

Parametrické úlohy o dvou nezávislých náhodných výběrech z normálních rozložení

Motivace: V této situaci je naším úkolem porovnat střední hodnoty či rozptyly dvou normálních rozložení na základě znalosti dvou nezávislých náhodných výběrů pořízených z těchto rozložení. Zpravidla konstruujeme intervaly spolehlivosti pro rozdíl středních hodnot respektive hodnotíme shodu středních hodnot pomocí dvouvýběrového t-testu či dvouvýběrového z-testu a shodu rozptylů pomocí F-testu.

Rozložení statistik odvozených z výběrových průměrů a výběrových rozptylů

Máme dva nezávislé náhodné výběry, první pochází z rozložení $N(\mu_1, \sigma_1^2)$ a má rozsah $n_1 \geq 2$, druhý pochází z rozložení $N(\mu_2, \sigma_2^2)$ a má rozsah $n_2 \geq 2$. Označme M_1, M_2 výběrové průměry, S_1^2, S_2^2 výběrové rozptyly a $S_*^2 = \frac{(n_1 - 1)S_1^2 + (n_2 - 1)S_2^2}{n_1 + n_2 - 2}$ vážený průměr výběrových rozptylů.

Pak platí:

a) Statistiky $M_1 - M_2$ a $S_*^2 = \frac{(n_1 - 1)S_1^2 + (n_2 - 1)S_2^2}{n_1 + n_2 - 2}$ jsou stochasticky nezávislé.

b) $U = \frac{M_1 - M_2 - (\mu_1 - \mu_2)}{\sqrt{\frac{\sigma_1^2}{n_1} + \frac{\sigma_2^2}{n_2}}} \sim N(0, 1)$. (Pivotová statistika U slouží k řešení úloh o $\mu_1 - \mu_2$, když σ_1^2 a σ_2^2 známe.)

c) Necht' $\sigma_1^2 = \sigma_2^2 =: \sigma^2$, pak $K = \frac{(n_1 - 1)S_1^2 + (n_2 - 1)S_2^2}{\sigma^2} \sim \chi^2(n_1 + n_2 - 2)$. (Pivotová statistika K slouží k řešení úloh o neznámém rozptylu σ^2 .)

d) Jestliže $\sigma_1^2 = \sigma_2^2 =: \sigma^2$, pak $T = \frac{M_1 - M_2 - (\mu_1 - \mu_2)}{S_* \sqrt{\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}}} \sim t(n_1 + n_2 - 2)$. (Pivotová statistika T slouží k řešení úloh o $\mu_1 - \mu_2$, když σ_1^2 a σ_2^2

neznáme, ale víme, že jsou shodné.)

e) $F = \frac{S_1^2/S_2^2}{\sigma_1^2/\sigma_2^2} \sim F(n_1 - 1, n_2 - 1)$. (Pivotová statistika F slouží k řešení úloh o σ_1^2/σ_2^2 .)

Vysvětlení:

ad b) $M_1 - M_2$ je lineární kombinace náhodných veličin s normálním rozložením, má tedy normální rozložení s parametry

$$E(M_1 - M_2) = \mu_1 - \mu_2,$$

$$D(M_1 - M_2) = \sigma_1^2/n_1 + \sigma_2^2/n_2.$$

U se získá standardizací $M_1 - M_2$.

ad c) $K_1 = \frac{(n_1 - 1) \hat{\sigma}_1^2}{\sigma_1^2} \sim \chi^2(n_1 - 1)$ a $K_2 = \frac{(n_2 - 1) \hat{\sigma}_2^2}{\sigma_2^2} \sim \chi^2(n_2 - 1)$ jsou stochasticky nezávislé náhodné veličiny, tedy $K = K_1 + K_2 \sim \chi^2(n_1 + n_2 - 2)$.

ad d) $U = \frac{M_1 - \mu_1}{\sqrt{\sigma_1^2/n_1}} \sim N(0, 1)$, $K = \frac{(n_1 + n_2 - 2) \hat{S}^2}{\sigma^2} \sim \chi^2(n_1 + n_2 - 2)$ jsou stochasticky nezávislé, protože $M_1 - M_2$ a \hat{S}^2 jsou stochasticky nezávislé.

$T = \frac{U}{\sqrt{K/(n_1 + n_2 - 2)}} = \frac{M_1 - \mu_1}{\hat{S} \sqrt{1/n_1 + 1/n_2}} \sim t(n_1 + n_2 - 2)$.

ad e) $K_1 = \frac{(n_1 - 1) \hat{\sigma}_1^2}{\sigma_1^2} \sim \chi^2(n_1 - 1)$ a $K_2 = \frac{(n_2 - 1) \hat{\sigma}_2^2}{\sigma_2^2} \sim \chi^2(n_2 - 1)$ jsou stochasticky nezávislé náhodné veličiny, tedy

$F = \frac{K_1/n_1}{K_2/n_2} = \frac{S_1^2/S_2^2}{\sigma_1^2/\sigma_2^2} \sim F(n_1 - 1, n_2 - 1)$.

