



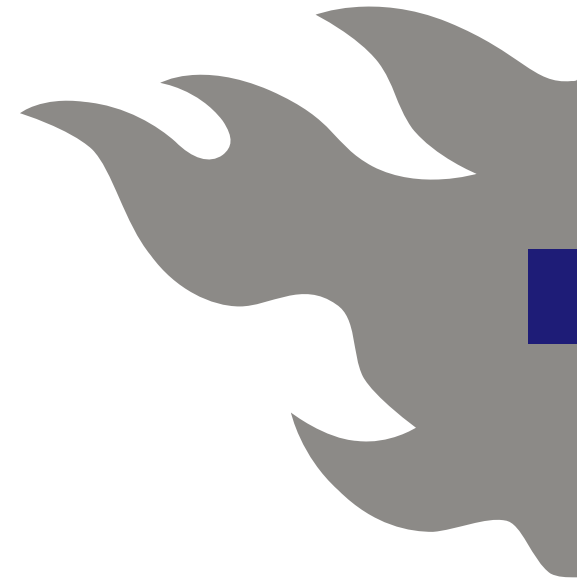
HELSINGIN YLIOPISTO
HELSINGFORS UNIVERSITET
UNIVERSITY OF HELSINKI

Otantamenetelmät (78143) Syksy 2011

TEEMA 1

Risto Lehtonen

risto.lehtonen@helsinki.fi





Otantamenetelmät

Luennot

Tiistaisin klo 14–18

1.-29.11.2011 (yhteensä 20 tuntia), Exactum C122

Harjoitukset

Torstaisin klo 12–15

3.11.–1.12.2011 (yhteensä 15 tuntia), Mikroluokka C128

Harjoituksissa käytetään tilastollisia ohjelmistoja (pääasiassa SAS, SPSS)

Loppukuulustelu

Tiistai 13.12.2011 klo 14–16 Exactum C323

Suoritustapa

Luentoja ja käytännön harjoituksia (yht. 35 t)

Aineopinnot: Loppukuulustelu (6 op) tai loppukuulustelu ja (vapaaehtoinen) harjoitustyö (8 op)

Syventävät opinnot: Loppukuulustelu ja (pakollinen) harjoitustyö (8 op)

Ilmoittautuminen

Kurssille ilmoittaudutaan [WebOodissa](#)



Harjoitustyö

- Aineopinnot
 - Vapaaehtoinen mutta suositeltava (2 op)

- Syventävät opinnot
 - Pakollinen (2 op)

- Työn palautus tammikuun 2012 loppuun mennessä



Kurssin soveltuvuus

- Kurssi soveltuu tilastotieteen aine- tai syventäviä opintoja suorittaville opiskelijoille ja tilastotieteen sivuaineopiskelijoille sekä myös yliopistoissa, korkeakouluissa ja tutkimuslaitoksissa toimiville jatko-opiskelijoille ja tutkijoille.
 - Kurssi on pakollinen tilastotieteen maisteriopintojen yhteiskuntatilastotieteen linjalla
- Kurssi mm. sisältyy valtiotieteellisen tiedekunnan [menetelmäkoriin](#)
- Soveltuvia jatkokursseja
 - Otanta-aineistojen analyysi, kevät 2012



Tavoitteet

- Kurssilla annetaan yleiskuva tilastollisista otantamenetelmistä ja niihin liittyvästä estimoinnista sekä menetelmien käytöstä eri tieteenalojen empiirisessä tutkimuksessa
- **Kurssin keskeinen teema on lisäinformaation käyttö otannassa ja estimoinnissa**
- Kurssi on luonteeltaan soveltava



Tavoitteet

- Otannan perusmenetelmät
 - yksinkertainen satunnaisotanta
 - systemaattinen otanta
- Lisäinformaation käyttö otanta-asetelmassa
 - PPS-otanta (*sampling with probability-proportional-to-size method*)
 - ositettu otanta
- SAS-proseduuri SURVEYSELECT
- SAS-proseduuri SURVEYMEANS



Tavoitteet

- Lisäinformaation käyttö estimointiasetelmassa
 - suhde-estimointi
 - regressioestimointi
 - yleistetty regressioestimointi (kalibrointi)

- SAS-proseduuri SURVEYREG



Tavoitteet

- Esimerkkejä otosperusteisista tiedonkeruista ja tutkimuksista
 - OECD:n Pisa-tutkimussarja
 - Terveys 2000, Terveys 2010
 - [Tilastokeskuksen työvoimatutkimus](#)
 - EU SILC - Statistics on Income and Living Conditions

- Otantaan ja estimointiin soveltuvat tilastolliset ohjelmistot
 - SAS - SURVEY-proseduurit
 - SPSS - Complex samples -moduli
 - Stata - svy-ohjelmat

Table 1.1 Real survey data sets used in examples and case studies.

Name of survey	Type of primary sampling unit PSU	Number of strata, clusters and elements in the survey data set		
		Strata	Clusters (PSU:s)	Elements
Census register data set				
(1) <i>Province'91</i> Population (data for one province)	Municipality	2	8 regional groups of municipalities	32 municipalities
Real survey data sets adjusted for pedagogical use				
(2) Mini-Finland Health Survey (data for males aged 30–64 years)	Municipality	24	48 municipalities	2699 persons
(3) Occupational Health Care Survey (data for establishments with 10 workers or more)	Industrial establishment	5	250 industrial establishments	7841 employees
Real survey data sets used in case studies				
(4) Passenger Transport Survey	Person	25	(Element-level sampling)	11711 persons
(5) Wages Survey	Business firm	25	744 firms	13987 employees
(6) Health Security Survey (data for one stratum)	Household	1	878 households	2071 persons
(7) PISA 2000 Survey (data for 7 countries)	School	7	1388 schools	32 101 pupils



Kirjallisuutta

- Lehtonen R. and Pahkinen E. (2004). *Practical Methods for Design and Analysis of Complex Surveys. Second Edition.* Chichester: John Wiley & Sons.
- Pahkinen E. ja Lehtonen R. (1989). *Otanta-asetelmat ja tilastollinen analyysi.* Helsinki: Gaudeamus.
- **Web extension:**
- VLISS-Virtual Laboratory in Survey Sampling
<http://mathstat.helsinki.fi/VLISS/>
- Laaksonen S. (2011). [Surveymetodiikka.](#)
Bookboon.com.



Kirjallisuutta

- Lehtonen R. and Djerf K. (2008). *Survey sampling reference guidelines*. Luxembourg: Eurostat Methodologies and Working papers
- Saatavilla vapaasti osoitteessa:
http://epp.eurostat.ec.europa.eu/cache/ITY_OFFPUB/KS-RA-08-003/EN/KS-RA-08-003-EN.PDF
- Lehtonen R. and Veijanen A. (2009). Design-based methods of estimation for domains and small areas. In: C. R. Rao and D. Pfeffermann (eds.), *Handbook of statistics, vol. 29(B). Sample surveys: theory, methods and inference*. Elsevier.



ISSN 1977-0375

eurostat
Methodologies and
Working papers

Survey sampling reference guidelines
Introduction to sample design and estimation techniques

2008 edition





Teemat

- Teema 1: Otannan perusmenetelmät ja lisäinformaation käyttö otantaasetelmassa
- Teema 2: Lisäinformaation käyttö estimointiasetelmassa: Malliavusteinen estimointi
- Teema 3: Erityiskysymyksiä
- Teema 4: Tilastolliset ohjelmistot



Teema 1

OTANNAN PERUSMENETELMÄT JA LISÄINFORMAATION KÄYTTÖ OTANTA-ASETELMASSA

: Empiirinen kvantitatiivinen tutkimusprosessi - Survey-prosessi

Survey = Empiiris-kvantitatiivinen (yhteiskunta)tutkimus

■ Survey-hankkeen vaiheet:

- I Suunnittelu ja testaus
- II Tiedonkeruuoperaatiot
- III Tilastollinen analyysi
- IV Raportointi ja jälkihoito

■ Vaiheet osavaiheineen:

- I Suunnittelu ja testaus
 - 1. Tutkimusongelman muotoilu
 - 2. Tutkimusasetelman laadinta
 - 3. **Otanta-asetelman laadinta**
 - 4. Tiedonkeruuvälineiden valmistus
 - 5. Testaus laboratorio-oloissa ja pilotointi kentällä

II Tiedonkeruuoperaatiot

- 6. **Otoksen poiminta**
- 7. Tiedonkeruu
- 8. Tiedostonmuodostus

III Tilastollinen analyysi

- 9. **Eksplorointi ja kuvailu**
- 10. **Analyysi ja tulkinta**

IV Raportointi ja jälkihoito

- 11. Julkaisut ja artikkelit
- 12. Opinnäytetyöt
- 13. Esitelmät
- 14. Sähköiset tuotteet
- 15. Dokumentointi ja arkistointi



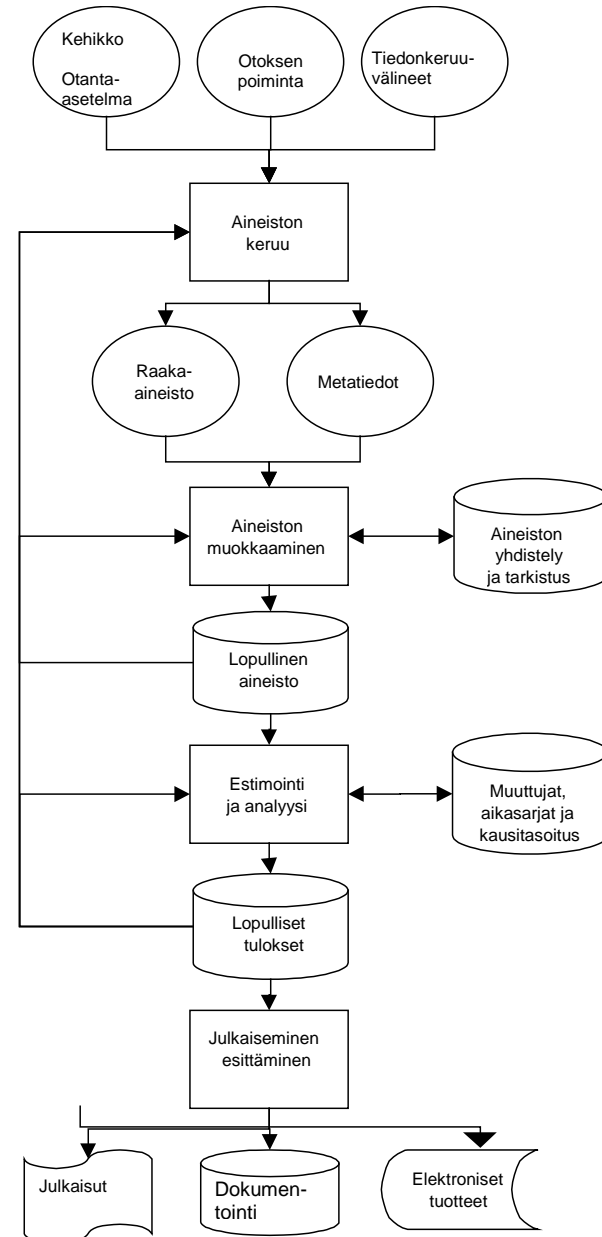
Survey-prosessi

■ Kaavio 1. Survey-hankkeen operationaaliset vaiheet.

