasteikollisen muuttujan* x havaittuja arvoja.

- **Aritmeettinen keskiarvo**

$$\bar{x} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i = \frac{x_1 + x_2 + \dots + x_n}{n}$$

kuvaa havaintoarvojen x_1, x_2, \dots, x_n *keskimääräistä* arvoa.

- Aritmeettisestä keskiarvosta (engl. *mean*) käytetään usein myös symbolia M .

Luokitellun aineiston aritmeettinen keskiarvo

- Oletetaan, että *jatkuvan* muuttujan x havaituista arvoista on muodostettu *luokiteltu frekvenssijakauma* ja olkoon käytetty *luokkien lukumäärä* k .
- Oletetaan, että *luokkakeskuksina* ovat luvut

$$z_1, z_2, \dots, z_k$$

ja että vastaavat *luokkafrekvenssit* ovat

$$f_1, f_2, \dots, f_k$$

- Tällöin **luokitellun aineiston aritmeettinen keskiarvo** on

$$\bar{x} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^k f_i z_i$$

jossa $n = \sum f_i$.

Aritmeettinen keskiarvo jakauman kuvaajana

- Aritmeettinen keskiarvo kuvaa havaintoarvojen *keskimääräistä* arvoa.
- Havaintoarvojen aritmeettinen keskiarvo sijoittuu havaintoarvojen jakauman *painopisteeseen*.
- Jos havaintoarvojen jakauma on *vino* tai *monihuippuinen*, aritmeettinen keskiarvo *ei välttämättä ole tyypillinen* tai *yleinen havaintoarvo*.
- Aritmeettinen keskiarvo *ei ole robusti* eli se on *herkkä poikkeaville havaintoarvoille*, koska *jokainen havaintoarvo vetää aritmeettista keskiarvoa puoleensa*; ks. havainnollistusta seuraavalla kalvolla.

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Aritmeettisen keskiarvon herkkyyys poikkeaville havainnoille

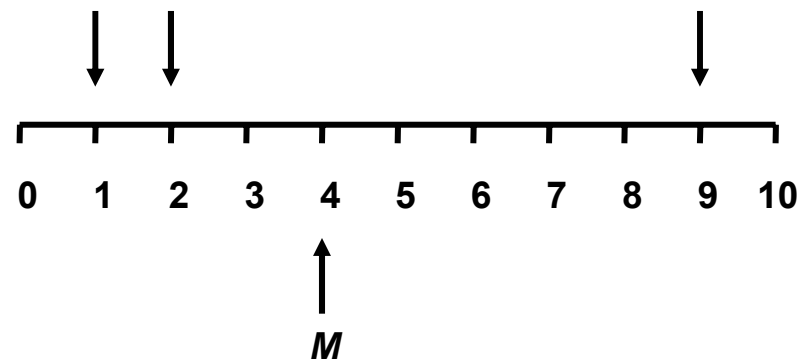
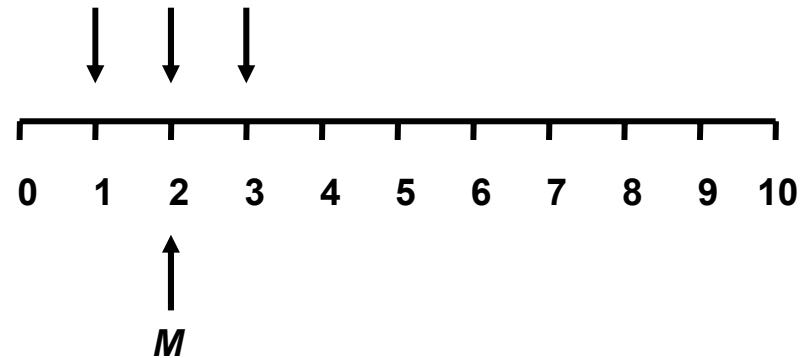
- Aritmeettinen keskiarvo on *herkkä* poikkeaville havainnoille.
- Havaintoarvojen 1, 2, 3 aritmeettinen keskiarvo on

$$M = \frac{1+2+3}{3} = 2$$

- Muutetaan havaintoarvo 3 havaintoarvoksi 9 ja *pidetään muut havaintoarvot samoina*.
- Tällöin *uudeksi* aritmeettiseksi keskiarvoksi tulee

$$M = \frac{1+2+9}{3} = 4$$

- Ks. kuvaa oikealla.



Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Varianssi 1/2

- Olkoot

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

välimatka- tai *suhdeasteikollisen muuttujan* x havaittuja arvoja ja olkoon \bar{x} havaintoarvojen *aritmeettinen keskiarvo*.

- **(Otos-) varianssi**

$$s^2 = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2$$

kuvaa havaintoarvojen x_1, x_2, \dots, x_n *hajaantuneisuutta* tai *keskittyneisyyttä* niiden painopisteen \bar{x} ympärillä.

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Varianssi 2/2

- Havaintoarvojen x_1, x_2, \dots, x_n otosvarianssi lasketaan usein myös kaavalla

$$\hat{\sigma}^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2$$

jossa summalausekkeen jakajana on n .

- Huomautus:

Otosvarianssin kaksi erilaista kaavaa liittyvät erilaisiin tapoihin *estimoida* normaalijakauman $N(\mu, \sigma^2)$ *varianssiparametri* σ^2 :

(i) s^2 on *harhaton estimaattori* parametrille σ^2 .

(ii) $\hat{\sigma}^2$ on parametrin σ^2 *suurimman uskottavuuden estimaattori*.

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Varianssi:

Toinen laskukaava

- Jos otosvarianssi joudutaan laskemaan *käsin* tai *laskimella* havaintoarvojen x_1, x_2, \dots, x_n *varianssi kannattaa laskea* kaavalla

$$s^2 = \frac{1}{n-1} \left(\sum_{i=1}^n x_i^2 - \frac{1}{n} \left(\sum_{i=1}^n x_i \right)^2 \right)$$

tai vaihtoehdoisen kaavan tapauksessa kaavalla

$$\hat{\sigma}^2 = \frac{1}{n} \left(\sum_{i=1}^n x_i^2 - \frac{1}{n} \left(\sum_{i=1}^n x_i \right)^2 \right)$$

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Varianssi:

Toisen laskukaavan todistus 1/2

- Olkoot

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

välimatka- tai *suhdeasteikollisen muuttujan* x havaittuja arvoja ja olkoon

$$\bar{x} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i$$

havaintoarvojen *aritmeettinen keskiarvo*.

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Varianssi:

Toisen laskukaavan todistus 2/2

- Tällöin

$$\begin{aligned}(n-1)s^2 &= \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2 \\ &= \sum_{i=1}^n (x_i^2 - 2\bar{x}x_i + \bar{x}^2) \\ &= \sum_{i=1}^n x_i^2 - 2\bar{x} \sum_{i=1}^n x_i + \sum_{i=1}^n \bar{x}^2 \\ &= \sum_{i=1}^n x_i^2 - 2 \left(\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i \right) \sum_{i=1}^n x_i + n \left(\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i \right)^2 \\ &= \left(\sum_{i=1}^n x_i^2 - \frac{1}{n} \left(\sum_{i=1}^n x_i \right)^2 \right)\end{aligned}$$

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Keskihajonta 1/2

- Olkoot

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

välimatka- tai *suhdeasteikollisen muuttujan* x havaittuja arvoja ja olkoon \bar{x} havaintoarvojen *aritmeettinen keskiarvo*.