Příklad: Necht' jsou dány dva nezávislé náhodné výběry, první pochází z rozložení $N(0,28; 0,09)$ a má rozsah 16, druhý pochází z rozložení $N(0,25; 0,04)$ a má rozsah 25. Jaká je pravděpodobnost, že výběrový průměr 1. výběru bude větší než výběrový průměr 2. výběru?

Řešení:

$$P(M_1 > M_2) = P(M_1 - M_2 > 0) = P\left(\frac{M_1 - M_2 - 0}{\sqrt{\frac{\sigma_1^2}{n_1} + \frac{\sigma_2^2}{n_2}}} \leq \frac{0}{\sqrt{\frac{\sigma_1^2}{n_1} + \frac{\sigma_2^2}{n_2}}}\right)$$

$$= P\left(\frac{0,28 - 0,25}{\sqrt{\frac{0,09}{16} + \frac{0,04}{25}}} \leq Z \leq \frac{0,28 - 0,25}{\sqrt{\frac{0,09}{16} + \frac{0,04}{25}}}\right) = P(-0,529 \leq Z \leq 0,529) = 0,53683$$

S pravděpodobností přibližně 63,7% je výběrový průměr 1. výběru větší než výběrový průměr 2. výběru.

Výpočet pomocí systému STATISTICA:

Statistika $M_1 - M_2$ se podle bodu (a) řídí rozložením $N(\mu_1 - \mu_2, \frac{\sigma_1^2}{n_1} + \frac{\sigma_2^2}{n_2})$,

kde $\mu_1 - \mu_2 = 0,28 - 0,25 = 0,03$, $\frac{\sigma_1^2}{n_1} + \frac{\sigma_2^2}{n_2} = \frac{0,09}{16} + \frac{0,04}{25} = 0,0072$, tj. statistika $M_1 - M_2 \sim N(0,03; 0,00725)$.

Otevřeme nový datový soubor o jedné proměnné a jednom případě. Do Dlouhého jména této proměnné napíšeme = 1-INormal(0;0,03;sqrt(0,007225)).

V proměnné Prom1 se objeví hodnota 0,637934.

Intervaly spolehlivosti pro parametrické funkce $\mu_1 - \mu_2, \sigma_1^2 / \sigma_2^2$

Uvedeme přehled vzorců pro meze $100(1-\alpha)\%$ empirických intervalů spolehlivosti pro parametrické funkce $\mu_1 - \mu_2, \sigma_1^2 / \sigma_2^2$.

a) Interval spolehlivosti pro $\mu_1 - \mu_2$, když σ_1^2, σ_2^2 známe (využití pivotové statistiky U)

$$\text{Oboustranný: } (d, h) = (m_1 - m_2 - \sqrt{\frac{\sigma_1^2}{n_1} + \frac{\sigma_2^2}{n_2}} u_{1-\alpha/2}, m_1 - m_2 + \sqrt{\frac{\sigma_1^2}{n_1} + \frac{\sigma_2^2}{n_2}} u_{1-\alpha/2})$$

$$\text{Levostranný: } (d, \infty) = (m_1 - m_2 - \sqrt{\frac{\sigma_1^2}{n_1} + \frac{\sigma_2^2}{n_2}} u_{1-\alpha}, \infty)$$

$$\text{Pravostranný: } (-\infty, h) = (-\infty, m_1 - m_2 + \sqrt{\frac{\sigma_1^2}{n_1} + \frac{\sigma_2^2}{n_2}} u_{1-\alpha})$$

b) Interval spolehlivosti pro $\mu_1 - \mu_2$, když σ_1^2, σ_2^2 neznáme, ale víme, že jsou shodné (využití pivotové statistiky T)

