

Induktivní statistika

Odhady

Odhady

- bodové odhady
 - intervalové odhady
 - konstrukce intervalu spolehlivosti pro průměr
 - odhady podílů (kategorická proměnná)
-

Odhady

- v příkladech v předchozích přednáškách jsme znali hodnoty průměru a rozptylu populace
 - obvykle tomu ale bývá přesně naopak: **známe hodnoty (statistiky) výběru a neznáme hodnoty (parametry) populace**
 - ty chceme z výběru **odhadnout**
-

Odhady

- 2 typy odhadů: bodové a intervalové
 - **bodový odhad**: použijeme průměr vzorku a odhadneme, že se rovná průměru populace
-

Bodový odhad

- bodový odhad je problematický v tom, že dva různé výběry nám mohou dát dva různé odhady
 - bodový odhad **neobsahuje** žádnou **informaci** o jeho **přesnosti** či **spolehlivosti**
 - na čem závisí přesnost odhadu?
-

Bodový odhad

přesnost odhadu závisí na dvou charakteristikách

- **velikost výběru** (čím větší n , tím menší výběrová chyba)
 - **variabilita hodnot v populaci** (čím vyšší, tím vyšší i výběrová chyba)
-

Intervalový odhad

- poskytuje rozsah (interval) hodnot, který s určitou pravděpodobností obsahuje hledanou hodnotu parametru
-

Intervalový odhad

je založen na:

- bodovém odhadu
 - velikosti výběru
 - variabilitě znaku v populaci (známé nebo rovněž odhadované)
-

