Universität des Saarlandes
Lehrstab Statistik
Dr. Martin Becker

12. Übungsblatt zur Vorlesung
Schließende Statistik WS 2016/17

Aufgabe 46

Gegeben seien n Punkte (y_i, x_i), durch die eine Gerade $y = a + b \cdot x$ gelegt werden soll.

(a) Wie lautet das Kleinst-Quadrate-Prinzip?

(b) Zeigen Sie, dass das Kleinst-Quadrate-Prinzip auf die beiden Normalgleichungen

(1) $na + b\sum_{i=1}^{n} x_i = \sum_{i=1}^{n} y_i$
(2) $a\sum_{i=1}^{n} x_i + b\sum_{i=1}^{n} x_i^2 = \sum_{i=1}^{n} x_i \cdot y_i$

führt.

(c) Geben Sie die Kleinst-Quadrate-Lösungen $\widehat{a}$ und $\widehat{b}$ an.

(d) Es sei $\widehat{u}_i = y_i - \widehat{y}_i$ mit $\widehat{y}_i = \widehat{a} + \widehat{b} \cdot x_i$. Zeigen Sie die Gültigkeit der Beziehung $\sum_{i=1}^{n} \widehat{u}_i = 0$.

(e) Zeigen Sie, dass die Beziehung $\overline{y} = \overline{\widehat{y}}$ gilt, wobei $\overline{\widehat{y}} = \frac{1}{n}\sum_{i=1}^{n} \widehat{y}_i$.

(f) Zeigen Sie die Gültigkeit der Beziehung $\sum_{i=1}^{n} x_i \cdot \widehat{u}_i = 0$.

(g) Zeigen Sie die Gültigkeit der Beziehung $\sum_{i=1}^{n} \widehat{y}_i \cdot \widehat{u}_i = 0$.

(h) Beweisen Sie die folgende Zerlegungsformel:
$\sum_{i=1}^{n}(y_i - \overline{y})^2 = \sum_{i=1}^{n}(\widehat{y}_i - \overline{\widehat{y}})^2 + \sum_{i=1}^{n} \widehat{u}_i^2$.

Aufgabe 47

Man gehe davon aus, dass sich die Abhängigkeit des systolischen Blutdrucks y_i vom Lebensalter x_i eines Menschen durch das einfache lineare Regressionsmodell

$$y_i = \beta_1 + \beta_2 x_i + u_i \qquad \text{mit} \quad u_i \overset{\text{iid}}{\sim} N(0, \sigma^2), \ i = 1, \dots, n$$

erklären lässt.

In einer medizinischen Studie wurden bei $n = 62$ Personen die Merkmale Alter x_i und systolischer Blutdruck y_i erhoben und daraus für die Durchführung einer einfachen linearen Regressionsanalyse bereits die folgenden Zwischenwerte errechnet:

$$\sum_{i=1}^{62} y_i = 9193; \quad \sum_{i=1}^{62} y_i^2 = 1384977; \quad \sum_{i=1}^{62} x_i = 2882;$$

$$\sum_{i=1}^{62} x_i^2 = 148292; \quad \sum_{i=1}^{62} x_i y_i = 441517$$

(a) Schätzen Sie β_1 und β_2 mit Hilfe der Kleinst-Quadrate-Methode.

(b) Berechnen Sie das zugehörige Bestimmtheitsmaß R^2.

(c) Schätzen Sie die Varianz σ^2 mit einer erwartungstreuen Schätzfunktion und berechnen Sie $\widehat{\sigma^2}_{\widehat{\beta}_1}$ sowie $\widehat{\sigma^2}_{\widehat{\beta}_2}$.

(d) Testen Sie zum Signifikanzniveau $\alpha = 0.001$ **(!)**, ob das Alter einer Person einen signifikanten Einfluss auf den systolischen Blutdruck hat.

(e) Geben Sie ein zweiseitiges Konfidenzintervall zum Niveau $1 - \alpha = 0.95$ für β_1 an.

(f) Testen Sie zum Signifikanzniveau $\alpha = 0.05$, ob sich β_1 signifikant von 100 unterscheidet.

(g) Steigt der systolische Blutdruck eher mit zunehmendem oder eher mit abnehmendem Alter? Begründen Sie Ihre Antwort.