- Muokattu lähteestä: Sundgren B. 1999. Information systems architecture for national and international statistical offices. Guidelines and recommendations. Geneva: United Nations, Statistical Standards and Studies 51. (Tilastokeskus, Laatukäsikirja)

■ Kaavio 2.

- Lehtonen R. and Pahkinen E. (2004). *Practical methods for Design and Analysis of Complex Surveys. Second Edition.* Chichester: John Wiley & Sons.



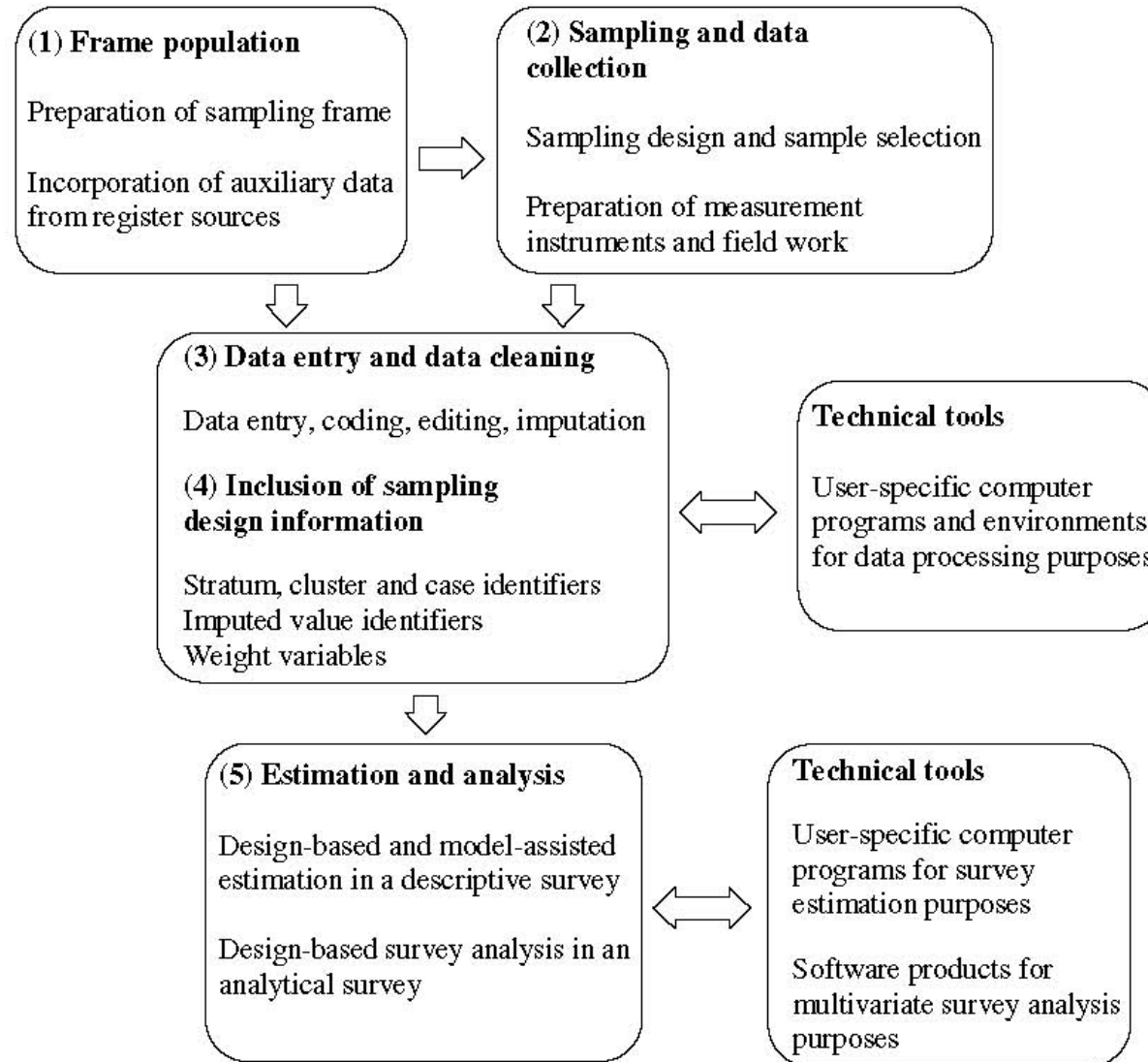


Figure 1.1 Flow chart for design-based estimation and analysis of complex survey data.

HY Otantamenetelmät syksy 2011 Risto Lehtonen

YHTEENVETO 1. Aineisto-otiot tiedonkeruun tavan ja kattavuuden mukaan.

TIEDONKERUUTAPA	KATTAVUUS PERUSJOUKON SUHTEEN	
	A. OSITTAINEN KATTAVUUS: OTOSTUTKIMUS	B. TÄYSI KATTAVUUS: KOKONAISTUTKIMUS
1. SUORA TIEDONKERUU Tietolähde Haastattelututkimus Tietokoneavusteinen käyntihaastattelu <i>Computer Assisted Personal Interview</i> CAPI Tietokoneavusteinen puhelinhaastattelu <i>Computer Assisted Telephone Interview</i> CATI Tietokoneavusteinen kysely <i>Computer Assisted Self-interview</i> CASI <i>Computer Assisted Web Survey</i> CAWI Tiedonkeruu kynä- ja paperi -menetelmällä <i>Paper-and-Pencil Interview</i> PAPI Postikysely Internet-kysely, Web-kysely, eSurvey	Optio 1a. Suoraan tiedonkeruuseen perustuva otostutkimus Perinteinen otostutkimuksen tyyppi Tilastokeskuksen tutkimuksia ja tilastoja <input type="checkbox"/> Työvoimatutkimus <input type="checkbox"/> Kulutusutkimus Kelan tutkimuksia ja selvityksiä <input type="checkbox"/> Terveysturvan väestötutkimukset Monikansallisia tutkimuksia <input type="checkbox"/> European Social Survey ESS <input type="checkbox"/> PISA	Optio 1b. Suoraan tiedonkeruuseen perustuva kokonaistutkimus Perinteinen kokonaistutkimuksen tyyppi <input type="checkbox"/> Tilastokeskuksen väestölaskennat (vuoteen 1985 saakka)
2. EPÄSUORA TIEDONKERUU Tietolähde: Rekisteri Kattaa kohdeperusjoukon Päivitetään säännöllisesti Hallinnollinen rekisteri Hallinnollisen proseduurin oheistuote Tilastorekisteri Usean hallinnollisen rekisterin yhdistelmä	Optio 2a. Hallinnolliseen rekisteriaineistoon perustuva otostutkimus Puhtaana muotona harvinainen <input type="checkbox"/> Poikkeuksena Tilastokeskuksesta saatavat tilastorekistereiden otosaineistot	Optio 2b. Hallinnolliseen rekisteriin tai tilastorekisteriin perustuva kokonaistutkimus Tämä surveyn tyyppi on yleistymässä Aineistolähteet <input type="checkbox"/> Rekisteriperusteiset väestölaskennat <input type="checkbox"/> Sosiaalivakuutuksen rekisterit <input type="checkbox"/> Väestörekisteri <input type="checkbox"/> Yritysrekisteri <input type="checkbox"/> Verotusrekisterit <input type="checkbox"/> Kelan lääketutkimukset
3. TIEDONKERUUTAPOJEN YHDISTELMÄ Tietolähde: Suoran ja epäsuoran tiedonkeruun yhdistelmä	Optio 3. Otostutkimus, joka perustuu suoran tiedonkeruun ja rekisteriaineiston yhdistelyyn Tämä surveyn tyyppi on yleistymässä <input type="checkbox"/> KTL:n Terveys 2000 ja Terveys 2010 <input type="checkbox"/> Kelan Mini-Suomi-terveystutkimus <input type="checkbox"/> Tilastokeskuksen Tulonjakotutkimus <input type="checkbox"/> EU:n European Community Household Panel ECHP <input type="checkbox"/> EU SILC (Statistics on Income and Living Conditions)	



Tiedonkeruumenetelmiä

- Tyypillisiä tiedonkeruumenetelmiä
Mode of data collection
 - PAPI
 - *Paper-and-pencil*
 - Paperilomake

 - CAPI
 - *Computer assisted personal interview*
 - Tietokoneavusteinen käyntihaastattely

 - CATI
 - *Computer assisted telephone survey*
 - Tietokoneavusteinen puhelinhaastattelu



Nettikysely

- web-CASI
 - *internet-based computer assisted self-interviewing*
 - Itsevalikoituva web-kysely *Self-selection web survey*
 - *Computer Assisted Web Survey CAWI*
 - Internet-kysely, nettikysely
-
- tai jokin yllä listattujen yhdistelmä (*mixed-mode survey*)



Nuoria työttömiä koskeva nettikysely mediassa 2009

- "Työttömyys hävettää entistä harvempia nuoria"
 - julkaistu ma 31.8.2009 klo 05:56
 - YLE Uutiset
- "Monet nuoret työttömät suhtautuvat työttömyyteensä myönteisesti. Uuden tutkimuksen mukaan yli 40 prosenttia työttömistä nuorista ei pidä työttömyyttä pahana asiana, jos toimeentulo on muuten turvattu."
- (prekariaatti)



Nuoria työttömiä koskeva nettikysely

- Ministry of Labour, työministeriö
 - Toukokuu 2009
 - $n = 716$ nuorta työtöntä (16-29 v.)
 - Web-lomake on ollut MOL:n sivustolla
- Nuori työtön on löytänyt lomakkeen työtä tai työvoimatoimenpiteitä koskevaa tietoa etsiessään
- "Oletko nuori aikuinen, joka on ollut joskus työttömänä tai olet par- aikaa työtön...- jos , niin vastaa..."



