

Weitere Lagemaße: Quantile/Perzentile I

- Für jeden Median x_{med} gilt: Mindestens 50% der Merkmalswerte sind kleiner gleich x_{med} und ebenso mindestens 50% größer gleich x_{med} .
- Verallgemeinerung dieser Eigenschaft auf beliebige Anteile geläufig, also auf Werte, zu denen mindestens ein Anteil p kleiner gleich und ein Anteil $1 - p$ größer gleich ist, sog. **p -Quantilen** (auch **p -Perzentile**) x_p .
- Mediane sind dann gleichbedeutend mit 50%-Quantilen bzw. 0.5-Quantilen, es gilt also insbesondere bei eindeutigen Medianen

$$x_{\text{med}} = x_{0.5} .$$

Weitere Lagemaße: Quantile/Perzentile III

- p -Quantile kann man auch mit der emp. Verteilungsfunktion F bestimmen:
- Mit der Abkürzung

$$F(x - 0) := \lim_{\substack{h \rightarrow 0 \\ h > 0}} F(x - h), \quad x \in \mathbb{R},$$

für linksseitige Grenzwerte empirischer Verteilungsfunktionen F ist x_p ist genau dann ein p -Quantil, wenn gilt:

$$F(x_p - 0) \leq p \leq F(x_p)$$

- Spezieller ist x_p genau dann ein p -Quantil, wenn
 - ▶ bei Vorliegen der exakten Häufigkeitsverteilung r und Verteilungsfunktion F

$$F(x_p) - r(x_p) \leq p \leq F(x_p) ,$$

- ▶ bei Verwendung der approximativen Verteilungsfunktion F bei klassierten Daten (wegen der Stetigkeit der Approximation!)

$$F(x_p) = p$$

gilt.

Weitere Lagemaße: Quantile/Perzentile II

Definition 3.4 (Quantile/Perzentile, Quartile)

Sei X ein (mindestens) ordinalskaliertes Merkmal auf der Menge der vorstellbaren Merkmalsausprägungen M mit den Merkmalswerten x_1, \dots, x_n .

Für $0 < p < 1$ heißt jeder Wert $x_p \in M$ mit der Eigenschaft

$$\frac{\#\{i \in \{1, \dots, n\} \mid x_i \leq x_p\}}{n} \geq p \quad \text{und} \quad \frac{\#\{i \in \{1, \dots, n\} \mid x_i \geq x_p\}}{n} \geq 1 - p$$

p -Quantil (auch **p -Perzentil**) von X . Man bezeichnet spezieller das 0.25-Quantil $x_{0.25}$ als **unteres Quartil** sowie das 0.75-Quantil $x_{0.75}$ als **oberes Quartil**.

Weitere Lagemaße: Quantile/Perzentile IV

- Genauso wie der Median muss ein p -Quantil nicht eindeutig bestimmt sein.
- Bei stetigen Merkmalen kann Eindeutigkeit *zum Beispiel* durch die gängige Festlegung

$$x_p = \begin{cases} x_{(\lfloor n \cdot p \rfloor + 1)} & \text{für } n \cdot p \notin \mathbb{N} \\ \frac{1}{2} \cdot (x_{(n \cdot p)} + x_{(n \cdot p + 1)}) & \text{für } n \cdot p \in \mathbb{N} \end{cases}$$

erreicht werden, wobei $x_{(1)}, x_{(2)}, \dots, x_{(n)}$ die gemäß der vorgegebenen Ordnung sortierte Urliste ist und mit $\lfloor y \rfloor$ für $y \in \mathbb{R}$ die größte ganze Zahl kleiner gleich y bezeichnet wird.