- **(Otos-) keskihajonta**

$$s = \sqrt{\frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2}$$

on otosvarianssin s^2 neliöjuuri ja kuvaa havaintoarvojen x_1, x_2, \dots, x_n *hajaantuneisuutta* tai *keskittyneisyyttä* niiden painopisteen \bar{x} ympärillä.

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Keskihajonta 2/2

- Havaintoarvojen x_1, x_2, \dots, x_n (**otos-**) keskihajonta lasketaan usein myös kaavalla

$$\hat{\sigma} = \sqrt{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2}$$

jossa summalausekkeen jakajana on n .

- Huomautus:

Keskihajonnan kaksi erilaista kaavaa liittyvät erilaisiin tapoihin *estimoida* normaalijakauman $N(\mu, \sigma^2)$ varianssiparametri σ^2 :

(i) s^2 on *harhaton estimaattori* parametrille σ^2 .

(ii) $\hat{\sigma}^2$ on parametrin σ^2 *suurimman uskottavuuden estimaattori*.

Keskihajonta ja varianssi jakauman kuvaajina 1/2

- Keskihajonta ja varianssi ovat *havaintoarvojen vaihtelun mittoja*.
 - *Varianssi* on havaintoarvojen keskimääräinen neliöllinen poikkeama niiden aritmeettisesta keskiarvosta.
 - Havaintoarvojen *keskihajonta* on varianssin neliöjuuri.
 - Jos havaintoarvojen jakaumaa kuvaavana *keskilukuna* on käytetty *aritmeettista keskiarvoa*, *hajontalukuna* on luontevaa käyttää *keskihajontaa*:
 - (i) Keskihajonnalla ja aritmeettisellä keskiarvolla *on sama dimensio (laatu)*.
 - (ii) Varianssin ja aritmeettisen keskiarvon *dimensio (laatu) ei ole sama*.
-

Keskihajonta ja varianssi jakauman kuvaajina 2/2

- ”*Pieni*” keskihajonta (varianssi) merkitsee sitä, että havaintoarvot *keskittyvät* niiden painopisteen (aritmeettisen keskiarvon) ympärille.
- ”*Suuri*” keskihajonta (varianssi) merkitsee sitä, että havaintoarvot *ovat hajaantuneet* niiden painopisteen (aritmeettisen keskiarvon) ympärille.
- Varianssi ja keskihajonta eivät ole *robusteja* eli ne ovat *herkkiä poikkeaville havaintoarvoille*.

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Aritmeettinen keskiarvo ja varianssi:

Laskutoimitusten suorittaminen 1/2

- Oletetaan, että haluamme laskea havaintoarvojen

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

aritmeettisen keskiarvon \bar{x} ja otosvarianssin s^2 käsin tai käyttämällä laskinta

- Tällöin tarvittavat laskutoimitukset on mukavinta järjestää seuraavalla kalvolla esitettävän kaavion muotoon.

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Aritmeettinen keskiarvo ja varianssi:

Laskutoimitusten suorittaminen 2/2

- Havaintoarvojen *aritmeettinen keskiarvo* ja *varianssi* voidaan laskea määräämällä ensin havaintoarvojen *summa* ja *neliösumma* sekä käyttämällä sen jälkeen alla esitettyjä kaavoja:

i	x_i	x_i^2
1	x_1	x_1^2
2	x_2	x_2^2
\vdots	\vdots	\vdots
n	x_n	x_n^2
Summa	$\sum_{i=1}^n x_i$	$\sum_{i=1}^n x_i^2$

$$\bar{x} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i$$

$$s^2 = \frac{1}{n-1} \left(\sum_{i=1}^n x_i^2 - \frac{1}{n} \left(\sum_{i=1}^n x_i \right)^2 \right)$$

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Standardointi

- Olkoot \bar{x} välimatka- tai suhdeasteikollisen muuttujan x havaittujen arvojen x_1, x_2, \dots, x_n aritmeettinen keskiarvo ja s_x^2 niiden varianssi.
- Tällöin **standardoitujen havaintoarvojen**

$$z_i = \frac{x_i - \bar{x}}{s_x}, i = 1, 2, \dots, n$$

aritmeettinen keskiarvo ja varianssi ovat

$$\bar{z} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n z_i = 0$$

$$s_z^2 = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (z_i - \bar{z})^2 = 1$$

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Tilastollinen etäisyys

- Olkoot \bar{x} välimatka- tai suhdeasteikollisen muuttujan x havaittujen arvojen x_1, x_2, \dots, x_n aritmeettinen keskiarvo ja s_x^2 niiden varianssi.
- Havaintoarvojen x_k ja x_l **tilastollinen etäisyys** d_{kl} on

$$d_{kl} = \frac{x_k - x_l}{s_x}$$

- Havaintoarvojen x_k ja x_l tilastollinen etäisyys ottaa etäisyyttä määrättäessä huomioon kaikkien havaintoarvojen x_1, x_2, \dots, x_n vaihtelun.
- Huomautus:

Tilastollisessa testauksessa käytettävät *testisuureet* voidaan usein tulkita *tilastollisen etäisyyden mittareiksi*; ks. lukuja **Testit ...** .

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Origomomentit

- Olkoot

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

välimatka- tai *suhdeasteikollisen muuttujan* x havaittuja arvoja.

- Havaintoarvojen x_1, x_2, \dots, x_n **k . origomomentti** on

$$a_k = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^k, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

- Erityisesti 1. origomomentti a_1 on havaintoarvojen x_1, x_2, \dots, x_n *aritmeettinen keskiarvo*:

$$a_1 = \bar{x}$$

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Keskusmomentit

- Olkoot

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

välimatka- tai *suhdeasteikollisen muuttujan* x havaittuja arvoja ja olkoon \bar{x} havaintoarvojen *aritmeettinen keskiarvo*.

- Havaintoarvojen x_1, x_2, \dots, x_n **k . keskusmomentti** on

$$m_k = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^k, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

- Erityisesti $m_1 = 0$ kaikille havaintoarvoille ja

$$m_2 = \hat{\sigma}^2 = a_2 - a_1^2$$

on havaintoarvojen x_1, x_2, \dots, x_n *varianssi*.

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Vinous

- Olkoot

$$m_2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2$$

$$m_3 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^3$$

havaintoarvojen

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

2. ja vastaavasti 3. *keskusmomentti*.

- Tunnuslukua

$$c_1 = \frac{m_3}{m_2^{3/2}}$$

käytetään kuvaamaan havaintoarvojen jakauman **vinoutta**.

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Vinous jakauman kuvaajana 1/3

- Jos havaintoarvojen jakauma on *symmetrinen painopisteensä suhteen*,

$$c_1 \approx 0$$

- Esimerkki:

Normaalijakautuneilla havaintoaineistoilla $c_1 \approx 0$.