Nettikysely... ja vaihtoehdot?

- Millaisia yleistyksiä nettikyselyn perusteella voidaan tehdä?
 - *How accurate are self-selection web surveys?*
Jelke Bethlehem, Statistics Netherlands,
[Discussion paper](#) (08014)

<http://www.cbs.nl/NR/rdonlyres/EEC0E15B-76B0-4698-9B26-8FA04D2B3270/0/200814x10pub.pdf>

- Millaisia vaihtoehtoja nettikyselylle voisi olla?



Kuvaileva ja analyttinen survey

HY Otantamenetelmät syksy 2011

YHTEENVETO 2 KUVAILEVA JA ANALYTTINEN SURVEY

	KUVAILEVA	ANALYTTINEN	
Tulosmuuttajat	Muutamia	Useita	
Yleistystaso	Kiinteä perusjoukko	"Superpopulaatio"	
Estimoitavat parametrit	Kuvailevia, esim. totaalit, keskiarvot	Analyttisiä, esim. regressiokertoimet	
Estimaattori-tyypit	Lineaarisia, esim. totaalin HT-estimaattori	Epälineaarisia, esim. regressiokertoimen PNS-estimaatto ri	
Varianssien estimointi	Analyttisesti	Approksimatiivisesti	
Ulkoisen lisäinfon käyttö analyysissä	Tärkeää	Vähemmän tärkeää	
Malliavusteinen estimointi	Käytetään paljon	Ei juurikaan käytetä	
Monimuuttuja-analyysi	Ei käytetä	Käytetään	paljon
Tilastollinen testaus	Ei käytetä	Käytetään	paljon
Painojen skaalaus	Perusjoukon taso (N)	Otostaso (n)	
Tilastolliset ohjelmistot	SAS, GES, CLAN, SPSS, SUDAAN	SAS, SPSS, SUDAAN, Stata, MLwiN	

Risto Lehtonen 2011



Lisätieto – auxiliary information

- Yleensä perusjoukon alkioista on käytettävissä **otoksen ulkopuolista lisätietoa** apumuuttujien muodossa
- Lisätietoa saadaan eri rekisterilähteistä
 - tilastorekisterit, hallinnolliset rekisterit, viralliset tilastot
- Apumuuttujat yhdistetään otosaineistoon **identifikaatiomuuttujien** avulla
 - henkilötunnus, yritystunnus, kuntanumero jne.



Lisätieto – auxiliary information

- Apumuuttujatieto voi olla saatavilla myös perusjoukon kokonaismäärätietoina
- Jotta lisätiedon käytöstä on hyötyä estimoinnissa, tulee apumuuttujien korreloida tutkittavien tulosmuuttujien kanssa
 - Hyötykriteeri: Estimoinnin tehostuminen eli estimaattorin varianssin ja keskivirheen pieneneminen



Lisätiedon kaksi käyttötapaa

A. Lisätiedon käyttö otanta-asetelmassa

- Tavoitteena tehokkaan otanta-asetelman konstruointi
 - mahdollisimman pienet keskivirheet
 - Ositettu otanta (*Stratified sampling* STR)
 - PPS-otanta
 - poiminta otosyksikön kokoon suhteutetuin todennäköisyyksin; *Probability Proportional to Size*

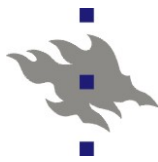
- SAS Procedure SURVEYSELECT



Lisätiedon kaksi käyttötapaa

B. Lisätiedon käyttö estimointiasetelmassa

- Tavoitteena estimoinnin tehostaminen poimitulle otokselle
 - keskivirheiden pienentäminen käytetyn otanta-asetelman puitteissa
 - Regressioestimointi
 - Suhde-estimointi
 - Kalibrointimenetelmät
 - Jälkiosittaminen...
- SAS Procedure SURVEYMEANS
- SAS Procedure SURVEYREG



Strategia

- Otanta-asetelman ja estimointiasetelman yhdistelmä
- Lisäinformaation sisällyttäminen
 - Otanta-asetelmaan
 - Estimointiasetelmaan
 - Otanta-asetelmaan ja estimointiasetelmaan
- Tilastollisen mallin käyttö estimointiasetelmassa



Esimerkkejä strategioista

- Yksinkertainen satunnaisotanta SRS
 - Ei lisäinfoa, ei tilastollista mallia
- PPS-otanta
 - Lisäinformaatio otanta-asetelmassa
 - Perusjoukon alkion kokotieto
 - Ei tilastollista mallia
- SRS ja regressioestimointi
 - Ei lisäinfoa otannassa
 - Lisäinfo estimoinnissa: Jatkuva apumuuttuja
 - Tilastollinen malli: Regressiomalli



Estimointistrategioita perusjoukon kokonaismäärälle

Strategia

Lisäinformaatio

Avustava malli

Asetelmaperusteinen strategia

SRSWOR
SRSWR
PPSWOR

Ei käytetä
Ei käytetä
Kokotieto

Ei ole
Ei ole
Ei ole

Malliavusteinen strategia

Jälkiositus

SRS*pos

Diskreetti

ANOVA

Suhde-estimointi

SRS*rat

Jatkuva

Regressiomalli
(ei vakiotermejä)

Regressioestimointi

SRS*reg

Jatkuva

Regressiomalli



Otanta-asetelma *sampling design*

- Niiden sääntöjen ja menetelmien kokonaisuus, jolla **otos** poimitaan määritellystä **perusjoukosta**
 - Tavoiteperusjoukko
 - Kohdeperusjoukko
 - Kehikkoperusjoukko
 - Ylipeitto
 - Alipeitto



Otanta-asetelma

- N alkion perusjoukko
- Jokaisella perusjoukon alkiolla k on tunnettu, nolaa suurempi todennäköisyys π_k tulla mukaan n alkion otokseen

$$0 < \pi_k \leq 1$$

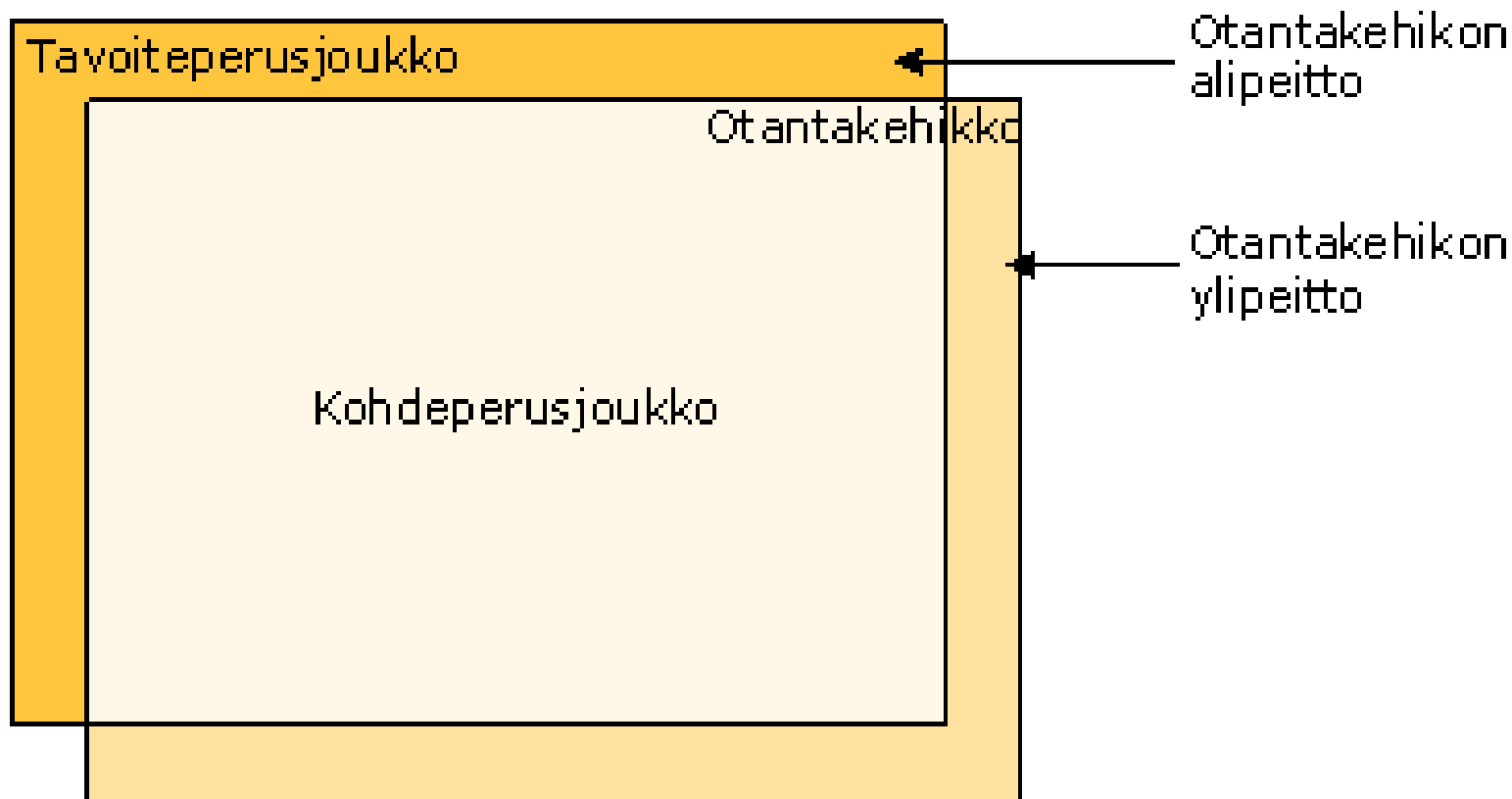
perusjoukon alkiolle k ,

$$k = 1, \dots, N$$

missä N on perusjoukon alkioiden lukumäärä

Otantakehikon alipeitto ja ylipeitto

Tilastokeskus: Laatusa tilastoissa -käsikirja



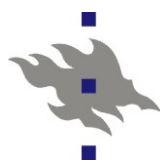


Otos Sample

- Perusjoukon osajoukko
- Poimitaan jollain satunnaisotannan menetelmällä
(*Random sampling, Probability sampling*)
- Poiminnassa käytetään sisältymistodennäköisyyksiä
(*Inclusion probability*)
- Miksi satunnaisotanta?
 - Otoksesta saatavat tulokset voidaan yleistää koskemaan koko kiinnostuksen kohteena olevaa perusjoukkoa tai hypoteettista mallia
 - Tilastollinen päättely
 - Piste-estimaatit
 - Kesquivirheet
 - Luottamusvälit
 - Tilastollinen testaus