- Zum Beispiel ist für die (bereits sortierte) Urliste

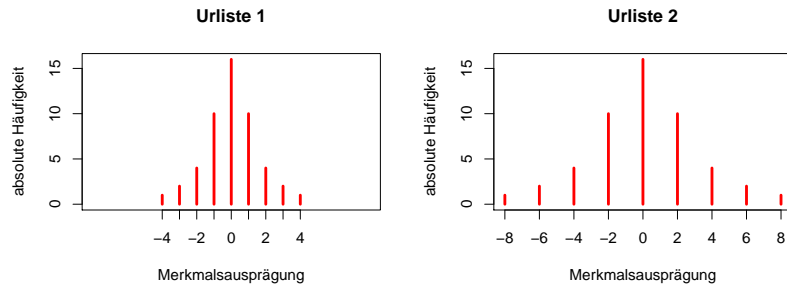
$$6.77, 7.06, 8.84, 9.98, 11.87, 12.18, 12.7, 14.92$$

der Länge $n = 8$ das 0.25-Quantil $x_{0.25}$ wegen $n \cdot p = 8 \cdot 0.25 = 2 \in \mathbb{N}$ nicht eindeutig bestimmt, sondern alle Werte $x_{0.25} \in [7.06, 8.84]$ sind 0.25-Quantile. Die eindeutige Festlegung nach obiger Konvention würde dann die „Auswahl“ $x_{0.25} = \frac{1}{2} (7.06 + 8.84) = 7.95$ treffen.

Streuungsmaße I

- Verdichtung der Merkmalswerte auf einen Lageparameter als einzige Kennzahl recht unspezifisch.
- Starke Unterschiede trotz übereinstimmender Lagemaße möglich:

Stabdiagramme zu Urlisten mit identischem Mittelwert, Modus, Median



Streuungsmaße III

Definition 3.5 (Spannweite, IQA, mittlere abs. Abweichung)

Seien x_1, \dots, x_n die Urliste zu einem kardinalskalierten Merkmal X , x_{med} der Median und $x_{0,25}$ bzw. $x_{0,75}$ das untere bzw. obere Quartil von X .

Dann heißt

- 1 $SP := \left(\max_{i \in \{1, \dots, n\}} x_i \right) - \left(\min_{i \in \{1, \dots, n\}} x_i \right) = x_{(n)} - x_{(1)}$ die **Spannweite** von X ,
- 2 $IQA := x_{0,75} - x_{0,25}$ der **Interquartilsabstand (IQA)** von X ,
- 3 $MAA := \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n |x_i - x_{med}|$ die **mittlere absolute Abweichung** von X .

Streuungsmaße II

- Bei kardinalskalierten Merkmalen: zusätzliche Kennzahl für Variation bzw. Streuung der Merkmalswerte von Interesse
- Ähnlich wie bei Lagemaßen: verschiedene Streuungsmaße gängig
- Allen Streuungsmaßen gemeinsam: Bezug zu „Abstand“ zwischen Merkmalswerten
- Ein möglicher Abstand: (Betrag der) Differenz zwischen Merkmalswerten

Streuungsmaße IV

- Die Betragsstriche in Teil 1 und 2 von Definition 3.5 fehlen, da sie überflüssig sind.
- Um Eindeutigkeit in Teil 2 von Definition 3.5 zu erhalten, sind die für kardinalskalierte Merkmale üblichen Konventionen zur Berechnung von Quantilen aus Folie 76 anzuwenden.
- Verwendung von \bar{x} statt x_{med} in Teil 3 von Definition 3.5 prinzipiell möglich, aber: Beachte Folie 72!
- Weiterer möglicher Abstand: Quadrate der Differenzen zwischen Merkmalswerten

Streuungsmaße V

Definition 3.6 (empirische Varianz, empirische Standardabweichung)

Seien x_1, \dots, x_n die Urliste zu einem kardinalskalierten Merkmal X , $\bar{x} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i$ das arithmetische Mittel von X . Dann heißt

1 $s^2 := \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2$ die **(empirische) Varianz** von X ,

2 die (positive) Wurzel $s = \sqrt{s^2} = \sqrt{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2}$ die **(empirische) Standardabweichung** von X .