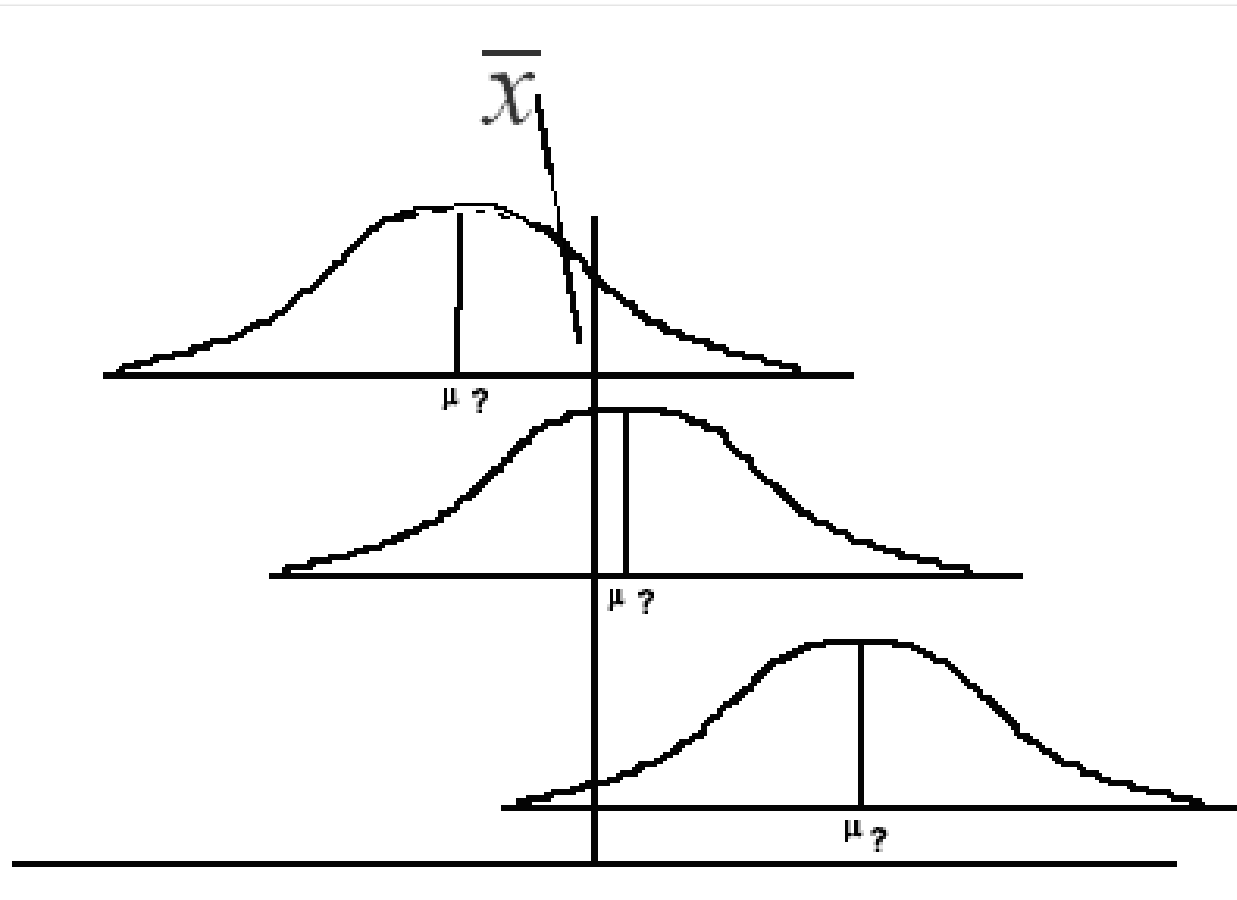
Intervalový odhad

□ ptáme se: **jaká je hodnota μ ?**

Intervalový odhad

- ptáme se: **jaká je hodnota μ ?**
 - výběrový průměr určité hodnoty může pocházet z populací o různých průměrech
 - proto **nemůžeme jednoznačně určit hodnotu μ**
-