Huomioita sisältymistodennäköisyydestä

- Nollaa suurempi
- Voi olla = 1
 - Milloin?
- Voi olla yhtäsuuri kaikille alkioille
- Voi vaihdella
 - Alkioryhmittäin
 - Ositettu otanta
 - Alkioittain
 - PPS-otanta (otanta alkion kokoon suhteutetuin todennäköisyyksin)
- Sis.todennäköisyyttä käytetään painokertoimien muodostamisessa
- **Asetelmapaino** (*design weight*)
 - Totaalien estimointi
- **Analyysipaino** (*analysis weight*)
 - Muut analyysitilanteet
- **Uudelleenpainotus**
 - Vastauskadon korjausta varten
 - Voidaan soveltaa sekä asetelmapainoon että analyysipainoon



Huomioita asetelmapainosta

Asetelmapaino: $w_k = 1/\pi_k$ otosalkiolle k ,
 $k = 1, \dots, n$, missä n on otoskoko

Asetelmapainolle pätee $\sum_{k=1}^n w_k = N$

Asetelmapainoja tarvitaan kun estimoidaan kokonaismääriä (esim. työttömien kokonaismäärä)

HUOM: Muissa tilanteissa kannattaa käyttää analyysipainoa

Taulukko

- Province91-
perusjoukko
- $N = 32$ kuntaa
- Tulosmuuttuja
 - UE91
- Apumuuttujat
 - STR osite
 - Kuntamuoto
 - HOU85
 - Kotitalouksien
lkm

- Lähde: Lehtonen R. and Pahkinen E. (2004). Practical Methods for Design and Analysis of Complex Surveys. Second Edition. Wiley.

Table 2.1 The Province'91 population. Percentage unemployment (%UE) and totals of unemployed persons (UE91), labour force (LAB91), population in 1991 (POP91) and number of households (HOU85) by municipality in the province of Central Finland in 1985.

ID	LABEL	STR	CLU	%UE	UE91	LAB91	POP91	HOU85
Urban				12.67	8022	63 314	129 460	49 842
1	Jyväskylä	1	1	12.20	4123	33786	67 200	26 881
2	Jämsä	1	2	11.07	666	6016	12907	4663
3	Jämsänkoski	1	2	13.83	528	3818	8118	3019
4	Keuruu	1	2	12.84	760	5919	12707	4896
5	Saarijärvi	1	3	14.62	721	4930	10774	3730
6	Suolahti	1	5	15.12	457	3022	6159	2389
7	Äänekoski	1	3	13.17	767	5823	11 595	4264
Rural				12.63	7076	56 011	125 124	41 911
8	Hankasalmi	2	5	15.07	391	2594	6080	2179
9	Joutsa	2	6	9.38	194	2069	4594	1823
10	Jyväskylän mk.	2	7	11.82	1623	13727	29 349	9230
11	Kannonkoski	2	4	18.64	153	821	1919	726
12	Karstula	2	4	13.53	341	2521	5594	1868
13	Kinnula	2	8	13.92	129	927	2324	675
14	Kivijärvi	2	8	15.63	128	819	1972	634
15	Konginkangas	2	3	21.04	142	675	1636	556
16	Konnevesi	2	5	12.91	201	1557	3453	1215
17	Korpilahti	2	1	11.15	239	2144	5181	1793
18	Kuhmoinen	2	2	12.91	187	1448	3357	1463
19	Kyyjärvi	2	4	11.31	94	831	1977	672
20	Laukaa	2	5	12.11	874	7218	16 042	4952
21	Leivonmäki	2	6	10.65	61	573	1370	545
22	Luhanka	2	6	10.34	54	522	1153	435
23	Multia	2	7	11.24	119	1059	2375	925
24	Muurame	2	1	9.79	296	3024	6830	1853
25	Petäjävesi	2	7	15.08	262	1737	3800	1352
26	Pihlajavesi	2	8	13.02	331	2543	5654	1946
27	Pylkönmäki	2	4	17.98	98	545	1266	473
28	Summatinen	2	3	12.80	79	617	1426	485
29	Säynätsalo	2	1	10.28	166	1615	3628	1226
30	Toivakka	2	6	11.72	127	1084	2499	834
31	Uurainen	2	7	16.47	219	1330	3004	932
32	Vitasaari	2	8	14.16	568	4011	8641	3119
Whole province				12.65	15 098	119 325	254 584	91 753

Sources: Statistics Finland: Population Census 1985. Statistics Finland (1992): Statistical Yearbook of Finland, Volume 87. Ministry of Labour of Finland (1991): Employment Service Statistics, November 30, 1991.



Esimerkki: Yksinkertainen satunnaisotanta SRS

SRS-otanta, $n = 8$ otosalkiota

Perusjoukossa $N = 32$ kuntaa

Sisältymistn $\pi_k = \pi = 8 / 32 = 0.25$

Asetelmapaino $w_k = 1 / \pi_k = 1 / 0.25 = 4$

$$\sum_{k=1}^8 w_k = N = 32$$

TRAINING KEY 28 [Analysing an SRS sample](#)



VLISS-Virtual Laboratory in Survey Sampling

- Province'91 perusjoukko (*population*)

(entinen K-S lääni)

- Tilastoyksikkönä (alkiona) kunta

- $N = 32$ kuntaa

- Tulosuuttuja UE91: Työttömien lkm läänissä

- **VLISS-toteutus**

Chapter 2. Basic sampling techniques

2.1 Basic definitions [2.2 The Province '91 population](#)

2.3. Simple Random Sampling and design effect

TRAINING KEY 28 [Analysing an SRS sample](#)

- www.math.helsinki.fi/VLISS/



Analyysipaino

■ Analyysipainon (*analysis weight*) laadinta

Tehdään uudelleenskaalattu painokerroin

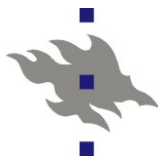
$$w_k^* = (n/N)w_k$$

missä n on otoskoko ja N on perusjoukon koko

Analyysipainoille pätee $\sum_{k=1}^n w_k^* = n$ (otoskoko)

joten analyysipainojen keskiarvo = 1

HUOM: SRS-otokselle analyysipaino = 1



Uudelleenpainotus *Reweighting*

- Asetelma- ja analyysipainojen konstruoinnin lisäksi usein tarvitaan painojen muokkausta kadon (*nonresponse*) vaikutusten oikaisemiseksi
 - Uudelleenpainotus
 - Estimoidaan ensin vastaustodennäköisyys (*response probability*)
 - Aineiston osajoukoissa tai
 - Alkioittain
 - Korjataan analyysipainoja estimoitujen vastaustodennäköisyyksien avulla
 - Esimerkki: [Terveys 2000 -tutkimus](#)



Esimerkki: Health 2000 – Weighting procedures

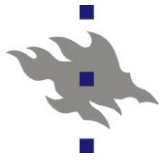
Sampling weight $w_{hik} = 1/\pi_{hik}$ where π_{hik} denotes the inclusion probability of person k in cluster i of stratum h in the population.

WARNING: The sum of the sampling weights over the sample data set is equal to the size of the population N . That weight should not be used as a weight variable in the analysis!

Analysis weight $w_{hik}^* = \frac{n}{N} \times \frac{1}{\pi_{hik} \hat{\theta}_{hik}}$ where $\hat{\theta}_{hik}$ denotes the

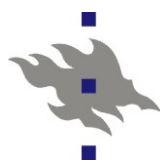
estimated response probability of sample person k in cluster i of stratum h .

NOTE: The sum of analysis weights over the sample data set is equal to the size n of the sample data set. Can be used in the analysis.



Vastauskadon hallinta (1)

- Tiedonkeruun eri vaiheissa havaintojen määrä usein pienenee erilaisista syistä.
- Perinteisesti **vastauskatoa** (*non-response*) esiintyy vapaaehtoisuuteen perustuvissa kysely- ja haastattelututkimuksissa.
- Vastauskato rekisteriaineistoissa?
- Vastauskato nettikyselyissä?
- Vastauskato jaetaan kahteen pääryhmään:
 - **eräkatoon** (*item non-response*) ja
 - **yksikkökattoon** (*unit non-response*).
- **Eräkadolla** tarkoitetaan sellaista vastausta, jossa tutkimusyksikkö antaa vain osan tiedoista hyväksyttävästi tai antaa sellaisen vastauksen, joka myöhemmissä aineiston tarkistuksissa joudutaan hylkäämään.



Vastauskadon hallinta (2)

- **Yksikkökadon** tapauksessa kaikki havaintoyksikköä koskevat tutkimustiedot puuttuvat tai joudutaan hylkäämään.
- Kadolla on vaikutusta tutkimuksen tuloksiin.
 - Tutkimusjoukon pienenemisellä tavoitteeseen eli perusjoukkoon nähden on useimmiten harmillisia vaikutuksia.
- Mikäli vastanneet ja kato ovat sekä tausta- että tutkimusmuuttujien suhteen samoin jakautuneita, otosvarianssi suurenee kadon vaikutuksesta.
- Myös kokonaistutkimukseen syntyy otosvarianssia tällä tavoin.
- Useimmiten vastaajat ja katoon jääneet yksiköt poikkeavat toisistaan, mikä aiheuttaa tutkimuksen tuloksiin virhettä, pahimmassa tapauksessa harhaa.



Vastauskadon hallinta (3)

■ Yksikkökato

Unit nonresponse

- Uudelleenpainotusmenetelmät
 - RHG-menetelmä
Response homogeneity groups
- Mallinnusmenetelmät
 - Logistinen katomalli
 - Terveys 2000
- **Katoanalyysi ja katoon reagointi ovat empiirisen tutkimuksen tärkeitä työvaiheita**

■ Eräkato

Item nonresponse

- Imputointimenetelmät
 - Hot deck
 - Lähimmän naapurin menetelmä
Nearest neighbour method
 - Moni-imputointi
Multiple imputation
- **Imputointimenetelmien käyttö on yleistymässä eri tieteenaloilla ja sovelluksissa**



Otanta-asetelman laadintavaiheet

A. Perusjoukkojen määrittely

- Alkiotason perusjoukko
- Ryvästason perusjoukko

B. Otanta-asteiden määrittely

- Alkiotason otanta
- Ryväsootanta
 - Yksiasteinen otanta
 - Kaksiasteinen otanta
 - Moniasteinen otanta

C. Otantamenetelmien kiinnittäminen eri otanta-asteille

- Osittaminen
- Otoksen kiintiöinti
- Alkioiden poimintamenetelmän valinta kullakin otanta-asteella ja ositteessa



Alkiotason otanta ja ryväsotanta

(1) Alkiotason otanta

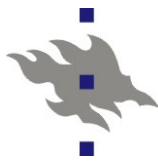
(*element sampling*)

- Otantayksikkönä on perusjoukon alkiio (esim. henkilö).
- Otos poimitaan valitulla otantamenetelmällä suoraan perusjoukon alkioiden muodostamasta kehikkoperusjoukosta
 - Väestörekisteri, toimipaikkarekisteri jne.