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Vinous jakauman kuvaajana 2/3

- Jos

$$c_1 > 0$$

sanomme, että havaintoarvojen jakauma on **positiivisesti vino**.

- Oletetaan, että $c_1 > 0$ ja havaintoarvojen jakaumaa kuvaava *pylväsdiagrammi* (diskreetin muuttujan tapauksessa) tai *histogrammi* (jatkuvan muuttujan tapauksessa) on *yksihuippuinen*.
- Tällöin jakaumaa kuvaava diagrammi on **vino oikealle** eli sen oikeanpuoleinen häntä on pitempi kuin sen vasemmanpuoleinen häntä.

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Vinous jakauman kuvaajana 3/3

- Jos

$$c_1 < 0$$

sanomme, että havaintoarvojen jakauma on **negatiivisesti vino**.

- Oletetaan, että $c_1 < 0$ ja havaintoarvojen jakaumaa kuvaava *pylväsdiagrammi* (diskreetin muuttujan tapauksessa) tai *histogrammi* (jatkuvan muuttujan tapauksessa) on *yksihuippuinen*.
- Tällöin jakaumaa kuvaava diagrammi on **vino vasemmalle** eli sen vasemmanpuoleinen häntä on pitempi kuin sen oikeanpuoleinen häntä.

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Huipukkuus

- Olkoot

$$m_2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2$$

$$m_4 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^4$$

havaintoarvojen

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

2. ja vastaavasti 4. *keskusmomentti*.

- Tunnuslukua

$$c_2 = \frac{m_4}{m_2^2} - 3$$

käytetään kuvaamaan havaintoarvojen jakauman
huipukkuutta.

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Huipukkuus jakauman kuvaajana

- *Normaalijakautuneilla* havaintoaineistoilla $c_2 \approx 0$.
- Olkoon havaintoarvojen jakauman huipukkuus

$$c_2 > 0$$

Tällöin jakauma on **huipukas** (normaalijakautuneeseen havaintoaineistoon verrattuna).

- Olkoon havaintoarvojen jakauman huipukkuus

$$c_2 < 0$$

Tällöin jakauma on **laakea** (normaalijakautuneeseen havaintoaineistoon verrattuna).

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Harmoninen keskiarvo

- Olkoot

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

positiivisen välimatka- tai suhdeasteikollisen muuttujan x havaittuja arvoja.

- Havaintoarvojen x_1, x_2, \dots, x_n **harmoninen keskiarvo on**

$$H = \frac{1}{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \frac{1}{x_i}}$$

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Harmoninen keskiarvo:

Esimerkki 1/2

- Esimerkki osoittaa, että *aritmeettinen keskiarvo ei ole kaikissa tilanteissa sopiva keskiluku.*
- Olkoon kahden kaupungin A ja B välimatka 120 km.
- Ajetaan matka A :sta B :hen 60 km/h ja matka B :stä A :han 120 km/h.
- Mikä on ollut *keskinopeus* edestakaisella matkalla?

Matka A :sta B :hen ja takaisin = 240 km

Ajoaika A :sta B :hen = 2 h

Ajoaika B :stä A :han = 1 h

Ajoaika yhteensä = 3 h

Keskinopeus

edestakaisella matkalla = $240/3 = 80$ km/h

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Harmoninen keskiarvo:

Esimerkki 2/2

- Nopeuksien *aritmeettinen keskiarvo*

$$M = \frac{60 + 120}{2} = 90 \text{ km/h}$$

antaa *väärän* keskinopeuden.

- Sen sijaan nopeuksien *harmoninen keskiarvo*

$$H = \frac{1}{\frac{1}{2} \left(\frac{1}{60} + \frac{1}{120} \right)} = 80 \text{ km/h}$$

antaa *oikean* keskinopeuden.

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Geometrinen keskiarvo

- Olkoot

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

positiivisen välimatka- tai suhdeasteikollisen muuttujan x havaittuja arvoja.

- Havaintoarvojen x_1, x_2, \dots, x_n **geometrinen keskiarvo** on

$$G = \sqrt[n]{x_1 x_2 \cdots x_n}$$

- Huomautus:

Geometrisen keskiarvon logaritmi on havaintoarvojen logaritmien aritmeettinen keskiarvo:

$$\log(G) = \frac{\log(x_1) + \log(x_2) + \cdots + \log(x_n)}{n}$$

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Geometrinen keskiarvo:

Esimerkki 1/4

- Esimerkki osoittaa, että *aritmeettinen keskiarvo ei ole kaikissa tilanteissa sopiva keskiluku.*
- Olkoon lainan suuruus 100 € .
- Olkoon korkoprosentti 1. vuotena 10 % ja 2. vuotena 20 % .
- Jos lainaa ei lyhennetä, lainapääoma karttuu seuraavalla tavalla:

$$\text{Pääoma 1. vuoden lopussa} = 1.1 \times 100 = 110 \text{ €}$$

$$\text{Pääoma 2. vuoden lopussa} = 1.2 \times 110 = 132 \text{ €}$$

- Lainapääoma karttuu siis kahdessa vuodessa 32 % .
- Jos kumpanakin vuotena käytettäisiin *samaa korkoprosenttia*, miten se pitäisi valita, jotta lainapääoma olisi 2. vuoden lopussa 132 € ?

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Geometrinen keskiarvo:

Esimerkki 2/4

- Korkoprosenttien *aritmeettinen keskiarvo*

$$M = \frac{10 + 20}{2} = 15 \%$$

tuottaa *väärän* lainapääoman 2. vuoden lopussa:

$$\text{Pääoma 1. vuoden lopussa} = 1.15 \times 100 = 115 \text{ €}$$

$$\text{Pääoma 2. vuoden lopussa} = 1.15 \times 115 = 132.25 \text{ €}$$

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Geometrinen keskiarvo:

Esimerkki 3/4

- Myös korkoprosentti

$$\frac{32}{2} = 16 \%$$

tuottaa *väärän* lainapääoman 2. vuoden lopussa:

$$\text{Pääoma 1. vuoden lopussa} = 1.16 \times 100 = 116 \text{ €}$$

$$\text{Pääoma 2. vuoden lopussa} = 1.16 \times 116 = 134.56 \text{ €}$$

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Geometrinen keskiarvo:

Esimerkki 4/4

- Sen sijaan *geometrinen keskiarvo*

$$G = \sqrt{1.1 \times 1.2} = 1.1489125$$

antaa korkoprosentiksi

$$14.89125 \%$$

joka tuottaa *oikean* lainapääoman 2. vuoden lopussa:

$$\text{Pääoma 1. vuoden lopussa} = 1.1489125 \times 100 = 114.89125 \text{ €}$$

$$\text{Pääoma 2. vuoden lopussa} = 1.1489125 \times 114.89125$$

$$= 132.00 \text{ €}$$

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Aritmeettinen, harmoninen ja geometrinen keskiarvo

- Oletetaan, että *aritmeettinen keskiarvo* M , *harmoninen keskiarvo* H ja *geometrinen keskiarvo* G määrätään *samoista* positiivisista luvuista x_1, x_2, \dots, x_n .