Intervalový odhad



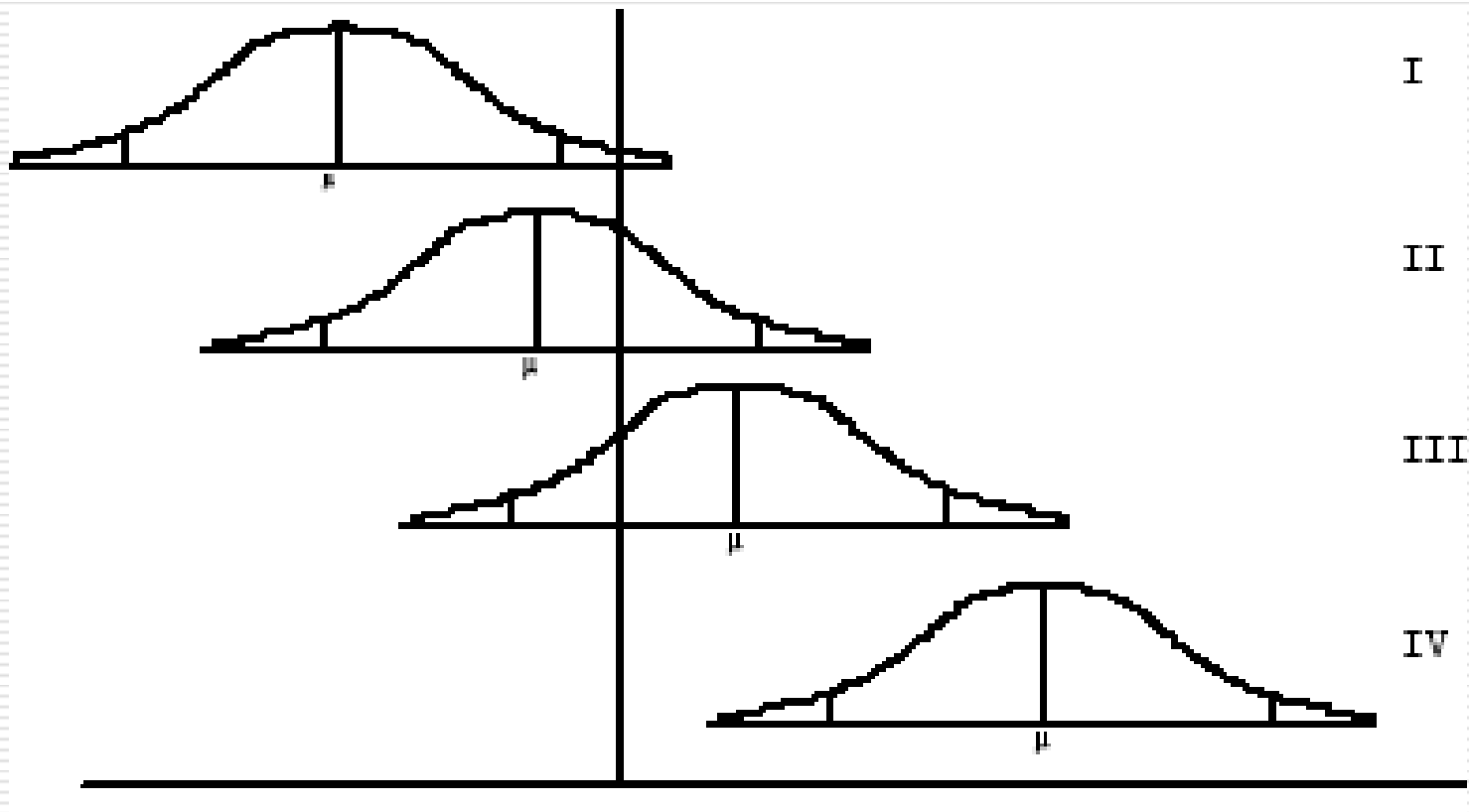
Intervalový odhad

- takže se místo toho snažíme určit, jaký je **možný rozsah hodnot μ**
 - jaké populace (tj. s jakou hodnotou průměru) by mohly být pravděpodobným zdrojem našeho vzorku?
-

Intervalové odhady

- ze které populace nejpravděpodobněji pochází výběr, jehož průměr je v následujícím grafu naznačen svislou čarou?

