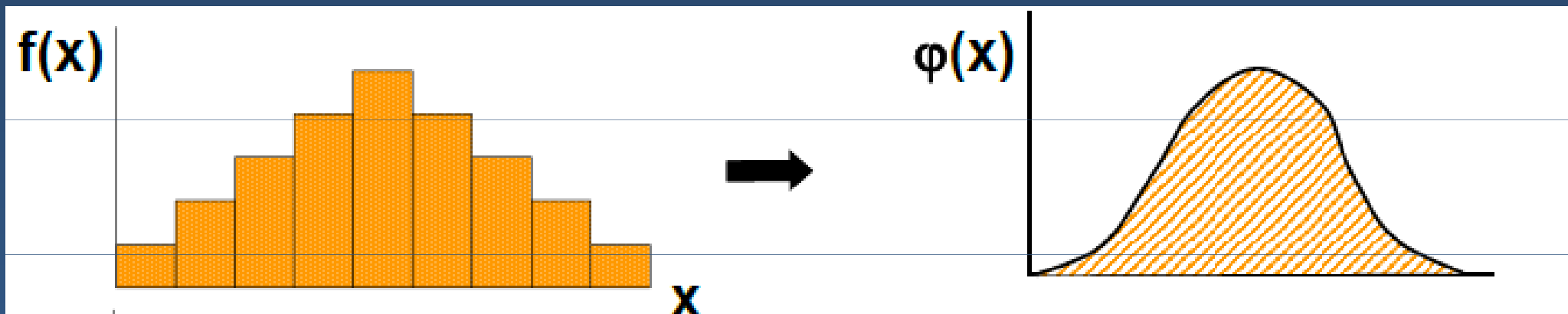


7. Odhady populačních průměrů a pravděpodobností

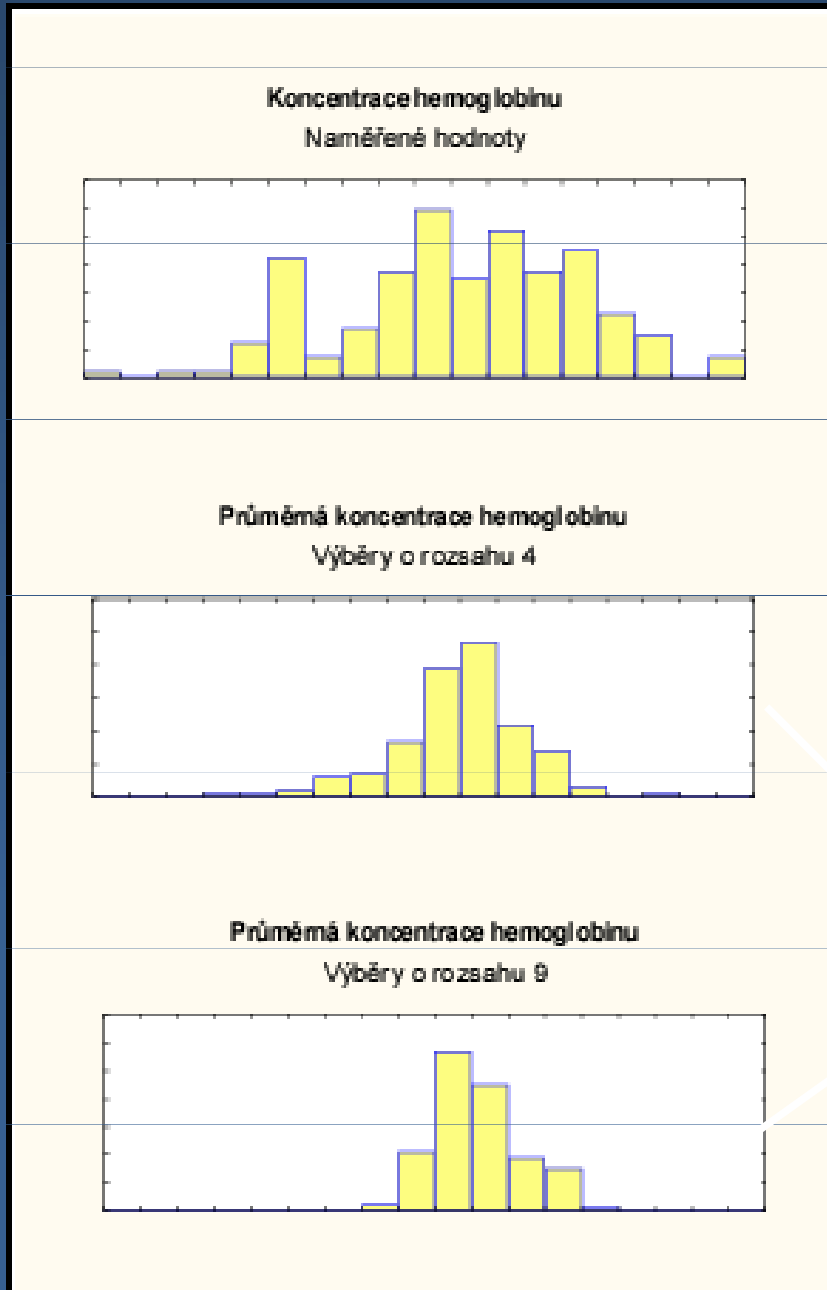
Výběrové a teoretické rozložení



Výběrové rozložení
(N, \bar{x}, s)

Teoretické rozložení
(μ, σ)

Motivace



1. všechny tři histogramy kolísají kolem stejného středu
2. čím větší rozsah výběru, tím užší rozdělení
3. rozdělení průměrů pro $n = 4$ a $n = 9$ jsou podobnější normálnímu rozdělení než rozdělení původních dat.