Streuungsmaße VII

- Mit der Schreibweise $\overline{x^2} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2$ erhält man aus Satz 3.1 die kürzere Darstellung $s^2 = \overline{x^2} - \bar{x}^2$.
- Liegt zum Merkmal X die absolute Häufigkeitsverteilung $h(a)$ bzw. die relative Häufigkeitsverteilung $r(a)$ auf der Menge der Ausprägungen $A = \{a_1, \dots, a_m\}$ vor, so kann s^2 auch durch

$$s^2 = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^m h(a_j) \cdot (a_j - \bar{x})^2 = \sum_{j=1}^m r(a_j) \cdot (a_j - \bar{x})^2$$

berechnet werden. (Berechnung von \bar{x} dann mit Häufigkeiten als $\bar{x} = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^m h(a_j) \cdot a_j = \sum_{j=1}^m r(a_j) \cdot a_j$, siehe Bemerkung 3.1 auf Folie 67)

- Natürlich kann alternativ auch Satz 3.1 verwendet und $\overline{x^2} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2$ mit Hilfe der Häufigkeitsverteilung durch

$$\overline{x^2} = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^m h(a_j) \cdot a_j^2 = \sum_{j=1}^m r(a_j) \cdot a_j^2$$

berechnet werden.

Streuungsmaße VI

- Empirische Varianz bzw. Standardabweichung sind die gebräuchlichsten Streuungsmaße.
- Standardabweichung s hat dieselbe Dimension wie die Merkmalswerte, daher i.d.R. besser zu interpretieren als Varianz.
- Für Merkmale mit positivem Mittelwert \bar{x} als relatives Streuungsmaß gebräuchlich: **Variationskoeffizient** $VK := \frac{s}{\bar{x}}$
- „Rechenregeln“ zur alternativen Berechnung von s bzw. s^2 vorhanden.

Satz 3.1 (Verschiebungssatz)

Seien x_1, \dots, x_n die Urliste zu einem kardinalskalierten Merkmal X , \bar{x} das arithmetische Mittel und s^2 die empirische Varianz von X . Dann gilt

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

Empirische Varianz bei klassierten Daten

- Bei klassierten Daten: auch für empirische Varianz nur Approximation möglich.
- Analog zur Berechnung von s^2 aus Häufigkeitsverteilungen:
 - ▶ Näherungsweise Berechnung von s^2 aus Klassenmitten m_j und absoluten bzw. relativen Klassenhäufigkeiten h_j bzw. r_j der l Klassen als

$$s^2 = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^l h_j \cdot (m_j - \bar{x})^2 \quad \text{mit} \quad \bar{x} = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^l h_j \cdot m_j$$

bzw.

$$s^2 = \sum_{j=1}^l r_j \cdot (m_j - \bar{x})^2 \quad \text{mit} \quad \bar{x} = \sum_{j=1}^l r_j \cdot m_j .$$

- ▶ Alternativ: Verwendung von Satz 3.1 mit

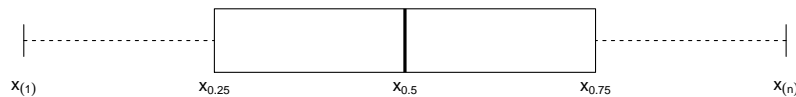
$$\bar{x} := \frac{1}{n} \sum_{j=1}^l h_j \cdot m_j = \sum_{j=1}^l r_j \cdot m_j$$

und

$$\overline{x^2} := \frac{1}{n} \sum_{j=1}^l h_j \cdot m_j^2 = \sum_{j=1}^l r_j \cdot m_j^2 .$$