RVP pro populace I-IV



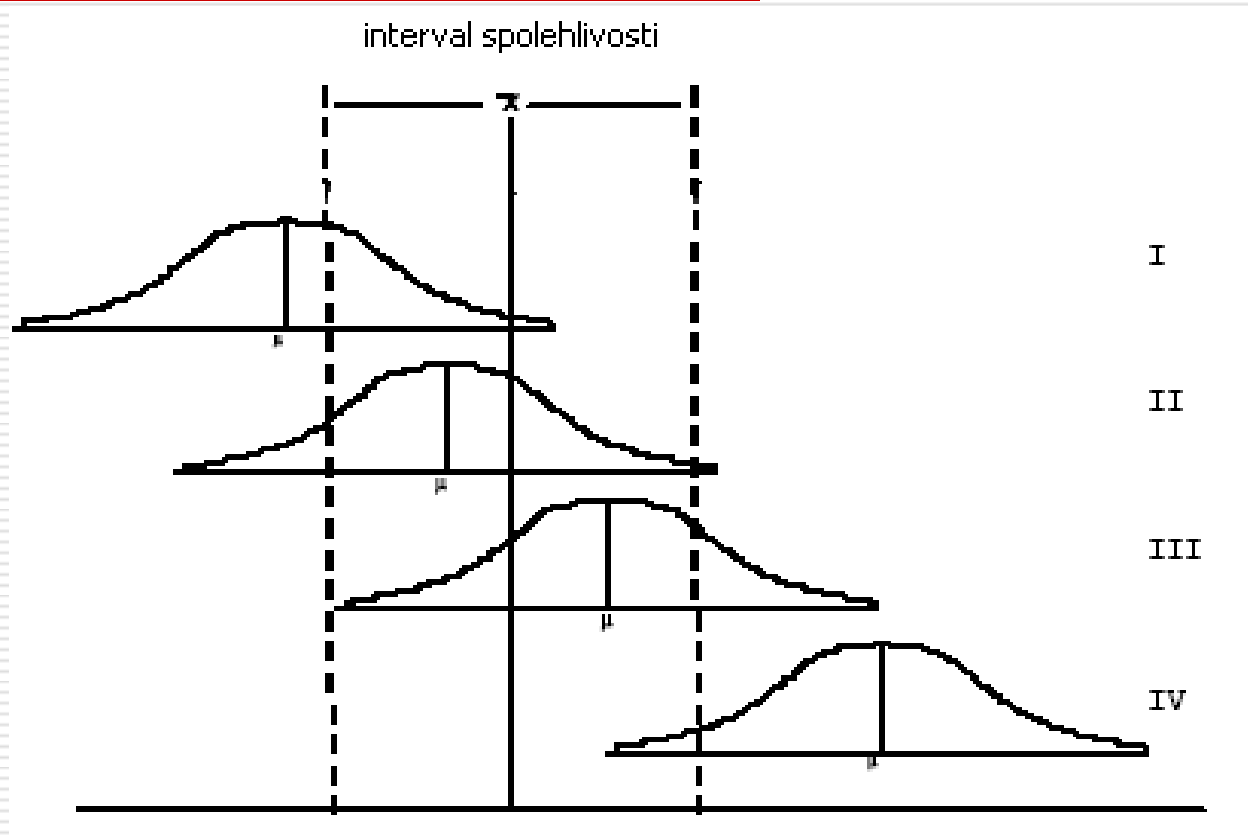
Intervalové odhady

- výběr pochází
 - nejpravděpodobněji z populace II nebo III
 - méně pravděpodobně z populace I
 - a velmi málo pravděpodobně z populace IV
-

Intervalové odhady

- intervalový odhad spočívá v konstrukci tzv. **intervalu spolehlivosti** (confidence interval) = rozsahu hodnot, ve kterém s určitou pravděpodobností leží průměr populace
-

Interval spolehlivosti



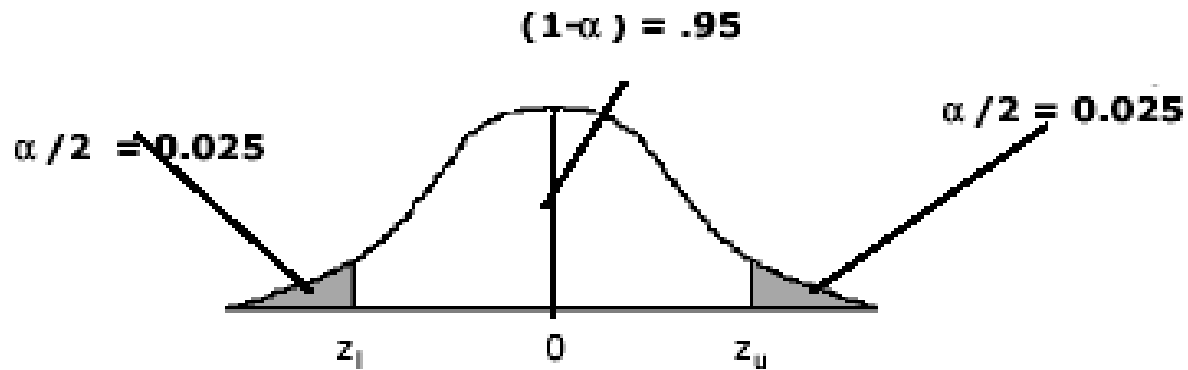
Interval spolehlivosti

- nejprve je třeba si **stanovit tuto pravděpodobnost** – tj. úroveň přesnosti (spolehlivosti);
 - obvyklá je např. **95%** - snažíme se najít interval hodnot, ve kterém s 95% pravděpodobností leží průměr populace
 - pak jde o tzv. **95% interval spolehlivosti**
-

Interval spolehlivosti

- poté **najít hodnotu z pro tuto pravděpodobnost** – tj. rozsah, ve kterém bude ležet středních 95% hodnot (výběrových průměrů)
 - 2,5% na každé straně rozdělení
-