- Tällöin

$$H \leq G \leq M$$

ja

$$H = G = M$$

jos ja vain jos

$$x_1 = x_2 = \dots = x_n$$

Tilastollisten aineistojen kuvaaminen

Havaintoarvojen jakauma

Tunnusluvut

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

>> Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Laatueroasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Tunnusluvut järjestysasteikollisille muuttujille 1/2

- Tavallisimmat tunnusluvut *järjestysasteikollisten* muuttujien havaituille arvoille:
 - **Järjestystunnusluvut**
 - **Mimimi ja maksimi**
 - **Vaihteluväli ja vaihteluvälin pituus**
 - **Prosenttipisteet**
 - **Mediaani** keskilukuna
 - **Kvartiilit**
 - **Kvartiiliväli ja kvartiilivälin pituus**
 - **Kvartiilipoikkeama** hajontalukuna

Tunnusluvut järjestysasteikollisille muuttujille 2/2

- Havaintoaineistojen jakaumia voidaan usein havainnollistaa kätevästi **Box and Whisker -kuviolla**.

- Huomautus:

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnuslukuja saa käyttää ja on usein myös järkevää käyttää kuvaamaan välimatka- ja suhteasteikollisten muuttujien havaittujen arvojen jakaumaa.

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Järjestystunnusluvut

- Olkoot

$$x_1, x_2, \dots, x_n$$

järjestys-, välimatka- tai suhdeasteikollisen muuttujan x havaittuja arvoja.

- *Järjestetään* havaintoarvot x_1, x_2, \dots, x_n suuruusjärjestykseen pienimmästä suurimpaan ja olkoot

$$z_1, z_2, \dots, z_n$$

järjestykseen asetetut havaintoarvot.

- Suuruusjärjestyksessä k . havaintoarvoa z_k kutsutaan **k . järjestystunnusluvuksi.**

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Minimi, maksimi ja vaihteluväli

- Olkoot

$$z_1, z_2, \dots, z_n$$

järjestys-, välimatka- tai suhdeasteikollisen muuttujan x havaitut arvot järjestettyinä suuruusjärjestykseen pienimmästä suurimpaan.

- Tällöin

$$z_1 = \text{minimiarvo}$$

$$z_n = \text{maksimiarvo}$$

$$(z_1, z_n) = \text{vaihteluväli}$$

$$z_n - z_1 = \text{vaihteluvälin pituus}$$

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Prosenttipisteet

- Olkoot

$$z_1, z_2, \dots, z_n$$

järjestys-, välimatka- tai suhdeasteikollisen muuttujan x havaitut arvot järjestettyinä suuruusjärjestykseen pienimmästä suurimpaan.

- Havaintoarvojen **p . prosenttipiste**

$$z_{(p)}, p = 1, 2, \dots, 99$$

on piste, joka jakaa havaintoaineiston *kahteen osaan*:

- p % havaintoarvoista on lukua $z_{(p)}$ *pienempiä* tai korkeintaan yhtä suuria kuin $z_{(p)}$.
- $(100 - p)$ % havaintoarvoista on lukua $z_{(p)}$ *suurempia*.

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Mediaani

- Olkoot

$$z_1, z_2, \dots, z_n$$

järjestys-, välimatka- tai suhdeasteikollisen muuttujan x havaitut arvot järjestettyinä suuruusjärjestykseen pienimmästä suurimpaan.

- **Mediaani** Me on havaintoarvojen 50. prosenttipiste:

$$Me = z_{(50)}$$

- Mediaani jakaa havaintoaineiston *kahteen yhtä suureen osaan* niin, että toisessa *kaikki* havaintoarvot ovat mediaania *pienempiä*, toisessa *kaikki* havaintoarvot ovat mediaania *suurempia*.

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Mediaanin laskeminen

- Havaintoarvojen mediaani Me voidaan määrätä seuraavalla tavalla:
 - (1) Järjestetään havaintoarvot *suuruusjärjestykseen* pienimmästä suurimpaan.
 - (2a) Jos havaintoarvojen lukumäärä on *pariton*, mediaani on järjestetyistä havaintoarvoista *keskimmäinen*.
 - (2b) Jos havaintoarvojen lukumäärä on *parillinen*, mediaani on järjestetyistä havaintoarvoista *kahden keskimmäisen aritmeettinen keskiarvo*.

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Luokitellun aineiston mediaani

- **Luokitellun aineiston mediaani** voidaan laskea kaavalla

$$Me = L_i + \frac{\frac{1}{2}n - \sum f_j}{f_i} \times c_i$$

jossa

L_i = mediaaniluokan alaraja

$\sum f_j$ = kaikkien mediaaniluokan alapuolella oleviin luokkiin kuuluvien havaintoarvojen frekvenssi

f_i = mediaaniluokkaan kuuluvien havaintoarvojen frekvenssi

c_i = mediaaniluokan pituus

n = havaintoarvojen lukumäärä

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Mediaani jakauman kuvaajana 1/2

- Mediaani on suuruusjärjestykseen asetettujen havaintoarvojen *keskimmäinen* havaintoarvo (tai kahden keskimmäisen aritmeettinen keskiarvo).
- Jos havaintoarvojen jakauma on *symmetrinen*, havaintoarvojen mediaani ja aritmeettinen keskiarvo yhtyvät.
- Jos havaintoarvojen jakauma on *vinno*, mutta yksihuippuinen, havaintoarvojen mediaani kuvaa *tyypillisiä* havaintoarvoja usein paremmin kuin niiden aritmeettinen keskiarvo.
- Jos havaintoarvojen jakauma on *monihuippuinen*, mediaani *ei välttämättä ole yleinen havaintoarvo*.

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Mediaani jakauman kuvaajana 2/2

- Mediaani on **robusti** eli se *ei ole* – toisin kuin aritmeettinen keskiarvo – *herkkä poikkeaville havaintoarvoille*.

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Mediaanin robustisuus: Havainnollistus

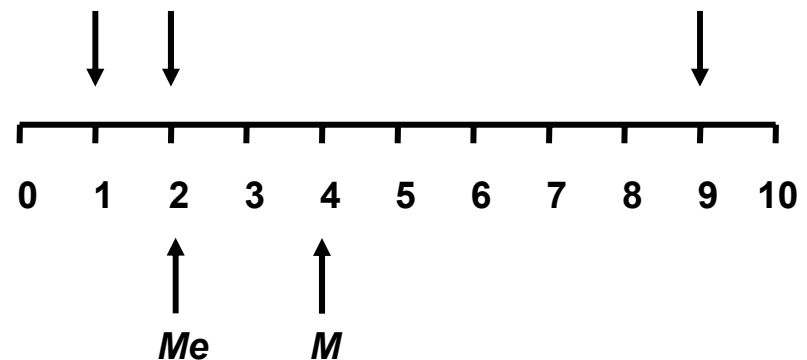
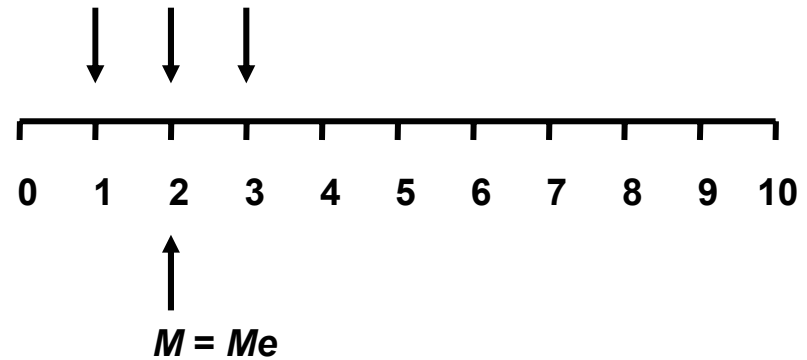
- Havaintoarvojen 1, 2, 3 aritmeettinen keskiarvo on