Oboustranný:

$$(d, h) = (m_1 - m_2 - S_* \sqrt{\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}} t_{1-\alpha/2}(n_1+n_2-2), m_1 - m_2 + S_* \sqrt{\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}} t_{1-\alpha/2}(n_1+n_2-2))$$

$$\text{Levostranný: } (d, \infty) = (m_1 - m_2 - S_* \sqrt{\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}} t_{1-\alpha}(n_1+n_2-2), \infty)$$

$$\text{Pravostranný: } (-\infty, h) = (-\infty, m_1 - m_2 + S_* \sqrt{\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}} t_{1-\alpha}(n_1+n_2-2))$$

c) Interval spolehlivosti pro společný neznámý rozptyl σ^2 (využití pivotové statistiky K)

$$\text{Oboustranný: } (d, h) = \left(\frac{(n_1 + n_2 - 2)s_*^2}{\chi_{1-\alpha/2}^2(n_1 + n_2 - 2)}, \frac{(n_1 + n_2 - 2)s_*^2}{\chi_{\alpha/2}^2(n_1 + n_2 - 2)} \right)$$

$$\text{Levostranný: } (d, \infty) = \left(\frac{(n_1 + n_2 - 2)s_*^2}{\chi_{1-\alpha}^2(n_1 + n_2 - 2)}, \infty \right)$$

$$\text{Pravostranný: } (-\infty, h) = \left(-\infty, \frac{(n_1 + n_2 - 2)s_*^2}{\chi_{\alpha}^2(n_1 + n_2 - 2)} \right)$$

d) Interval spolehlivosti pro podíl rozptylů $\frac{\sigma_1^2}{\sigma_2^2}$ (využití pivotové statistiky F)

$$\text{Oboustranný: } (d, h) = \left(\frac{s_1^2/s_2^2}{F_{1-\alpha/2}(n_1-1, n_2-1)}, \frac{s_1^2/s_2^2}{F_{\alpha/2}(n_1-1, n_2-1)} \right)$$

$$\text{Levostranný: } (d, \infty) = \left(\frac{s_1^2/s_2^2}{F_{1-\alpha}(n_1-1, n_2-1)}, \infty \right)$$

$$\text{Pravostranný: } (-\infty, h) = \left(-\infty, \frac{s_1^2/s_2^2}{F_{\alpha}(n_1-1, n_2-1)} \right)$$

Upozornění: Není-li v bodě (b) splněn předpoklad o shodě rozptylů, lze sestavit aspoň přibližný $100(1-\alpha)\%$ interval spolehlivosti pro $\mu_1 - \mu_2$.

V tomto případě má statistika T přibližně rozložení $t(\nu)$, kde počet stupňů volnosti $\nu = \frac{s_1^2/n_1 + s_2^2/n_2}{s_1^2/n_1^2 + s_2^2/n_2^2}$. Není-li v celé

číslo, použijeme v tabulkách kvantilů Studentova rozložení lineární interpolaci.

Příklad: Ve dvou nádržích se zkoumal obsah chlóru (v g/l). Z první nádrže bylo odebráno 25 vzorků, z druhé nádrže 10 vzorků. Byly vypočteny realizace výběrových průměrů a rozptylů: $m_1 = 34,48$, $m_2 = 35,59$, $s_1^2 = 1,7482$, $s_2^2 = 1,7121$. Hodnoty zjištěné z odebraných vzorků považujeme za realizace dvou nezávislých náhodných výběrů z rozložení $N(\mu_1, \sigma^2)$ a $N(\mu_2, \sigma^2)$. Sestrojte 95% empirický interval spolehlivosti pro rozdíl středních hodnot $\mu_1 - \mu_2$.

Řešení:

Úloha vede na vzorec z bodu (b). Vypočteme vážený průměr výběrových rozptylů a najdeme odpovídající kvantily Studentova rozložení:

$$S_*^2 = \frac{(n_1 - 1)s_1^2 + (n_2 - 1)s_2^2}{n_1 + n_2 - 2} = \frac{24 \cdot 1,7482 + 9 \cdot 1,7121}{33} = 1,738, \quad t_{0,975}(33) = 2,035$$

Dosadíme do vzorců pro dolní a horní mez intervalu spolehlivosti:

$$d = m_1 - m_2 - S_* \sqrt{\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}} \cdot t_{1-\alpha/2}(n_1+n_2-2) =$$

$$= 34,48 - 35,59 - \sqrt{1,738} \cdot \sqrt{\frac{1}{25} + \frac{1}{10}} \cdot 2,035 = -2,114$$

$$h = m_1 - m_2 + S_* \sqrt{\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}} \cdot t_{1-\alpha/2}(n_1+n_2-2) =$$

$$= 34,48 - 35,59 + \sqrt{1,738} \cdot \sqrt{\frac{1}{25} + \frac{1}{10}} \cdot 2,035 = -0,106$$

$-2,114 \text{ g/l} < \mu_1 - \mu_2 < -0,106 \text{ g/l}$ s pravděpodobností aspoň 0,95.

Výpočet pomocí systému STATISTICA:

Otevřeme nový datový soubor o dvou proměnných d a h a jednom případě.