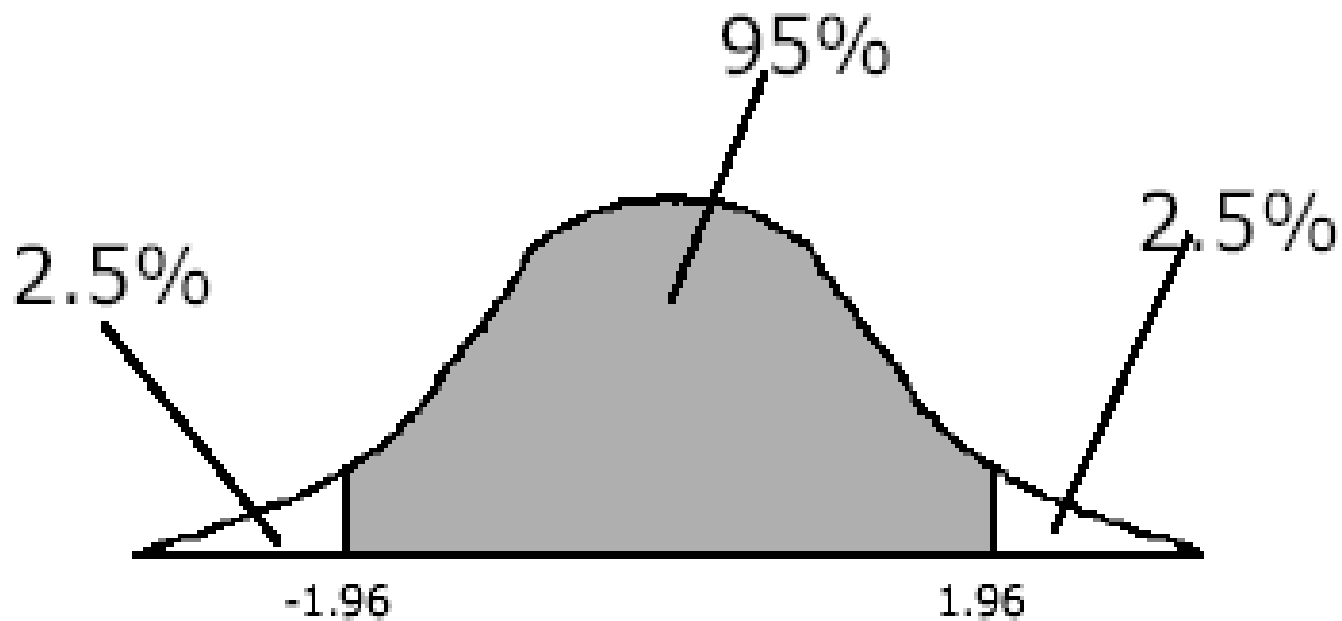
Interval spolehlivosti



Interval spolehlivosti

- tomu odpovídají hodnoty
 $z = -1,96$
 $z = 1,96$

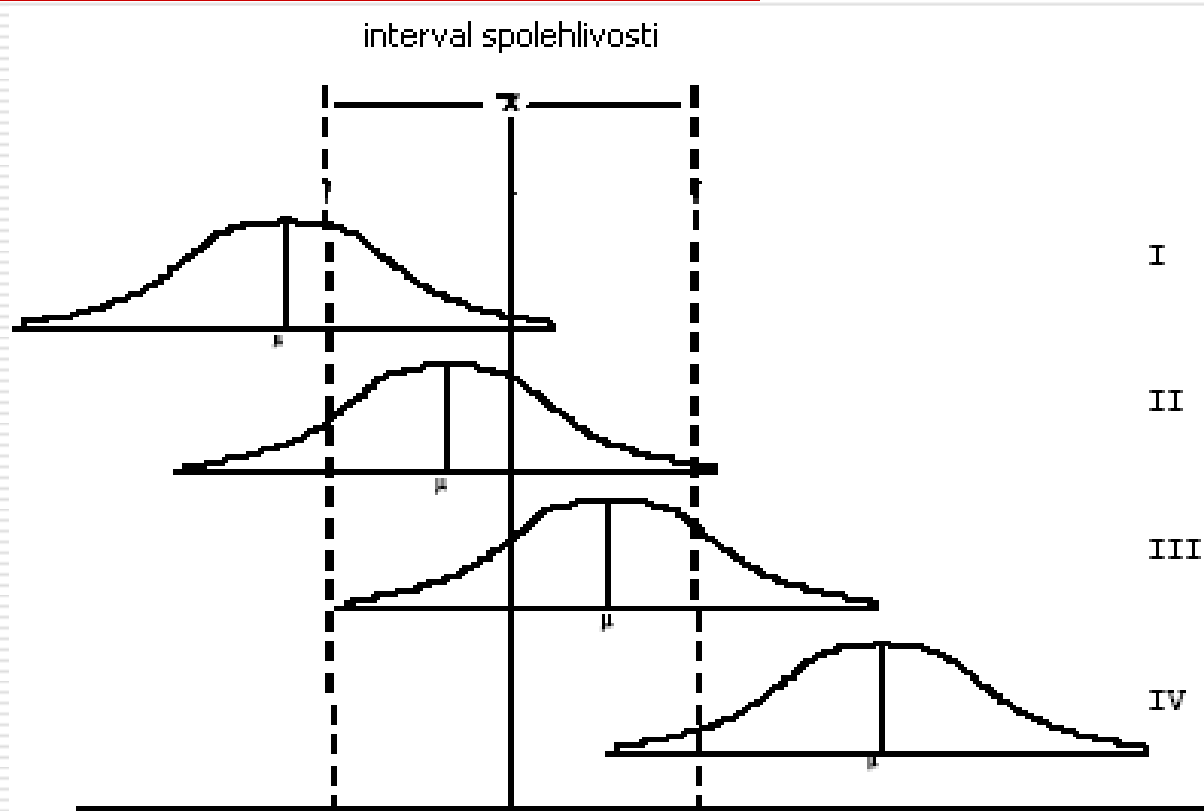
Interval spolehlivosti



Interval spolehlivosti - výpočet

$$\bar{x} \pm z_{1-\alpha/2} \frac{\sigma}{\sqrt{n}}$$

Interval spolehlivosti



Interval spolehlivosti

- interpretace intervalu spolehlivosti:
pokud bychom z populace vybrali 100 náhodných výběrů o velikosti n a pro každý z nich sestrojili tento interval, 95 intervalů by obsahovalo průměr populace a 5 nikoliv