(2) Ryväsotanta

(*cluster sampling*)

- Otantayksikkönä on perusjoukon alkioiden muodostama luonnollinen ryhmä eli **ryväs** (*cluster*)
- Esim:
 - Kunta, terveyskeskuspiiri
 - Terveys 2000
 - Koulu, opetusryhmä
 - PISA
- **Esimerkkejä ryväyksiköistä omalta toiminta-alueeltasi?**



Otanta-asetelma voi olla...

■ Yksinkertainen

- Systemaattinen otanta
 - Poiminta suoraan alkiotason kehikkoperusjoukosta
- Ositettu systemaattinen otanta
 - Alkioiden ositus ja kiintiöinti
 - Systemaattinen otanta kustakin ositteesta

■ Mutkikas

(*Complex survey*)

- Ositettu kaksiasteinen otanta
 - Rypäiden poiminta ryvästason perusjoukosta PPS-otannalla
 - Alkioiden poiminta otosrypäistä systemaattisella otannalla



Ryväsotannan motivaatio

- Tiedonkeruumenetelmän kannalta voi olla edullista käyttää ryväsotantaa
 - Käyntihaastattelut
 - Rypäänä kotitalous
 - Kliiniset menetelmät
 - Rypäänä terveyskeskus
- Kehikkoperusjoukon huono saatavuus voi edellyttää ryväsotantaa
 - Koulusaavutus-tutkimukset
 - Pisa
- Tutkimusasetelma voi edellyttää ryväsotantaa
 - Terveys 2000



Tiivistelmä: Otantamenetelmät I

Otantamenetelmä

Poimintatapa

SRS

Simple random sampling

Yksinkertainen satunnaisotanta

Otos poimitaan perusjoukosta satunnaislukujen avulla

SYS

Systematic sampling

Systemaattinen otanta

Otos poimitaan tasavälisesti listasta tai rekisterinä olevasta tietokannasta

STR

Stratified sampling

Ositettu otanta

Perusjoukon alkiot jaetaan ensin homogeenisiin ositteisiin. Kustakin ositteesta poimitaan SRS tai SYS otos



Tiivistelmä: Otantamenetelmät II

Otantamenetelmä

Poimintatapa

CLU

Cluster sampling

Ryväsotanta

Perusjoukon alkiot muodostavat luonnollisia osajoukkoja eli rypäitä

- Yksiasteinen
one-stage

1) Rypäiden perusjoukosta poimitaan otosrypäät
2) Kaikki otosrypäiden alkiot tulevat alkiotason otokseen

- Kaksiasteinen
two-stage

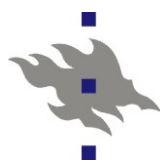
1) Rypäiden perusjoukosta poimitaan otosrypäät
2) Otosrypäiden alkiosta poimitaan alkiotason otokset SRS:llä tai SYS:llä

PPS

Selection with Probabilities

Proportional to Size

Sisällymismetodennäköisyys on suhteessa alkion kokoon



Tiivistelmä: Otantamenetelmät III

	SRS	SYS	STR	CLU	STR- CLU	PPS
Sisältymis- todennäköi- syys(*)	Vakio n/N	Vakio n/N	Voi vaih- della(**)	Voi vaih- della	Voi vaih- della	Voi vaih- della
Lisä- informaatio	Ei tarvita	Ei tarvita (***)	Osite- indi- kaattori	Ryväs- indi- kaattori	Osite- ja ryväs- indik.	Koko- tieto

(*) Sisältymistodennäköisyys = todennäköisyys sille, että N alkion perusjoukkoon kuuluva alkiio sisältyy otokseen, jonka koko on n alkiota

(**) Sisältymistodennäköisyys voi vaihdella alkiorryhmittäin (ositettu otanta) tai alkiioittain (PPS-otanta)

(***) SYS: Voidaan käyttää (implisiittinen osittaminen lajittelemalla perusjoukko ennen poimintaa)



Tekninen yhteenveto I

- Peruskäsitteet
- Ks. Tekninen yhteenveto I
 - sivut 1-2
- Otantajakaumien simulointi

http://onlinestatbook.com/stat_sim/sampling_dist/index.html



Otannan perusmenetelmät

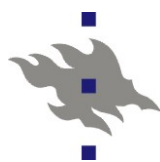
- Yksinkertainen satunnaisotanta
SRS - *Simple random sampling*
- Bernoulli-otanta BER
- Systemaattinen otanta
SYS - *Systematic sampling*
- Ei käytetä lisäinfoa
- Sisältymistn on sama kaikille pj:n alkioille



Yksinkertainen satunnaisotanta SRS

Simple random sampling

- Kunkin perusjoukon alkion otokseen sisällymistodennäköisyys on vakio n/N missä n on otoskoko ja N on perusjoukon alkioden lukumäärä
- Tekninen toteutus esimerkiksi satunnaislukujen avulla
- Erikoistapaukset:
 - SRSWOR
 - SRS **palauttamatta** (*without replacement*)
 - SRSWR
 - SRS **palauttaen** (*with replacement*)
- SAS Procedure SURVEYSELECT **Syntax**



Yksinkertainen satunnaisotanta

Perusjoukko: N alkiota

Perusjoukon tuntemattomat arvot $Y_1, Y_2, \dots, Y_k, \dots, Y_N$

Parametrit $T = \sum_{k=1}^N Y_k$ kokonaismäärä

$$\bar{Y} = \sum_{k=1}^N Y_k / N \text{ keskiarvo}$$

Perusjoukon alkion k sisällymistodennäköisyys π_k

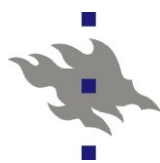
Otos: n alkiota

Otoksesta mitatut arvot $y_1, y_2, \dots, y_k, \dots, y_n$

Otosalkion k asetelmapaino w_k

Kokonaismäärän estimaattori \hat{t}

Keskiarvon estimaattori \bar{y}



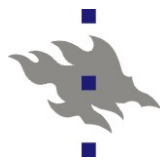
Perusjoukon *Population91* parametrit

UE91 totaali:

$$T = \sum_{k=1}^N Y_k = 15098$$

UE91 keskiarvo:

$$\bar{Y} = \sum_{k=1}^N Y_k / N = 15098 / 32 = 472$$



Yksinkertainen satunnaisotanta

Sisältymistodennäköisyys $\pi_k = n / N$ on vakio

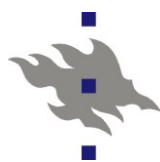
Kokonaismäärän eli totaalin $T = \sum_{k=1}^N Y_k$ estimaattori

$$\hat{t} = N\bar{y} = N \sum_{k=1}^n y_k / n$$

missä $\bar{y} = \sum_{k=1}^n y_k / n$ on **otoskeskiarvo**

$$\hat{t} = \sum_{k=1}^n w_k y_k = \sum_{k=1}^n \frac{1}{\pi_k} y_k = \frac{N}{n} \sum_{k=1}^n y_k \quad \text{ja} \quad \bar{y} = \hat{t} / N$$

missä $w_k = N/n$ on asetelmapaino



Yksinkertainen satunnaisotanta

Totaalin varianssiestimaattori ja keskivirhe (SRSWOR)

$$\hat{v}_{SRS}(\hat{t}) = N^2 \left(1 - \frac{n}{N}\right) \left(\frac{1}{n}\right) \sum_{k=1}^n (y_k - \bar{y})^2 / (n-1) = N^2 \left(1 - \frac{n}{N}\right) \left(\frac{1}{n}\right) \hat{s}^2$$

$\text{s.e}_{SRS}(\hat{t}) = \sqrt{\hat{v}_{SRS}(\hat{t})}$ on keskivirhe (*standard error s.e*)

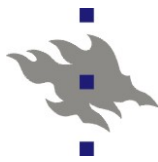
missä $\bar{y} = \sum_{k=1}^n y_k / n$ on otoskeskiarvo

$\hat{s}^2 = \sum_{k=1}^n (y_k - \bar{y})^2 / (n-1)$ on otosvariassi

$\left(1 - \frac{n}{N}\right)$ on äärellisyyskorjaus (fpc, *finite population correction*)

Keskiarvon varianssiestimaattori ja keskivirhe

$$\hat{v}_{SRS}(\bar{y}) = \left(1 - \frac{n}{N}\right) \left(\frac{1}{n}\right) \hat{s}^2 \quad \text{ja} \quad \text{s.e}_{SRS}(\bar{y}) = \sqrt{\hat{v}_{SRS}(\bar{y})}$$



SRSWOR-otanta perusjoukosta Population91

UE91 totaalin T estimaatti, varianssiestimaatti
ja 95 % luottamusväli:

$$\hat{t} = \sum_{k=1}^n w_k y_k = \sum_{k=1}^n \frac{1}{\pi_k} y_k = \frac{N}{n} \sum_{k=1}^n y_k = \frac{32}{8} \sum_{k=1}^8 y_k = 26440$$

$$\hat{v}_{SRS}(\hat{t}) = N^2 \left(1 - \frac{n}{N}\right) \left(\frac{1}{n}\right) \sum_{k=1}^n (y_k - \bar{y})^2 / (n-1)$$

$$= 32^2 \left(1 - \frac{8}{32}\right) \left(\frac{1}{8}\right) \hat{s}^2 = 13282^2$$

95 % LV: -4967 -- 57847 Käyttökelvoton tulos!



