

ЛЕКЦИЯ № 6

МЕРЫ

ВАРИАЦИИ

Что такое вариация ?

**Различие в значениях одного
и того же признака у разных
единиц совокупности в один и
тот же момент времени,
возникающее в результате
разнообразных условий
(факторов)**

§ 1. ОСНОВНЫЕ МЕРЫ ВАРИАЦИИ

$$R = x_{\max} - x_{\min}$$

КОЛЕБЛЕМОСТЬ ПРИЗНАКА

Данные о производительности труда
по двум магазинам коммерческого
предприятия (тыс.руб./чел.)

	1 отдел	2 отдел	3 отдел
магазин № 1	9,5	10	10,5
магазин № 2	7,5	10	12,5

$$\bar{x}_1 = \bar{x}_2 = 10 \text{ тыс.руб./чел.}$$

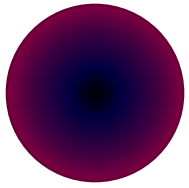
КОЛЕБЛЕМОСТЬ R

для первого магазина - 1 т.р.;

для второго магазина - 5 т.р.

ОБОБЩЕНИЯ КОЛЕБАНИЙ ПРИЗНАКА

- Среднее линейное отклонение
- Среднее квадратическое отклонение



$$\bar{d} = \begin{cases} \frac{\sum |x_i - \bar{x}|}{n} & \text{несгруппированные} \\ & \text{данные} \\ \frac{\sum |x_i - \bar{x}| \cdot f_i}{\sum f_i} & \text{сгруппированные} \\ & \text{данные} \end{cases}$$

ДИСПЕРСИЯ

$$\sigma^2 = \begin{cases} \frac{\sum (x_i - \bar{x})^2}{n} \\ \frac{\sum (x_i - \bar{x})^2 \cdot f_i}{\sum f_i} \end{cases}$$

несгруппированные
данные

сгруппированные
данные

$$\sigma = \sqrt{\sigma^2}$$

**Среднее
квадратическое
отклонение**

СВОЙСТВА ДИСПЕРСИИ

1. Если к каждому значению признака прибавить одно и то же число, то дисперсия не изменится:

$$\frac{\sum [(x_i + A) - (\bar{x} + A)]^2 \cdot f_i}{\sum f_i} = \sigma^2$$

2. Если каждое значение признака изменить в k раз, то дисперсия изменится в k^2 раз:

$$\frac{\sum [(x_i \cdot k) - (\bar{x} \cdot k)]^2 \cdot f_i}{\sum f_i} = k^2 \cdot \sigma^2$$

*Расчёт показателей по способу
моментов (для интервальных
рядов с равными интервалами)*

$$\bar{x} = \frac{\sum x'_i \cdot f_i}{\sum f_i} \cdot h + A$$

*Расчёт показателей по способу
моментов (для интервальных
рядов с равными интервалами)*

$$\sigma^2 = \frac{\sum (x'_i)^2 \cdot f_i}{\sum f_i} \cdot h^2 - (\bar{x} - A)^2$$

*Расчёт показателей по способу
моментов (для интервальных
рядов с равными интервалами)*

$$x'_i = \frac{x_i - A}{h}$$

ОДНОРОДНОСТЬ СОВОКУПНОСТИ

$$v = \frac{\sigma}{\bar{x}} \cdot 100\% \leq 33\%$$

Коэффициент вариации

ВАРИАЦИЯ АЛЬТЕРНАТИВНОГО ПРИЗНАКА

1 - значение признака для единиц совокупности, обладающих изучаемым свойством

0 - значение признака для единиц совокупности, необладающих изучаемым свойством

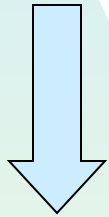
ВАРИАЦИЯ АЛЬТЕРНАТИВНОГО ПРИЗНАКА

*p - доля единиц, обладающих
изучаемым свойством*

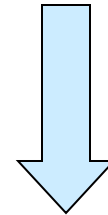
*q - доля единиц, необладающих
изучаемым свойством*

