

5. Testování exponenciálního a Poissonova rozložení

5.1. Věta (test dobré shody – viz přednáška 2)

H_0 : náhodný výběr X_1, \dots, X_n pochází z rozložení s distribuční funkcí $\Phi(x)$

H_1 : non H_0

Testová statistika:
$$K = \sum_{j=1}^r \frac{(n_j - np_j)^2}{np_j} \approx \chi^2(r - p - 1), \text{ když } H_0 \text{ platí}$$

r ... počet třídících intervalů (u_j, u_{j+1}) ve spojitém případě resp. počet variant $x_{[j]}$ v diskrétním případě.

n_j ... absolutní četnost j -tého třídícího intervalu resp. j -té varianty.

p_j ... pravděpodobnost, že náhodná veličina X s distribuční funkcí $\Phi(x)$ se bude realizovat v j -tém třídícím intervalu resp. j -tou variantou.

p ... počet odhadovaných parametrů testovaného rozložení.

Kritický obor: $W = \langle \chi^2_{1-\alpha}(r - p - 1), \infty \rangle$

$K \in W \Rightarrow H_0$ zamítáme na asymptotické hladině významnosti α .

Podmínky dobré aproximace: $np_j \geq 5, j = 1, \dots, r$. Při nesplnění těchto podmínek se doporučuje slučování některých třídících intervalů resp. variant.

5.2. Příklad: Byla zjišťována doba životnosti 45 součástek (v hodinách). Ze získaných údajů byl vypočten výběrový průměr $m = 99,93$ h a výběrový rozptyl $s^2 = 7328,9$ h². Máme k dispozici roztríděné údaje:

Doba životnosti	Počet součástek
(0,50)	15
(50,100)	14
(100,150)	6
(150,200)	5
(200,250)	2
(250,300)	1
(300,350)	1
(350,400)	1

Na asymptotické hladině významnosti 0,05 testujte hypotézu, že doba životnosti se řídí exponenciálním rozložením.

Řešení: $\hat{\lambda} = \frac{1}{m} = \frac{1}{99,93}$, testujeme $H_0: X_1, \dots, X_{45} \sim \text{Ex}\left(\frac{1}{99,93}\right)$ proti $H_1: \text{non } H_0$. Počítáme

pravděpodobnosti $p_j = \int_{u_j}^{u_{j+1}} \frac{1}{99,93} e^{-\frac{x}{99,93}} dx, j = 1, 2, \dots, 8$

j	(u_j, u_{j+1})	n_j	p_j	$np_j = 45p_j$
1	$(0, 50)$	15	0,3937	17,72
2	$(50, 100)$	14	0,2387	10,74
3	$(100, 150)$	6	0,1447	6,51
4	$(150, 200)$	5	0,0878	3,95
5	$(200, 250)$	2	0,0532	2,39
6	$(250, 300)$	1	0,0323	1,45
7	$(300, 350)$	1	0,0196	0,88
8	$(350, 400)$	1	0,0119	0,53

Vidíme, že pro $j = 4, \dots, 8$ nejsou splněny podmínky dobré aproximace. Posledních 5 intervalů tedy sloučíme do jednoho.

Dostaneme novou tabulku

j	(u_j, u_{j+1})	n_j	p_j	$np_j = 45p_j$
1	$(0, 50)$	15	0,3937	17,7157
2	$(50, 100)$	14	0,2387	10,7413
3	$(100, 150)$	6	0,1447	6,5127
4	$(150, 400)$	10	0,2046	9,2084

Testová statistika:

$$K = \sum_{j=1}^r \frac{(n_j - np_j)^2}{np_j} = \frac{(15 - 17,7157)^2}{17,7157} + \frac{(14 - 10,7413)^2}{10,7413} + \frac{(6 - 6,5127)^2}{6,5127} + \frac{(10 - 9,2084)^2}{9,2084} = 1,5133$$

Kritický obor: $W = \langle \chi^2_{1-\alpha}(r-p-1), \infty \rangle = \langle \chi^2_{0,95}(4-1-1), \infty \rangle = \langle 5,9915, \infty \rangle$

$K \notin W \Rightarrow H_0$ nezamítáme na asymptotické hladině významnosti 0,05.