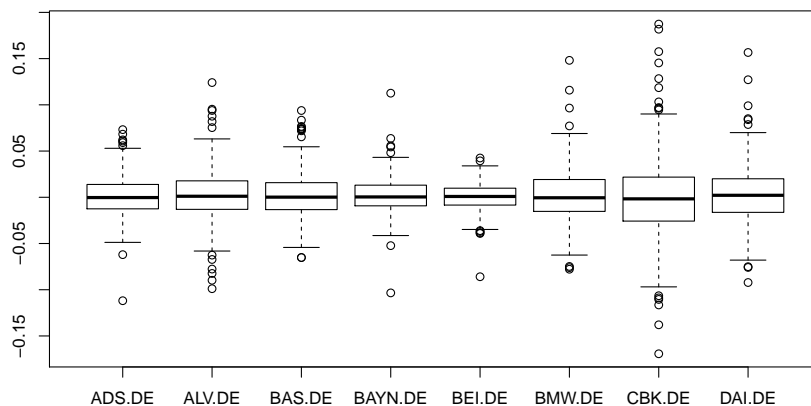
Box-and-whisker-Plot I

- Häufig von Interesse:
Visueller Vergleich **eines** Merkmals für **verschiedene** statistische Massen
 - Dazu nötig: Grafische Darstellung mit Ausdehnung (im Wesentlichen) nur in einer Dimension (2. Dimension für Nebeneinanderstellung der Datensätze)
- ↪ **Box-and-whisker-Plot** oder kürzer **Box-Plot**:
Zur Urliste x_1, \dots, x_n eines kardinalskalierten Merkmals werden *im Prinzip* die 5 Kennzahlen $x_{(1)}, x_{0.25}, x_{0.5}, x_{0.75}, x_{(n)}$ in Form eines durch $x_{0.5}$ geteilten „Kästchens“ (Box) von $x_{0.25}$ bis $x_{0.75}$ und daran anschließende „Schnurrhaare“ (Whisker) bis zum kleinsten Merkmalswert $x_{(1)}$ und zum größten Merkmalswert $x_{(n)}$ dargestellt:



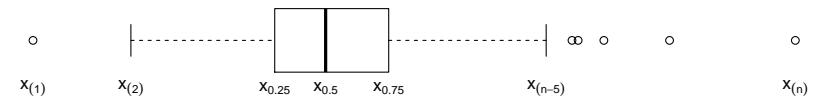
Box-and-whisker-Plot III

- Beispiel für Gegenüberstellung mehrerer Datensätze
(Diskrete Tagesrenditen verschiedener DAX-Papiere)



Box-and-whisker-Plot II

- (Häufig auftretende!) Ausnahme:
 $x_{(1)}$ und/oder $x_{(n)}$ liegen weiter als der 1.5-fache Interquartilsabstand (IQA) $x_{0.75} - x_{0.25}$ von der Box entfernt (also weiter als die 1.5-fache Breite der Box)
- ↪ Dann: Whiskers nur bis zu äußersten Merkmalswerten innerhalb dieser Distanz und separates Eintragen der „Ausreißer“, d.h. aller Urlisteneinträge, die nicht von der Box und den Whiskers abgedeckt werden.
- Beispiel mit „Ausreißern“:



Symmetrie(-maß), Schiefe I

- Neben Lage und Streuung bei kardinalskalierten Merkmalen auch interessant: **Symmetrie** (bzw. Asymmetrie oder Schiefe) und **Wölbung**
- Ein Merkmal X ist symmetrisch (um \bar{x}), wenn die Häufigkeitsverteilung von $X - \bar{x}$ mit der von $\bar{x} - X$ übereinstimmt.
(Dabei ist mit $X - \bar{x}$ das Merkmal mit den Urlistenelementen $x_i - \bar{x}$ für $i \in \{1, \dots, n\}$ bezeichnet, dies gilt analog für $\bar{x} - X$.)
- Symmetrie eines Merkmals entspricht also der Achsensymmetrie des zugehörigen Stabdiagramms um \bar{x} .
- Ist ein Merkmal nicht symmetrisch, ist die **empirische Schiefe** bzw. **empirische Skewness** ein geeignetes Maß für die Stärke der Asymmetrie.

Symmetrie(-maß), Schiefe II

Definition 3.7 (empirische Schiefe, Skewness)

Sei X ein Merkmal mit der Urliste x_1, \dots, x_n . Dann heißt

$$\text{skewness}(X) := \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \left(\frac{x_i - \bar{x}}{s} \right)^3$$

mit $\bar{x} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i$ und $s = \sqrt{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2}$ die **empirische Schiefe (Skewness)** von X .