ВАРИАЦИЯ АЛЬТЕРНАТИВНОГО ПРИЗНАКА

единицы, обладающие изучаемым свойством единицы, необладающие изучаемым свойством



$$x_1 = 1$$
$$f_1 = p$$



$$x_2 = 0$$
$$f_2 = q$$



ВАРИАЦИЯ АЛЬТЕРНАТИВНОГО ПРИЗНАКА

$$p + q = 1 \Rightarrow q = 1.$$



$$\begin{aligned}\bar{x} &= \frac{\sum x_i \cdot f_i}{\sum f_i} = \\ &= \frac{1 \cdot p + 0 \cdot q}{p + q} = p\end{aligned}$$

$$\begin{aligned}\sigma^2 &= \frac{\Sigma(x_i - \bar{x})^2 \cdot f_i}{\Sigma f_i} = \\ &= \frac{(1-p)^2 \cdot p + (0-p)^2 \cdot q}{p+q} = \\ &= p \cdot q\end{aligned}$$

ПРИМЕР:

Группы по выручке, тыс.у.е., x_i		Число предприятий, ед., f_i
118	257	3
257	396	5
396	535	9
535	674	6
674	813	4
813	952	3

*Найти среднюю стоимость выручки на предприятиях отрасли
и оценить вариацию средней по способу моментов*

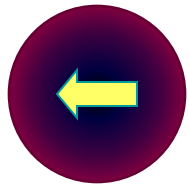
ПРИМЕР:

Группы по выручке, тыс.у.е., x_i		Число предприятий, ед., f_i	x_i'	$x_i' * f_i$	$x_i'^2 * f_i$
118	257	3	-2	-6	12
257	396	5	-1	-5	5
396	535	9	0	0	0
535	674	6	1	6	6
674	813	4	2	8	16
813	952	3	3	9	27
Итого:		30	3	12	66

$$A = \frac{535 + 396}{2} = 465,5 \quad h = 535 - 396 = 139$$

$$\bar{x} = \frac{12}{30} \cdot 139 + 465,5 = 521,1 \quad \sigma^2 = \frac{12}{30} \cdot 139^2 - (521,1 - 465,5)^2$$

§ 2. ПРАВИЛО СЛОЖЕНИЯ, ДИСПЕРСИИ



ВАРИАЦИЯ

Влияние факторов можно выделить, произведя группировку и оценив влияние вариации фактора группировки на изучаемый признак, рассчитав три вида дисперсий:

ОБЩАЯ

ДИСПЕРСИЯ

Измеряет вариацию результата по всей совокупности под влиянием всех факторов

$$\sigma^2 = \frac{\sum (x_i - \bar{x})^2 \cdot f_i}{\sum f_i}$$

МЕЖГРУППОВАЯ

ДИСПЕРСИЯ

Характеризует систематическую вариацию результативного признака под влиянием признака-фактора, положенного в основание группировки

$$\delta^2 = \frac{\sum (\bar{x}_i - \bar{x})^2 \cdot f_i}{\sum f_i}$$

Средняя из внутригрупповых дисперсий

Отражает случайную вариацию результата под влиянием неучтённых факторов

$$\sigma_i^2 = \frac{\sum (x_i - \bar{x}_i)^2 \cdot f_i}{\sum f_i} \quad \text{дисперсия в } i\text{-ой группе}$$

$$\bar{\sigma}_i^2 = \frac{\sum \sigma_i^2 \cdot f_i}{\sum f_i} \quad \text{средняя из
внутригрупповых дисперсий}$$