Do Dlouhého jména proměnné d napíšeme

$$=34,48-35,59-\text{sqrt}((24*1,7482+9*1,7121)/33)*\text{sqrt}((1/25)+(1/10))*\text{VStudent}(0,975;33)$$

Do Dlouhého jména proměnné h napíšeme

$$=34,48-35,59+$$

$$\text{sqrt}((24*1,7482+9*1,7121)/33)*\text{sqrt}((1/25)+(1/10))*\text{VStudent}(0,975;33)$$

	d	h
1	-2,114	-0,106

S pravděpodobností aspoň 0,95 tedy $-2,114 \text{ g/l} < \mu_1 - \mu_2 < -0,106 \text{ g/l}$.

Příklad: V předešlém příkladě nyní předpokládáme, že dané dva náhodné výběry pocházejí z rozložení $N(\mu_1, \sigma_1^2)$ a $N(\mu_2, \sigma_2^2)$. Sestrojte 95% empirický interval spolehlivosti pro podíl rozptylů.

Řešení:

Úloha vede na vzorec z bodu (d).

$$d = \frac{s_1^2/s_2^2}{F_{1-\alpha/2}(n_1-1, n_2-1)} = \frac{1,7482/1,7121}{F_{0,975}(24;9)} = \frac{1,0199}{3,6142} = 0,28$$

$$h = \frac{s_1^2/s_2^2}{F_{\alpha/2}(n_1-1, n_2-1)} = \frac{1,7482/1,7121}{F_{0,025}(24;9)} = \frac{1,0199}{0,3671} = 2,76$$

0,28 < σ_1^2/σ_2^2 < 2,76 s pravděpodobností aspoň 0,95.

Výpočet pomocí systému STATISTICA:

Otevřeme nový datový soubor o dvou proměnných d a h a jednom případě.

Do Dlouhého jména proměnné d napíšeme

$$=(1,7482/1,7121)/VF(0,975;24;9)$$

(Funkce VF(x;ný;omega) počítá x-quantil Fisherova – Snedecorova rozložení F(ný, omega).)

Do Dlouhého jména proměnné h napíšeme

$$=(1,7482/1,7121)/VF(0,025;24;9)$$

	1	2
	d	h
1	0,282	2,759

S pravděpodobností aspoň 0,95 tedy platí: $0,28 < \sigma_1^2/\sigma_2^2 < 2,76$.

Jednotlivé typy testů o parametrických funkcích $\mu_1 - \mu_2$, σ_1^2/σ_2^2

a) Necht' X_{11}, \dots, X_{1n_1} je náhodný výběr z rozložení $N(\mu_1, \sigma_1^2)$ a X_{21}, \dots, X_{2n_2} je na něm nezávislý náhodný výběr z rozložení $N(\mu_2, \sigma_2^2)$, přičemž $n_1 \geq 2$, $n_2 \geq 2$ a σ_1^2, σ_2^2 známe. Necht' c je konstanta.

Test $H_0: \mu_1 - \mu_2 = c$ proti $H_1: \mu_1 - \mu_2 \neq c$ se nazývá **dvouvýběrový z-test**.

b) Necht' X_{11}, \dots, X_{1n_1} je náhodný výběr z rozložení $N(\mu_1, \sigma^2)$ a X_{21}, \dots, X_{2n_2} je na něm nezávislý náhodný výběr rozložení $N(\mu_2, \sigma^2)$, přičemž $n_1 \geq 2$ a $n_2 \geq 2$ a σ^2 neznáme. Necht' c je konstanta.

Test $H_0: \mu_1 - \mu_2 = c$ proti $H_1: \mu_1 - \mu_2 \neq c$ se nazývá **dvouvýběrový t-test**.

c) Necht' X_{11}, \dots, X_{1n_1} je náhodný výběr z rozložení $N(\mu_1, \sigma_1^2)$ a X_{21}, \dots, X_{2n_2} je na něm nezávislý náhodný výběr rozložení $N(\mu_2, \sigma_2^2)$, přičemž $n_1 \geq 2$ a $n_2 \geq 2$. Test $H_0: \frac{\sigma_1^2}{\sigma_2^2} = 1$ proti $H_1: \frac{\sigma_1^2}{\sigma_2^2} \neq 1$ se nazývá **F-test**.

Provedení testů o parametrických funkcích $\mu_1 - \mu_2, \sigma_1^2 / \sigma_2^2$ pomocí kritického oboru

a) Provedení dvouvýběrového z-testu

Vypočteme realizaci testového kritéria $t_0 = \frac{\bar{x}_1 - \bar{x}_2 - c}{\sqrt{\frac{\sigma_1^2}{n_1} + \frac{\sigma_2^2}{n_2}}}$.