- Man kann zeigen: X symmetrisch \Rightarrow $\text{skewness}(X) = 0$
- X heißt **linkssteil** oder **rechtsschief**, falls $\text{skewness}(X) > 0$.
- X heißt **rechtssteil** oder **linksschief**, falls $\text{skewness}(X) < 0$.
- Für symmetrische Merkmale ist \bar{x} gleichzeitig Median von X , bei linkssteilen Merkmalen gilt **tendenziell** $\bar{x} > x_{\text{med}}$, bei rechtssteilen **tendenziell** $\bar{x} < x_{\text{med}}$.

Wölbungsmaß (Kurtosis) I

Definition 3.8 (empirische Wölbung, Kurtosis)

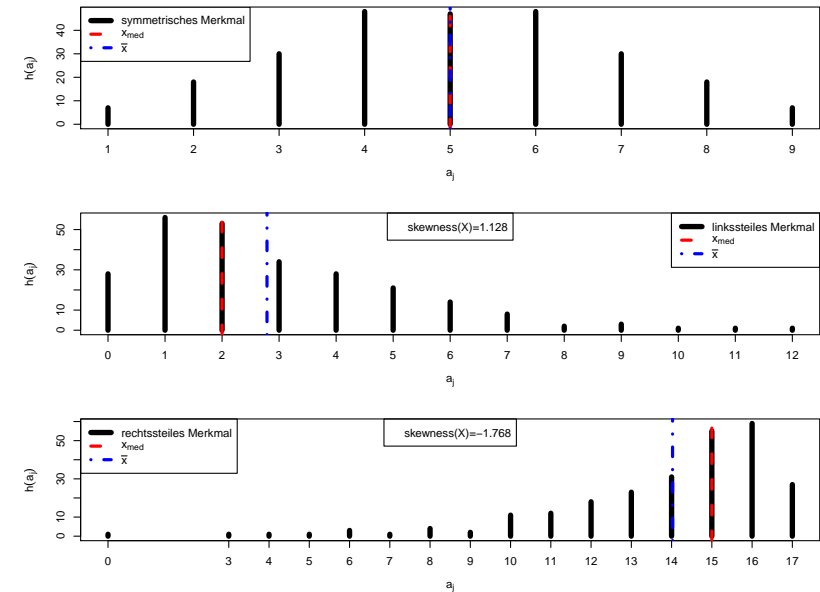
Sei X ein Merkmal mit der Urliste x_1, \dots, x_n . Dann heißt

$$\text{kurtosis}(X) := \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \left(\frac{x_i - \bar{x}}{s} \right)^4$$

mit $\bar{x} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i$ und $s = \sqrt{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2}$ die **empirische Wölbung (Kurtosis)** von X .

- Kurtosis misst bei Merkmalen mit *einem* Modalwert, wie „flach“ (kleiner Wert) bzw. „spitz“ (großer Wert) der „Gipfel“ um diesen Modalwert ist.