$$M = \frac{1+2+3}{3} = 2$$

- Muutetaan havaintoarvo 3 havaintoarvoksi 9 ja *pidetään muut havaintoarvot samoina.*
- Tällöin *uudeksi* aritmeettiseksi keskiarvoksi tulee

$$M = \frac{1+2+9}{3} = 4$$

- Sen sijaan havaintoarvojen mediaani *Me ei muutu.*
- Ks. kuvaa oikealla.



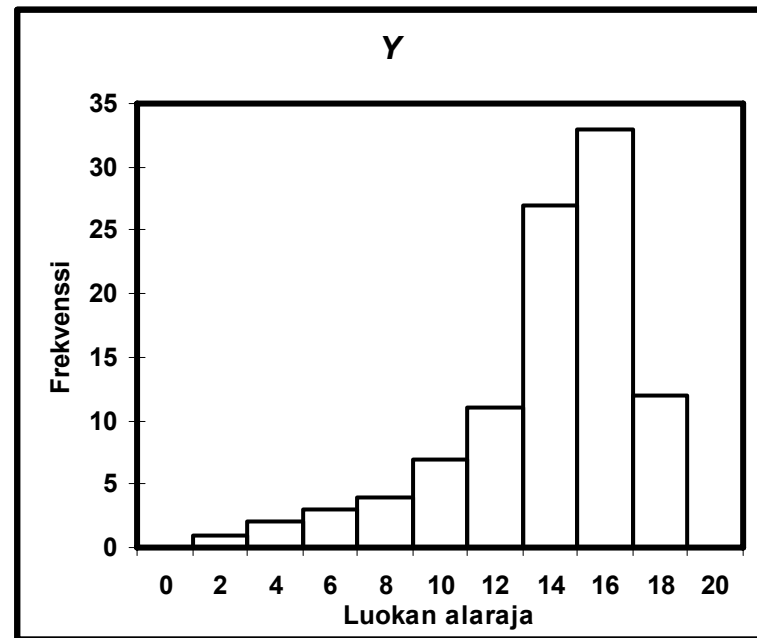
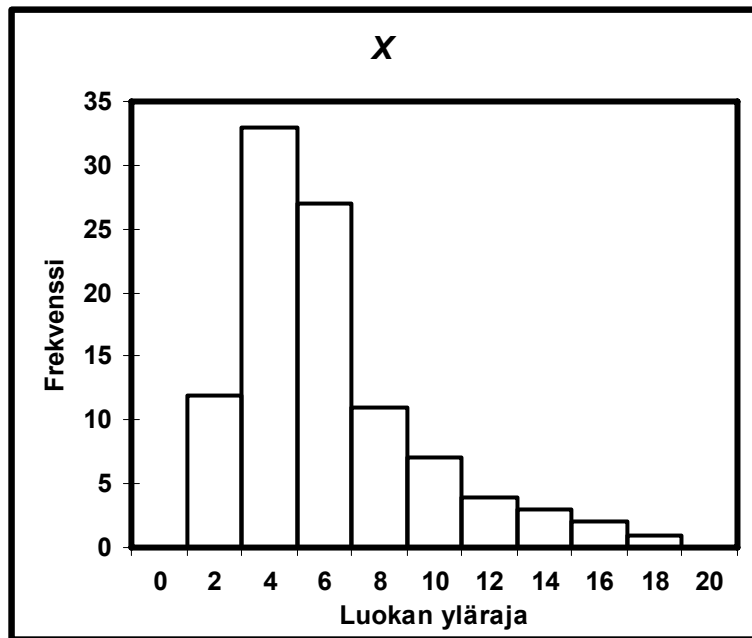
Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Mediaani, aritmeettinen keskiarvo ja jakauman vinous

- Oletetaan, että *aritmeettinen keskiarvo* M ja *mediaani* Me määrätään *samasta jatkuvan muuttujan havaittujen arvojen luokitellusta frekvenssijakaumasta*.
- Jos havaintoarvojen jakauma on *yksihuippuinen*, pätee seuraava (ks. havainnollistusta seuraavalla kalvolla):
 - (i) *Vasemmalle vinoilla jakaumilla*
$$M < Me$$
 - (ii) *Symmetrisillä jakaumilla*
$$M \approx Me$$
 - (iii) *Oikealle vinoilla jakaumilla*
$$Me < M$$

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Mediaani, aritmeettinen keskiarvo ja jakauman vinous: Havainnollistus 1/2



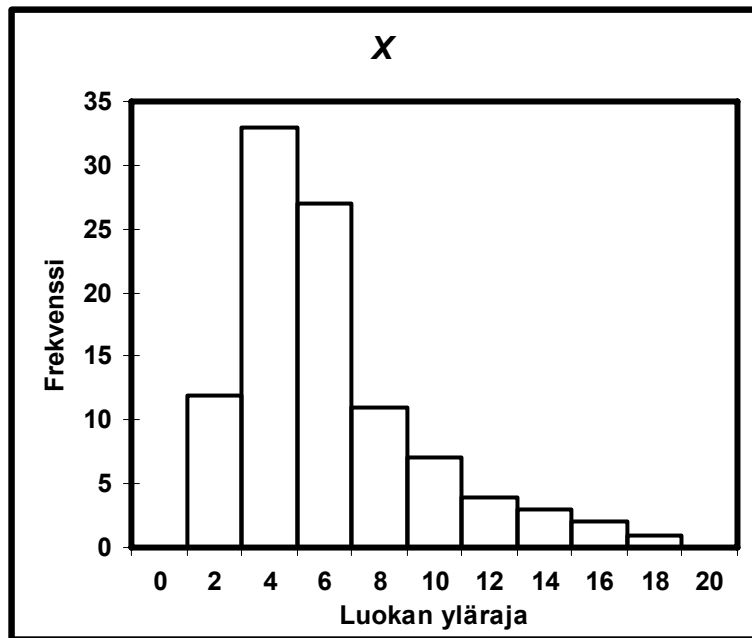
- Yllä olevat histogrammit perustuvat sataan satunnaislukujen avulla generoituun havaintoarvoon:

$$X \sim \chi^2(5)$$

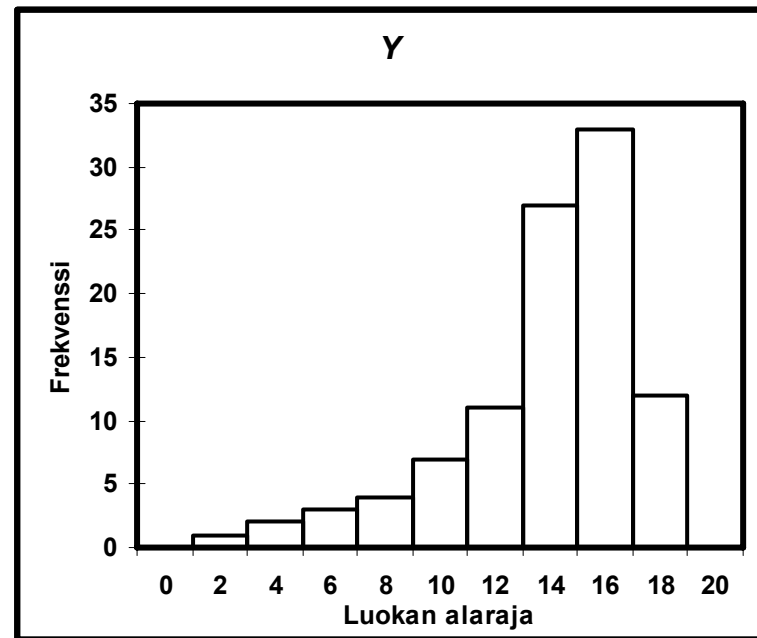
$$Y = 20 - X$$

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Mediaani, aritmeettinen keskiarvo ja jakauman vinous: Havainnollistus 2/2



- Jakauma on vino *oikealle*:
Vinous = 1.25
Aritmeettinen keskiarvo = 5.19
Mediaani = 4.41



- Jakauma on vino *vasemmalle*:
Vinous = -1.25
Aritmeettinen keskiarvo = 14.81
Mediaani = 15.59

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Kvartiilit 1/2

- Olkoot

$$z_1, z_2, \dots, z_n$$

järjestys-, välimatka- tai suhdeasteikollisen muuttujan x havaitut arvot järjestettyinä suuruusjärjestykseen pienimmästä suurimpaan.

- Tällöin

$$Q_1 = \text{Alakvartiili} = 25. \text{ prosenttipiste} = z_{(25)}$$

$$Q_2 = \text{Keskikvartiili} = 50. \text{ prosenttipiste} = z_{(50)}$$

$$Q_3 = \text{Yläkvartiili} = 75. \text{ prosenttipiste} = z_{(75)}$$

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Kvartiilit 2/2

- Kvartiilit Q_1 , Q_2 , Q_3 jakavat suuruusjärjestykseen asetetun havaintoaineiston *neljään yhtä suureen osaan*.
- Erityisesti:

Keskikvartiili Q_2

= Havaintoarvojen *mediaani* Me

Alakvartiili Q_1

= Havaintoarvojen mediaania Me *pienempien havaintoarvojen mediaani*

Yläkvartiili Q_3

= Havaintoarvojen mediaania Me *suurempien havaintoarvojen mediaani*

Kvartiilit, kvartiiliväli ja kvartiilipoikkeama

- Olkoot havaintoarvojen *kvartiilit* Q_1 , Q_2 , Q_3 .

- Tällöin

$$(Q_1 , Q_3) = \text{kvartiiliväli}$$

$$Q_3 - Q_1 = IQR = \text{kvartiilivälin pituus}$$

$$(Q_3 - Q_1)/2 = IQR/2 = \text{kvartiilipoikkeama}$$

- Kvartiiliväliä, kvartiilivälin pituutta ($IQR = \underline{i}$ nterquartile range) ja kvartiilipoikkeamaa voidaan käyttää kuvaamaan havaintoarvojen *hajaantuneisuutta* (*keskittyneisyyttä*).
- Jos havaintoarvojen jakaumaa kuvaavana *keskilukuna* on käytetty *mediaania*, *hajontalukuna* käytetään usein *kvartiilipoikkeamaa*.

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Box and Whisker -kuvio 1/6

- Havaintoarvojen jakaumaa voidaan usein kätevästi havainnollistaa ns. **Box and Whisker -kuviolla**.

- Olkoon

$$(Q_1, Q_3)$$

havaintoarvojen *kvartiiliväli* ja

$$Me = Q_2$$

havaintoarvojen *mediaani*.

- Olkoon

$$IQR = Q_3 - Q_1$$

havaintoarvojen *kvartiilivälin* (Q_1, Q_3) *pituus*.

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Box and Whisker -kuvio 2/6

- Määritellään kuvion *sisäaidat* f_1 ja f_3 kaavoilla

$$f_1 = Q_1 - 1.5 \times IQR$$

$$f_3 = Q_3 + 1.5 \times IQR$$

- Olkoon a_1 *pienin* havaintoarvo, joka toteuttaa ehdon

$$a_1 \geq f_1$$

- Olkoon a_3 *suurin* havaintoarvo, joka toteuttaa ehdon

$$a_3 \leq f_3$$

- Määritellään kuvion *ulkoaidat* F_1 ja F_3 kaavoilla

$$F_1 = Q_1 - 3 \times IQR$$

$$F_3 = Q_3 + 3 \times IQR$$

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Box and Whisker -kuvio 3/6

- *Box and Whisker -kuvio* koostuu *laatikosta*, *viiksistä* ja kuvioon merkityistä *poikkeuksellisista havainnoista*.
- Box and Whisker -kuvion piirtäminen:
 - (i) Piirretään suorakaiteen muotoinen **laatikko** kuvaamaan havaintoarvojen *kvartiiliväliä*
 (Q_1, Q_3)
Merkitään havaintoarvojen *mediaani*
 $Me = Q_2$
laatikkoon poikkiviivalla.

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Box and Whisker -kuvio 4/6

Box and Whisker -kuvion piirtäminen (jatkuu):

(ii) Piirretään jananmuotoiset **viikset** laatikon molemmille puolille kuvaamaan välejä

$$(a_1, Q_1) \text{ ja } (Q_3, a_3)$$

(iii) Merkitään väleihin

$$(F_1, a_1) \text{ ja } (a_3, F_3)$$

kuuluvat havaintoarvot kuvioon *tähdillä*.

Merkitään väleihin

$$(-\infty, F_1) \text{ ja } (F_3, +\infty)$$

kuuluvat havaintoarvot kuvioon *ympyröillä*.

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Box and Whisker -kuvio 5/6

- Laatikon ja viiksien määrittelemään väliin

$$(a_1, a_3)$$

kuuluvat havaintoarvoja voidaan pitää *tavallisina*.

- Erityisesti kvartiilivälin

$$(Q_1, Q_3)$$

määrittelemä laatikko sulkee sisäänsä *keskimmäiset 50 %* havaintoarvoista.

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Box and Whisker -kuvio 6/6

- Tähdillä ja ympyröillä merkityt, välin (a_1, a_3) ulkopuolelle jäävät havaintoarvot ovat *poikkeuksellisia*:

- (i) Tähdillä merkityt, väleihin

$$(F_1, a_1) \text{ ja } (a_3, F_3)$$

kuuluvat havaintoarvot ovat vain *lievästi* poikkeuksellisia.