Stanovíme kritický obor W .

Pokud $t_0 \in W$, H_0 zamítáme na hladině významnosti α a přijímáme H_1 .

Oboustranný test: Testujeme $H_0: \mu_1 - \mu_2 = c$ proti $H_1: \mu_1 - \mu_2 \neq c$. Kritický obor má tvar: $W = (-\infty, u_{1-\alpha/2}) \cup (u_{\alpha/2}, \infty)$.

Levostranný test: Testujeme $H_0: \mu_1 - \mu_2 = c$ proti $H_1: \mu_1 - \mu_2 < c$. Kritický obor má tvar: $W = (-\infty, u_{1-\alpha})$.

Pravostranný test: Testujeme $H_0: \mu_1 - \mu_2 = c$ proti $H_1: \mu_1 - \mu_2 > c$. Kritický obor má tvar: $W = (u_{1-\alpha}, \infty)$.

b) Provedení dvouvýběrového t-testu

Vypočteme realizaci testového kritéria $t_0 = \frac{\bar{x}_1 - \bar{x}_2 - c}{s^* \sqrt{\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}}}$.

Stanovíme kritický obor W .

Pokud $t_0 \in W$, H_0 zamítáme na hladině významnosti α a přijímáme H_1 .

Oboustranný test: Testujeme $H_0: \mu_1 - \mu_2 = c$ proti $H_1: \mu_1 - \mu_2 \neq c$. Kritický obor má tvar:

$$W = (-\infty, -t_{1-\alpha/2, n_1+n_2-2}] \cup [t_{1-\alpha/2, n_1+n_2-2}, \infty).$$

Levostranný test: Testujeme $H_0: \mu_1 - \mu_2 = c$ proti $H_1: \mu_1 - \mu_2 < c$. Kritický obor má tvar:

$$W = (-\infty, -t_{1-\alpha, n_1+n_2-2}).$$

Pravostranný test: Testujeme $H_0: \mu_1 - \mu_2 = c$ proti $H_1: \mu_1 - \mu_2 > c$. Kritický obor má tvar:

$$W = [t_{1-\alpha, n_1+n_2-2}, \infty).$$

c) Provedení F-testu

Vypočteme realizaci testového kritéria $t_0 = \frac{s^2}{\sigma_0^2}$.

Stanovíme kritický obor W .

Pokud $t_0 \in W$, H_0 zamítáme na hladině významnosti α a přijímáme H_1 .

Oboustranný test: Testujeme $H_0: \sigma = 1$ proti $H_1: \sigma \neq 1$. Kritický obor má tvar:

$$W = \left(0, F_{\alpha/2}(n_1-1, n_2-1)\right) \cup \left(F_{1-\alpha/2}(n_1-1, n_2-1), \infty\right)$$

Levostranný test: Testujeme $H_0: \sigma = 1$ proti $H_1: \sigma < 1$. Kritický obor má tvar: $W = \left(0, F_{1-\alpha}(n_1-1, n_2-1)\right)$.

Pravostranný test: Testujeme $H_0: \sigma = 1$ proti $H_1: \sigma > 1$. Kritický obor má tvar: $W = \left(F_{1-\alpha}(n_1-1, n_2-1), \infty\right)$.

Příklad: V restauraci "U bílého koníčka" měřili ve 20 případech čas obsluhy zákazníka. Výsledky v minutách: 6, 8, 11, 4, 7, 6, 10, 6, 9, 8, 5, 12, 13, 10, 9, 8, 7, 11, 10, 5. V restauraci "Zlatý lev" bylo dané pozorování uskutečněno v 15 případech s těmito výsledky: 9, 11, 10, 7, 6, 4, 8, 13, 5, 15, 8, 5, 6, 8, 7. Za předpokladu, že uvedené hodnoty pocházejí ze dvou normálních rozložení, na hladině významnosti 0,05 testujte hypotézu, že střední hodnoty doby obsluhy jsou v obou restauracích stejné.