5.3. Poznámka: V MATLABu se test dobré shody pro exponenciální rozložení provádí pomocí funkce `tds_exp.m`.

5.4. Příklad: Sledujeme rozložení počtu pacientů, kteří během 75 dnů přijdou na zubní pohotovost. Osmihodinovou pracovní dobu rozdělíme do půlhodinových intervalů a v každém intervalu zjistíme počet příchozích pacientů (máme $16 \times 75 = 1200$ intervalů).

Počet pacientů	0	1	2	3	4	5	6	7	8 a víc
četnost	79	188	282	275	196	114	45	10	11

Na asymptotické hladině významnosti 0,05 testujte hypotézu, že počet příchozích pacientů během půl hodiny se řídí Poissonovým rozložením.

Řešení:

$$\hat{\lambda} = m = \frac{1}{1200} (79 \cdot 0 + 188 \cdot 1 + 282 \cdot 2 + 275 \cdot 3 + 196 \cdot 4 + 114 \cdot 5 + 45 \cdot 6 + 10 \cdot 7 + 11 \cdot 8) = 2,7992,$$

testujeme $H_0: X_1, \dots, X_{1200} \sim \text{Po}(2,7992)$ proti $H_1: \text{non } H_0$. Počítáme pravděpodobnosti

$$p_j = \frac{2,7992^j}{j!} e^{-2,7992}, j = 0, 1, \dots, 7, p_8 = 1 - \sum_{j=0}^7 p_j.$$

j	0	1	2	3	4	5	6	7	8
n_j	79	188	282	275	196	114	45	10	11
np_j	73,0329	204,4313	286,1186	266,9646	186,8195	104,5878	48,7931	19,5114	9,7406

Podmínky dobré aproximace jsou splněny.

Testová statistika:

$$K = \sum_{j=1}^r \frac{(n_j - np_j)^2}{np_j} = \frac{(79 - 73,0329)^2}{73,0329} + \frac{(188 - 204,4313)^2}{204,4313} + \dots + \frac{(11 - 9,7406)^2}{9,7406} = 8,5019$$

$$\text{Kritický obor: } W = \langle \chi^2_{1-\alpha}(r - p - 1), \infty \rangle = \langle \chi^2_{0,95}(9 - 1 - 1), \infty \rangle = \langle 14,067, \infty \rangle$$

$K \notin W \Rightarrow H_0$ nezamítáme na asymptotické hladině významnosti 0,05.

5.5. Poznámka: V MATLABu se test dobré shody pro Poissonovo rozložení provádí pomocí funkce `tds_poiss.m`.

5.6. Věta: Darlingův (jednoduchý) test exponenciálního rozložení

Testujeme hypotézu, která tvrdí, že náhodný výběr X_1, \dots, X_n pochází z exponenciálního rozložení. Označme M výběrový průměr a S^2 výběrový rozptyl tohoto náhodného výběru. Víme, že střední hodnota náhodné veličiny $X \sim \text{Ex}(\lambda)$ je $E(X) = 1/\lambda$ a rozptyl je $D(X) = 1/\lambda^2$.

Test založíme na statistice $K = \frac{(n-1)S^2}{M^2}$, která se v případě platnosti H_0 asymptoticky řídí rozložením $\chi^2(n-1)$.

Kritický obor: $W = \langle 0, \chi^2_{\alpha/2}(n-1) \rangle \cup \langle \chi^2_{1-\alpha/2}(n-1), \infty \rangle$.

Jestliže $K \in W$, H_0 zamítáme na asymptotické hladině významnosti α .

5.7. Příklad: Pro data z příkladu 5.2. proveďte na hladině významnosti 0,05 Darlingův test.

Řešení: $n = 45$, $m = 99,93$ h, $s^2 = 7328,9$ h²

Testová statistika: $K = \frac{(n-1)S^2}{M^2} = \frac{44 \cdot 7328,91}{99,93^2} = 32,2924$

Kritický obor:

$W = \langle 0, \chi^2_{\alpha/2}(n-1) \rangle \cup \langle \chi^2_{1-\alpha/2}(n-1), \infty \rangle = \langle 0, \chi^2_{0,025}(44) \rangle \cup \langle \chi^2_{0,975}(44), \infty \rangle = \langle 0,27,575 \rangle \cup \langle 64,202,$

Protože se testová statistika nerealizuje v kritickém oboru, hypotézu o exponenciálním rozložení nezamítáme na asymptotické hladině významnosti 0,05.