Rozdělení výběrového průměru

Odhady

```
graph TD; A[Odhady] --> B[Bodové (číslo)]; A --> C[Intervalové (interval pravděpodobných hodnot)];
```

**Bodové
(číslo)**

**Intervalové
(interval pravděpodobných
hodnot)**

Výběrový průměr \bar{x} je bodovým odhadem parametru μ

Výběrová směrodatná odchylka s je bodovým odhadem parametru σ

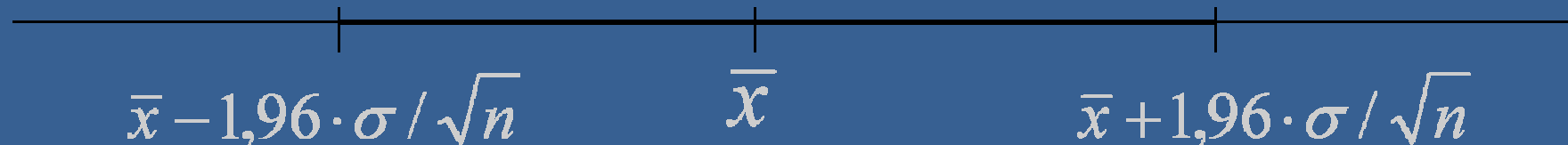
Relativní četnost p je bodovým odhadem parametru π