Řešení:

Na hladině významnosti 0,05 testujeme nulovou hypotézu $H_0: \mu_1 - \mu_2 = 0$ proti oboustranné alternativě $H_1: \mu_1 - \mu_2 \neq 0$. Je to úloha na dvouvýběrový t-test. Před provedením tohoto testu je však nutné pomocí F-testu ověřit shodu rozptylů. Na hladině významnosti 0,05 tedy testujeme $H_0:$

$\sigma_1^2 = 1$ proti $H_1: \sigma_1^2 \neq 1$. Nejprve vypočteme $m_1 = 8,25$, $m_2 = 8,13$, $s_1^2 = 6,307$, $s_2^2 = 9,41$,

$$s_*^2 = \frac{(n_1 - 1)s_1^2 + (n_2 - 1)s_2^2}{n_1 + n_2 - 2} = \frac{19 \cdot 6,307 + 14 \cdot 9,41}{33} = 7,623. \text{ Podle vzorce z bodu (c) vypočteme realizaci testové statistiky:}$$

$$t_0 = \frac{m_1 - m_2}{s_* \sqrt{\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}}} = \frac{8,25 - 8,13}{\sqrt{7,623} \sqrt{\frac{1}{20} + \frac{1}{15}}} = 0,2. \text{ Stanovíme kritický obor:}$$

$$W = \left(F_{\alpha/2, n_1 - 1, n_2 - 1} \cup F_{1 - \alpha/2, n_1 - 1, n_2 - 1}, \infty \right) \cup \left(0, F_{0,025, 19, 14} \cup F_{0,975, 19, 14}, \infty \right) \\ = \left(0,1/F_{0,975, 14, 19} \cup F_{0,975, 19, 14}, \infty \right) \cup \left(0,1/26,469, 28,607 \cup 0,03778, 28,607, \infty \right)$$

Protože se testová statistika nerealizuje v kritickém oboru, nulovou hypotézu nezamítáme na hladině významnosti 0,05. Rozptyly tedy můžeme považovat za shodné.

Nyní se vrátíme k dvouvýběrovému t-testu. Podle vzorce z bodu (b) vypočteme realizaci testové statistiky:

$$t_0 = \frac{m_1 - m_2}{s_* \sqrt{\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}}} = \frac{8,25 - 8,13}{\sqrt{7,623} \sqrt{\frac{1}{20} + \frac{1}{15}}} = 0,2.$$

Stanovíme kritický obor:

$$W = \left(t_{1 - \alpha/2, n_1 + n_2 - 2} \cup t_{\alpha/2, n_1 + n_2 - 2}, \infty \right) \cup \left(-\infty, t_{0,975, 33} \cup t_{0,975, 33}, \infty \right) \\ = \left(-\infty, 2,035 \cup 2,035, \infty \right) \cup \left(-\infty, 3,3 \cup 3,3, \infty \right)$$

Protože testová statistika se nerealizuje v kritickém oboru, nulovou hypotézu nezamítáme na hladině významnosti 0,05.

Výpočet pomocí systému STATISTICA:

Otevřeme nový datový soubor o dvou proměnných a 35 případech. První proměnnou nazveme OBSLUHA, druhou ID. Do proměnné OBSLUHA napíšeme nejprve doby obsluhy v první restauraci a poté doby obsluhy ve druhé restauraci. Do proměnné ID, která slouží k rozlišení první a druhé restaurace, napíšeme 20 krát jedničku a 15 krát dvojku.

Provedeme dvouvýběrový t-test současně s testem o shodě rozptylů: Statistika – Základní statistiky a tabulky – t-test, nezávislé, dle skupin – OK, Proměnné – Závislé proměnné OBSLUHA, Grupovací proměnná ID – OK.

Po kliknutí na tlačítko Souhrn dostaneme tabulku

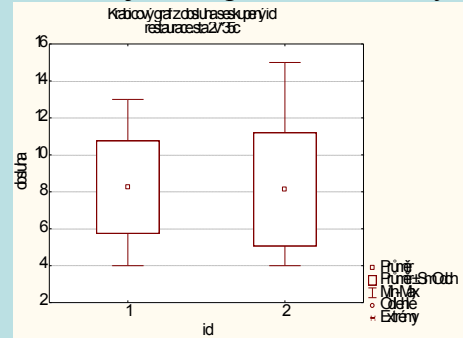
t-testy; grupovano: ID (restaurace)											
Skup. 1: 1											
Skup. 2: 2											
Proměr	Prům. 1	Prům. 2	t	s\	p	Poč.p 1	Poč.p 2	Sm.od 1	Sm.od 2	F-por rozpty	p rozpty
OBSLU	8,250	8,133	0,123	3	0,902	20	15	2,510	3,067	1,492	0,410

Vidíme, že testová statistika pro test shody rozptylů se realizuje hodnotou 1,492952 (je to převrácená hodnota k číslu 0,6702, které jsme vypočítali při ručním postupu), odpovídající p-hodnota je 0,41044, tedy na hladině významnosti 0,05 nezamítáme hypotézu o shodě rozptylů.

(Upozornění: v případě zamítnutí hypotézy o shodě rozptylů je zapotřebí v tabulce t-testu pro nezávislé vzorky dle skupin zaškrtnout volbu Test se samostatnými odhady rozptylu.)