- (ii) Ympyröillä merkityt, väleihin

$$(-\infty, F_1) \text{ ja } (F_3, +\infty)$$

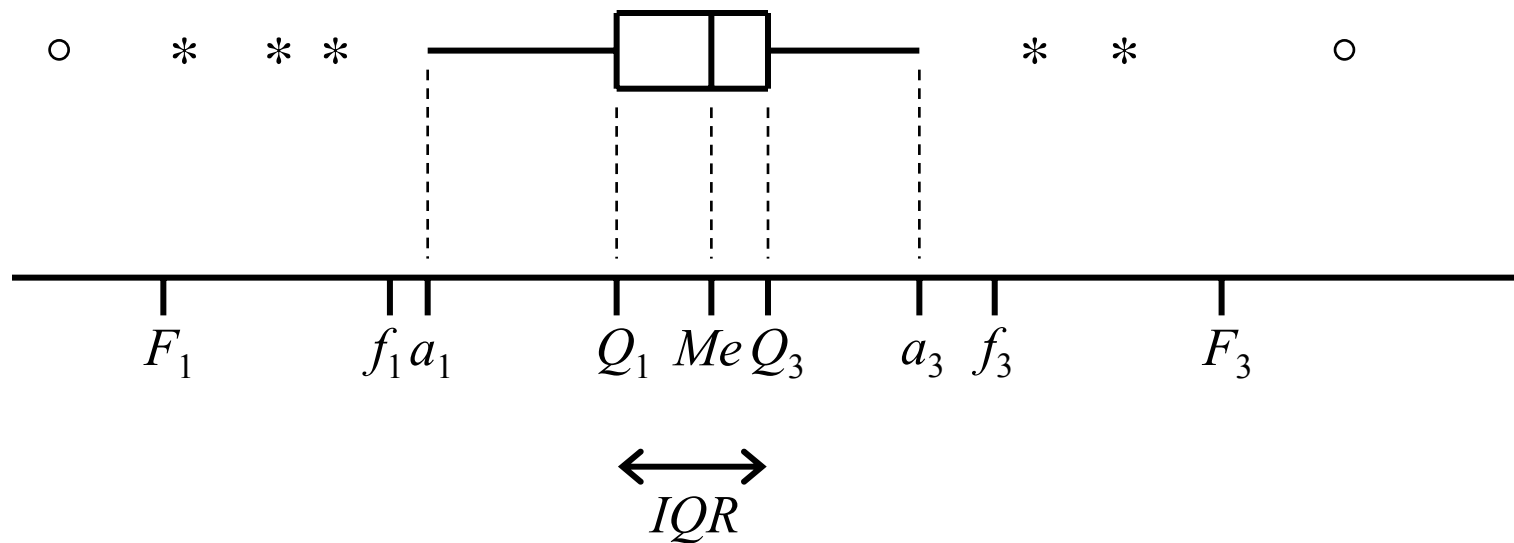
kuuluvia havaintoarvoja voidaan pitää *voimakkaasti* poikkeuksellisina.

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Box and Whisker -kuvio:

Havainnollistus

- *Box and Whisker -kuvio:*



Tilastollisten aineistojen kuvaaminen

Havaintoarvojen jakauma

Tunnusluvut

Suhdeasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Järjestysasteikollisten muuttujien tunnusluvut

>> Laatueroasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Tunnusluvut laatueroasteikollisille muuttujille

- Tavallisimmat tunnusluvut *laatueroasteikollisten* muuttujien havaituille arvoille:
 - **Suhteellinen frekvenssi**
 - **Moodi** keskilukuna

- Huomautus:

Laatueroasteikollisten muuttujien tunnuslukuja *saa käyttää ja on usein myös järkevää käyttää kuvaamaan järjestys-, välimatka- ja suhdeasteikollisten muuttujien havaittujen arvojen jakaumaa.*

Laatueroasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Suhteellinen frekvenssi

- Olkoon *otoskoko* eli kerättyjen *havaintoarvojen lukumäärä* n .
- Olkoon A perusjoukon osajoukko ja otokseen kuuluvien A -tyyppisten havaintoarvojen *frekvenssi* eli *lukumäärä* f .
- Tällöin A -tyyppisten havaintoarvojen **suhteellinen frekvenssi** eli **osuus** otoksessa on

$$\frac{f}{n}$$

Laatueroasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Moodi

- *Frekvenssijakauman moodi eli tyyppi-arvo M_o on yleisin havaintoarvo.*
- *Luokitellun frekvenssijakauman moodi eli tyyppi-arvo M_o on siinä luokassa, jossa luokiteltua frekvenssijakaumaa vastaava histogrammi saavuttaa maksiminsa.*
- Huomautuksia:
 - Jos käytetty luokitus *on tasavälinen*, luokitellun frekvenssijakauman moodi *on* siinä luokassa, jota vastaava frekvenssi on suurin.
 - Jos käytetty luokitus *ei ole tasavälinen*, luokitellun frekvenssijakauman moodi *ei välttämättä ole* siinä luokassa, jota vastaava frekvenssi on suurin.

Laatueroasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Luokitellun aineiston moodi

- **Luokitellun aineiston moodi** voidaan laskea kaavalla

$$Mo = L_i + \frac{d_{i-1}}{d_{i-1} + d_{i+1}} \times c_i$$

jossa

L_i = moodiluokan alaraja

d_{i-1} = moodiluokan ja sitä alemman luokan suorakaiteiden korkeuksien erotus

d_{i+1} = moodiluokan ja sitä ylemmän luokan suorakaiteiden korkeuksien erotus

c_i = moodiluokan pituus

Laatueroasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Moodi jakauman kuvaajana

- Moodi kuvaa *yleisimpien* havaintoarvojen sijoittumista havaintoarvojen jakaumassa.
- Jos havaintoarvojen jakauma on *yksihuippuinen* ja *symmetrinen*, havaintoarvojen moodi, mediaani ja aritmeettinen keskiarvo yhtyvät.
- Jos havaintoarvojen jakauma on *monihuippuinen*, jakaumalla on useita *lokaaleja moodeja*.
- Jos havaintoarvojen jakauma on *monihuippuinen*, jakauman *lokaalit moodit* antavat usein paremman kuvan jakaumasta kuin mediaani tai aritmeettinen keskiarvo.