 - opatrně můžeme říct: máme 95% pravděpodobnost, že se v tomto intervalu nachází průměr populace
-

Interval spolehlivosti

- oblíbený omyl:
 - v 95% intervalu spolehlivosti leží 95% hodnot populace (NEPLATÍ!)

 - kromě 95% intervalu spolehlivosti se používá také např. 99% a 90% pravděpodobnost
-

Příklad

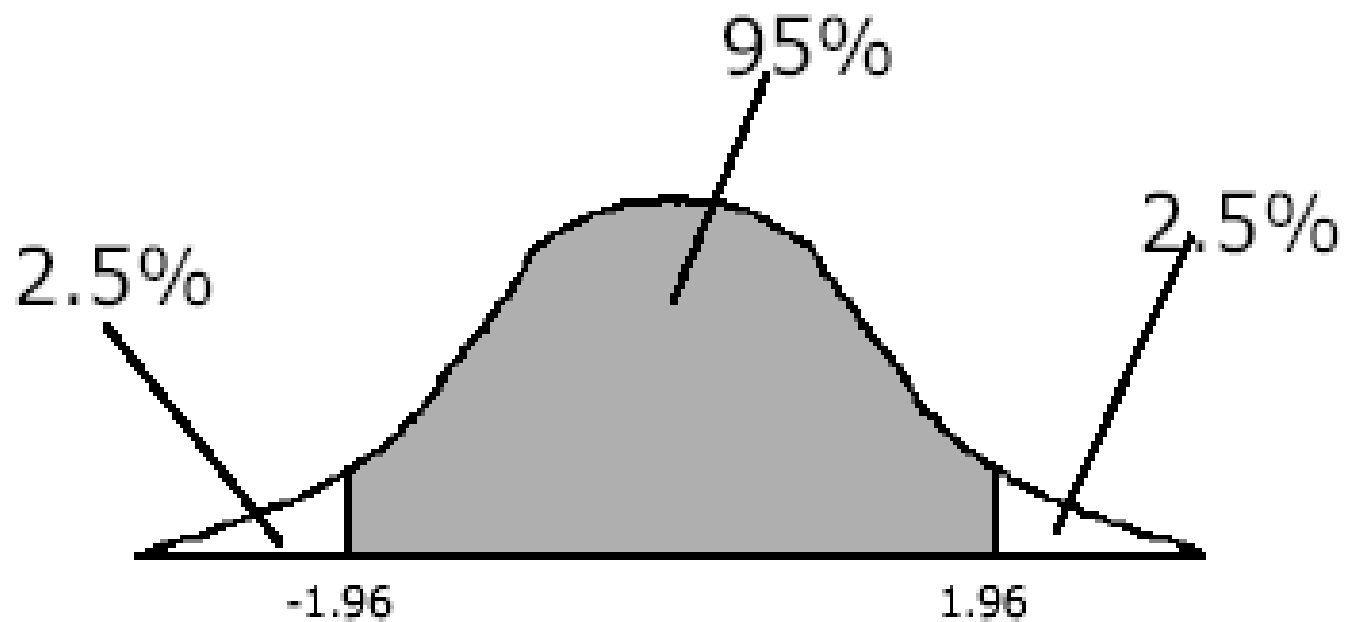
- náhodný výběr 36 dětí hospitalizovaných bez matky v raném věku (do 6 měsíců), průměrné IQ vzorku = 96
 - na základě tohoto zjištění odhadněte průměrné IQ populace dětí hospitalizovaných bez matky v raném věku (sestavte 95% interval spolehlivosti)
-