Dále z tabulky plyne, že testová statistika pro test shody středních hodnot se realizuje hodnotou 0,12373, počet stupňů volnosti je 33, odpovídající p-hodnota 0,902279, tedy hypotézu o shodě středních hodnot nezamítáme na hladině významnosti 0,05. Znamená to, že s rizikem omylu nejvýše 5% se neprokázal rozdíl ve středních hodnotách dob obsluhy v restauracích "U bílého koníčka" a „Zlatý lev“.

Tabulku ještě doplníme krabicovými diagramy. Na záložce Details zaškrtneme krabicový graf a vybereme volbu Průměr/SmOdch/Min-Max.



Z grafu je vidět, že průměrná doba obsluhy v první restauraci je nepatrně delší a má menší variabilitu než ve druhé restauraci. Extrémní ani odlehle hodnoty se zde nevyskytují.

Cohenův koeficient věcného účinku – doplnění významu dvouvýběrového t-testu:

Nechť X_{11}, \dots, X_{1n_1} je náhodný výběr z rozložení $N(\mu_1, \sigma^2)$ a X_{21}, \dots, X_{2n_2} je na něm nezávislý náhodný výběr rozložení $N(\mu_2, \sigma^2)$, přičemž $n_1 \geq 2$ a $n_2 \geq 2$ a σ^2 neznáme. Nechť c je konstanta.

Testujeme $H_0: \mu_1 - \mu_2 = 0$ proti $H_1: \mu_1 - \mu_2 \neq 0$. Označme m_1, m_2 realizace výběrových průměrů hodnot dané veličiny v těchto dvou skupinách,

s_1^2, s_2^2 realizace výběrových rozptylů a $S_*^2 = \frac{n_1 - 1}{n_1 + n_2 - 2} s_1^2 + \frac{n_2 - 1}{n_1 + n_2 - 2} s_2^2$ realizaci váženého průměru výběrových rozptylů.

Cohenův koeficient d vypočteme podle vzorce: $d = \frac{m_1 - m_2}{S_*}$.

Tento koeficient slouží k posouzení velikosti rozdílu průměrů, který je standardizován pomocí odmocniny z váženého průměru výběrových rozptylů. Jedná se o tzv. **věcnou významnost** neboli **velikost účinku** skupiny na variabilitu hodnot sledované náhodné veličiny. Velikost účinku hodnotíme podle následující tabulky:

Hodnota d	účinek
aspoň 0,8	velký
mezi 0,5 až 0,8	střední
mezi 0,2 až 0,5	malý
pod 0,2	zanedbatelný

(Uvedené hodnoty nemají samozřejmě absolutní platnost, posouzení, jaký účinek považujeme za velký či malý, závisí na kontextu.)

Je zapotřebí si uvědomit, že při dostatečně velkých rozsazích náhodných výběrů i malý rozdíl ve výběrových průměrech způsobí zamítnutí nulové hypotézy na hladině významnosti α , i když z věcného hlediska tak malý rozdíl nemá význam. Naopak, máme-li výběry malých rozsahů, pak i značně velký rozdíl ve výběrových průměrech nemusí vést k zamítnutí nulové hypotézy na hladině významnosti α .

Příklad:

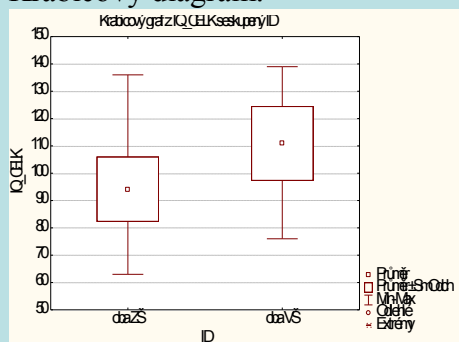
Máme k dispozici údaje o celkovém IQ 856 žáků ZŠ. Zajímáme se jednak o skupinu dětí, jejichž oba rodiče mají pouze základní vzdělání (je jich 296) a jednak o skupinu dětí, jejichž oba rodiče mají vysokoškolské vzdělání (těch je 75). Na hladině významnosti 0,05 budeme testovat hypotézu, že střední hodnota celkového IQ je v obou skupinách stejná a také vypočteme Cohenův koeficient věcného účinku.