5.8. Věta: Jednoduchý test Poissonova rozložení

Testujeme hypotézu, která tvrdí, že náhodný výběr X_1, \dots, X_n pochází z Poissonova rozložení. Označme M výběrový průměr a S^2 výběrový rozptyl tohoto náhodného výběru. Víme, že střední hodnota náhodné veličiny $X \sim \text{Po}(\lambda)$ je $E(X) = \lambda$ a rozptyl je $D(X) = \lambda$.

Test založíme na statistice $K = \frac{(n-1)S^2}{M}$, která se v případě platnosti H_0 asymptoticky řídí rozložením $\chi^2(n-1)$.

Kritický obor: $W = \langle 0, \chi^2_{\alpha/2}(n-1) \rangle \cup \langle \chi^2_{1-\alpha/2}(n-1), \infty \rangle$.

Jestliže $K \in W$, H_0 zamítáme na asymptotické hladině významnosti α .

5.9. Příklad: Pro data z příkladu 5.4. proveďte na hladině významnosti 0,05 jednoduchý test Poissonova rozložení.

Řešení: Nejprve musíme vypočítat realizaci výběrového průměru a výběrového rozptylu:

$$\hat{\lambda} = m = \frac{1}{1200} (79 \cdot 0 + 188 \cdot 1 + 282 \cdot 2 + 275 \cdot 3 + 196 \cdot 4 + 114 \cdot 5 + 45 \cdot 6 + 10 \cdot 7 + 11 \cdot 8) = 2,7992$$

$$s^2 = \frac{1}{1199} [79 \cdot (0 - 2,7992)^2 + 188 \cdot (1 - 2,7992)^2 + \dots + 1 \cdot (10 - 2,7992)^2] = 2,6594$$

$$K = \frac{(n-1)S^2}{M} = \frac{1199 \cdot 2,6594}{2,7882} = 1139,1$$

$$\text{Kritický obor: } W = \langle 0, \chi^2_{\alpha/2}(n-1) \rangle \cup \langle \chi^2_{1-\alpha/2}(n-1), \infty \rangle = \langle 0; 1104,93 \rangle \cup \langle 1296,86; \infty \rangle$$

H_0 nezamítáme na asymptotické hladině významnosti 0,05.

5.10. Poznámka: Darlingův test i jednoduchý test Poissonova rozložení můžeme v MATLABu provést pomocí funkce `darling.m`.

5.11. Poznámka: Pro výpočet kvantilů Pearsonova chí-kvadrát rozložení pro počet stupňů

volnosti nad 30 můžeme použít aproximační vzorec: $\chi^2_\alpha(n) \approx \frac{1}{2} \left(u_\alpha + \sqrt{2n-1} \right)^2$. Pro kvantily z příkladu 5.9. dostáváme:

$$\chi^2_{0,025}(1199) \approx \frac{1}{2} \left(u_{0,025} + \sqrt{2 \cdot 1199 - 1} \right)^2 = \frac{1}{2} \left(-1,96 + \sqrt{2397} \right)^2 = 1104,46$$

$$\chi^2_{0,975}(1199) \approx \frac{1}{2} \left(u_{0,975} + \sqrt{2 \cdot 1199 - 1} \right)^2 = \frac{1}{2} \left(1,96 + \sqrt{2397} \right)^2 = 1296,42$$

5.12. Poznámka: Pro vizuální posouzení, zda naše data pocházejí z exponenciálního rozložení, lze také použít P-P graf.

Způsob konstrukce: spočteme standardizované hodnoty $z_i = \frac{x_i - m}{s}$, $i = 1, \dots, n$ a uspořádáme je podle velikosti $z_{(1)} \leq \dots \leq z_{(n)}$. Na vodorovnou osu vyneseme hodnoty distribuční funkce exponenciálního rozložení $\Phi(z_{(i)}) = 1 - e^{-\lambda z_{(i)}}$, $i = 1, \dots, n$ a na svislou osu hodnoty empirické distribuční funkce $F_n(z_{(i)}) = \frac{i}{n}$, $i = 1, \dots, n$. Pokud se body $(\Phi(z_{(i)}), F(z_{(i)}))$ řadí kolem hlavní diagonály čtverce $[0,1] \times [0,1]$, lze soudit, že data pocházejí z exponenciálního rozložení.