Příklad

□ Postup:

- bodový odhad: $\mu=96$
 - výpočet výběrové chyby (směrodatné odchyly RVP):
$$\sigma/\sqrt{n} = 15/\sqrt{36} = 15/6 = \mathbf{2,5}$$
 - stanovení úrovně spolehlivosti: 95%
 - najít hodnotu z pro 95% pravděpodobnost
-

Příklad



Příklad

- v tabulce normálního rozdělení najdeme hodnoty z
 - hodnoty z pro 95% : 1,96 a -1,96
-

Příklad

- k výběrovému průměru přičteme (pro horní hranici intervalu) a odečteme (pro spodní hranici) výběrovou chybu, vynásobenou hodnotou z
-

Příklad

$$CI(\mu) = \bar{x} \pm z(\sigma/\sqrt{n})$$

$$CI(\mu) = 96 + 1,96 * 2,5 = 96 + 4,9 = \mathbf{100,9}$$

$$CI(\mu) = 96 - 1,96 * 2,5 = 96 - 4,9 = \mathbf{91,10}$$

95% interval spolehlivosti je 91,1 – 100,9

Interval spolehlivosti

□ **hodnoty z** pro nejčastěji užívané pravděpodobnosti:

■ 90% (zbývá 5% + 5%) $z = +/- 1,645$

■ 95% (zbývá 2,5% + 2,5%) $z = +/- 1,96$

■ 99% (zbývá 0,5% + 0,5%) $z = +/- 2,57$

Příklad 2

- pro odhad průměru z předchozího příkladu sestrojte 99% interval spolehlivosti
-

Příklad 2

$$CI(\mu) = \bar{x} \pm z(\sigma/\sqrt{n})$$

$$CI(\mu) = 96 + 2,57 * 2,5 = 96 + 6,4 = \mathbf{102,4}$$

$$CI(\mu) = 96 - 2,57 * 2,5 = 96 - 6,4 = \mathbf{89,6}$$

99% interval spolehlivosti je 89,6 – 102,4

Odhady podílů

- u kategoriálních proměnných nemůžeme počítat průměry
 - odhadujeme proto **podíly** jednotlivých kategorií proměnné
-

Odhady podílů

- např. podíl kuřáků v populaci českých adolescentů
 - podíl pacientů s rakovinou plic, kteří přežijí 5 let od diagnózy
 - podíl chlapců mezi dětmi s poruchou pozornosti
-

Odhady podílů

- pokud zkoumáme místo celé populace pouze výběr z ní, nezajímá nás tolik, jaký je podíl kategorií proměnné ve výběru (četnost \mathbf{p})
 - ale spíše jaký je skutečný podíl v populaci – četnost π
-

Odhady podílů

- při dostatečně velkém n platí i pro rozdělení podílů centrální limitní věta
- rozdělení výběrových podílů je normální rozdělení, s **průměrnou četností π** a směrodatnou odchylkou (výběrovou chybou)

$$SE = \sqrt{\frac{\pi(1-\pi)}{n}}$$

Příklad 4

- ❑ chceme zjistit, jaká je podpora státní maturity v populaci letošních maturantů (studentů 4. ročníků SŠ)
 - ❑ náhodný výběr z populace maturantů ($n=1000$ osob)
 - ❑ 585 osob se vyjádřilo pro ($p=0,585$)
 - ❑ odhadněte s 95% spolehlivostí podporu státní maturity v populaci letošních maturantů
-