Řešení: Provedeme dvouvýběrový t-test:

t-testy; grupovano: ZS a VS (IQ)											
Skup. 1: oba ZS											
Skup. 2: oba VS											
Promě	Prum. oba Z	Prum. oba V	t	sv	p	Poc. p oba Z	Poc. pl oba V	Sm. od. oba Z	Sm. od. oba V	F-pon. Rozpt'	p Rozpt'
IQ CE	94,13	110,9	-10,6	36	0,000	29	7	11,82	13,60	1,322	0,110

Hypotézu o shodě středních hodnot zamítáme na hladině významnosti 0,05, protože odpovídající p-hodnota je velmi blízká 0 (hypotézu o shodě rozptylů nezamítáme na hladině významnosti 0,05, p-hodnota F-testu je 0,110124, což je větší než 0,05).

Krabicový diagram:



Vidíme, že průměrné celkové IQ dětí v 1. skupině je 94,1, zatímco ve 2. skupině 110,9. Vliv skupiny na variabilitu hodnot celkového IQ posoudíme pomocí Cohenova koeficientu.

	1	2	3	4	5	6	7
	n1	n2	m1	m2	s1	s2	d
1	29	7	94,13	110,9	11,82	13,60	1,374

Cohenův koeficient nabývá hodnoty 1,37, tudíž vliv skupiny na variabilitu hodnot celkového IQ lze považovat za velký.

Příklad: Výrobce limonád chtěl zjistit, zda změna technologie výroby se projeví v prodeji limonád. Proto sledoval po 14 náhodně vybraných dnů před zavedením nových limonád tržby v určitém regionu a zjistil, že za den utržil v průměru 39 600 Kč se směrodatnou odchylkou 5 060 Kč. Po zavedení nových limonád prověřil stejným způsobem tržby v 11 náhodně vybraných dnech v témž regionu a zjistil průměrný příjem 41 200 Kč se směrodatnou odchylkou 4 310 Kč. Předpokládejte, že tržby za starý typ limonád se řídí rozložením $N(\mu_1, \sigma^2)$ a tržby za nový typ limonád se řídí rozložením $N(\mu_2, \sigma^2)$. Na hladině významnosti 0,05 testujte hypotézu $H_0: \mu_1 - \mu_2 = 0$ proti oboustranné alternativě $H_1: \mu_1 - \mu_2 \neq 0$.

Řešení:

Za odhad společného neznámého rozptylu vezmeme vážený průměr výběrových rozptylů:

$$s_*^2 = \frac{13 \cdot 5060^2 + 11 \cdot 4310^2}{23} = 2548,265$$

Realizace testového kritéria:

$$t_0 = \frac{39600 - 41200}{s_* \sqrt{\frac{1}{14} + \frac{1}{11}}} = \frac{-1600}{22548,265 \sqrt{\frac{1}{14} + \frac{1}{11}}} = -0,36$$

Kritický obor:

$$W = (-\infty, t_{1-\alpha/2, n_1+n_2-2}) \cup (t_{\alpha/2, n_1+n_2-2}, \infty) = (-\infty, t_{0,975, 23}) \cup (t_{0,975, 23}, \infty) = (-20687, 20687)$$

Protože testové kritérium se nerealizuje v kritickém oboru, na hladině významnosti 0,05 nelze zamítnout hypotézu o shodě středních hodnot.

Výpočet pomocí systému STATISTICA:

Statistiky – Základní statistiky a tabulky – Testy rozdílů: r, %, průměry – OK – vybereme Rozdíl mezi dvěma průměry (normální rozdělení) – do políčka Pr1 napíšeme 39600, do políčka SmOd1 napíšeme 5600, do políčka N1 napíšeme 14, do políčka Pr2 napíšeme 41200, do políčka SmOd2 napíšeme 4310, do políčka N2 napíšeme 14 - Výpočet. Dostaneme p-hodnotu 0,4116 tedy nezamítáme nulovou hypotézu na hladině významnosti 0,05.

Testy rozdílů: r, %, průměry: pr6121

Poslat/tisknout výsledky každ. výpočtu do okna protokolu Storno

Rozdíl mezi dvěma korelačními koeficienty

r1: 0,00 N1: 10 r2: 0,00 N2: 10 p: 1,0000 Jednostr. Oboustr. Výpočet

Rozdíl mezi dvěma průměry (normální rozdělení)

Pr1: 39600 SmOd1: 5060 N1: 14 p: .4116 Výpočet

Pr2: 41200 SmOd2: 4310 N2: 11 Jednostr. Oboustr.

Výběrový průměr vs. střední hodnota

Rozdíl mezi dvěma poměry

P 1: .50000 N1: 10 P 2: .50000 N2: 10 p: 1,0000 Jednostr. Oboustr. Výpočet

Jelikož p-hodnota je větší než hladina významnosti 0,05, H_0 nezamítáme na hladině významnosti 0,05. Znamená to, že změna technologie výroby se neprojevila ve střední hodnotě tržeb.