Moodi, mediaani, aritmeettinen keskiarvo ja jakauman vinous

- Oletetaan, että *aritmeettinen keskiarvo* M , *mediaani* Me ja *moodi* Mo määrätään *samasta jatkuvan muuttujan havaittujen arvojen luokitellusta frekvenssijakaumasta*.
- Jos havaintoarvojen jakauma on *yksihuippuinen*, pätee seuraava (ks. havainnollistusta seuraavalla kalvolla):

(i) *Vasemmalle vinoilla jakaumilla*

$$M < Me < Mo$$

(ii) *Symmetrisillä jakaumilla*

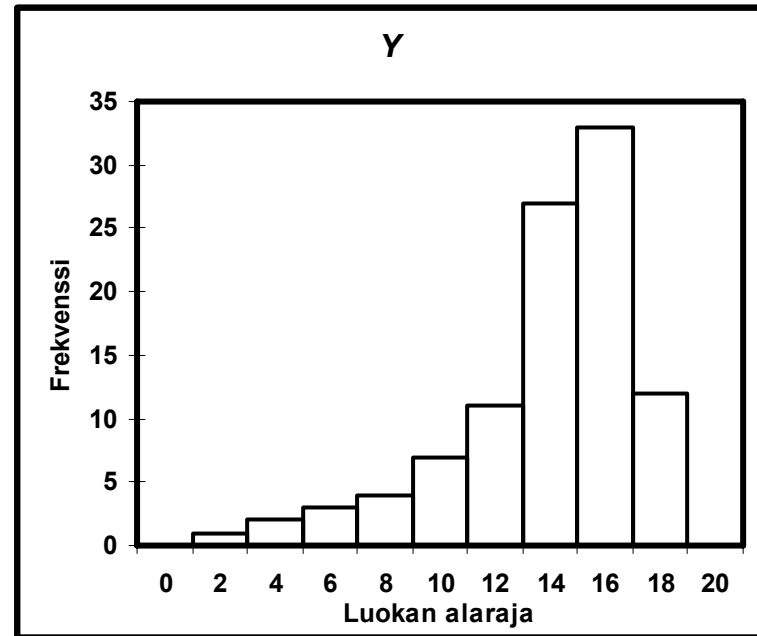
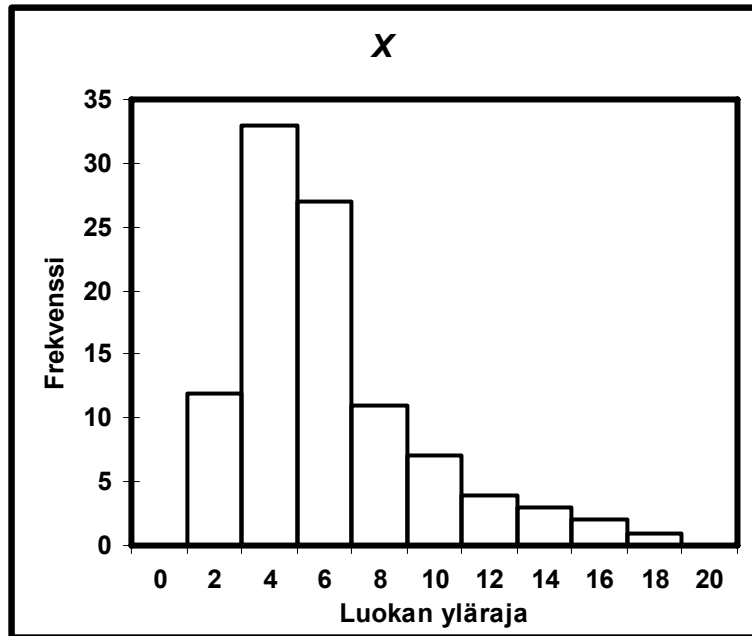
$$M \approx Me \approx Mo$$

(iii) *Oikealle vinoilla jakaumilla*

$$Mo < Me < M$$

Laatueroasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Moodi, mediaani, aritmeettinen keskiarvo ja jakauman vinous: Havainnollistus 1/2



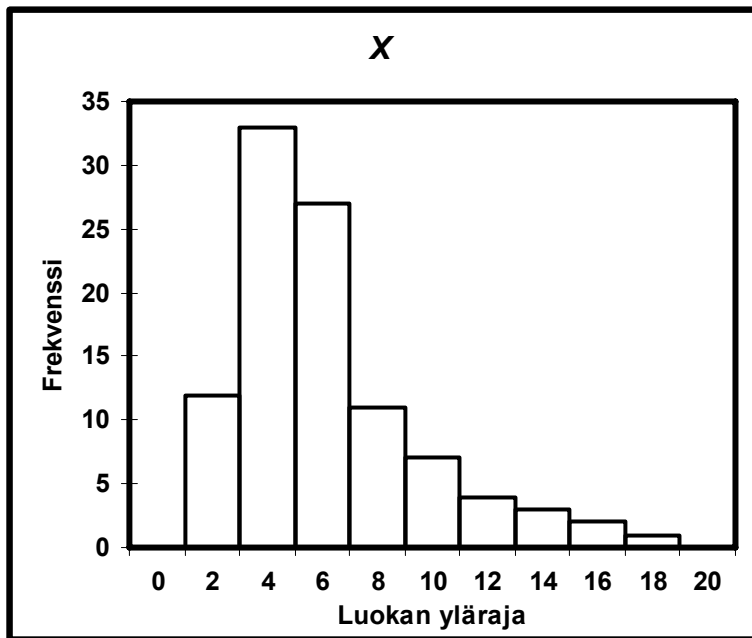
- Yllä olevat histogrammit perustuvat sataan satunnaislukujen avulla generoituun havaintoarvoon:

$$X \sim \chi^2(5)$$

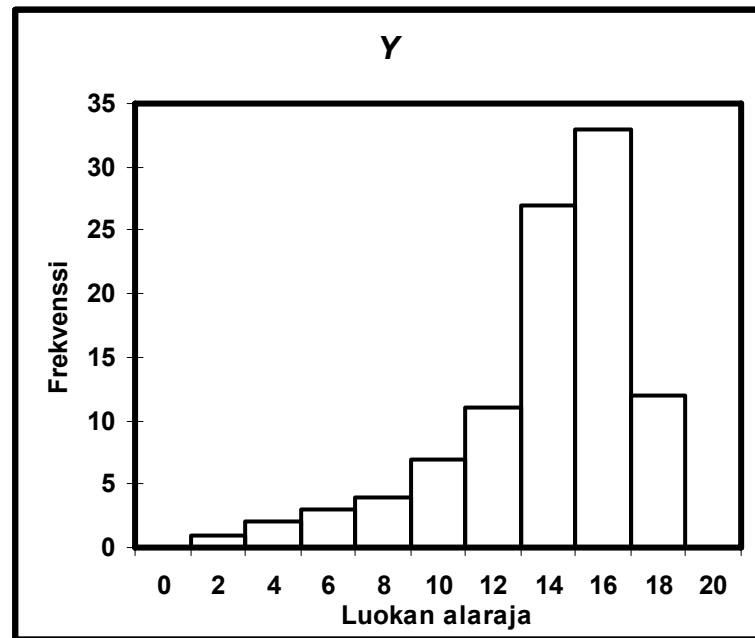
$$Y = 20 - X$$

Laatueroasteikollisten muuttujien tunnusluvut

Moodi, mediaani, aritmeettinen keskiarvo ja jakauman vinous: Havainnollistus 2/2



- Jakauma on vino *oikealle*:
Vinous = 1.25
Aritmeettinen keskiarvo = 5.19
Mediaani = 4.41
Moodi $\in (2, 4]$



- Jakauma on vino *vasemmalle*:
Vinous = -1.25
Aritmeettinen keskiarvo = 14.81
Mediaani = 15.59
Moodi $\in (16, 18]$