Odhady podílů

- interval spolehlivosti pro podíly se spočítá podobně jako pro průměry:

$$p \pm z_{1-\alpha/2} \sigma_p$$

Odhady podílů

- ❑ nemůžeme však spočítat výběrovou chybu, protože neznáme π
 - ❑ v tomto případě je však možné dosadit místo toho p a přitom použít normální rozdělení (pokud je $n > 30$)
 - ❑ pokud je $n < 30$, pak dosadíme místo π hodnotu 0,5
-

Příklad 4

□ $p=0,585$

□ $z=1,96$

□ $SE(p)=\sqrt{[0,585(1-0,585)/1000]}$
 $=0,0156$

interval spolehlivosti

$$0.585 \pm 1.96(0.0156)$$

$$0.585 \pm 0,0305$$

--- přesnost odhadu je $\pm 3\%$

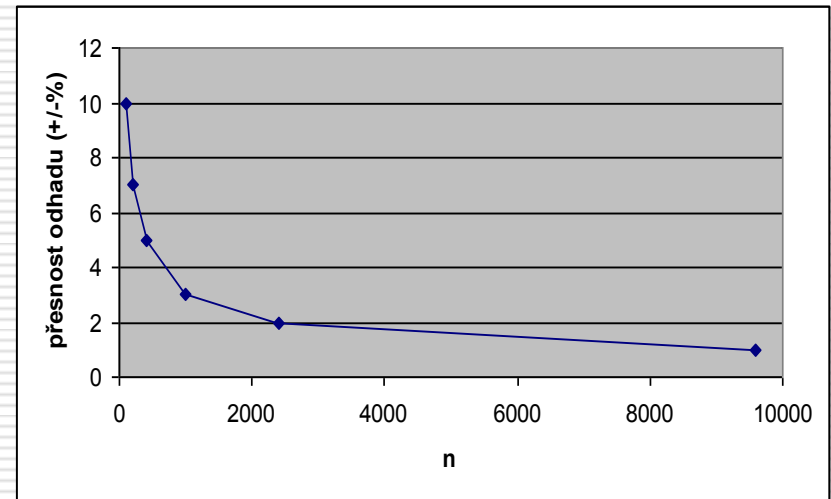
Příklad 4

- s 95% pravděpodobností je podíl maturantů podporujících zavedení státní maturity **mezi 55.4% a 61.6%**
-

Odhady podílů

vztah mezi velikostí vzorku a přesností odhadu

■ n=100	± 10%
■ n=200	± 7%
■ n=400	± 5%
■ n=1000	± 3%
■ n=2400	± 2%
■ n=9600	± 1%



Odhady podílů

- ❑ požadovaná velikost vzorku roste mnohem rychleji než spolehlivost odhadu (pro zdvojnásobení spolehlivosti je nutné asi čtyřnásobně zvětšit vzorek)
 - ❑ důležité při plánování výzkumu – jakou přesnost potřebujeme? jaké budou náklady?
 - ❑ podobný vztah platí pro odhad průměrů
-

Příklad na závěr

- z denního tisku:
 - **Padesát pět procent** českých voličů nesouhlasí s navrhovanými úspornými opatřeními Nečasovy vlády, zatímco před dvěma týdny sdílelo tento názor **jen 50 procent** voličů. Průzkum byl proveden v posledních čtyřech dnech a statistická chyba je 2,9 procenta.
 - můžeme dojít k závěru, že nesouhlas s úspornými opatřeními skutečně roste?
-

Kontrolní otázky

- 2 typy odhadů
 - na čem závisí šířka intervalu spolehlivosti? (*není nutno znát zpaměti vzorce, ale je třeba chápat princip výpočtu*)
 - vztah velikosti výběru a spolehlivosti odhadu
-

Literatura

- Hendl: kapitoly 4 a 5
-