Tekninen yhteenveto I

- SRSWOR ja SRSWR
- Ks. Tekninen yhteenveto I
 - sivu 3
- SAS-laskenta
- Ks. VLISS
- [Training Key 28](#)
 - Analysing an SRS sample



Bernoulli-otanta

- Katso [Survey sampling reference manual](#) (Lehtonen and Djerf 2008)
 - Sivu 17
 - Appendix 1
 - Vähän muokattu tätä esitystä varten



Bernoulli-otanta

- **Example.** *Bernoulli sampling* provides an example of an SRS-WOR type sampling scheme. In this method, the sample size is not fixed in advance but is a random variate whose expectation is n , the desired sample size. This property leads to a variation in the sample size with the expected value $N\pi$ and variance $N(1 - \pi)\pi$, where π stands for the inclusion probability. The randomness in the sample size is relatively unimportant in large samples.



Bernoulli-otanta

- Let us briefly introduce the technique. To carry out Bernoulli sampling, we need to carry out the following steps:
- Step 1. Fix the value of the inclusion probability π , where $0 < \pi < 1$, so that the expected sample size will be $N\pi$, the product of the population size and the inclusion probability. If the desired sample size is n , then $\pi = n/N$.



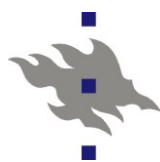
Bernoulli-otanta

- Step 2. Append three variables, let say PI, IND and UNI, to the sampling frame data set. PI is set equal to the chosen value of π , and IND is set to zero, for all N population elements. For UNI, a value from a uniform distribution over the range $(0, 1)$ is drawn independently for each population element, starting from the first element. A pseudo random number generator can be used in generating the random numbers.



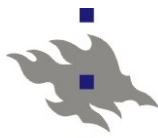
Bernoulli-otanta

- Step 3. The decision rule for inclusion of a population element in the sample is the following. The k th population element is included in the sample if $UNI \leq PI$, and correspondingly, we set $IND = 1$ for the selected element (otherwise, the value of IND remains zero).



Bernoulli-otanta

- Step 4. Treat all population elements sequentially by using Step 3.
- When Steps 1 to 4 are completed, the sum of IND over the sampling frame appears to be close (or, equal) to the desired sample size n . The elements having $IND = 1$ constitute the Bernoulli sample. The procedure can be easily programmed for example with Excel, SAS or SPSS.
 - Appendix 1. contains a short example of Bernoulli sampling.



Bernoulli-otanta HUOM

- **Appendix 1.** Example of sample selection using Bernoulli sampling
- We create a sampling frame consisting 2000 elements and want to select about 200 units to the sample.
- Sampling fraction $PI = 200/2000 = 0.1$.
- All elements in the frame are assigned a pseudo random number from Uniform distribution, UNI.
- Those elements with $UNI \leq 0.1$ are selected and selection indicator IND is given value 1.
- If the unit was not selected, IND is set 0.



Bernoulli-otanta – SAS-koodi

```
data Bernoulli;  
PI=200/2000;  
do i=1 to 2000;  
    UNI=Ranuni(0);  
    if UNI le PI then IND=1;  
    else IND=0;  
    output;  
end;  
proc print data=Bernoulli;  
sum IND;  
run;
```

SAS-toteutus



I	PI	UNI	IND
1	0.1	0.83976	0
2	0.1	0.50375	0
3	0.1	0.08013	1
4	0.1	0.87756	0
5	0.1	0.13501	0
6	0.1	0.41416	0
7	0.1	0.10639	0
8	0.1	0.28283	0
9	0.1	0.16496	0
10	0.1	0.88332	0
...			
1991	0.1	0.67351	0
1992	0.1	0.11558	0
1993	0.1	0.78235	0
1994	0.1	0.66004	0
1995	0.1	0.08314	1
1996	0.1	0.19041	0
1997	0.1	0.77828	0
1998	0.1	0.07666	1
1999	0.1	0.53644	0
2000	0.1	0.35678	0
Sum			201



Bernoulli-otanta

- In Bernoulli sampling the sample size is a random quantity and this example shows that we received one unit too much.
 - The simplest way to obtain a fixed sample size would be to sort the frame by the random number and select exactly 200 cases (from the beginning, end or just at any point as long as the random numbers are used for selection).



Systemaattinen otanta **SYS**
Systematic sampling

■ **Poimintamenettely**

- a) Määrää poimintaväli
 $q = N/n$
- b) Valitse satunnaisesti ensimmäinen otokseen poimittava alkio väliltä $[1, q]$
- c) Poimi ensimmäisestä poimitusta lähtien joka q :s alkio.
Saadaan n alkion otos



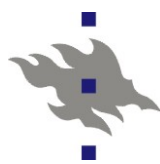
Systemaattinen otanta SYS

- SYS-poiminta on teknisesti helppo toteuttaa esim. numeroidusta kehikkoperusjoukosta manuaalisesti tai koneellisesti atk-rekisteristä
- SYS-otantaa käytetään usein päämenettelynä poimittaessa alkiotason otoksia atk-rekistereistä
 - SAS Procedure SURVEYSELECT
 - Useita mahdollisia tapoja käytännön toteutuksessa Syntax



Systemaattinen otanta SYS

- **SYS-otannan erikoistapauksia**
- Satunnaisjärjestyksessä oleva perusjoukko
 - estimointi palautuu SRSWOR-tilanteeseen
- Implisiittisesti ositettu perusjoukko
 - perusjoukon alkiot on lajiteltu tiettyjen kriteerien mukaan ennen poimintaa
 - estimointi palautuu ositetun otannan (STR) tilanteeseen
 - käytännössä usein sovellettu menetelmä



Systemaattinen otanta

Sisältymistodennäköisyys $\pi_k = n / N$ on vakio

Kokonaismäärän eli totaalin T estimaattori

$$\hat{t} = N \sum_{k=1}^n y_k / n$$

Keskiarvon \bar{Y} estimaattori

$$\bar{y} = \hat{t} / N = \sum_{k=1}^n y_k / n$$



Systemaattinen otanta

Asetelmavarianssi

$$V_{sys}(\hat{t}) = \sum_{j=1}^q (\hat{t}_j - T)^2 / q = V_{SRS}(\hat{t})(1 + (n-1)\rho_{int}) = N \times SSB,$$

missä \hat{t}_j on j :nnen systemaattisen otoksen kokonaismäärän estimaattori

$q=N/n$ on poimintaväli

$$\rho_{int} = 1 - \frac{n}{n-1} \times \frac{SSW}{SST}$$

on sisäkorrelaatiokerroin, missä käytetään ANOVA-neliösummahajoitelmia $SST = SSW + SSB$.



Systemaattinen otanta

Asetelmakerroin (parametri)

$$DEFF_{sys}(\hat{t}) = \frac{V_{sys}(\hat{t})}{V_{srs}(\hat{t})} = 1 + (n-1)\rho_{int}$$

Systemaattinen otanta on yksinkertaiseen satunnaisotantaan verrattuna:

- tehokkaampi, jos $-1/(n-1) < \rho_{int} < 0$,
- yhtä tehokas, jos $\rho_{int} = 0$,
- tehottomampi, jos $0 < \rho_{int} < 1$



Systemaattinen otanta

■ Varianssiestimaattori

- Asetelmavarianssille ei ole analyttistä estimaattoria - Miksi?
- Asetelmavarianssin estimointi vaatii approksimaatioita

- Estimointi kuten SRS, jos oletetaan, että kyseessä on **satunnaisjärjestyksessä** oleva perusjoukko (jolloin sisäkorrelaatio = 0)
- Estimointi kuten STR (ositettu otanta, suhteellinen kiintiöinti), jos oletetaan **implisiittinen** ositus
 - Perusjoukon alkioden lajittelu ennen SYS-poimintaa
 - Ks: Lehtonen-Pahkinen (2004) Example 2.3



Systemaattinen otanta

- Ks. Tekninen yhteenveto I sivu 4
- VLISS [Training Key 45](#)
 - In this exercise the intra-class correlation is negative (-0.08) which means that given the current sorting order of the population, systematic sampling will be more efficient than simple random sampling without replacement (SRSWOR). Note that the population was pre-sorted first by the variable URB85 (urbanicity) and within each URB85 class, by the variable Municipality for this exercise.



Lisäinfon käyttö otanta-asetelmassa

- Ositettu otanta
STR - *Stratified sampling*
- PPS-otanta
PPS: *Selection with probabilities proportional to size*



Ositettu otanta STR

Stratified sampling

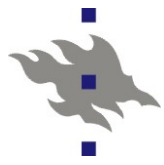
■ Tavoite

■ Tehokas otanta-asetelma muodostamalla perusjoukon alkioista ennen otoksen poimintaa tutkittavan ilmiön kannalta sisäisesti homogeenisia, toisensa poissulkevia ositteita (*stratum; strata*)

■ Ositteet ovat toisistaan riippumattomia osaperusjoukkoja

■ Kullekin ositteelle voidaan tarvittaessa kiinnittää oma otanta-asetelma

- Joustavuusperiaate



Ositettu otanta STR Työvaiheet

(1) Osituskriteerien valinta

- alueelliset ositteet
demografiset ositteet
- toimialan mukaiset ositteet (yritysootannot)

(2) Kehikkoperusjoukon osittaminen

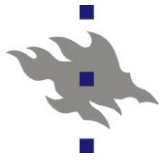
- kunkin kehikkoperusjoukon alkion kiinnittäminen yhteen (ja vain yhteen) ositteeseen

(3) Otoksen kiintiöinti

- määritellään kustakin ositteesta poimittavien alkioden lukumäärä niin, että kokonaisotoskoko on n

(4) Otoksen poiminta kustakin ositteesta

- kustakin ositteesta poimitaan valitulla otantamenetelmällä alkiotason otos valitun kiintiöintimenetelmän mukaisesti



Ositettu otanta STR Kiintiöinti

■ Suhteellinen kiintiöinti

- kustakin ositteesta poimitaan alkioita otokseen ositteen suhteellista osuutta koko perusjoukossa vastaava määrä
- sisällysmistodennäköisyys on vakio n/N

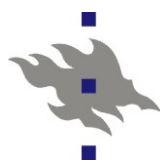
■ Tasakiintiöinti

- kustakin ositteesta poimitaan yhtä monta otosalkiota
- sisällysmistn vaihtelee ositteittain

■ Optimaalinen kiintiöinti

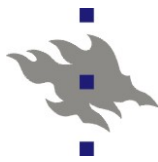
- suurista ositteista ja ositteista, joissa on suuri variaatio, poimitaan suhteessa enemmän alkioita kuin pienistä ositteista ja ositteista, joissa on pieni variaatio
- sisällysmistn vaihtelee ositteittain

- HUOM: Ositusmuuttujien arvot tulee olla tiedossa kaikille perusjoukon alkioille ennen otoksen poimintaa



STR: Tekninen yhteenveto I ja VLISS

- Ositettu otanta STR
- Ks. Tekninen yhteenveto I
 - Sivut 5-6
- [Lehtonen-Djerf](#) (2008)
- Asetelmakerroin *deff*
 - Lehtonen-Pahkinen (2004) s. 62-63
- Ks. VLISS
 - [Training Key 63](#)
 - Design effect and allocation under stratified sampling



PPS-otanta

- PPS: *Selection with probabilities proportional to size*
 - Poiminta otosyksiköiden koon mukaisin todennäköisyyksin
 - Perusjoukon alkion otokseen sisällymis-todennäköisyys riippuu alkion kokoa mittaavan muuttujan z arvosta
 - **Kokoa mittaavan muuttujan arvo tulee olla tiedossa kaikilta p_j :n alkioilta ennen poimintaa**
 - Käytetään usein yritysotannoissa
 - Muita esimerkkejä: Kouluotokset, alueotokset
 - PISA-tutkimukset, Terveys 2000
- PPS-otoksien poiminta
 - SAS Procedure SURVEYSELECT **Syntax**



PPS sampling

Sampling with probability proportional to size (PPS) is a method where auxiliary information has a key role. An auxiliary variable is assumed to be available as a measure of the size of a population element. Varying inclusion probabilities for population elements can be assigned using the size variable. Efficiency improves relative to SRS if the relationship between the study variable and the size variable is strong. PPS is often used in business surveys and in general, for situations where the sampling units vary with a size measure.



PPS-otanta

- PPS-otanta on erittäin tehokas menetelmä, jos kokoa mittaava muuttuja korreloi voimakkaasti tulosmuuttujan kanssa JA jos y-muuttujan ja z-muuttujan suhde pysyy (likimain) vakiona yli koko perusjoukon (lin. mallin vakiotermin = 0)

Sisällymistodennäköisyys

$$\pi_k = n \times z_k / \sum_{k=1}^N z_k$$

missä z_k on kokomuuttujan arvo perusjoukon alkiolle k



PPS: Tekninen yhteenveto I ja VLISS

- Kokonaismäärän perusestimaattori:
Horvitz-Thompson (HT) -estimaattori

$$\hat{t}_{HT} = \sum_{k=1}^n \frac{y_k}{\pi_k} = \sum_{k=1}^n w_k y_k$$

- Ks. Tekninen yhteenveto I
 - Sivut 7-10
- Ks. VLISS
 - [Training Key 54](#)
 - The effective use of auxiliary information in PPS sampling



Otoksien poiminta käytännössä

- **SAS Procedure SURVEYSELECT**
- SRS – yksinkertainen satunnaisotanta
 - SRSWOR -palauttamatta
 - SRSWR - palauttaen
- SYS- systemaattinen otanta
- STR – ositettu otanta
- PPS-otanta
 - PPSWOR
 - PPSWR
 - PPSSYS
 - Ositettu PPS



- **ESIMERKKI: Otoksien poiminta**
- **Province-perusjoukosta**

a) SRSWOR-otos

■ SAS Procedure SURVEYSELECT

- SRSWOR, $n=8$

```
proc surveyselect  
  data=province91  
  out=otos1  
  sampsize=8  
  seed=9876543  
  method=srs stats;  
run;
```



Poimittu SRSWOR-otos

(1) SRSWOR-otos / n=8 kuntaa

Obs	ID	LABEL	UE91	SamplingWeight
1	1	Jyvaskyla	4123	4
2	4	Keuruu	760	4
3	5	Saarijarvi	721	4
4	15	Konginkangas	142	4
5	18	Kuhmoinen	187	4
6	26	Pihtipudas	331	4
7	30	Toivakka	127	4
8	31	Urainen	219	4
Sum				32

SURVEYMEANS, SRSWOR

Totaaliestimaatti ja keskivirhe Std Dev

Statistics

Variable	Sum	Std Dev
UE91	26440	13282

- Sum = Estimoitu totaali
- Std Dev = totaaliestimaatin keskivirheen estimaatti (s.e = standard error)
- HUOM: SURVEYSELECT tuottaa painomuuttujan SamplingWeight arvot otostiedostoon kaikissa otantamenetelmissä



Totaaliestimaatti ja s.e

Horvitz-Thompson-estimaatti
SRSWOR-otokselle

$$\hat{t} = \sum_{k=1}^n w_k y_k = 26440$$

missä $w_k = 1/\pi = 4$ on asetelmapaino

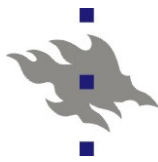
$s.e(\hat{t}) = 13282$ mikä on kovin suuri!

HUOM: Perusjoukossa $t = 15098$



Huomioita SRSWOR-otoksesta

- Tulosuuttujan UE91 jakauma vino
- Muutama suuri arvo
 - Jyväskylä
 - Jkl mlk
- Estimaatin arvo riippuu vahvasti siitä, ovatko suuret kunnat mukana otoksessa
 - Kyllä: Suuri estimaatti
 - Ei: Pieni estimaatti...
 - Katsotaan tarkemmin PC-demoissa
- Parempi estimointi:
- Ositettu otanta
 - Kaupungit
 - Muut kunnat
- PPS-otanta
 - Käytetään otannassa kokomuuttujaa
 - Tässä HOU85
 - Väestölaskennasta saatu kotitalouksien lukumäärä kussakin perusjoukon kunnassa

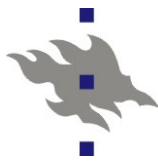


b) Ositettu SRSWOR-otos

■ SAS Procedure SURVEYSELECT

- Ositettu SRSWOR, $n=8$
- 2 ositetta (kaupungit/muut kunnat), muuttuja kumu (muuttujat STR tai URB85)
- Tasakiintiöinti (Equal allocation)

```
proc surveyselect  
  data=province91  
  out=otos2  
  sampsize=(4,4)  
  seed=9876543  
  method=srs stats;  
  strata kumu; run;
```

Kokonaismäärän estimointi

- Työttömien kokonaismäärän UE91 estimointi äsken poimitusta ositetusta SRSWOR-otoksesta:

```
data kunta; input kumu _total_;
datalines;
1 7
2 25
;
proc surveymeans data=otos2 total=kunta sum;
  strata kumu;
  weight SamplingWeight;
  var UE91;
run;
```



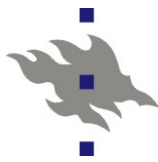
Ositettu SRSWOR-otos ja estimointi

(2a) Oma ositettu SRSWOR-otos / n=8 kuntaa

Obs	ID	kumu	LABEL	UE91	Sampling Weight
1	1	1	Jyvaskyla	4123	1.75
2	2	1	Jamsa	666	1.75
3	3	1	Jamsankoski	528	1.75
4	5	1	Saarijarvi	721	1.75
5	11	2	Kannonkoski	153	6.25
6	18	2	Kuhmoinen	187	6.25
7	19	2	Kyyjarvi	94	6.25
8	27	2	Pylkonmaki	98	6.25

Statistics

Variable	Sum	Std Dev
UE91	13892	4029.562414



c) Ositettu PPS-otos

■ SAS Procedure SURVEYSELECT

- Ositettu PPSWOR, $n=8$
- 2 ositetta (Jyväskylä /muut kunnat), muuttuja osite

```
proc surveyselect
  data=province91
  out=otos3
  sampsize=(1,7)
  seed=9876543
  method=pps stats;
  strata osite;
  size HOU85; * PPS-kokomuuttuja;
run;
```



Ositettu PPSWOR-otos

(3a) Oma PPSWOR-otos / n=8 kuntaa

Obs	osite	ID	LABEL	UE91	HOU85	Sampling Weight
1	1	1	Jyvaskyla	4123	26881	1.00000
2	2	9	Joutsa	194	1823	5.08361
3	2	3	Jamsankoski	528	3019	3.06970
4	2	5	Saarijarvi	721	3730	2.48457
5	2	7	Aanekoski	767	4264	2.17341
6	2	2	Jamsa	666	4663	1.98744
7	2	4	Keuruu	760	4896	1.89286
8	2	10	Jyvaskmlk	1623	9230	1.00406

Statistics

Variable	Sum	Std Dev
UE91	14580	635.260481



Yhteenveto, $n = 8$

Otos	Totaali	s.e	
SRSWOR	26440	13282	(huonoin)
STR	13892	4029	
PPSWOR	14580	635	(paras)
Perusjoukossa	15098	0	

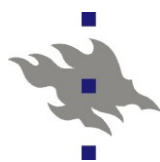


- Systemaattinen PPS Province91-populaatiosta
- Lehtonen-Pahkinen Example 2.6



VLISS – PPS sampling

- VLISS Training Key 54
- Simulation experiment
 - 1,000 simulated samples of size $n = 8$
 - Estimation total of Y-variable UE
 - Measures of performance of HT estimator
 - Monte Carlo mean and standard error
 - Bias, ARB (absolute relative bias)
 - RMSE (Root mean squared error)
 - Size variables in PPS
 - 1) HOU85 (number of households in a municipality)
 - 2) X (artificially created variable for pedagogical purposes, $UE91 + 3000$), Y and X dependent but nonzero intercept
 - 3) Z (artificially created variable for pedagogical purposes, $N(500, 150)$), Y and Z independent