Intervalový odhad průměru

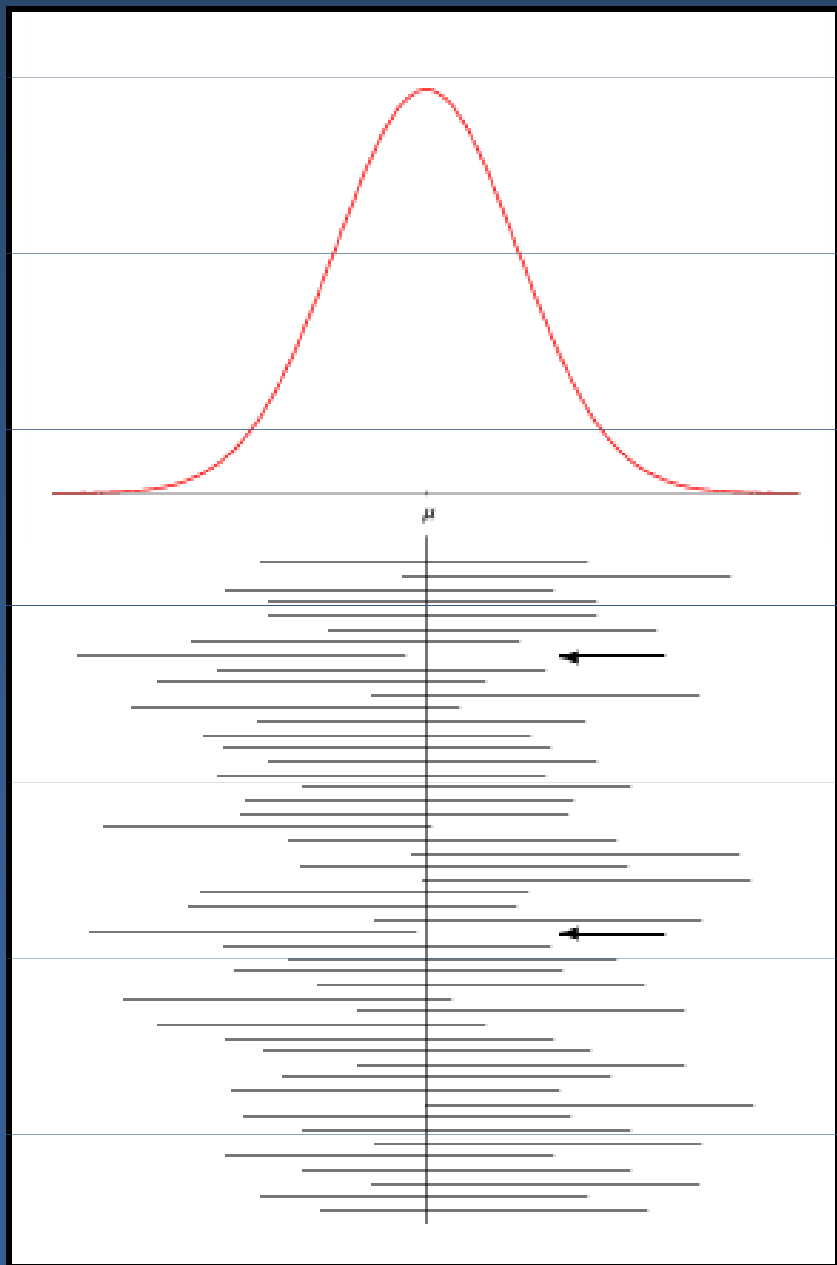
- $X_i \sim N(\mu, \sigma^2) \Rightarrow \bar{X} \sim N(\mu, \sigma^2/n)$
- Provedeme výběr o rozsahu n a vypočteme \bar{x} , pak μ leží s pstí 0,95 v intervalu:

$$\bar{x} \pm 1,96 \cdot \sigma / \sqrt{n} \quad \text{Interval spolehlivosti pro průměr}$$

- $z = 1,96$ kritická hodnota standardizovaného normálního rozložení pro koeficient spolehlivosti $P = 0,95$



Simulace



50 výběrů o rozsahu 10
Pouze dva nepokrývají
populační průměr

Obecný vzorec pro interval spolehlivosti

$$P(L_1 < \text{Odhad} < L_2) \geq 1 - \alpha / 2$$

Odhadovaný parametr \pm Kvantil modelového rozložení (pro $1 - \alpha / 2$) x SE (odhadu)

α	0,1	0,05	0,01	0,001
$z_{1-\alpha/2}$	1,645	1,960	2,576	3,290
$z_{1-\alpha}$	1,282	1,645	2,326	3,090
z_{α}	-1,282	-1,645	-2,326	-3,090

Intervalový odhad průměru při neznámé směrodatné odchylce v populaci

- Neznáme směrodatnou odchylku v populaci σ
=> nahradíme výběrovou směrodatnou odchylkou s
- Další nejistota
- Místo kvantilů standardizovaného normálního rozdělení použijeme kvantily studentova rozdělení pro příslušný počet stupňů volnosti $(n-1)$

$$\bar{x} \pm t \frac{s}{\sqrt{n}}; t = t_{1-\alpha/2}(n-1); \frac{s}{\sqrt{n}} - \text{standardní chyba průměru}$$

Studentovo t-rozdělení

- Podobné standardizovanému normálnímu rozdělení
- Symetrické kolem střední hodnoty $\mu = 0$
- Má pouze 1 parametr:
- Stupně volnosti: $\nu = n-1$

Intervalový odhad populační pravděpodobnosti

- Výběr o rozsahu n , danou vlastnost má r
- Relativní četnost výskytu vlastnosti ve výběru $p = r/n$
- Pro $n\pi(1-\pi) \geq 9$ má relativní četnost výskytu vlastnosti normální rozdělení
- Průměr = pst výskytu v celé populaci (π)
- Směrodatná odchylka = $\sqrt{\pi(1-\pi)/n}$
- 95% interval spolehlivosti pro populační pst

$$p \pm 1,96 \sqrt{\frac{\pi(1-\pi)}{n}}$$