ПРАВИЛО СЛОЖЕНИЯ ДИСПЕРСИЙ

$$\sigma^2 = \delta^2 + \overline{\sigma_i^2}$$

Эмпирический
коэффициент
детерминации

$$\eta^2 = \frac{\delta^2}{\sigma^2}$$

ЭМПИРИЧЕСКИЙ
КОЭФФИЦИЕНТ
ДЕТЕРМИНАЦИИ

*Выражает в процентах
часть изменений
результата под влиянием
вариации фактора*

Эмпирическое
корреляционное
отношение

$$\sqrt{\eta^2} = \eta$$

**Эмпирическое
корреляционное
отношение**

*Показывает силу
влияния фактора на
результат по
специальной шкале*

Шкала Чеддока

η	0,1-0,3	0,3-0,5	0,5-0,7	0,7-0,9	0,9-0,99
сила связи	слабая	умеренная	заметная	сильная	очень сильная

- Силу связи между признаками показывает эмпирическое корреляционное отношение по шкале Чеддока;
- Эмпирический коэффициент детерминации, выраженный в процентах, показывает часть вариации результативного признака, зависящей от вариации фактора

ПРИМЕР:

Группы работников	Производительность труда на 1 раб., тыс.руб.	Число работников	$x_i f_i$	$(x_i - \bar{x})^2 f_i$
неповышавшие квалификацию	80	8	640	24200
	100	11	1100	13475
	110	6	660	3750
	120	15	1800	3375
По 1 группе	105	40	4200	44800
повышавшие квалификацию	140	17	2380	425
	150	18	2700	4050
	160	14	2240	8750
	180	11	1980	22275
По 2 группе	155	60	9300	35500

$$\bar{x} = \frac{13500}{100} = 135 \quad \sigma^2 = \frac{80300}{100} = 803 \quad \bar{\sigma}_i^2 = 803 - 600 = 203$$

$$\delta^2 = \frac{(105 - 135)^2 \cdot 40 + (155 - 135)^2 \cdot 60}{100} = 600$$

Для нашей задачи

- эмпирический коэффициент

детерминации равен

$600/803=0,854=>85,4\%$,

- эмпирическое

корреляционное

отношение-0,747

ПРАВИЛО

3 S

$$[\bar{x} - \sigma; \bar{x} + \sigma]$$

• в интервале находится 68,3% единиц совокупности

$$\bar{x} \pm \sigma$$

$$[\bar{x} - 2\sigma; \bar{x} + 2\sigma]$$

• в интервале находится 95,4% единиц

$$\bar{x} \pm 2\sigma$$

совокупности

$$[\bar{x} - 3\sigma; \bar{x} + 3\sigma]$$

• в интервале находится 99,7% единиц

$$\bar{x} \pm 3\sigma$$

совокупности

ВОПРОСЫ
ПО
ИЗУЧЕННОЙ
ТЕМЕ



**КАКУЮ ЕДИНИЦУ
ИЗМЕРЕНИЯ ИМЕЕТ
СРЕДНЕЕ
ЛИНЕЙНОЕ
ОТКЛОНЕНИЕ?**

- а) не имеет единицы
измерения;**
- б) проценты;**
- в) такую же как и
основной показатель**



КАКАЯ ВЕЛИЧИНА

ОПИСЫВАЕТ ОДНОРОДНОСТИ

СОВОКУПНОСТИ?

- а) ДИСПЕРСИЯ ;**
- б) СРЕДНЕЕ КВАДРАТИЧЕСКОЕ ОТКЛОНЕНИЕ ;**
- в) КОЭФФИЦИЕНТ ВАРИАЦИИ**



3 ЧТО ПОКАЗЫВАЕТ МЕЖГРУППОВАЯ ДИСПЕРСИЯ?

- а) Влияние фактора, положенного в основание группировки, на результат;**
- б) Влияние результата на группировочный признак;**
- в) функциональную зависимость.**



4 Какой показатель описывает тесноту связи фактора и результата?

- а) коэффициент детерминации ;**
- б) коэффициент вариации ;**
- в) эмпирическое корреляционное отношение ;**
- г) средний квадрат отклонений .**



Какой показатель описывает силу связи фактора и результата?

- а) коэффициент детерминации ;**
- б) коэффициент вариации ;**
- в) эмпирическое корреляционное отношение ;**
- г) средний квадрат отклонений .**



**СПАСИБО
ЗА
ВНИМАНИЕ!**