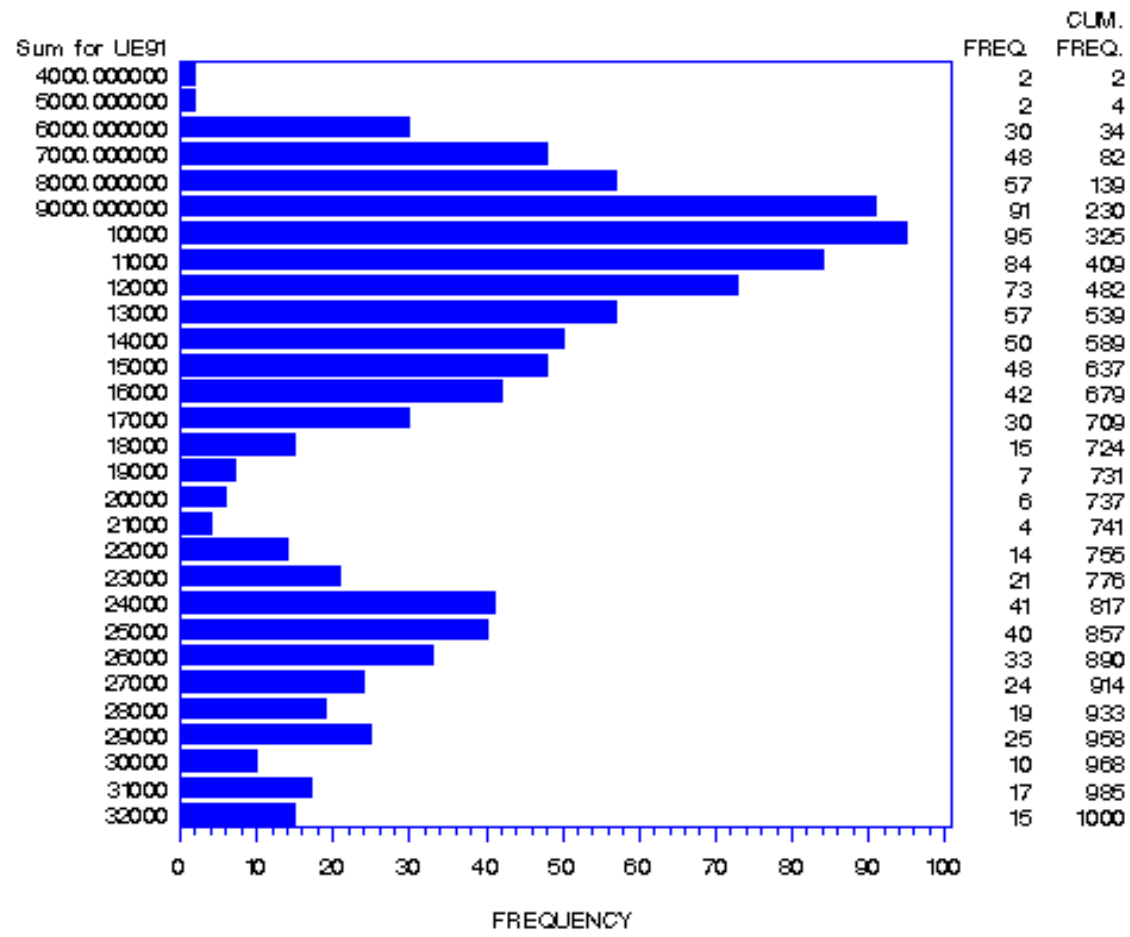
VLISS – PPS sampling

	Population	Mean of			Standard	Root
Strategy	Total	Estimates	Bias	ARB	error	MSE
SRSWOR_HT	15098	15360.5	262.5	1.74	7325.4	7330.1
PPS_HOU85	15098	15138.2	40.2	0.27	559.2	560.7
PPS_x	15098	15276.2	178.2	1.18	4609.6	4613.1
PPS_z	15098	15025.3	-72.7	0.48	7564.0	7564.4

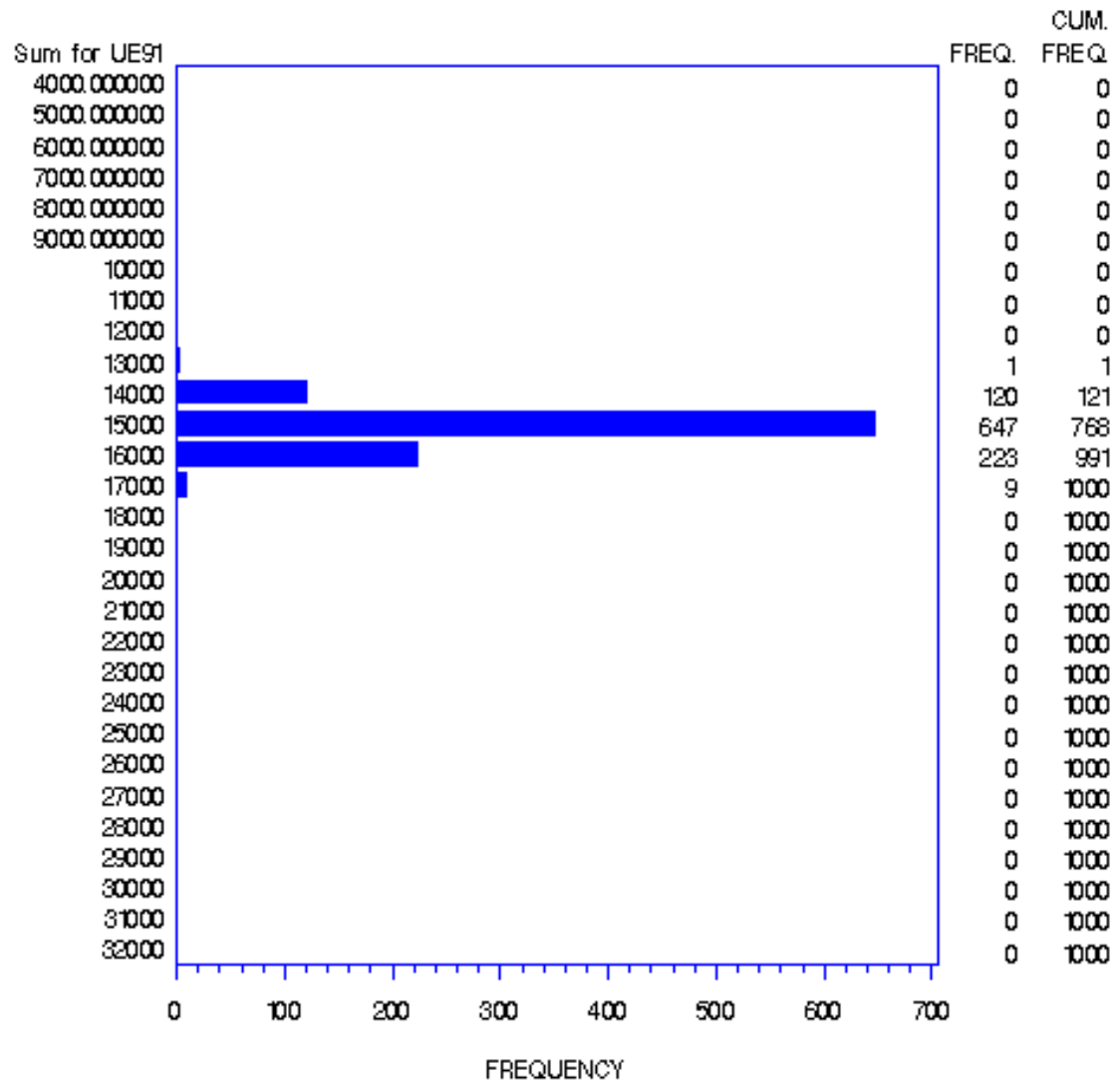


Distribution of SRSWOR_HT estimator

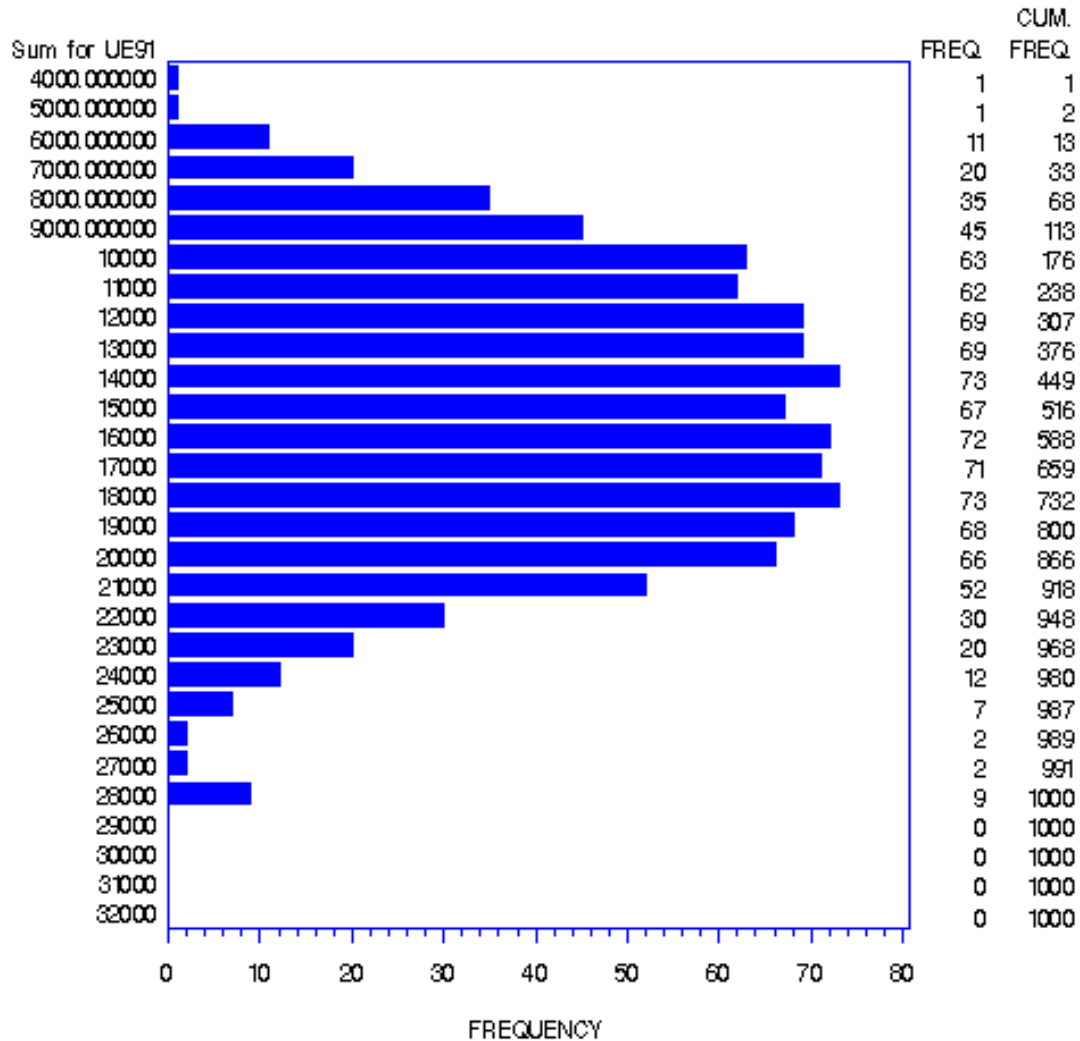
Distribution of Estimates
Strategy= SRSWOR_HT



Distribution of PPSWOR estimator (aux.var. HOU85)



Distribution of PPSWOR estimator (aux.var. X)



Distribution of PPSWOR estimator (aux.var. Z)