Beispiele für empirische Schiefe von Merkmalen

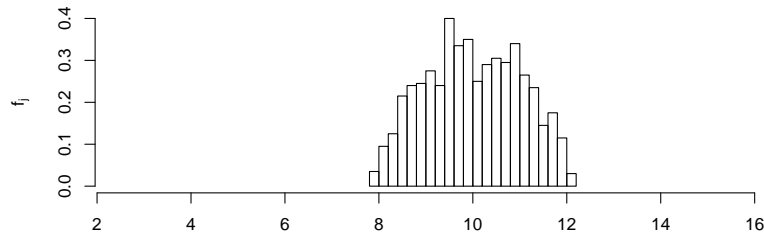


Wölbungsmaß (Kurtosis) II

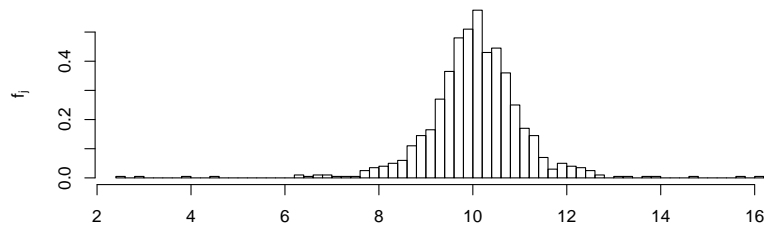
- Bei gleicher mittlerer quadratischer Abweichung vom Mittelwert (\rightsquigarrow Varianz) müssen Merkmale mit größerer emp. Kurtosis (mehr Werten in der Nähe des Gipfels) auch mehr weit vom Gipfel entfernte Merkmalswerte besitzen.
- Der Wert 3 wird als „normaler“ Wert für die empirische Kurtosis angenommen, Merkmale mit $1 \leq \text{kurtosis}(X) < 3$ heißen platykurtisch, Merkmale mit $\text{kurtosis}(X) > 3$ leptokurtisch.
- **Vorsicht:** Statt der Kurtosis von X wird oft die **Exzess-Kurtosis** von X angegeben, die der um den Wert 3 verminderten Kurtosis entspricht.

Beispiele für Merkmale mit unterschiedlicher empirischer Kurtosis

Merkmal mit kleiner empirischer Kurtosis (2.088)



Merkmal mit großer empirischer Kurtosis (12.188)

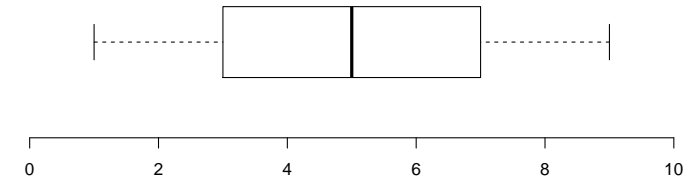


Schiefe und Wölbung in grafischen Darstellungen II

- Bei linkssteilen Merkmalen hat *tendenziell* der rechte/obere Teil (rechter/oberer Teil der Box und rechter/oberer Whisker) eine **größere** Ausdehnung als der linke/untere Teil.
- Bei rechtssteilen Merkmalen hat *tendenziell* der rechte/obere Teil (rechter/oberer Teil der Box und rechter/oberer Whisker) eine **kleinere** Ausdehnung als der linke/untere Teil.
- Bei Merkmalen mit **großer** empirischer Kurtosis gibt es *tendenziell* **viele** „Ausreißer“, also separat eingetragene Merkmalswerte außerhalb der Whiskers (wenigstens auf einer Seite).
- Bei Merkmalen mit **kleiner** empirischer Kurtosis gibt es häufig **wenige** oder **gar keine** „Ausreißer“.

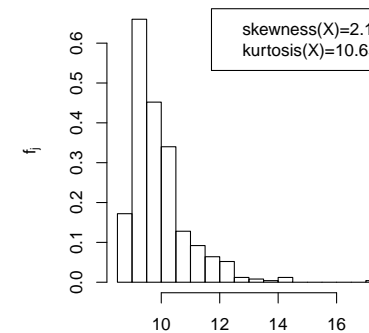
Schiefe und Wölbung in grafischen Darstellungen I

- Box-Plots lassen auch auf empirische Schiefe und Kurtosis schließen.
- Bei symmetrischen Merkmalen sind auch die Box-Plots symmetrisch. Beispiel: Box-Plot zur Urliste 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9:

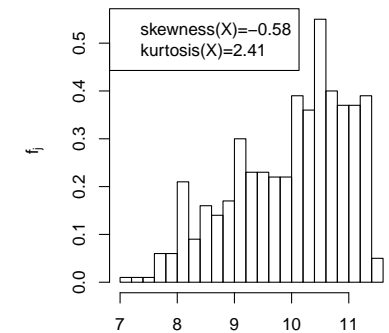


- Beispiele für Merkmale mit unterschiedlicher empirischer Schiefe/Kurtosis

Linkssteil mit großer emp. Kurtosis



Rechtssteil mit kleiner emp. Kurtosis



- Zugehörige Box-Plots:

