

Základy stochastiky

XII. Testování hypotéz

Prof. RNDr. Gejza Dohnal, CSc.



Jednovýběrový test o střední hodnotě

$$H_0 : \mu = m_0$$

- Nulová hypotéza

Jednovýběrový test o střední hodnotě

$$H_0 : \mu = m_0$$

- Nulová hypotéza

$$H_A : \mu \neq m_0$$

- Alternativní hypotéza

Jednovýběrový test o střední hodnotě

$$H_0 : \mu = m_0$$

- Nulová hypotéza

$$H_A : \mu \neq m_0$$

- Alternativní hypotéza

$$T = \frac{\bar{X} - m_0}{s} \sqrt{n}$$

- Testová statistika

- má t-rozdělení o (n-1) stupních volnosti

Jednovýběrový test o střední hodnotě

$$H_0 : \mu = m_0$$

$$H_A : \mu \neq m_0$$

- Nulová hypotéza

- Alternativní hypotéza

$$T = \frac{\bar{X} - m_0}{s} \sqrt{n}$$

- Testová statistika

- má t-rozdělení o (n-1) stupních volnosti

$$\alpha \Rightarrow t_\alpha(n-1)$$

- hladina významnosti, kritická hodnota

Jednovýběrový test o střední hodnotě

$$H_0 : \mu = m_0$$

- Nulová hypotéza

$$H_A : \mu \neq m_0$$

- Alternativní hypotéza

$$T = \frac{\bar{X} - m_0}{s} \sqrt{n}$$

- Testová statistika

- má t-rozdělení o (n-1) stupních volnosti

$$\alpha \Rightarrow t_\alpha(n-1)$$

- hladina významnosti, kritická hodnota

$$|T| \geq t_\alpha(n-1)$$

- rozhodovací pravidlo

Jednovýběrový test o střední hodnotě

$$H_0 : \mu = m_0$$

- Nulová hypotéza

$$H_A : \mu \neq m_0$$

- Alternativní hypotéza

$$T = \frac{\bar{X} - m_0}{s} \sqrt{n}$$

- Testová statistika

- má t-rozdělení o (n-1) stupních volnosti

$$\alpha \Rightarrow t_\alpha(n-1)$$

- hladina významnosti, kritická hodnota

$$|T| \geq t_\alpha(n-1)$$

- rozhodovací pravidlo

Nulová hypotéza se nepřijímá, pouze zamítá či nezamítá!

Statisticky nelze nic dokázat, pouze zamítnout!

Jednovýběrový test o střední hodnotě

$$H_0 : \mu = m_0$$

- Nulová hypotéza

$$H_A : \mu \neq m_0$$

- Alternativní hypotéza

$$T = \frac{\bar{X} - m_0}{s} \sqrt{n}$$

- Testová statistika

- má t-rozdělení o (n-1) stupních volnosti

$$\alpha \Rightarrow t_\alpha(n-1)$$

- hladina významnosti, kritická hodnota

$$|T| \geq t_\alpha(n-1)$$

- rozhodovací pravidlo

Nulová hypotéza se nepřijímá, pouze zamítá či nezamítá!

Statisticky nelze nic dokázat, pouze zamítnout!

$$\left| \frac{\bar{X} - m_0}{s} \sqrt{n} \right| \geq t_\alpha(n-1)$$

Jednovýběrový test o střední hodnotě

$$H_0 : \mu = m_0$$

- Nulová hypotéza

$$H_A : \mu \neq m_0$$

- Alternativní hypotéza

$$T = \frac{\bar{X} - m_0}{s} \sqrt{n}$$

- Testová statistika

- má t-rozdělení o (n-1) stupních volnosti

$$\alpha \Rightarrow t_\alpha(n-1)$$

- hladina významnosti, kritická hodnota

$$|T| \geq t_\alpha(n-1)$$

- rozhodovací pravidlo

Nulová hypotéza se nepřijímá, pouze zamítá či nezamítá!

Statisticky nelze nic dokázat, pouze zamítnout!

$$\left| \frac{\bar{X} - m_0}{s} \sqrt{n} \right| \geq t_\alpha(n-1) \Leftrightarrow \frac{\bar{X} - m_0}{s} \sqrt{n} \notin \langle -t_\alpha(n-1), t_\alpha(n-1) \rangle$$

Jednovýběrový test o střední hodnotě

$$H_0 : \mu = m_0$$

$$H_A : \mu \neq m_0$$

- Nulová hypotéza

- Alternativní hypotéza

$$T = \frac{\bar{X} - m_0}{s} \sqrt{n}$$

- Testová statistika

- má t-rozdělení o (n-1) stupních volnosti

$$\alpha \Rightarrow t_\alpha(n-1)$$

- hladina významnosti, kritická hodnota

$$|T| \geq t_\alpha(n-1)$$

- rozhodovací pravidlo

Nulová hypotéza se nepřijímá, pouze zamítá či nezamítá!

Statisticky nelze nic dokázat, pouze zamítnout!

$$\left| \frac{\bar{X} - m_0}{s} \sqrt{n} \right| \geq t_\alpha(n-1) \Leftrightarrow \frac{\bar{X} - m_0}{s} \sqrt{n} \notin \langle -t_\alpha(n-1), t_\alpha(n-1) \rangle$$

$$\bar{X} - m_0 \notin \left\langle -\frac{s}{\sqrt{n}} t_\alpha(n-1), \frac{s}{\sqrt{n}} t_\alpha(n-1) \right\rangle$$

Jednovýběrový test o střední hodnotě

$$H_0 : \mu = m_0$$

$$H_A : \mu \neq m_0$$

- Nulová hypotéza

- Alternativní hypotéza

$$T = \frac{\bar{X} - m_0}{s} \sqrt{n}$$

- Testová statistika

- má t-rozdělení o $(n-1)$ stupních volnosti

$$\alpha \Rightarrow t_\alpha(n-1)$$

- hladina významnosti, kritická hodnota

$$|T| \geq t_\alpha(n-1)$$

- rozhodovací pravidlo

Nulová hypotéza se nepřijímá, pouze zamítá či nezamítá!

Statisticky nelze nic dokázat, pouze zamítnout!

$$\left| \frac{\bar{X} - m_0}{s} \sqrt{n} \right| \geq t_\alpha(n-1) \Leftrightarrow \frac{\bar{X} - m_0}{s} \sqrt{n} \notin \langle -t_\alpha(n-1), t_\alpha(n-1) \rangle$$

$$\bar{X} - m_0 \notin \left\langle -\frac{s}{\sqrt{n}} t_\alpha(n-1), \frac{s}{\sqrt{n}} t_\alpha(n-1) \right\rangle$$

$$\bar{X} \notin \left\langle m_0 - \frac{s}{\sqrt{n}} t_\alpha(n-1), m_0 + \frac{s}{\sqrt{n}} t_\alpha(n-1) \right\rangle$$

Hmotnosti obsahu balení, dávkovaného automatem:

Lze považovat automat za správně seřízený ($m_0=25,0\text{g}$)?

Hmotnosti obsahu balení, dávkovaného automatem:

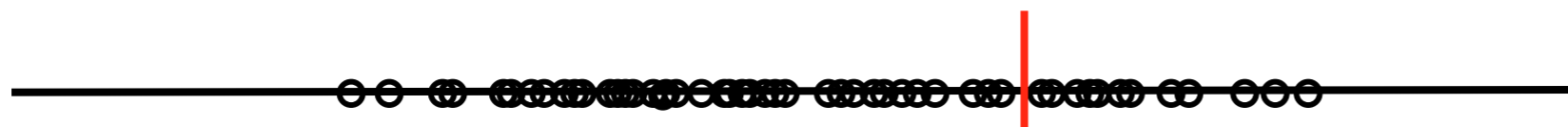
Lze považovat automat za správně seřízený ($m_0=25,0\text{g}$)?

24.52586	24.17119
24.54486	24.44240
23.93455	24.20389
24.19974	24.34851
23.94024	24.21022
24.87474	25.06155
25.48924	25.32572
23.71721	24.61622
25.06676	24.90055
24.36213	24.98580
24.80591	24.20853
24.72623	24.64437
24.70405	23.97645
25.29837	24.46910
24.99453	25.42994
24.66147	24.75773
25.03970	24.44901
25.13285	24.40205
24.78721	23.83656
24.17186	23.65390
24.48244	24.68550
24.22988	23.83956
24.09777	24.52098
24.89240	24.25332
24.14259	25.12906

Hmotnosti obsahu balení, dávkovaného automatem:

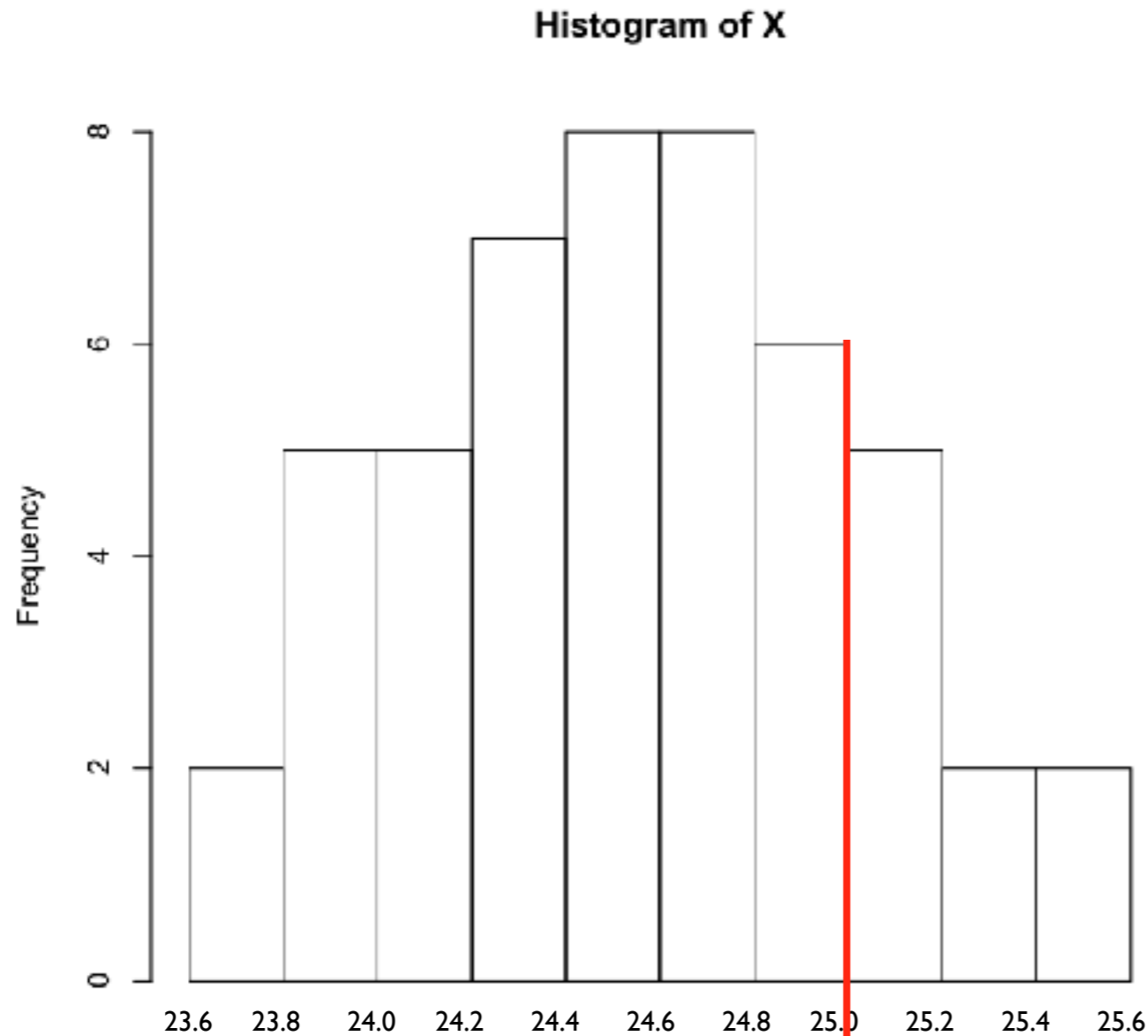
Lze považovat automat za správně seřízený ($m_0=25,0\text{g}$)?

24.52586	24.17119
24.54486	24.44240
23.93455	24.20389
24.19974	24.34851
23.94024	24.21022
24.87474	25.06155
25.48924	25.32572
23.71721	24.61622
25.06676	24.90055
24.36213	24.98580
24.80591	24.20853
24.72623	24.64437
24.70405	23.97645
25.29837	24.46910
24.99453	25.42994
24.66147	24.75773
25.03970	24.44901
25.13285	24.40205
24.78721	23.83656
24.17186	23.65390
24.48244	24.68550
24.22988	23.83956
24.09777	24.52098
24.89240	24.25332
24.14259	25.12906

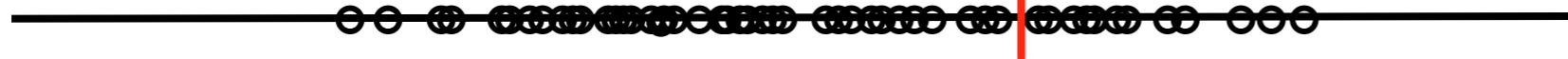


Hmotnosti obsahu balení, dávkovaného automatem:

Lze považovat automat za správně seřízený ($m_0=25,0g$)?

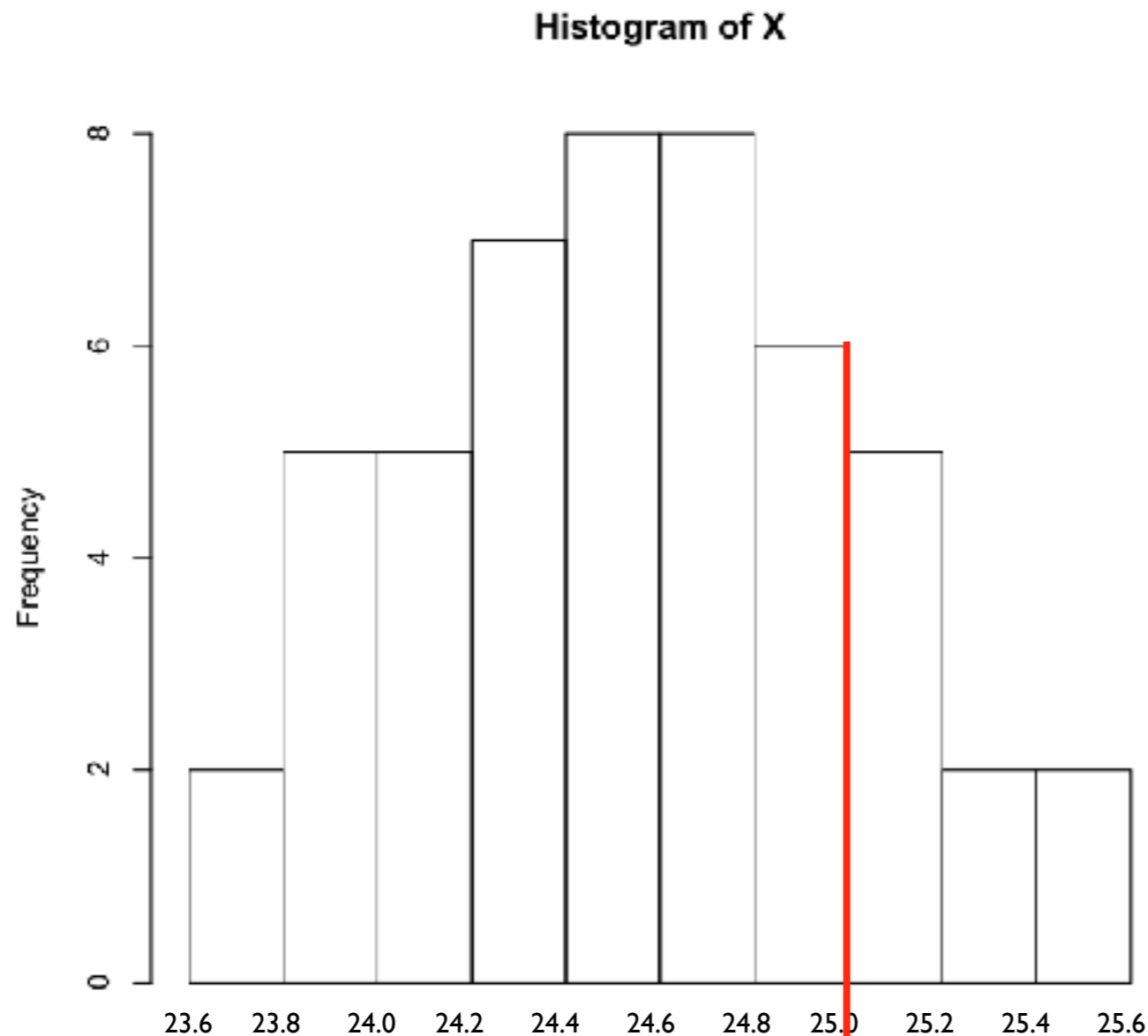


24.52586	24.17119
24.54486	24.44240
23.93455	24.20389
24.19974	24.34851
23.94024	24.21022
24.87474	25.06155
25.48924	25.32572
23.71721	24.61622
25.06676	24.90055
24.36213	24.98580
24.80591	24.20853
24.72623	24.64437
24.70405	23.97645
25.29837	24.46910
24.99453	25.42994
24.66147	24.75773
25.03970	24.44901
25.13285	24.40205
24.78721	23.83656
24.17186	23.65390
24.48244	24.68550
24.22988	23.83956
24.09777	24.52098
24.89240	24.25332
24.14259	25.12906



Hmotnosti obsahu balení, dávkovaného automatem:

Lze považovat automat za správně seřízený ($m_0=25,0g$)?

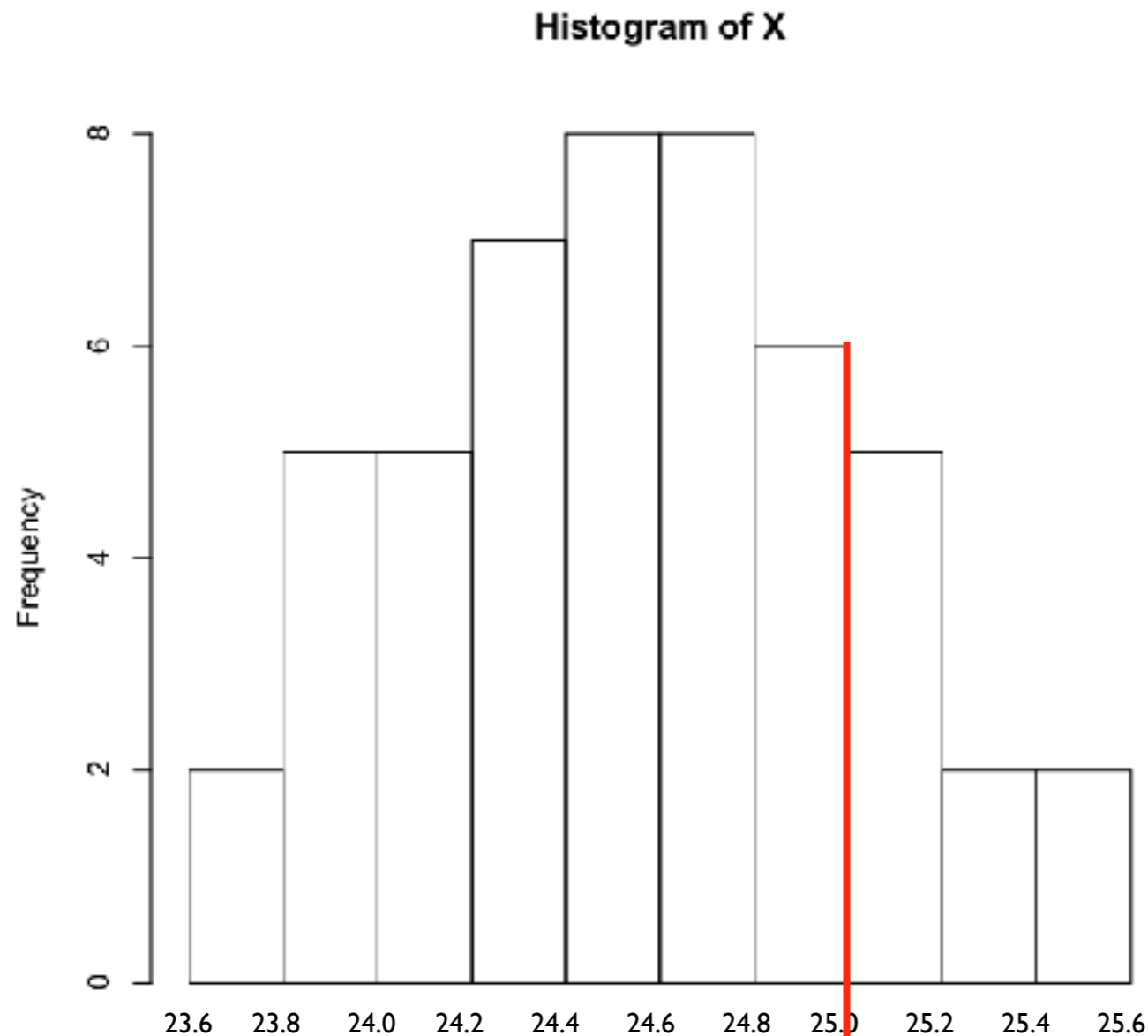


24.52586	24.17119
24.54486	24.44240
23.93455	24.20389
24.19974	24.34851
23.94024	24.21022
24.87474	25.06155
25.48924	25.32572
23.71721	24.61622
25.06676	24.90055
24.36213	24.98580
24.80591	24.20853
24.72623	24.64437
24.70405	23.97645
25.29837	24.46910
24.99453	25.42994
24.66147	24.75773
25.03970	24.44901
25.13285	24.40205
24.78721	23.83656
24.17186	23.65390
24.48244	24.68550
24.22988	23.83956
24.09777	24.52098
24.89240	24.25332
24.14259	25.12906

$\bar{X} = 24.55, s^2(X) = 0.21, s(X) = 0.46, n = 50$

Hmotnosti obsahu balení, dávkovaného automatem:

Lze považovat automat za správně seřízený ($m_0=25,0\text{g}$)?



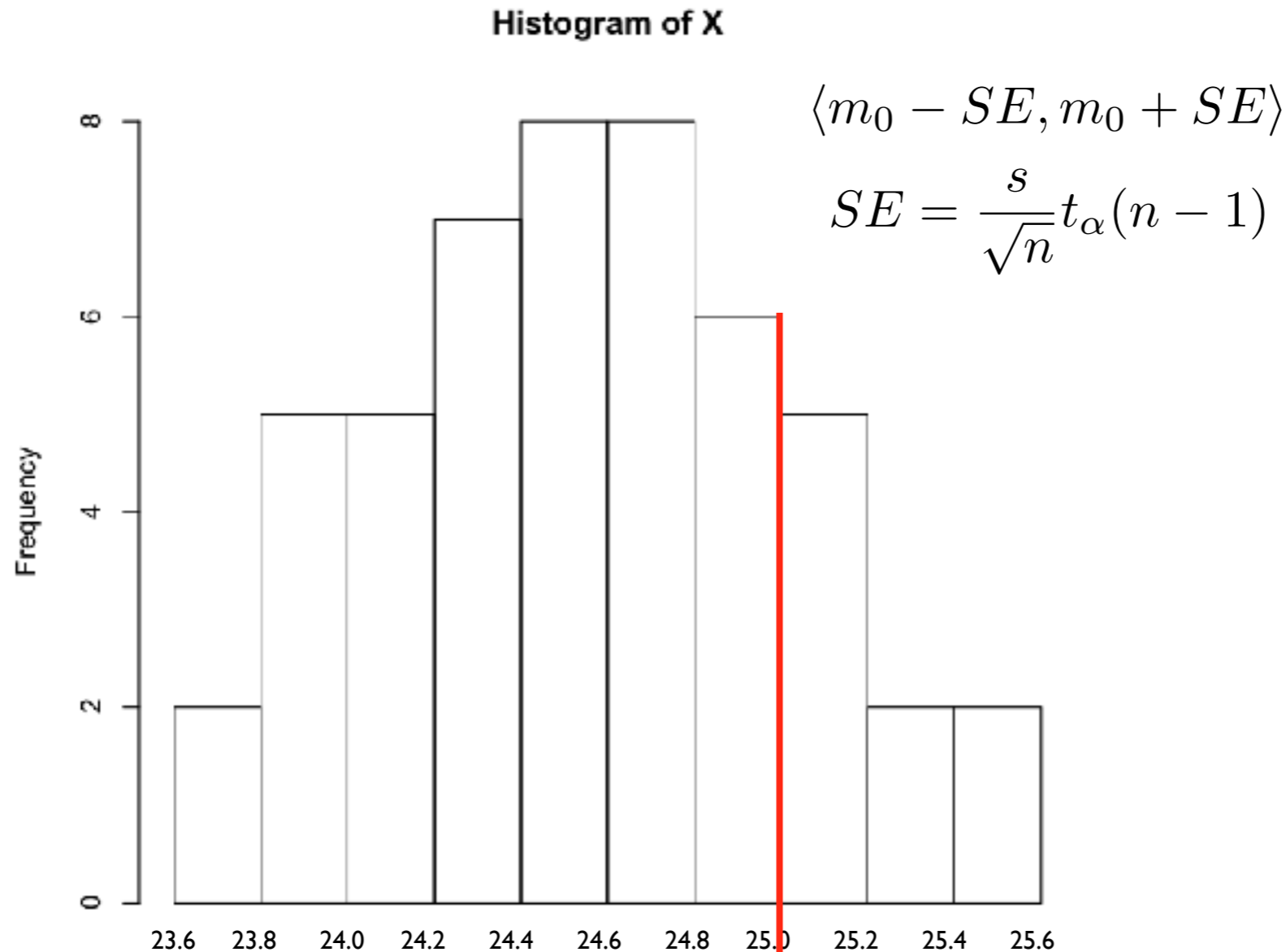
24.52586	24.17119
24.54486	24.44240
23.93455	24.20389
24.19974	24.34851
23.94024	24.21022
24.87474	25.06155
25.48924	25.32572
23.71721	24.61622
25.06676	24.90055
24.36213	24.98580
24.80591	24.20853
24.72623	24.64437
24.70405	23.97645
25.29837	24.46910
24.99453	25.42994
24.66147	24.75773
25.03970	24.44901
25.13285	24.40205
24.78721	23.83656
24.17186	23.65390
24.48244	24.68550
24.22988	23.83956
24.09777	24.52098
24.89240	24.25332
24.14259	25.12906

$$\bar{X} = 24.55, s^2(X) = 0.21, s(X) = 0.46, n = 50$$

Chceme ověřit, zda měření odpovídají rozdělení $N(m_0, s^2)$

Hmotnosti obsahu balení, dávkovaného automatem:

Lze považovat automat za správně seřízený ($m_0=25,0g$)?



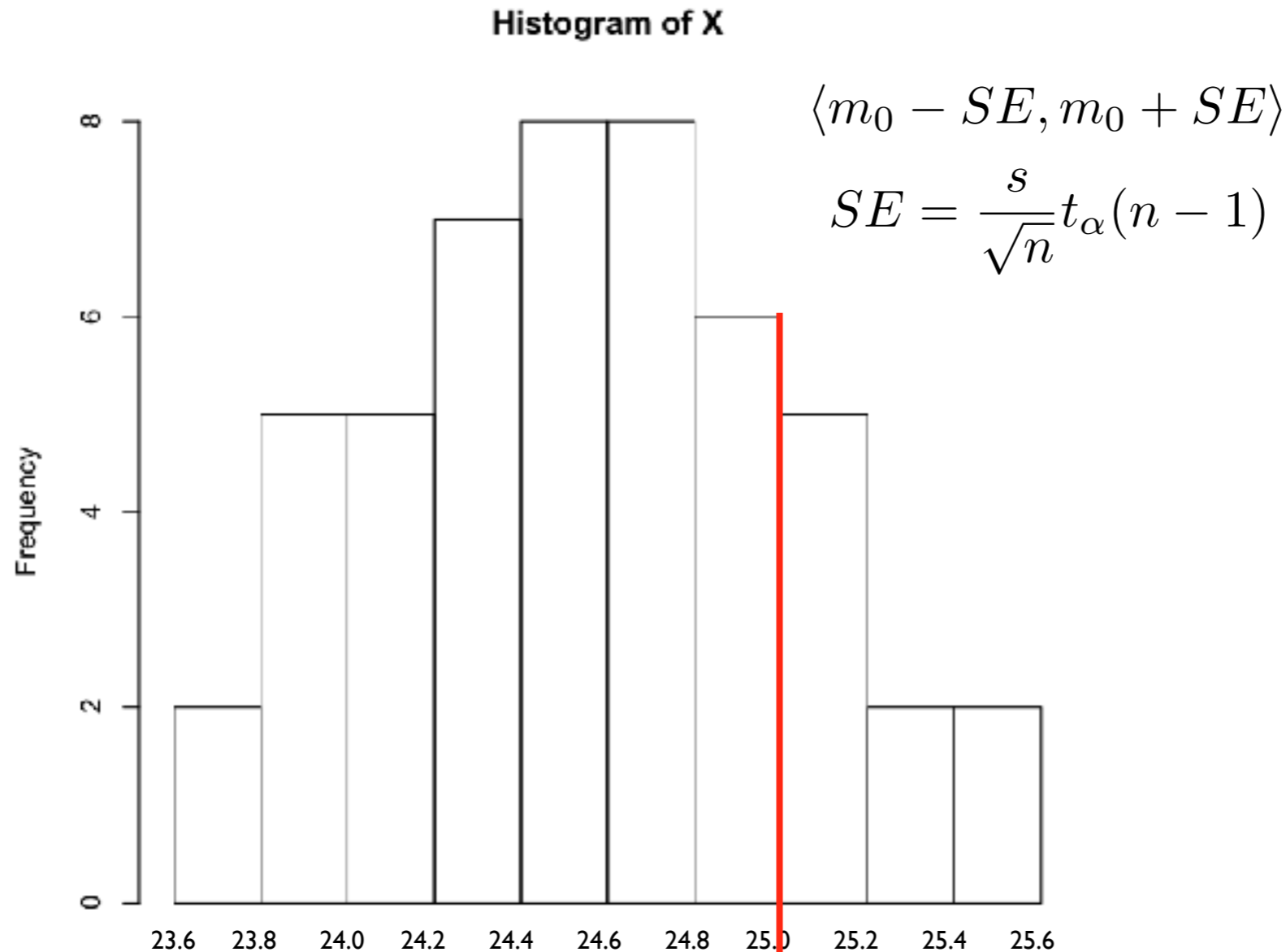
24.52586	24.17119
24.54486	24.44240
23.93455	24.20389
24.19974	24.34851
23.94024	24.21022
24.87474	25.06155
25.48924	25.32572
23.71721	24.61622
25.06676	24.90055
24.36213	24.98580
24.80591	24.20853
24.72623	24.64437
24.70405	23.97645
25.29837	24.46910
24.99453	25.42994
24.66147	24.75773
25.03970	24.44901
25.13285	24.40205
24.78721	23.83656
24.17186	23.65390
24.48244	24.68550
24.22988	23.83956
24.09777	24.52098
24.89240	24.25332
24.14259	25.12906

$\bar{X} = 24.55, s^2(X) = 0.21, s(X) = 0.46, n = 50$

Chceme ověřit, zda měření odpovídají rozdělení $N(m_0, s^2)$

Hmotnosti obsahu balení, dávkovaného automatem:

Lze považovat automat za správně seřízený ($m_0=25,0\text{g}$)?



24.52586 24.17119
 24.54486 24.44240
 23.93455 24.20389
 24.19974 24.34851
 23.94024 24.21022
 24.87474 25.06155
 25.48924 25.32572
 23.71721 24.61622
 25.06676 24.90055
 24.36213 24.98580
 24.80591 24.20853
 24.72623 24.64437
 24.70405 23.97645
 25.29837 24.46910
 24.99453 25.42994
 24.66147 24.75773
 25.03970 24.44901
 25.13285 24.40205
 24.78721 23.83656
 24.17186 23.65390
 24.48244 24.68550
 24.22988 23.83956
 24.09777 24.52098
 24.89240 24.25332
 24.14259 25.12906

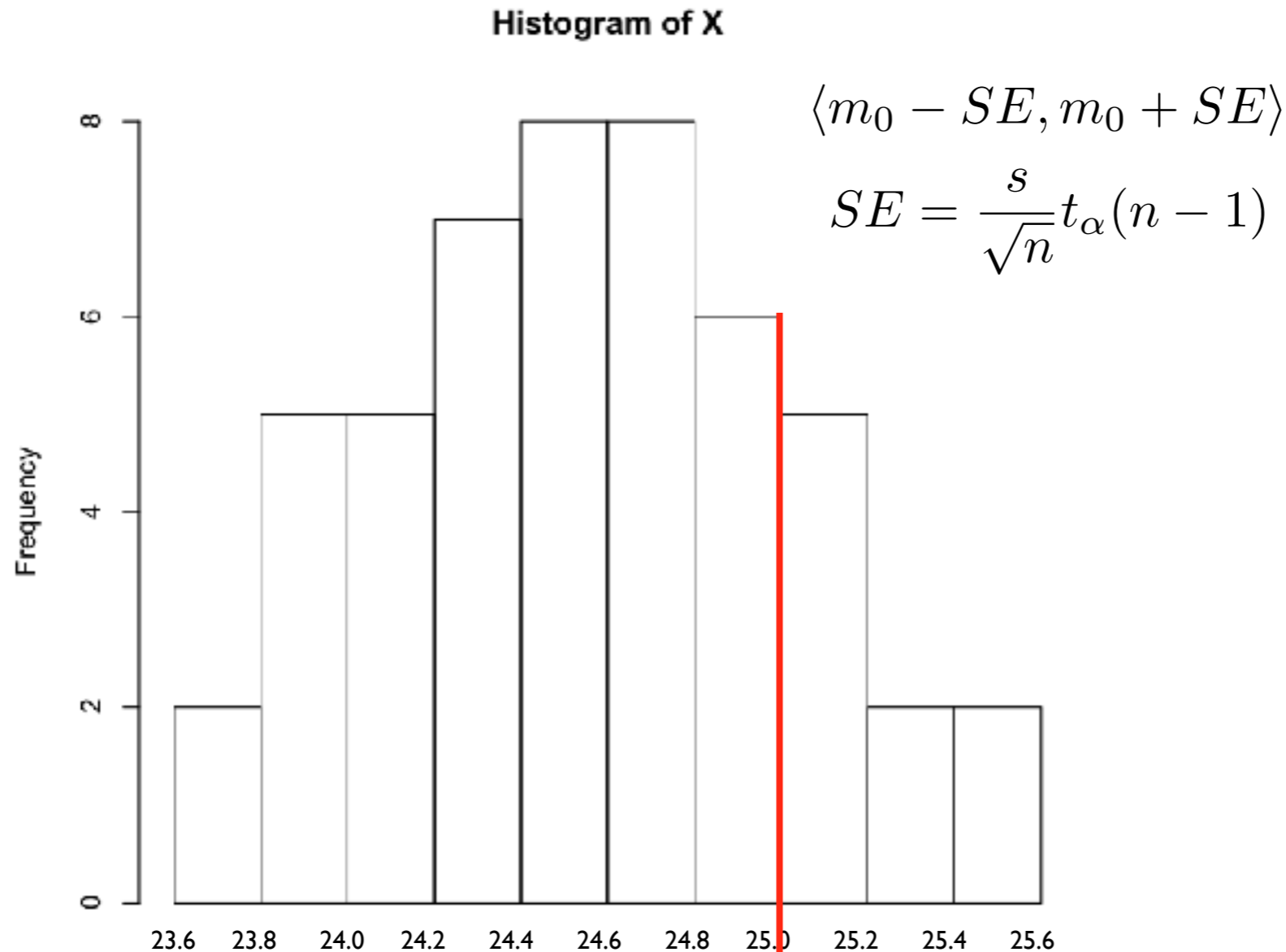
$$\bar{X} = 24.55, s^2(X) = 0.21, s(X) = 0.46, n = 50$$

Chceme ověřit, zda měření odpovídají rozdělení $N(m_0, s^2)$

$$\alpha = 0.05 \Rightarrow t_{0.05}(49) = 2.01$$

Hmotnosti obsahu balení, dávkovaného automatem:

Lze považovat automat za správně seřízený ($m_0=25,0g$)?



24.52586	24.17119
24.54486	24.44240
23.93455	24.20389
24.19974	24.34851
23.94024	24.21022
24.87474	25.06155
25.48924	25.32572
23.71721	24.61622
25.06676	24.90055
24.36213	24.98580
24.80591	24.20853
24.72623	24.64437
24.70405	23.97645
25.29837	24.46910
24.99453	25.42994
24.66147	24.75773
25.03970	24.44901
25.13285	24.40205
24.78721	23.83656
24.17186	23.65390
24.48244	24.68550
24.22988	23.83956
24.09777	24.52098
24.89240	24.25332
24.14259	25.12906

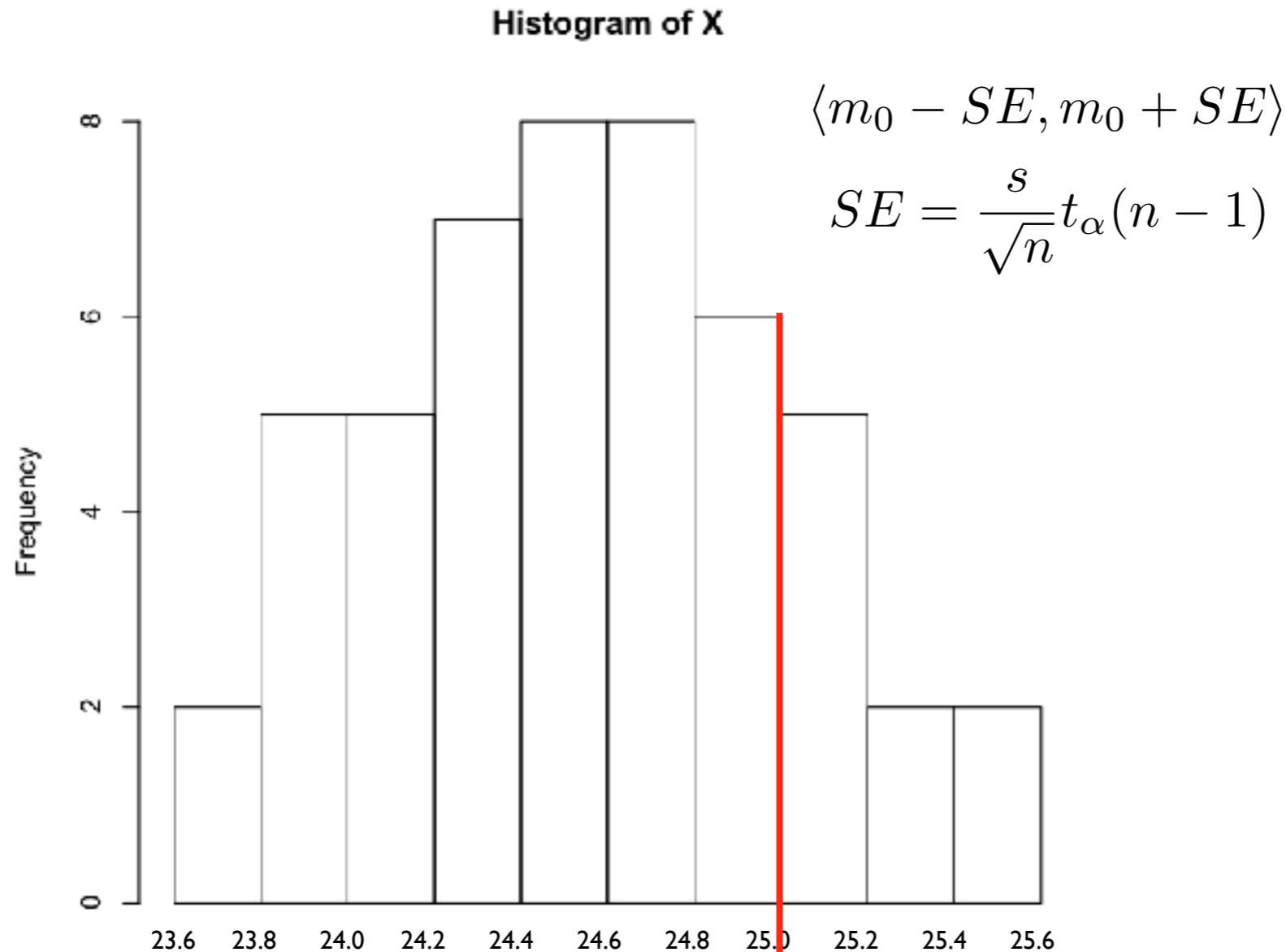
$$\bar{X} = 24.55, s^2(X) = 0.21, s(X) = 0.46, n = 50$$

Chceme ověřit, zda měření odpovídají rozdělení $N(m_0, s^2)$

$$\alpha = 0.05 \Rightarrow t_{0.05}(49) = 2.01 \quad SE = 0.132 \quad \langle 24.868, 25.132 \rangle$$

Hmotnosti obsahu balení, dávkovaného automatem:

Lze považovat automat za správně seřízený ($m_0=25,0g$)?



24.52586	24.17119
24.54486	24.44240
23.93455	24.20389
24.19974	24.34851
23.94024	24.21022
24.87474	25.06155
25.48924	25.32572
23.71721	24.61622
25.06676	24.90055
24.36213	24.98580
24.80591	24.20853
24.72623	24.64437
24.70405	23.97645
25.29837	24.46910
24.99453	25.42994
24.66147	24.75773
25.03970	24.44901
25.13285	24.40205
24.78721	23.83656
24.17186	23.65390
24.48244	24.68550
24.22988	23.83956
24.09777	24.52098
24.89240	24.25332
24.14259	25.12906

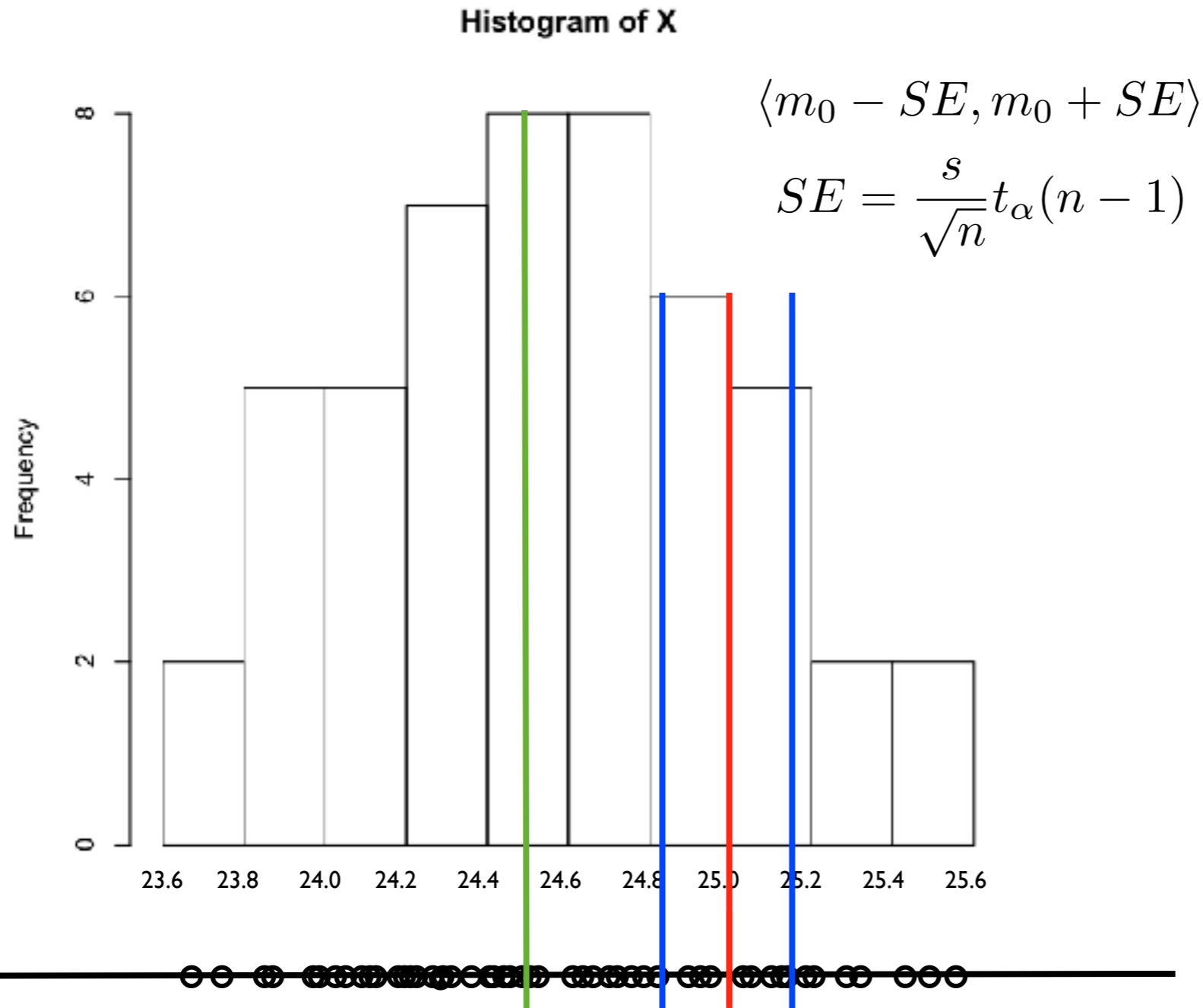
$$\bar{X} = 24.55, s^2(X) = 0.21, s(X) = 0.46, n = 50$$

Chceme ověřit, zda měření odpovídají rozdělení $N(m_0, s^2)$

$$\alpha = 0.05 \Rightarrow t_{0.05}(49) = 2.01 \quad SE = 0.132 \quad \bar{X} \notin \langle 24.868, 25.132 \rangle$$

Hmotnosti obsahu balení, dávkovaného automatem:

Lze považovat automat za správně seřízený ($m_0=25,0g$)?



24.52586	24.17119
24.54486	24.44240
23.93455	24.20389
24.19974	24.34851
23.94024	24.21022
24.87474	25.06155
25.48924	25.32572
23.71721	24.61622
25.06676	24.90055
24.36213	24.98580
24.80591	24.20853
24.72623	24.64437
24.70405	23.97645
25.29837	24.46910
24.99453	25.42994
24.66147	24.75773
25.03970	24.44901
25.13285	24.40205
24.78721	23.83656
24.17186	23.65390
24.48244	24.68550
24.22988	23.83956
24.09777	24.52098
24.89240	24.25332
24.14259	25.12906

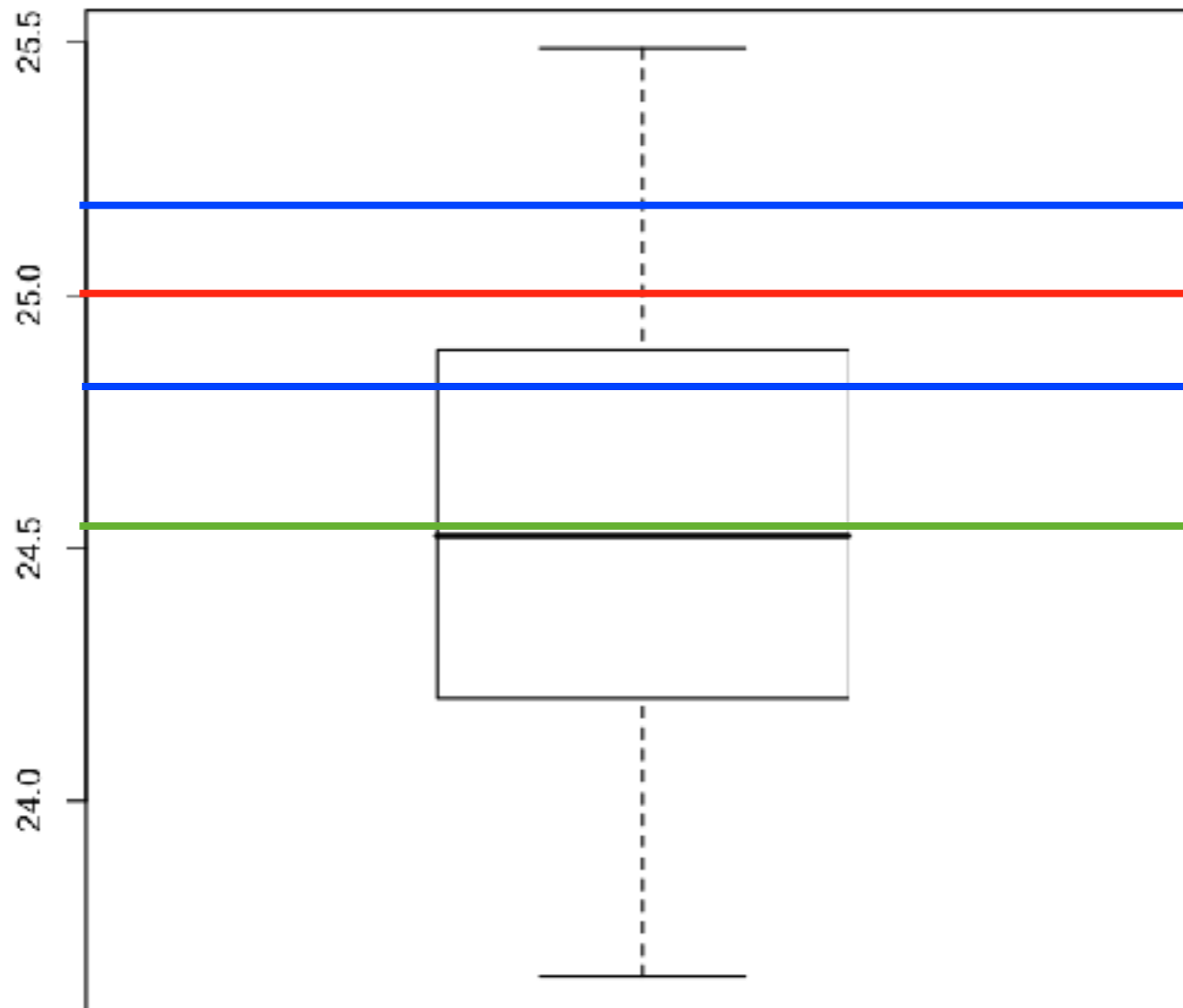
$$\bar{X} = 24.55, s^2(X) = 0.21, s(X) = 0.46, n = 50$$

Chceme ověřit, zda měření odpovídají rozdělení $N(m_0, s^2)$

$$\alpha = 0.05 \Rightarrow t_{0.05}(49) = 2.01 \quad SE = 0.132 \quad \bar{X} \notin \langle 24.868, 25.132 \rangle$$

Hmotnosti obsahu balení, dávkovaného automatem:

Lze považovat automat za správně seřízený ($m_0=25,0g$)?



24.52586	24.17119
24.54486	24.44240
23.93455	24.20389
24.19974	24.34851
23.94024	24.21022
24.87474	25.06155
25.48924	25.32572
23.71721	24.61622
25.06676	24.90055
24.36213	24.98580
24.80591	24.20853
24.72623	24.64437
24.70405	23.97645
25.29837	24.46910
24.99453	25.42994
24.66147	24.75773
25.03970	24.44901
25.13285	24.40205
24.78721	23.83656
24.17186	23.65390
24.48244	24.68550
24.22988	23.83956
24.09777	24.52098
24.89240	24.25332
24.14259	25.12906

$$\bar{X} = 24.55, s^2(X) = 0.21, s(X) = 0.46, n = 50$$

Chceme ověřit, zda měření odpovídají rozdělení $N(m_0, s^2)$

$$\alpha = 0.05 \Rightarrow t_{0.05}(49) = 2.01 \quad SE = 0.132 \quad \bar{X} \notin \langle 24.868, 25.132 \rangle$$

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2) \quad Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2) \quad Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

- oba parametry v obou případech známe

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2) \quad Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

- oba parametry v obou případech známe
- známe střední hodnoty a neznáme rozptyly

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2) \quad Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

- oba parametry v obou případech známe
- známe střední hodnoty a neznáme rozptyly
- známe rozptyly a neznáme střední hodnoty

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2) \quad Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

- oba parametry v obou případech známe
- známe střední hodnoty a neznáme rozptyly
- známe rozptyly a neznáme střední hodnoty
- žádný z parametrů neznáme

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2) \quad Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

- oba parametry v obou případech známe
- známe střední hodnoty a neznáme rozptyly
- známe rozptyly a neznáme střední hodnoty
- žádný z parametrů neznáme

Odhady středních hodnot:

$$\bar{X} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i \quad \bar{Y} = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m Y_i$$

Odhady rozptylů:

$$s_X^2 = \frac{1}{n-1} \sum (X - \bar{X})^2, \quad s_Y^2 = \frac{1}{m-1} \sum (Y - \bar{Y})^2$$

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2) \quad Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2) \quad Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

- test shody rozptylů

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2) \quad Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

- test shody rozptylů
- test shody středních hodnot při stejných rozptylech

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2) \quad Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

- test shody rozptylů
- test shody středních hodnot při stejných rozptylech
- test shody středních hodnot při nestejných rozptylech

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2) \quad Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

- test shody rozptylů
- test shody středních hodnot při stejných rozptylech
- test shody středních hodnot při nestejných rozptylech

Dvě závislá měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n$$

$$Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_n$$

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2) \quad Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

- test shody rozptylů
- test shody středních hodnot při stejných rozptylech
- test shody středních hodnot při nestejných rozptylech

Dvě závislá měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n$$

$$Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_n$$

párová
pozorování

- párový test shody středních hodnot

Srovnání dvou náhodných veličin

1) Srovnání rozptylů dvou nezávislých měření

Srovnání dvou náhodných veličin

1) Srovnání rozptylů dvou nezávislých měření

Liší se statisticky významně dvě nezávislá měření z hlediska velikosti rozptylu?

Srovnání dvou náhodných veličin

1) Srovnání rozptylů dvou nezávislých měření

Liší se statisticky významně dvě nezávislá měření z hlediska velikosti rozptylu?

Lze považovat rozptyl dvou nezávislých měření za shodný při dané hladině významnosti?

Srovnání dvou náhodných veličin

1) Srovnání rozptylů dvou nezávislých měření

Liší se statisticky významně dvě nezávislá měření z hlediska velikosti rozptylu?

Lze považovat rozptyl dvou nezávislých měření za shodný při dané hladině významnosti?

nulová hypotéza : $H_0 : \sigma_X^2 = \sigma_Y^2$

alternativní hypotéza: $H_A : \sigma_X^2 \neq \sigma_Y^2$

testová statistika : $F = \frac{s_X^2}{s_Y^2}$

hladina významnosti: α

Srovnání dvou náhodných veličin

1) Srovnání rozptylů dvou nezávislých měření

Liší se statisticky významně dvě nezávislá měření z hlediska velikosti rozptylu?

Lze považovat rozptyl dvou nezávislých měření za shodný při dané hladině významnosti?

nulová hypotéza : $H_0 : \sigma_X^2 = \sigma_Y^2$

alternativní hypotéza: $H_A : \sigma_X^2 \neq \sigma_Y^2$

testová statistika : $F = \frac{s_X^2}{s_Y^2}$

hladina významnosti: α

F-test

Fisherovo-Snedecorovo
rozdělení $F(n-1, m-1)$

Srovnání dvou náhodných veličin

1) Srovnání rozptylů dvou nezávislých měření

Liší se statisticky významně dvě nezávislá měření z hlediska velikosti rozptylu?

Lze považovat rozptyl dvou nezávislých měření za shodný při dané hladině významnosti?

nulová hypotéza : $H_0 : \sigma_X^2 = \sigma_Y^2$

alternativní hypotéza: $H_A : \sigma_X^2 \neq \sigma_Y^2$

testová statistika : $F = \frac{s_X^2}{s_Y^2}$

hladina významnosti: α

F-test

Fisherovo-Snedecorovo
rozdělení $F(n-1, m-1)$

H_0 nezamítneme, když pro dané α bude

$$F_{\alpha/2}(n-1, m-1) < F < F_{\alpha/2}(n-1, m-1)$$

Srovnání dvou náhodných veličin

2) Srovnání středních hodnot dvou nezávislých měření - Dvouvýběrový t-test

Srovnání dvou náhodných veličin

2) Srovnání středních hodnot dvou nezávislých měření - Dvouvýběrový t-test

Liší se statisticky významně dvě nezávislá měření z hlediska jejich střední hodnoty?

Srovnání dvou náhodných veličin

2) Srovnání středních hodnot dvou nezávislých měření - Dvouvýběrový t-test

Liší se statisticky významně dvě nezávislá měření z hlediska jejich střední hodnoty?

Lze považovat střední hodnoty dvou nezávislých měření za shodné při dané hladině významnosti?

Srovnání dvou náhodných veličin

2) Srovnání středních hodnot dvou nezávislých měření - Dvouvýběrový t-test

Liší se statisticky významně dvě nezávislá měření z hlediska jejich střední hodnoty?

Lze považovat střední hodnoty dvou nezávislých měření za shodné při dané hladině významnosti?

Lze od sebe statisticky významně odlišit dvě nezávislá měření podle jejich střední hodnoty?

Srovnání dvou náhodných veličin

2) Srovnání středních hodnot dvou nezávislých měření - Dvouvýběrový t-test

Liší se statisticky významně dvě nezávislá měření z hlediska jejich střední hodnoty?

Lze považovat střední hodnoty dvou nezávislých měření za shodné při dané hladině významnosti?

Lze od sebe statisticky významně odlišit dvě nezávislá měření podle jejich střední hodnoty?

nulová hypotéza : $H_0 : \mu_X = \mu_Y$

alternativní hypotéza: $H_A : \mu_X \neq \mu_Y$ (oboustranná)

testová statistika : $T = \frac{\bar{X} - \bar{Y}}{s_{\bar{X} - \bar{Y}}}$

hladina významnosti: α

Srovnání dvou náhodných veličin

2) Srovnání středních hodnot dvou nezávislých měření - Dvouvýběrový t-test

nulová hypotéza : $H_0 : \mu_X = \mu_Y$

alternativní hypotéza: $H_A : \mu_X \neq \mu_Y$ (oboustranná)

testová statistika : $T = \frac{\bar{X} - \bar{Y}}{s_{\bar{X} - \bar{Y}}}$

hladina významnosti: α

Srovnání dvou náhodných veličin

2) Srovnání středních hodnot dvou nezávislých měření - Dvouvýběrový t-test

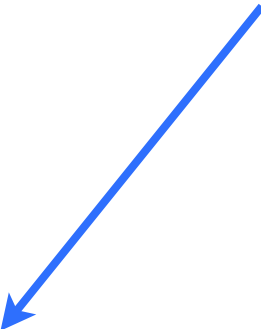
nulová hypotéza : $H_0 : \mu_X = \mu_Y$

alternativní hypotéza: $H_A : \mu_X \neq \mu_Y$ (oboustranná)

testová statistika : $T = \frac{\bar{X} - \bar{Y}}{s_{\bar{X} - \bar{Y}}}$

hladina významnosti: α

pokud $\sigma_X^2 = \sigma_Y^2$


dvouvýběrový t-test
se stejnými rozptyly

Srovnání dvou náhodných veličin

2) Srovnání středních hodnot dvou nezávislých měření - Dvouvýběrový t-test

nulová hypotéza : $H_0 : \mu_X = \mu_Y$

alternativní hypotéza: $H_A : \mu_X \neq \mu_Y$ (oboustranná)

testová statistika : $T = \frac{\bar{X} - \bar{Y}}{s_{\bar{X} - \bar{Y}}}$

hladina významnosti: α

pokud $\sigma_X^2 = \sigma_Y^2$

dvouvýběrový t-test
se stejnými rozptyly

pokud $\sigma_X^2 \neq \sigma_Y^2$

dvouvýběrový t-test
s nestejnými rozptyly

Dvě náhodné veličiny

2) Srovnání středních hodnot dvou nezávislých měření - Dvouvýběrový t-test

$$\begin{aligned} \text{pokud } \sigma_X^2 = \sigma_Y^2 = \sigma^2 &\Rightarrow s_{\bar{X}-\bar{Y}}^2 = s_{\bar{X}}^2 + s_{\bar{Y}}^2 = \frac{s_X^2}{n} + \frac{s_Y^2}{m} = \\ &= s^2 \left(\frac{1}{n} + \frac{1}{m} \right) = s^2 \left(\frac{m+n}{n \cdot m} \right) \end{aligned}$$

Dvě náhodné veličiny

2) Srovnání středních hodnot dvou nezávislých měření - Dvouvýběrový t-test

$$\begin{aligned} \text{pokud } \sigma_X^2 = \sigma_Y^2 = \sigma^2 &\Rightarrow s_{\bar{X}-\bar{Y}}^2 = s_{\bar{X}}^2 + s_{\bar{Y}}^2 = \frac{s_X^2}{n} + \frac{s_Y^2}{m} = \\ &= s^2 \left(\frac{1}{n} + \frac{1}{m} \right) = s^2 \left(\frac{m+n}{n \cdot m} \right) \end{aligned}$$

dále odhadneme s^2 ze všech naměřených hodnot:

$$\begin{aligned} s^2 &= \frac{1}{n+m-2} \left(\sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2 + \sum_{i=1}^m (Y_i - \bar{Y})^2 \right) = \\ &= \frac{1}{n+m-2} \left((n-1)s_X^2 + (m-1)s_Y^2 \right) \end{aligned}$$

Dvě náhodné veličiny

2) Srovnání středních hodnot dvou nezávislých měření - Dvouvýběrový t-test

$$\begin{aligned} \text{pokud } \sigma_X^2 = \sigma_Y^2 = \sigma^2 &\Rightarrow s_{\bar{X}-\bar{Y}}^2 = s_{\bar{X}}^2 + s_{\bar{Y}}^2 = \frac{s_X^2}{n} + \frac{s_Y^2}{m} = \\ &= s^2 \left(\frac{1}{n} + \frac{1}{m} \right) = s^2 \left(\frac{m+n}{n \cdot m} \right) \end{aligned}$$

dále odhadneme s^2 ze všech naměřených hodnot:

$$\begin{aligned} s^2 &= \frac{1}{n+m-2} \left(\sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2 + \sum_{i=1}^m (Y_i - \bar{Y})^2 \right) = \\ &= \frac{1}{n+m-2} \left((n-1)s_X^2 + (m-1)s_Y^2 \right) \end{aligned}$$

tedy:

$$s_{\bar{X}-\bar{Y}}^2 = \frac{n+m}{nm(n+m-2)} \left((n-1)s_X^2 + (m-1)s_Y^2 \right)$$

Srovnání dvou náhodných veličin

2) Srovnání středních hodnot dvou nezávislých měření - Dvouvýběrový t-test

pokud $\sigma_X^2 = \sigma_Y^2$, testová statistika bude mít tvar:

$$T = \frac{\bar{X} - \bar{Y}}{\sqrt{(n-1)s_X^2 + (m-1)s_Y^2}} \sqrt{\frac{nm(n+m-2)}{n+m}}$$

ta má t-rozdělení (Studentovo rozdělení) pravděpodobnosti o $(n+m-2)$ stupních volnosti.

Srovnání dvou náhodných veličin

2) Srovnání středních hodnot dvou nezávislých měření - Dvouvýběrový t-test

pokud $\sigma_X^2 = \sigma_Y^2$, testová statistika bude mít tvar:

$$T = \frac{\bar{X} - \bar{Y}}{\sqrt{(n-1)s_X^2 + (m-1)s_Y^2}} \sqrt{\frac{nm(n+m-2)}{n+m}}$$

ta má t-rozdělení (Studentovo rozdělení) pravděpodobnosti o $(n+m-2)$ stupních volnosti.

H_0 nezamítneme, když pro dané α bude $|T| \leq t_\alpha(n+m-2)$ kde $t_\alpha(n+m-2)$ je (oboustranná) α -kritická hodnota t-rozdělení o $(n+m-2)$ stupních volnosti.

Srovnání dvou náhodných veličin

2) Srovnání středních hodnot dvou nezávislých měření - Dvouvýběrový t-test

pokud $\sigma_X^2 \neq \sigma_Y^2$, testová statistika bude mít tvar:

$$T = \frac{\bar{X} - \bar{Y}}{\sqrt{\frac{1}{n} s_X^2 + \frac{1}{m} s_Y^2}}$$

a má rozdělení, které je směsí t-rozdělení o $(n-1)$ a $(m-1)$ stupních volnosti.

Srovnání dvou náhodných veličin

2) Srovnání středních hodnot dvou nezávislých měření - Dvouvýběrový t-test

pokud $\sigma_X^2 \neq \sigma_Y^2$, testová statistika bude mít tvar:

$$T = \frac{\bar{X} - \bar{Y}}{\sqrt{\frac{1}{n}s_X^2 + \frac{1}{m}s_Y^2}}$$

a má rozdělení, které je směsí t-rozdělení o $(n-1)$ a $(m-1)$ stupních volnosti.

H_0 nezamítneme, když pro dané α bude splněna nerovnost $|T| \leq At_\alpha(n-1) + Bt_\alpha(m-1)$, kde A a B jsou váhy, $A+B=1$.

$$A = \frac{\frac{1}{n}s_X^2}{\frac{1}{n}s_X^2 + \frac{1}{m}s_Y^2}, \quad B = \frac{\frac{1}{m}s_Y^2}{\frac{1}{n}s_X^2 + \frac{1}{m}s_Y^2}$$

Srovnání dvou náhodných veličin

3) Párový test shody středních hodnot dvou závislých měření

Srovnání dvou náhodných veličin

3) Párový test shody středních hodnot dvou závislých měření

- pozorování stejné veličiny před a po nějakém zásahu

Srovnání dvou náhodných veličin

3) Párový test shody středních hodnot dvou závislých měření

- pozorování stejné veličiny před a po nějakém zásahu
- měření stejných objektů za různých podmínek

Srovnání dvou náhodných veličin

3) Párový test shody středních hodnot dvou závislých měření

- pozorování stejné veličiny před a po nějakém zásahu
- měření stejných objektů za různých podmínek
- měření stejné veličiny ve dvou různých časech

Srovnání dvou náhodných veličin

3) Párový test shody středních hodnot dvou závislých měření

- pozorování stejné veličiny před a po nějakém zásahu
- měření stejných objektů za různých podmínek
- měření stejné veličiny ve dvou různých časech
-

Srovnání dvou náhodných veličin

3) Párový test shody středních hodnot dvou závislých měření

- pozorování stejné veličiny před a po nějakém zásahu
- měření stejných objektů za různých podmínek
- měření stejné veličiny ve dvou různých časech
-

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n$$

$$Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_n$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2)$$

$$Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

Srovnání dvou náhodných veličin

3) Párový test shody středních hodnot dvou závislých měření

- pozorování stejné veličiny před a po nějakém zásahu
- měření stejných objektů za různých podmínek
- měření stejné veličiny ve dvou různých časech
-

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2)$$

$$Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_n$$

$$Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

$$\Rightarrow Z_1 = X_1 - Y_1, Z_2 = X_2 - Y_2, \dots, Z_n = X_n - Y_n,$$

$$Z \sim N(\mu_X - \mu_Y, \sigma_Z^2)$$

Srovnání dvou náhodných veličin

3) Párový test shody středních hodnot dvou závislých měření

- pozorování stejné veličiny před a po nějakém zásahu
- měření stejných objektů za různých podmínek
- měření stejné veličiny ve dvou různých časech
-

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2)$$

$$Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_n$$

$$Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

$$\Rightarrow Z_1 = X_1 - Y_1, Z_2 = X_2 - Y_2, \dots, Z_n = X_n - Y_n,$$

$$Z \sim N(\mu_X - \mu_Y, \sigma_Z^2)$$

$$H_0 : \mu_X = \mu_Y$$

$$H_A : \mu_X \neq \mu_Y$$

Srovnání dvou náhodných veličin

3) Párový test shody středních hodnot dvou závislých měření

- pozorování stejné veličiny před a po nějakém zásahu
- měření stejných objektů za různých podmínek
- měření stejné veličiny ve dvou různých časech
-

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2)$$

$$Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_n$$

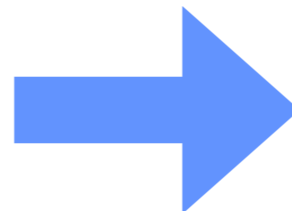
$$Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

$$\Rightarrow Z_1 = X_1 - Y_1, Z_2 = X_2 - Y_2, \dots, Z_n = X_n - Y_n,$$

$$Z \sim N(\mu_X - \mu_Y, \sigma_Z^2)$$

$$H_0 : \mu_X = \mu_Y$$

$$H_A : \mu_X \neq \mu_Y$$



$$H_0 : \mu_Z = 0$$

$$H_A : \mu_Z \neq 0$$

Srovnání dvou náhodných veličin

3) Párový test shody středních hodnot dvou závislých měření

$$H_0 : \mu_Z = a$$

$$H_A : \mu_Z \neq a$$

$$T = \frac{\bar{Z} - a}{s_Z} \sqrt{n}$$

T má t-rozdělení (Studentovo rozdělení) pravděpodobnosti o $(n-1)$ stupních volnosti.

Srovnání dvou náhodných veličin

3) Párový test shody středních hodnot dvou závislých měření

$$H_0 : \mu_Z = a$$

$$H_A : \mu_Z \neq a$$

$$T = \frac{\bar{Z} - a}{s_Z} \sqrt{n}$$

T má t-rozdělení (Studentovo rozdělení) pravděpodobnosti o $(n-1)$ stupních volnosti.

H_0 nezamítneme, když pro dané α bude $|T| \leq t_\alpha(n-1)$ kde $t_\alpha(n-1)$ je (oboustranná) α -kritická hodnota t-rozdělení o $(n-1)$ stupních volnosti.

Srovnání dvou náhodných veličin

Jednostranné testy

Srovnání dvou náhodných veličin

Jednostranné testy

“dolní” nebo “horní” jednostranná alternativa :

$$H_0 : \mu_X = \mu_Y$$

$$H_A : \mu_X < \mu_Y$$

$$H_0 : \mu_X = \mu_Y$$

$$H_A : \mu_X > \mu_Y$$

Srovnání dvou náhodných veličin

Jednostranné testy

“dolní” nebo “horní” jednostranná alternativa :

$$H_0 : \mu_X = \mu_Y$$

$$H_A : \mu_X < \mu_Y$$

$$H_0 : \mu_X = \mu_Y$$

$$H_A : \mu_X > \mu_Y$$

H_0 nezamítneme, když pro dané α bude buď

$$T < -t_\alpha(n-1) \quad \text{nebo} \quad T > t_\alpha(n-1)$$

kde $t_\alpha(n-1)$ je (jednostranná) α -kritická hodnota t-rozdělení o $(n-1)$ stupních volnosti.

Srovnání dvou náhodných veličin

Jednostranné testy

“dolní” nebo “horní” jednostranná alternativa :

$$H_0 : \mu_X = \mu_Y$$

$$H_A : \mu_X < \mu_Y$$

$$H_0 : \mu_X = \mu_Y$$

$$H_A : \mu_X > \mu_Y$$

H_0 nezamítneme, když pro dané α bude buď

$$T < -t_\alpha(n-1) \quad \text{nebo} \quad T > t_\alpha(n-1)$$

kde $t_\alpha(n-1)$ je (jednostranná) α -kritická hodnota t-rozdělení o $(n-1)$ stupních volnosti.

oboustranná α -kritická hodnota je $(1 - \alpha/2)$ -kvantil $t_{1-\alpha/2}(n-1)$

jednostranná α -kritická hodnota je $(1 - \alpha)$ -kvantil $t_{1-\alpha}(n-1)$

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Byly měřeny odchylky od požadované délky 4m ocelových tyčí od dvou dodavatelů. Odchylky jsou uvedeny v cm.

Lze považovat délky tyčí od různých dodavatelů za shodné na hladině významnosti 5%?

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Byly měřeny odchylky od požadované délky 4m ocelových tyčí od dvou dodavatelů. Odchylky jsou uvedeny v cm.

Lze považovat délky tyčí od různých dodavatelů za shodné na hladině významnosti 5%?

Dodavatel X:

```
> x
 [1] 0.41379418 0.51040227 3.28722973 7.31995568 4.53994434 -1.07426821
 [7] 4.74575978 2.55201407 3.22058685 -1.17401554 -1.24119500 4.18294690
[13] 0.65486399 -0.18908709 -0.73101186 1.27876451 1.26734875 2.78570344
[19] 2.96834139 1.22145702 1.80851440 -0.80356569 2.57347292 3.42552806
[25] 1.66904559 -2.21179295 4.17696270 2.15191523 3.62707736 0.06900211
[31] 0.51371315 0.54983237 4.09554316 1.28465289 4.05350899 5.10504379
[37] 4.25580572 0.79826235 -1.02042629 1.87299786 0.14051938 3.05622839
[43] 4.74780021 4.54794140 -6.54132331 1.94429658 1.95488616 4.73267571
[49] 4.83082378 2.95830720 2.99769818 -1.07337799 0.58403864 2.73050678
[55] 0.28021230 10.49771713 2.36870296 0.60689702 8.42679434 1.29763889
[61] 1.31289734 1.93230073 5.92597773 1.49746935 6.30721756 3.15585521
[67] 5.38824907 3.27322441 3.41248356 -0.40437473 3.19350142 -4.06261001
[73] -1.05763312 -0.39748962 0.86637433 2.02108109 -1.06445976 1.10375263
[79] 4.51823259 -0.75725877 -0.87173075 -2.19932463 7.70167909 1.48655986
[85] 4.90757730 5.51652338 -0.34615559 0.01031344 4.57582354 1.17516968
[91] -0.21932558 -1.27848277 2.97655676 1.44863955 3.67881403 0.30868429
[97] -2.52052309 0.05248743 0.07728483 -1.12975005 3.99585182 0.79045260
[103] 3.73159608 7.36490361 6.40646375 -1.54228149 -0.65100869 4.04305846
[109] 2.47766853 -3.48957597 6.20840771 0.40560482 0.49118447 -1.48277951
[115] -1.23675030 5.16138353 1.15383008 2.75286404 4.70183189 -2.29877355
```

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Byly měřeny odchylky od požadované délky 4m ocelových tyčí od dvou dodavatelů. Odchylky jsou uvedeny v cm.

Lze považovat délky tyčí od různých dodavatelů za shodné na hladině významnosti 5%?

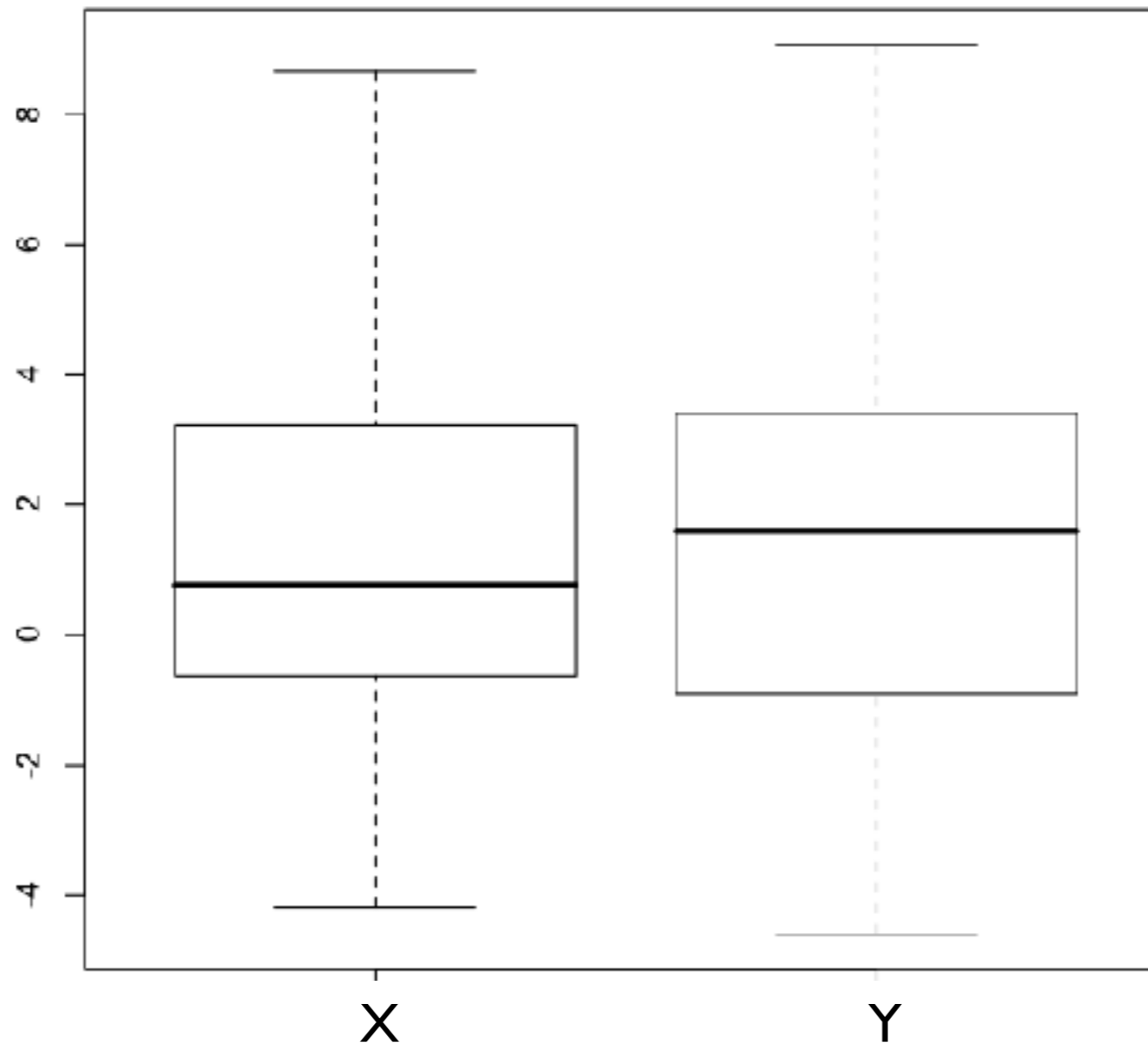
Dodavatel Y:

```
> y
 [1]  6.65956934  2.78876119  0.33397602 -0.03763918  0.74993937  3.81490677
 [7]  1.70428804 -3.31291341 -0.22972370  4.02124752  5.93229834  3.30506070
[13] -3.61277063  0.78809415  0.37976841  1.52357320  1.76230055  1.03078642
[19] -2.74093726  2.77205578 -0.25596771 -0.79295335 -1.99567925  7.14183490
[25]  6.56129569 -2.39785588 -2.30807391 -1.02088455 -2.26040839 -2.76088135
[31]  1.81877126  0.14669279  4.21783231 -2.13184320  3.69196005 -2.69614367
[37] -2.68014820  3.72209577  1.73709472 -0.70580812  0.07337669  2.17063230
[43]  2.72495294  5.04390706  1.32219033  4.72349163 -0.67638087  2.64424944
[49]  2.78769261 -2.10997705  4.26042721 -3.50266144  1.72564280 -2.07028305
[55] -4.59779260 -1.71953774  2.90307934  1.38358058  3.42339203 -1.68000430
[61]  7.55683608  6.32574310 -2.60318964  3.24511198  0.97390332  2.22611398
[67]  0.83831831  0.07828888  2.29402602  2.68356827  0.07483911  3.38214384
[73] -0.59180508  9.07209729 -1.27708114  4.77997853 -0.83918672  6.26383807
[79]  1.50674691  3.25716693  5.70351834  5.80174051  3.61099316  2.19293272
[85] -1.46102337 -0.97135778  1.54849399  4.34257358 -1.64886246  2.44942102
[91]  2.68469434  1.64707956  5.49827517  1.01640668  4.43099277  2.23430799
[97] -1.74337571  6.43458332  2.94137432 -1.01569579
```

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Byly měřeny odchylky od požadované délky 4m ocelových tyčí od dvou dodavatelů. Odchylky jsou uvedeny v cm.

I) Vizualizace dat: Box&Whiskers diagram



Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Byly měřeny odchylky od požadované délky 4m ocelových tyčí od dvou dodavatelů. Odchylky jsou uvedeny v cm.

2) Srovnání rozptylů: F-test

```
> var.test(x,y)

F test to compare two variances

data:  x and y
F = 0.8712, num df = 119, denom df = 99, p-value = 0.4701
alternative hypothesis: true ratio of variances is not equal to 1
95 percent confidence interval:
 0.5943383 1.2684711
sample estimates:
ratio of variances
 0.8711758
```

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Byly měřeny odchylky od požadované délky 4m ocelových tyčí od dvou dodavatelů. Odchylky jsou uvedeny v cm.

2) Srovnání rozptylů: F-test

```
> var.test(x,y)

      F test to compare two variances

data:  x and y
F = 0.8712, num df = 119, denom df = 99, p-value = 0.4701
alternative hypothesis: true ratio of variances is not equal to 1
95 percent confidence interval:
 0.5943383 1.2684711
sample estimates:
ratio of variances
 0.8711758
```

=> nulovou hypotézu nezamítáme,
rozptyly se statisticky významně neliší

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Byly měřeny odchylky od požadované délky 4m ocelových tyčí od dvou dodavatelů. Odchylky jsou uvedeny v cm.

3) Srovnání středních hodnot: dvouvýběrový t-test se shodnými rozptyly

```
> t.test(x,y, var.equal=T)
```

```
Two Sample t-test
```

```
data: x and y
```

```
t = 1.0375, df = 218, p-value = 0.3007
```

```
alternative hypothesis: true difference in means is not equal to 0
```

```
95 percent confidence interval:
```

```
-0.3598731  1.1598308
```

```
sample estimates:
```

```
mean of x mean of y
```

```
1.884360  1.484381
```

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Byly měřeny odchylky od požadované délky 4m ocelových tyčí od dvou dodavatelů. Odchylky jsou uvedeny v cm.

3) Srovnání středních hodnot: dvouvýběrový t-test se shodnými rozptyly

```
> t.test(x,y, var.equal=T)

Two Sample t-test

data:  x and y
t = 1.0375, df = 218, p-value = 0.3007
alternative hypothesis: true difference in means is not equal to 0
95 percent confidence interval:
 -0.3598731  1.1598308
sample estimates:
mean of x mean of y
 1.884360  1.484381
```

=> nulovou hypotézu nezamítáme,
střední hodnoty se statisticky významně neliší

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Bylo zjišťováno, zda množství vyrobených kusů za hodinu (výkonnost) závisí na typu šicího stroje.

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Bylo zjišťováno, zda množství vyrobených kusů za hodinu (výkonnost) závisí na typu šicího stroje.

1. Data:

operátor	1	2	3	4	5	6	7	8
stroj A1	53	60	58	48	46	54	62	49
stroj A2	50	55	56	44	45	50	57	47
rozdíl d_j	3	5	2	4	1	4	5	2

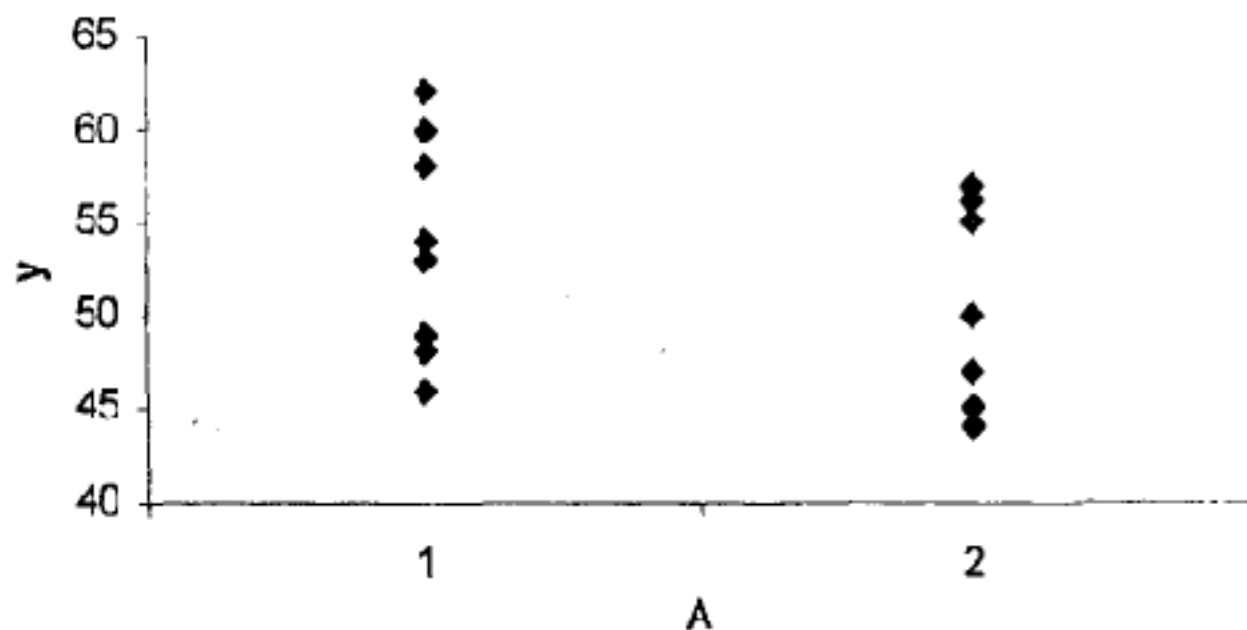
Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Bylo zjišťováno, zda množství vyrobených kusů za hodinu (výkonnost) závisí na typu šicího stroje.

1. Data:

operátor	1	2	3	4	5	6	7	8
stroj A1	53	60	58	48	46	54	62	49
stroj A2	50	55	56	44	45	50	57	47
rozdíl d_j	3	5	2	4	1	4	5	2

2. Grafické znázornění dat:



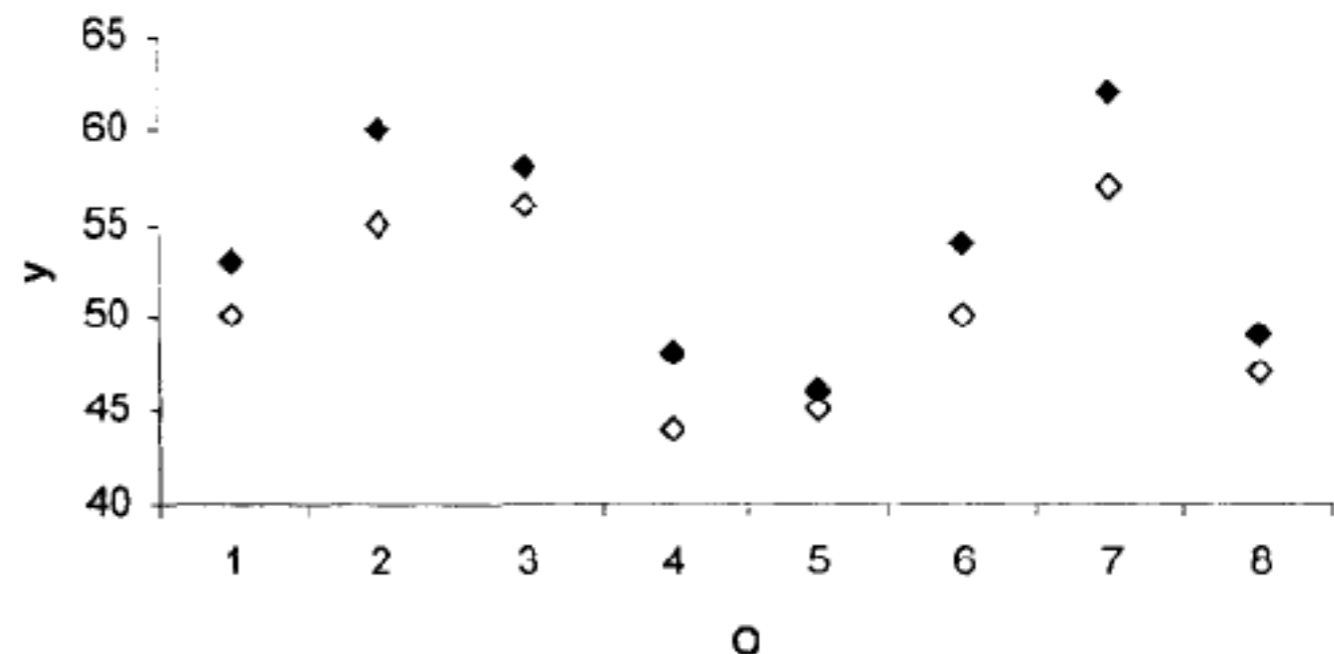
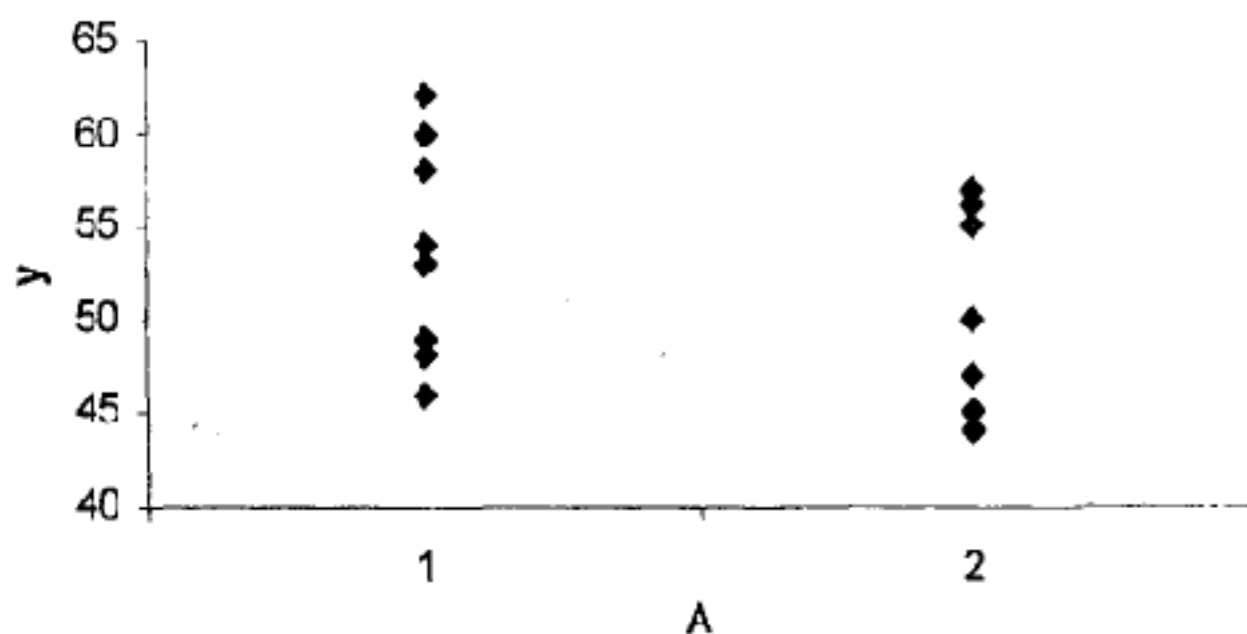
Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Bylo zjišťováno, zda množství vyrobených kusů za hodinu (výkonnost) závisí na typu šicího stroje.

1. Data:

operátor	1	2	3	4	5	6	7	8
stroj A1	53	60	58	48	46	54	62	49
stroj A2	50	55	56	44	45	50	57	47
rozdíl d_j	3	5	2	4	1	4	5	2

2. Grafické znázornění dat:



Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Bylo zjišťováno, zda množství vyrobených kusů za hodinu (výkonnost) závisí na typu šicího stroje.

3. Párový t-test:

$$H_0 : \mu_{A1} = \mu_{A2}, \quad H_A : \mu_{A1} \neq \mu_{A2}$$

$$T = \frac{\bar{d}}{\sqrt{\frac{s_d^2}{r}}}$$

kde

$$\bar{d} = \frac{1}{r} \sum_{j=1}^r d_j, \quad s_d^2 = \frac{1}{r-1} \sum_{j=1}^r (d_j - \bar{d})^2$$

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Bylo zjišťováno, zda množství vyrobených kusů za hodinu (výkonnost) závisí na typu šicího stroje.

3. Párový t-test:

$$H_0 : \mu_{A1} = \mu_{A2}, \quad H_A : \mu_{A1} \neq \mu_{A2}$$

$$T = \frac{\bar{d}}{\sqrt{\frac{s_d^2}{r}}}$$

kde

$$\bar{d} = \frac{1}{r} \sum_{j=1}^r d_j, \quad s_d^2 = \frac{1}{r-1} \sum_{j=1}^r (d_j - \bar{d})^2$$

	y1	y2
Stř. hodnota	53,75	50,5
Rozptyl	34,5	25,42857
Pozorování	8	8
Pears. korelace	0,974278	
Hyp. rozdíl stř. hodnot	0	
Rozdíl	7	
t stat	6,177483	
P(T<=t) (1)	0,000228	
t krit (1)	1,894578	
P(T<=t) (2)	0,000455	
t krit (2)	2,364623	

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Bylo zjišťováno, zda množství vyrobených kusů za hodinu (výkonnost) závisí na typu šicího stroje.

3. Párový t-test:

$$H_0 : \mu_{A1} = \mu_{A2}, \quad H_A : \mu_{A1} \neq \mu_{A2}$$

$$T = \frac{\bar{d}}{\sqrt{\frac{s_d^2}{r}}}$$

kde

$$\bar{d} = \frac{1}{r} \sum_{j=1}^r d_j, \quad s_d^2 = \frac{1}{r-1} \sum_{j=1}^r (d_j - \bar{d})^2$$

	y1	y2
Stř. hodnota	53,75	50,5
Rozptyl	34,5	25,42857
Pozorování	8	8
Pears. korelace	0,974278	
Hyp. rozdíl stř. hodnot	0	
Stupně volnosti	7	
t stat	6,177483	
P(T<=t) (1)	0,000228	
t krit (1)	1,894578	
P(T<=t) (2)	0,000455	
t krit (2)	2,364623	

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Bylo zjišťováno, zda množství vyrobených kusů za hodinu (výkonnost) závisí na typu šicího stroje.

3. Párový t-test:

$$H_0 : \mu_{A1} = \mu_{A2}, \quad H_A : \mu_{A1} \neq \mu_{A2}$$

$$T = \frac{\bar{d}}{\sqrt{\frac{s_d^2}{r}}}$$

kde

$$\bar{d} = \frac{1}{r} \sum_{j=1}^r d_j, \quad s_d^2 = \frac{1}{r-1} \sum_{j=1}^r (d_j - \bar{d})^2$$

	y1	y2
Stř. hodnota	53,75	50,5
Rozptyl	34,5	25,42857
Pozorování	8	8
Pears. korelace	0,974278	
Hyp. rozdíl stř. hodnot	0	
Stupně volnosti	7	
t stat	6,177483	
P(T<=t) (1)	0,000228	
t krit (1)	1,894578	
P(T<=t) (2)	0,000455	
t krit (2)	2,364623	

=> nulovou hypotézu zamítáme, typ stroje ovlivňuje výkonnost, která je statisticky významně vyšší u prvního typu stroje

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Byla měřena rychlost reakce operátorů před a po speciálním cvičení v sekundách. Mělo cvičení statisticky významný vliv na rychlost?

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Byla měřena rychlost reakce operátorů před a po speciálním cvičení v sekundách. Mělo cvičení statisticky významný vliv na rychlost?

I) Data:

```
> pred_cvicenim
 [1] 12.666378  7.322789 15.021706 13.616913 10.970712  5.464451
 [7]  9.999636 15.693764 13.771444 17.065310  6.940708 15.860749
[13] 18.019348  6.326531 20.647763 23.005369 14.619170 20.787108
[19] 14.238225  9.674337 14.763170  9.613791  9.727326  9.146292
[25] 21.246960 16.200128 15.466065 13.691879  9.032113 10.558392
[31] 18.258896 14.992416 14.722569 10.579842 10.758363  8.894299
[37] 13.502299 12.994734 14.775563  9.818535 18.208089  8.438143
[43]  8.282819 11.090392 15.174881  7.704479  8.917742 10.275903
[49] 11.488700 16.572150 18.892428 13.544225  9.309845 13.713258
[55] 12.904993  8.951567  9.041688 10.222305 14.136072  9.222289
[61] 15.208694 14.627659 15.287092 11.389052  7.716052 14.307632
[67] 14.647653 18.705963 13.665201  8.025347 13.157791 14.336731
[73]  9.548584 12.522605 11.876452 12.241549 12.944160 17.637175
[79]  9.854223 17.877400 15.892081  9.893356  7.791175 11.901961
[85] 15.605362 13.464186 12.451922 16.090626  8.907932 16.333859
[91] 13.554146 19.586575 11.765020  9.981692  5.325750 20.168371
[97] 12.485393 14.349888 14.198229  7.315012 16.787920 10.998550
[103] 10.377856 13.531181 12.258939 11.346062 12.998020  8.498104
[109] 14.195263 15.372914 11.698431 12.929311 11.232474 21.551867
[115] 10.436798 14.430260 18.836296 14.838428 14.450987 10.879682
```

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Byla měřena rychlost reakce operátorů před a po speciálním cvičení v sekundách. Mělo cvičení statisticky významný vliv na rychlost?

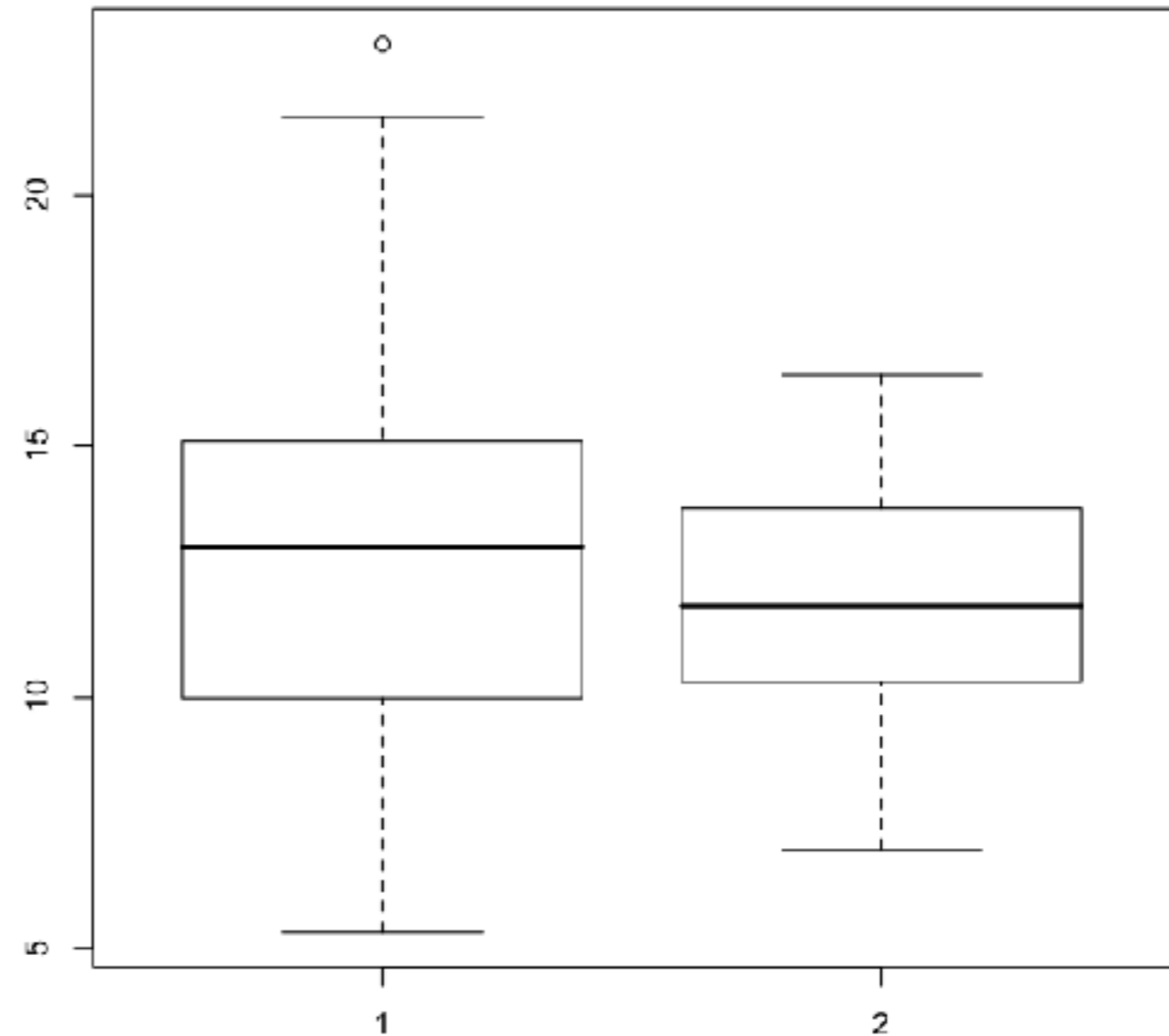
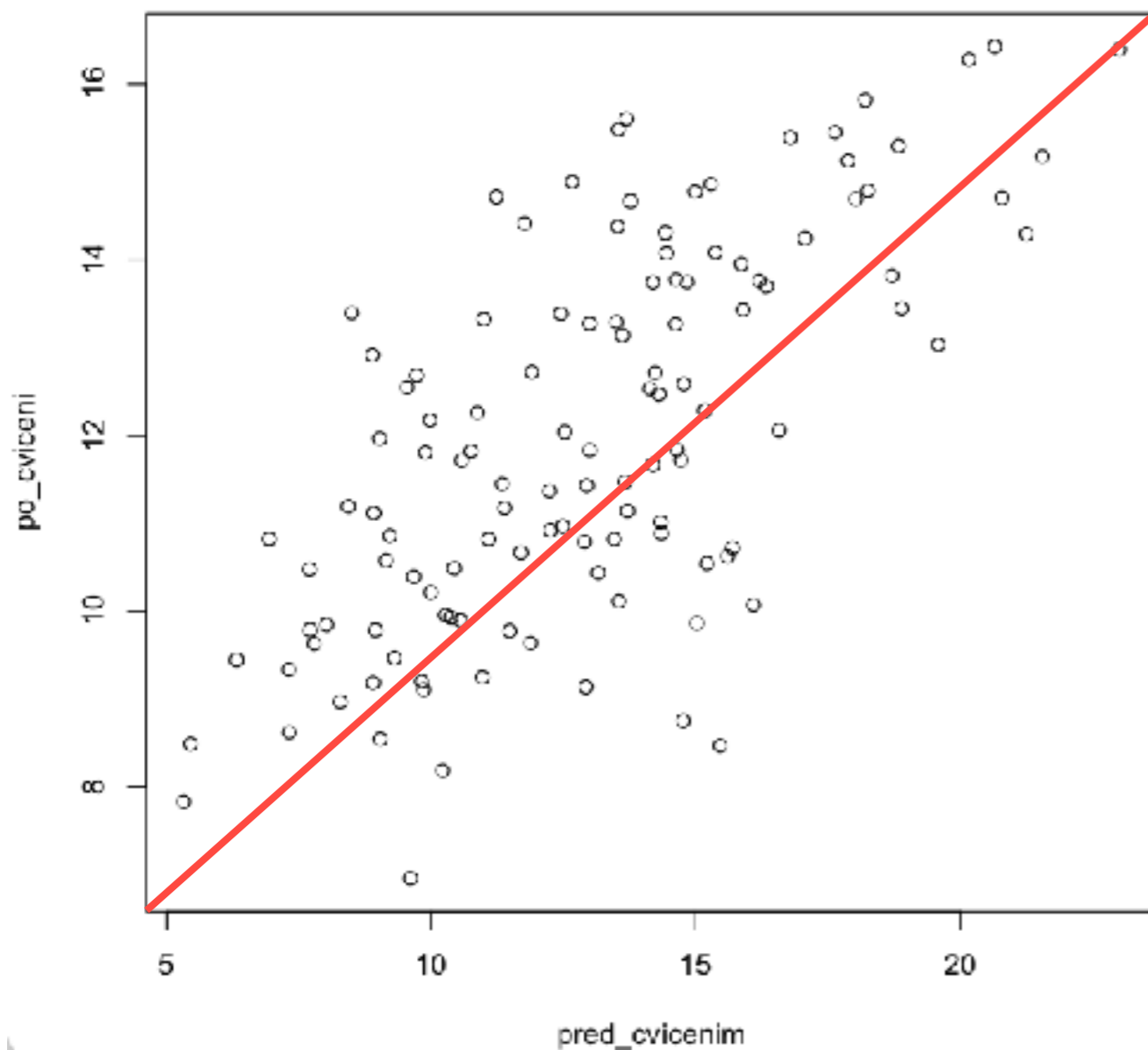
I) Data:

```
> po_cviceni
 [1] 14.889379  8.627612  9.867455 13.141168  9.249122  8.490774
 [7] 10.217290 10.724403 14.669450 14.243944 10.826905 13.951521
[13] 14.693401  9.449562 16.425888 16.392689 13.265474 14.704994
[19] 12.718107 10.395385  8.756276  6.961521 12.688497 10.578342
[25] 14.294064 13.763032  8.472324 15.605253 11.968936  9.897284
[31] 14.788205 14.773378 11.723336 11.719464 11.824407 12.914485
[37] 13.291805 13.272867 12.586791  9.202608 15.817188 11.197137
[43]  8.974410 10.823942 12.289400 10.483861 11.119684  9.956822
[49]  9.778551 12.062084 13.449972 15.481139  9.470557 11.143402
[55] 10.793291  9.786869  8.547580  8.188947 12.532635 10.862473
[61] 10.547040 13.774638 14.861969 11.180668  9.790466 12.469556
[67] 11.837173 13.820717 11.476120  9.850563 10.440890 11.015557
[73] 12.547672 12.041457  9.639740 11.368657 11.431948 15.449064
[79]  9.110052 15.125478 13.433802 11.807514  9.632299 12.725762
[85] 10.628523 10.824474 13.389953 10.077884  9.185360 13.697777
[91] 10.116078 13.036067 14.412094 12.175099  7.835201 16.277825
[97] 10.967441 10.892966 11.668289  9.340267 15.392018 13.323701
[103]  9.928631 14.378075 10.924935 11.448320 11.836161 13.397990
[109] 13.744963 14.083459 10.668370  9.139692 14.716621 15.173684
[115] 10.493444 14.308470 15.295041 13.748886 14.074436 12.261138
```

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Byla měřena rychlost reakce operátorů před a po speciálním cvičení v sekundách. Mělo cvičení statisticky významný vliv na rychlost?

2) Grafické zobrazení



Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Byla měřena rychlost reakce operátorů před a po speciálním cvičení v sekundách. Mělo cvičení statisticky významný vliv na rychlost?

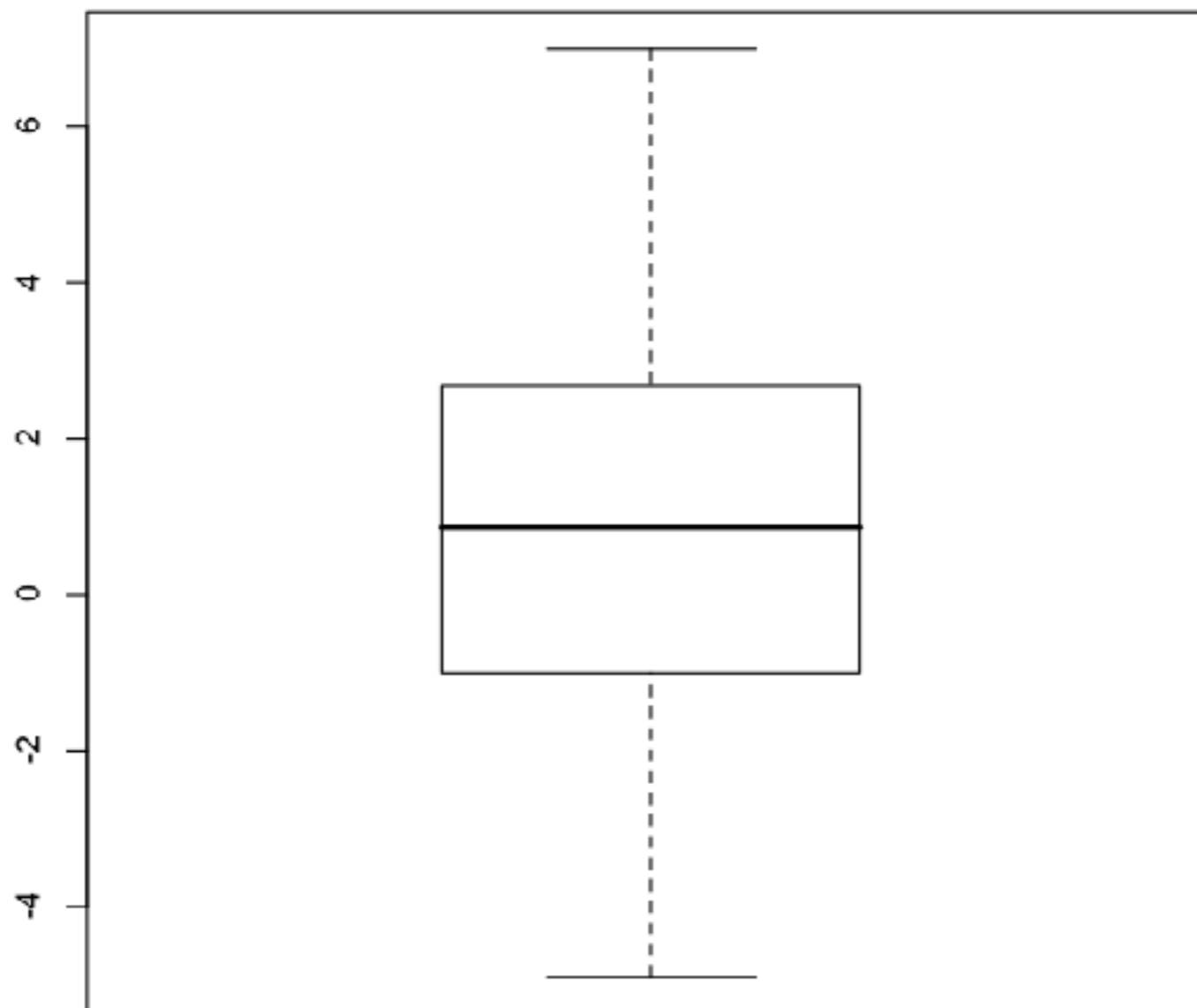
3) Rozdíl:

```
> rozdil = pred_cvicenim - po_cviceni
> rozdil
 [1] -2.22300091 -1.30482283  5.15425042  0.47574455  1.72159009 -3.02632291
 [7] -0.21765415  4.96936015 -0.89800534  2.82136665 -3.88619753  1.90922796
[13]  3.32594695 -3.12303070  4.22187531  6.61268030  1.35369637  6.08211421
[19]  1.52011877 -0.72104757  6.00689379  2.65226941 -2.96117094 -1.43204984
[25]  6.95289576  2.43709534  6.99374083 -1.91337370 -2.93682345  0.66110855
[31]  3.47069129  0.21903888  2.99923383 -1.13962267 -1.06604474 -4.02018585
[37]  0.21049440 -0.27813376  2.18877231  0.61592708  2.39090099 -2.75899399
[43] -0.69159043  0.26644963  2.88548193 -2.77938240 -2.20194265  0.31908043
[49]  1.71014906  4.51006508  5.44245554 -1.93691321 -0.16071226  2.56985696
[55]  2.11170209 -0.83530141  0.49410786  2.03335782  1.60343767 -1.64018405
[61]  4.66165463  0.85302053  0.42512280  0.20838398 -2.07441380  1.83807585
[67]  2.81048012  4.88524631  2.18908100 -1.82521582  2.71690126  3.32117337
[73] -2.99908758  0.48114855  2.23671217  0.87289130  1.51221215  2.18811115
[79]  0.74417071  2.75192209  2.45827873 -1.91415812 -1.84112463 -0.82380048
[85]  4.97683829  2.63971186 -0.93803104  6.01274276 -0.27742844  2.63608163
[91]  3.43806805  6.55050838 -2.64707408 -2.19340734 -2.50945055  3.89054571
[97]  1.51795203  3.45692228  2.52993961 -2.02525470  1.39590255 -2.32515191
[103] 0.44922574 -0.84689404  1.33400372 -0.10225811  1.16185938 -4.89988604
[109] 0.45029949  1.28945495  1.03006049  3.78961854 -3.48414755  6.37818258
[115] -0.05664624  0.12179055  3.54125530  1.08954167  0.37655117 -1.38145602
```

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Byla měřena rychlost reakce operátorů před a po speciálním cvičení v sekundách. Mělo cvičení statisticky významný vliv na rychlost?

3) Rozdíl:



Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Byla měřena rychlost reakce operátorů před a po speciálním cvičení v sekundách. Mělo cvičení statisticky významný vliv na rychlost?

4) Párový t-test:

```
> t.test(rozdil, mu=0)

One Sample t-test

data:  rozdil
t = 4.0391, df = 119, p-value = 9.54e-05
alternative hypothesis: true mean is not equal to 0
95 percent confidence interval:
 0.5089508 1.4878397
sample estimates:
mean of x
0.9983952
```

Srovnání dvou náhodných veličin

Příklad: Byla měřena rychlost reakce operátorů před a po speciálním cvičení v sekundách. Mělo cvičení statisticky významný vliv na rychlost?

4) Párový t-test:

```
> t.test(rozdil, mu=0)

One Sample t-test

data:  rozdil
t = 4.0391, df = 119, p-value = 9.54e-05
alternative hypothesis: true mean is not equal to 0
95 percent confidence interval:
 0.5089508 1.4878397
sample estimates:
mean of x
0.9983952
```

=> nulovou hypotézu zamítáme,
cvičení mělo vliv a rychlost reakce se statisticky významně zvýšila

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2) \quad Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

~~$$X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2) \quad Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$~~

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

- a) dvě nezávislá měření
- b) párová měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$\del{X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2)} \quad \del{Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)}$$

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

- a) dvě nezávislá měření
- b) párová měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$\del X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2) \quad \del Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

Neparametrické testy pro srovnání dvou souborů dat:

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

- a) dvě nezávislá měření
- b) párová měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$\cancel{X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2)} \quad \cancel{Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)}$$

Neparametrické testy pro srovnání dvou souborů dat:

1) Dvouvýběrový Wilcoxonův test

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

- a) dvě nezávislá měření
- b) párová měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$\del X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2) \quad \del Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

Neparametrické testy pro srovnání dvou souborů dat:

- 1) Dvouvýběrový Wilcoxonův test
- 2) Párový (jednovýběrový) Wilcoxonův test

Srovnání dvou náhodných veličin

Dvě nezávislá měření

- a) dvě nezávislá měření
- b) párová měření

$$X : X_1, X_2, \dots, X_n \quad Y : Y_1, Y_2, \dots, Y_m$$

$$\del{X \sim N(\mu_X, \sigma_X^2)} \quad \del{Y \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)}$$

Neparametrické testy pro srovnání dvou souborů dat:

- 1) Dvouvýběrový Wilcoxonův test
- 2) Párový (jednovýběrový) Wilcoxonův test
- 3) Znaménkový test

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Dvouvýběrový Wilcoxonův test $H_0 : \mu_X = \mu_Y$ $H_A : \mu_X \neq \mu_Y$

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Dvouvýběrový Wilcoxonův test $H_0 : \mu_X = \mu_Y$ $H_A : \mu_X \neq \mu_Y$

- Sloučíme všechna měření v jeden soubor: $X_1, X_2, \dots, X_n, Y_1, Y_2, \dots, Y_m$

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Dvouvýběrový Wilcoxonův test $H_0 : \mu_X = \mu_Y$ $H_A : \mu_X \neq \mu_Y$

- Sloučíme všechna měření v jeden soubor: $X_1, X_2, \dots, X_n, Y_1, Y_2, \dots, Y_m$
- Uspořádáme je podle velikosti a potom určíme:

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Dvouvýběrový Wilcoxonův test $H_0 : \mu_X = \mu_Y$ $H_A : \mu_X \neq \mu_Y$

- Sloučíme všechna měření v jeden soubor: $X_1, X_2, \dots, X_n, Y_1, Y_2, \dots, Y_m$
- Uspořádáme je podle velikosti a potom určíme:
 - R_k^X = pořadí k-tého pozorování X ve spojeném souboru

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Dvouvýběrový Wilcoxonův test $H_0 : \mu_X = \mu_Y$ $H_A : \mu_X \neq \mu_Y$

- Sloučíme všechna měření v jeden soubor: $X_1, X_2, \dots, X_n, Y_1, Y_2, \dots, Y_m$
- Uspořádáme je podle velikosti a potom určíme:
 - R_k^X = pořadí k-tého pozorování X ve spojeném souboru
 - R_l^Y = pořadí l-tého pozorování Y ve spojeném souboru

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Dvouvýběrový Wilcoxonův test $H_0 : \mu_X = \mu_Y$ $H_A : \mu_X \neq \mu_Y$

- Sloučíme všechna měření v jeden soubor: $X_1, X_2, \dots, X_n, Y_1, Y_2, \dots, Y_m$
- Uspořádáme je podle velikosti a potom určíme:
 - R_k^X = pořadí k-tého pozorování X ve spojeném souboru
 - R_l^Y = pořadí l-tého pozorování Y ve spojeném souboru
 - R^X = součet všech R_k^X pro $k=1, \dots, n$ a R^Y = součet všech R_l^Y pro $l=1, \dots, m$

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Dvouvýběrový Wilcoxonův test $H_0 : \mu_X = \mu_Y$ $H_A : \mu_X \neq \mu_Y$

- Sloučíme všechna měření v jeden soubor: $X_1, X_2, \dots, X_n, Y_1, Y_2, \dots, Y_m$
- Uspořádáme je podle velikosti a potom určíme:
 - R_k^X = pořadí k-tého pozorování X ve spojeném souboru
 - R_l^Y = pořadí l-tého pozorování Y ve spojeném souboru
 - R^X = součet všech R_k^X pro $k=1, \dots, n$ a R^Y = součet všech R_l^Y pro $l=1, \dots, m$

Pro malá n, m (do 30) porovnáváme přímo jednu z hodnot buď R^X nebo R^Y s kritickými hodnotami pro dvouvýběrový Wilcoxonův test (viz např. https://is.muni.cz/th/r5oe7/Bakalarska_prace.pdf), pro velké hodnoty n a m (nad 30) lze jako testovou statistiku použít

$$W = \frac{R^X - E(R^X)}{\sqrt{\text{var}(R^X)}}$$

kde $E(R^X) = \frac{n(m+n+1)}{2}$, $\text{var}(R^X) = \frac{mn(m+n+1)}{12}$

Tato statistika má přibližně $N(0,1)$ rozdělení.

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Párový Wilcoxonův test

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Párový Wilcoxonův test

- Spočítáme rozdíly $(X_1 - Y_1)$, $(X_2 - Y_2)$, ..., $(X_n - Y_n)$ a vyloučíme nulové rozdíly

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Párový Wilcoxonův test

- Spočítáme rozdíly $(X_1 - Y_1), (X_2 - Y_2), \dots, (X_n - Y_n)$ a vyloučíme nulové rozdíly
- Uspořádáme je podle velikosti absolutních hodnot a potom určíme:

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Párový Wilcoxonův test

- Spočítáme rozdíly $(X_1 - Y_1), (X_2 - Y_2), \dots, (X_n - Y_n)$ a vyloučíme nulové rozdíly
- Uspořádáme je podle velikosti absolutních hodnot a potom určíme:
 - R_k^+ = pořadí k-tého kladného rozdílu, R_l^- = pořadí l-tého záporného rozdílu

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Párový Wilcoxonův test

- Spočítáme rozdíly $(X_1 - Y_1), (X_2 - Y_2), \dots, (X_n - Y_n)$ a vyloučíme nulové rozdíly
- Uspořádáme je podle velikosti absolutních hodnot a potom určíme:
 - R_k^+ = pořadí k-tého kladného rozdílu, R_l^- = pořadí l-tého záporného rozdílu
 - R^+ = součet všech R_k^+ a R^- = součet všech R_l^-

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Párový Wilcoxonův test

- Spočítáme rozdíly $(X_1 - Y_1), (X_2 - Y_2), \dots, (X_n - Y_n)$ a vyloučíme nulové rozdíly
- Uspořádáme je podle velikosti absolutních hodnot a potom určíme:
 - R_k^+ = pořadí k-tého kladného rozdílu, R_l^- = pořadí l-tého záporného rozdílu
 - R^+ = součet všech R_k^+ a R^- = součet všech R_l^-

Pro malá n, m (do 30) porovnáваме přímo jednu z hodnot buď R^+ nebo R^- s kritickými hodnotami pro jednovýběrový Wilcoxonův test (viz např. https://is.muni.cz/th/r5oe7/Bakalarska_prace.pdf), pro velké hodnoty n a m (nad 30) lze jako testovou statistiku použít

$$V = \frac{R^+ - E(R^+)}{\sqrt{\text{var}(R^+)}}$$

kde $E(R^+) = \frac{n^*(n^* + 1)}{4}$, $\text{var}(R^+) = \frac{n^*(n^* + 1)(2n^* + 1)}{24}$ a n^* je počet

nenulových rozdílů. Tato statistika má přibližně $N(0, 1)$ rozdělení.

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Znaménkový test (párový test)

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Znaménkový test (párový test)

- Spočítáme rozdíly $(X_1 - Y_1)$, $(X_2 - Y_2)$, ..., $(X_n - Y_n)$ a vyloučíme nulové rozdíly

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Znaménkový test (párový test)

- Spočítáme rozdíly $(X_1 - Y_1)$, $(X_2 - Y_2)$, ..., $(X_n - Y_n)$ a vyloučíme nulové rozdíly
- Spočteme počet záporných rozdílů Z a počet nenulových rozdílů n^*

Srovnání dvou náhodných veličin

Neparametrické testy jsou založeny na **pořadových statistikách**:

Znaménkový test (párový test)

- Spočítáme rozdíly $(X_1 - Y_1), (X_2 - Y_2), \dots, (X_n - Y_n)$ a vyloučíme nulové rozdíly
- Spočteme počet záporných rozdílů Z a počet nenulových rozdílů n^*

Statistika Z má binomické rozdělení s parametry n^* a $1/2$, pro velké hodnoty n^* ji lze aproximovat normálním rozdělením a tedy test založit na statistice

$$S = \frac{|2Z - n^*|}{\sqrt{n^*}}$$

která má přibližně $N(0,1)$ rozdělení. Hypotézu o shodě zamítáme, když je $S \geq u(1 - \alpha/2)$.

Srovnání více náhodných veličin

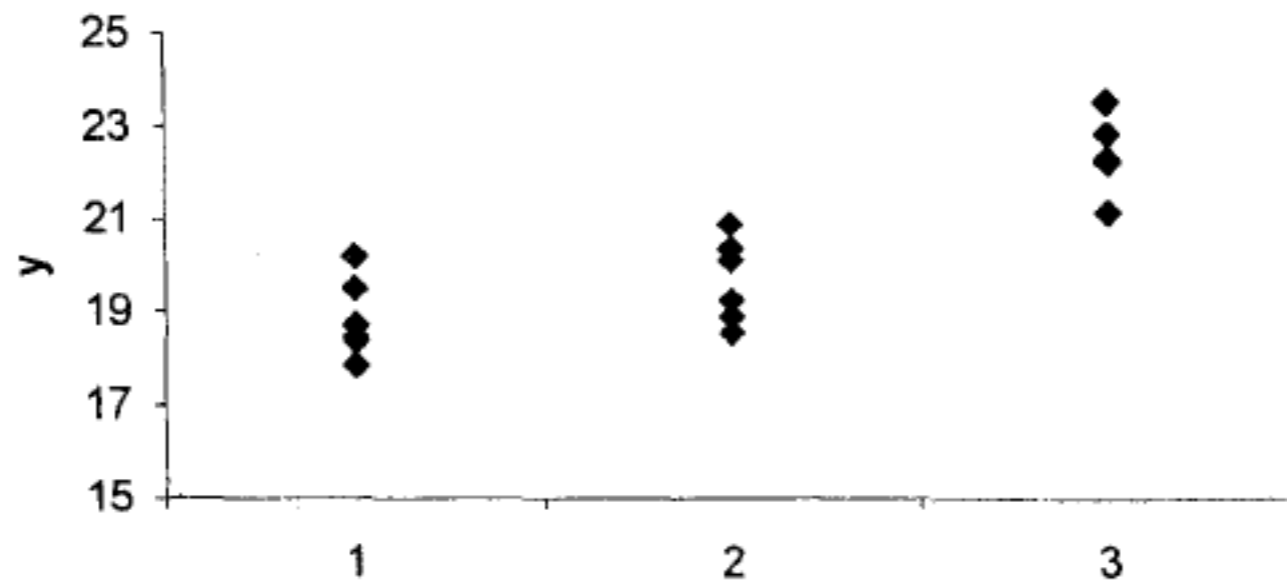
Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.

$$X_1^1, X_2^1, \dots, X_{n_1}^1, \quad X_1^2, X_2^2, \dots, X_{n_2}^2, \quad X_1^3, X_2^3, \dots, X_{n_3}^3,$$

Srovnání více náhodných veličin

Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.

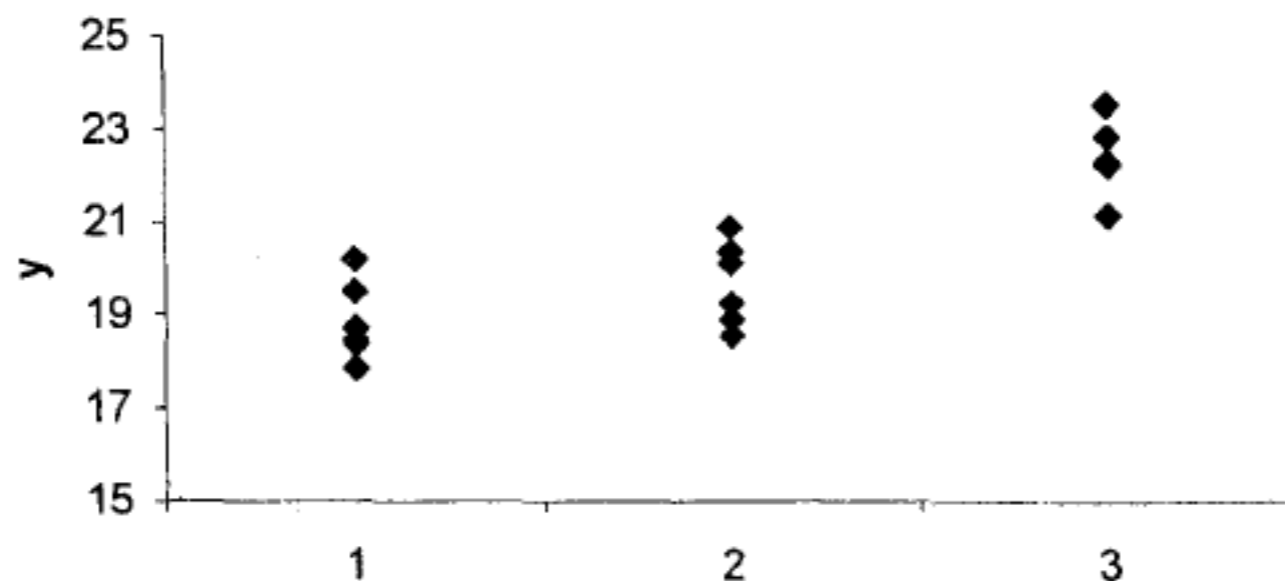
$$X_1^1, X_2^1, \dots, X_{n_1}^1, \quad X_1^2, X_2^2, \dots, X_{n_2}^2, \quad X_1^3, X_2^3, \dots, X_{n_3}^3,$$



Srovnání více náhodných veličin

Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.

$$X_1^1, X_2^1, \dots, X_{n_1}^1, \quad X_1^2, X_2^2, \dots, X_{n_2}^2, \quad X_1^3, X_2^3, \dots, X_{n_3}^3,$$



nulová hypotéza

$$H_0: \mu_1 = \mu_2 = \mu_3$$

alternativní hypotéza

$$H_A: \mu_i \neq \mu_j \text{ pro některou dvojici } i, j \text{ (oboustranná)}$$

hladina významnosti

$$\alpha = 5\%$$

Srovnání více náhodných veličin

Jedna z možností je provést $k(k-1)/2$ porovnání pomocí dvouvýběrových testů.

ALE: tím se výrazně zvýší hladina významnosti.

Srovnání více náhodných veličin

Jedna z možností je provést $k(k-1)/2$ porovnání pomocí dvouvýběrových testů.

ALE: tím se výrazně zvýší hladina významnosti.

	hladina významnosti v <i>t</i> -testu					
počet porovnávání <i>k</i>	0,20	0,10	0,05	0,02	0,01	0,001
2	0,20	0,10	0,05	0,02	0,01	0,001
3	0,41	0,23	0,13	0,05	0,03	0,003
4	0,58	0,36	0,21	0,09	0,05	0,006
5	0,71	0,47	0,23	0,13	0,07	0,009
10	0,96	0,83	0,63	0,37	0,23	0,034
20	1,00	0,98	0,92	0,71	0,52	0,109
∞	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,000

Srovnání více náhodných veličin

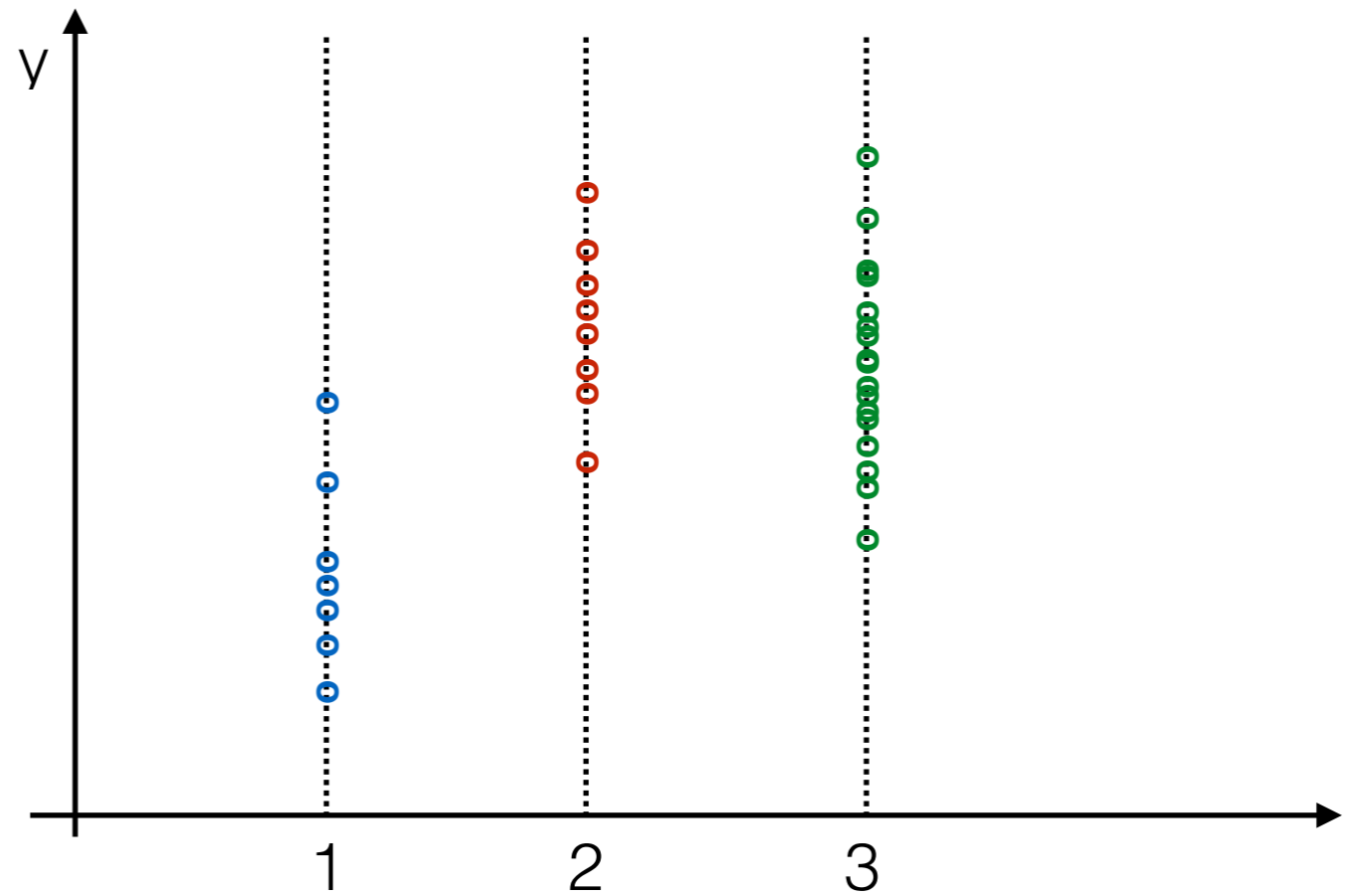
Jedna z možností je provést $k(k-1)/2$ porovnání pomocí dvouvýběrových testů.

ALE: tím se výrazně zvýší hladina významnosti.

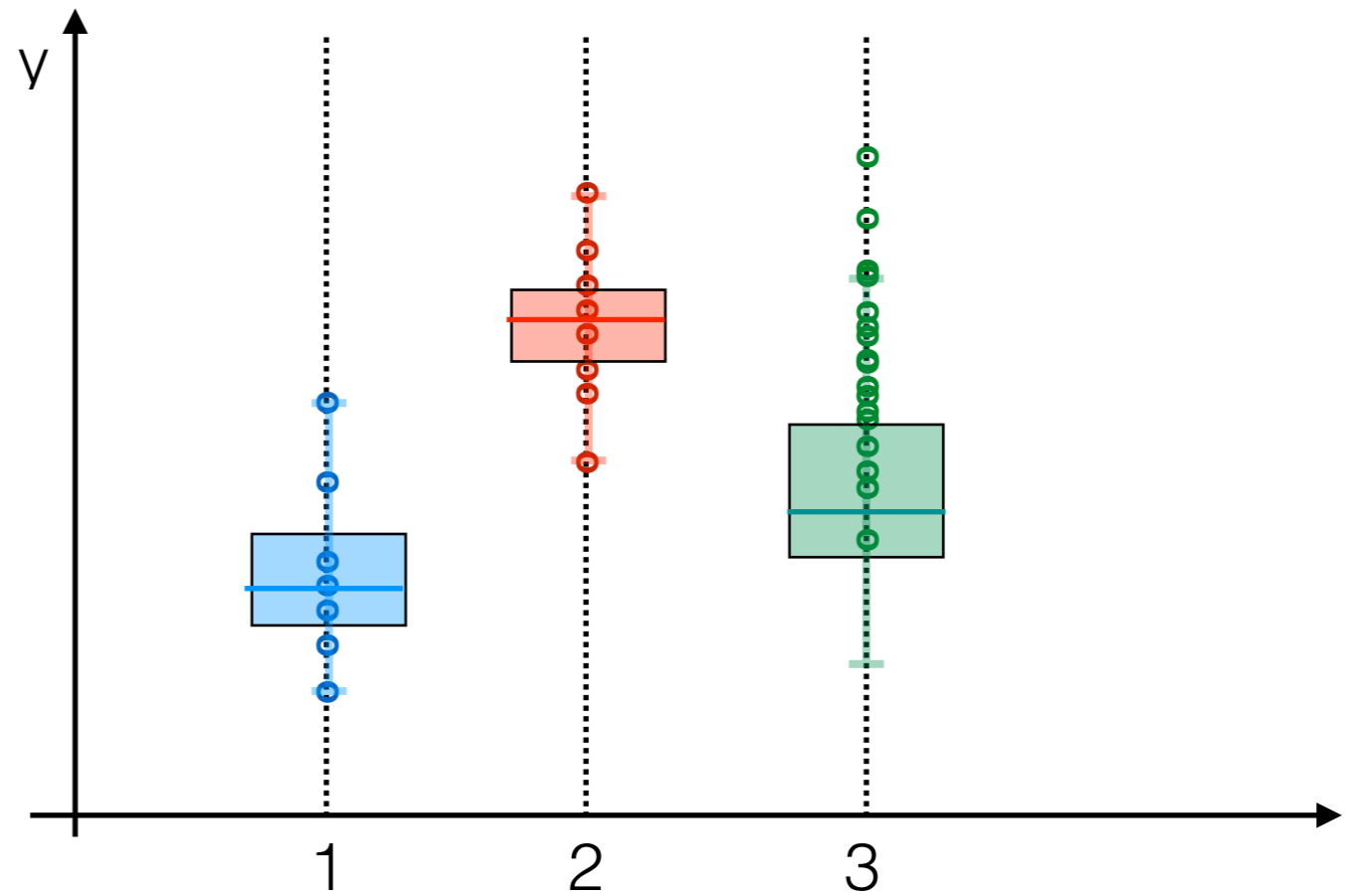
	hladina významnosti v <i>t</i> -testu					
počet porovnávání <i>k</i>	0,20	0,10	0,05	0,02	0,01	0,001
2	0,20	0,10	0,05	0,02	0,01	0,001
3	0,41	0,23	0,13	0,05	0,03	0,003
4	0,58	0,36	0,21	0,09	0,05	0,006
5	0,71	0,47	0,23	0,13	0,07	0,009
10	0,96	0,83	0,63	0,37	0,23	0,034
20	1,00	0,98	0,92	0,71	0,52	0,109
∞	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,000

Tedy je třeba provádět tzv. simultánní test.

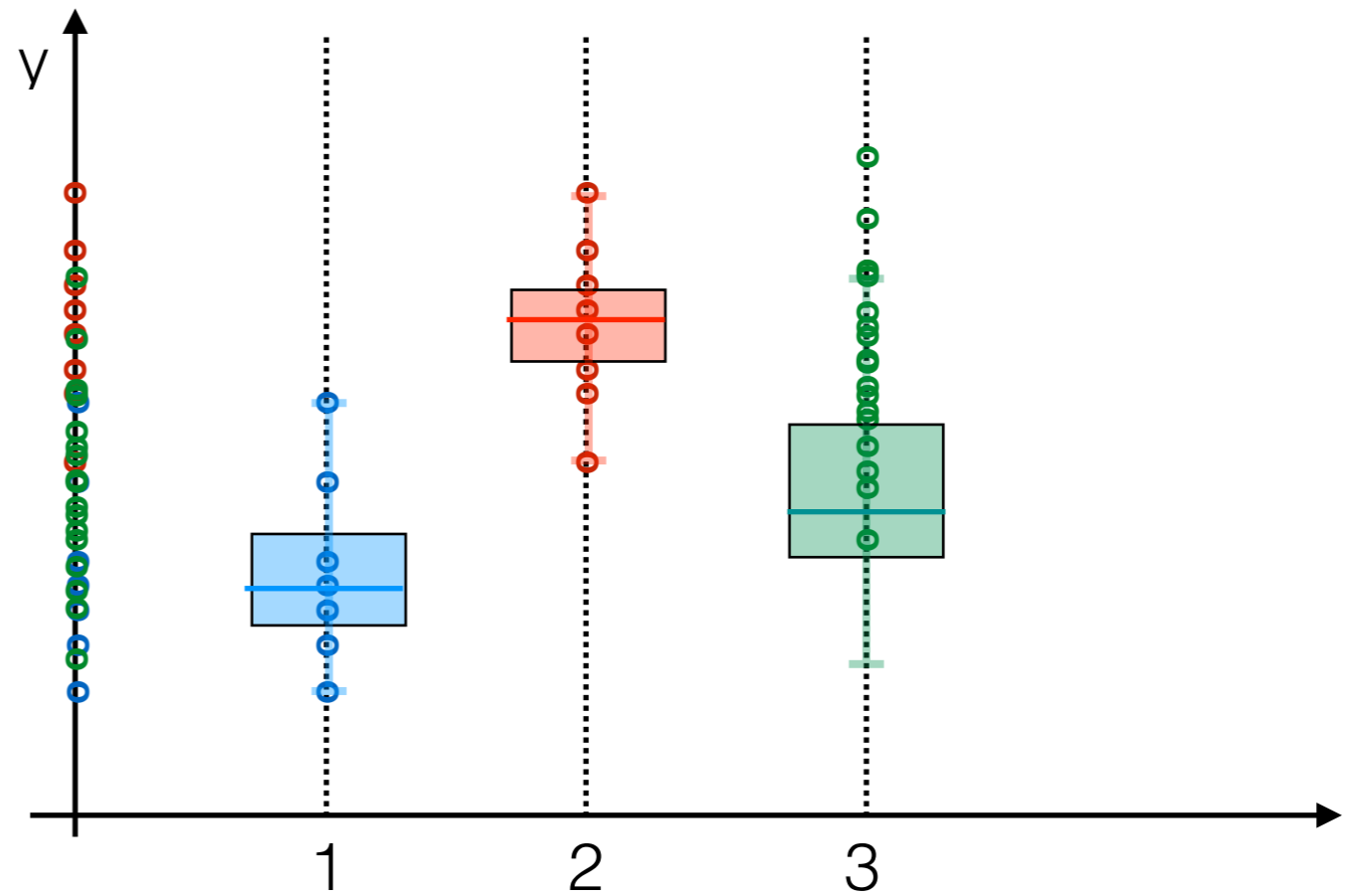
Srovnání více náhodných veličin



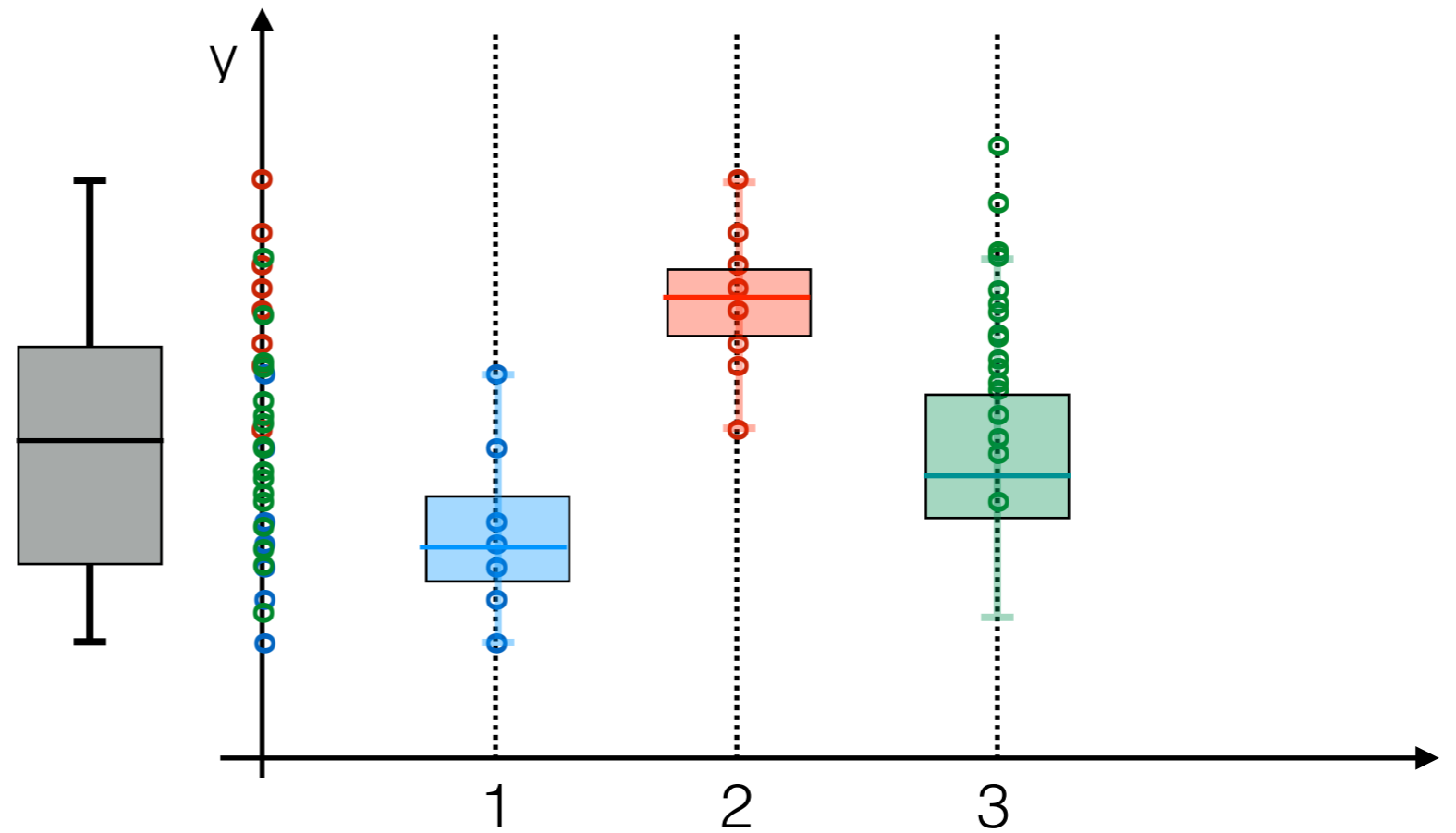
Srovnání více náhodných veličin



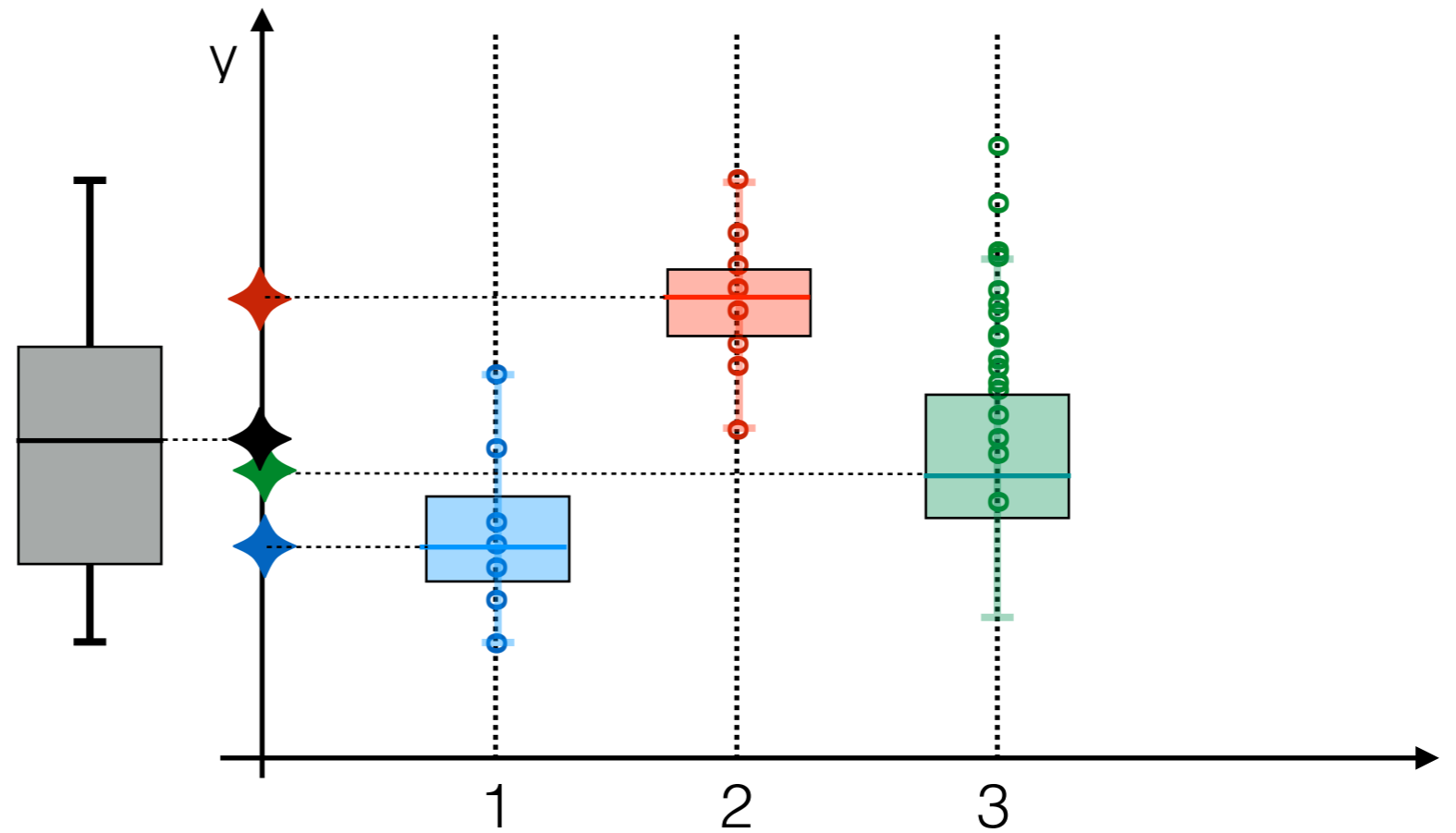
Srovnání více náhodných veličin



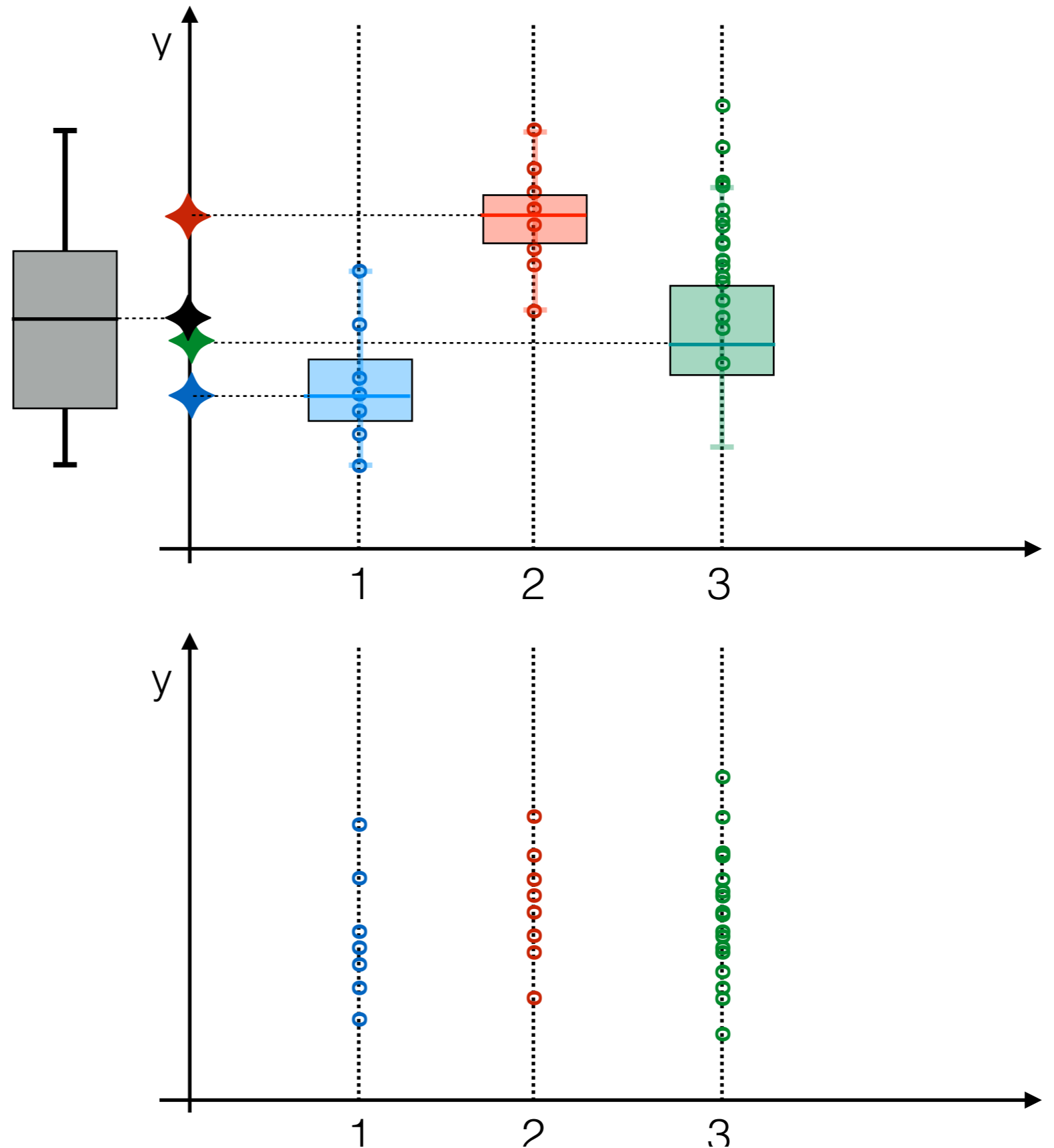
Srovnání více náhodných veličin



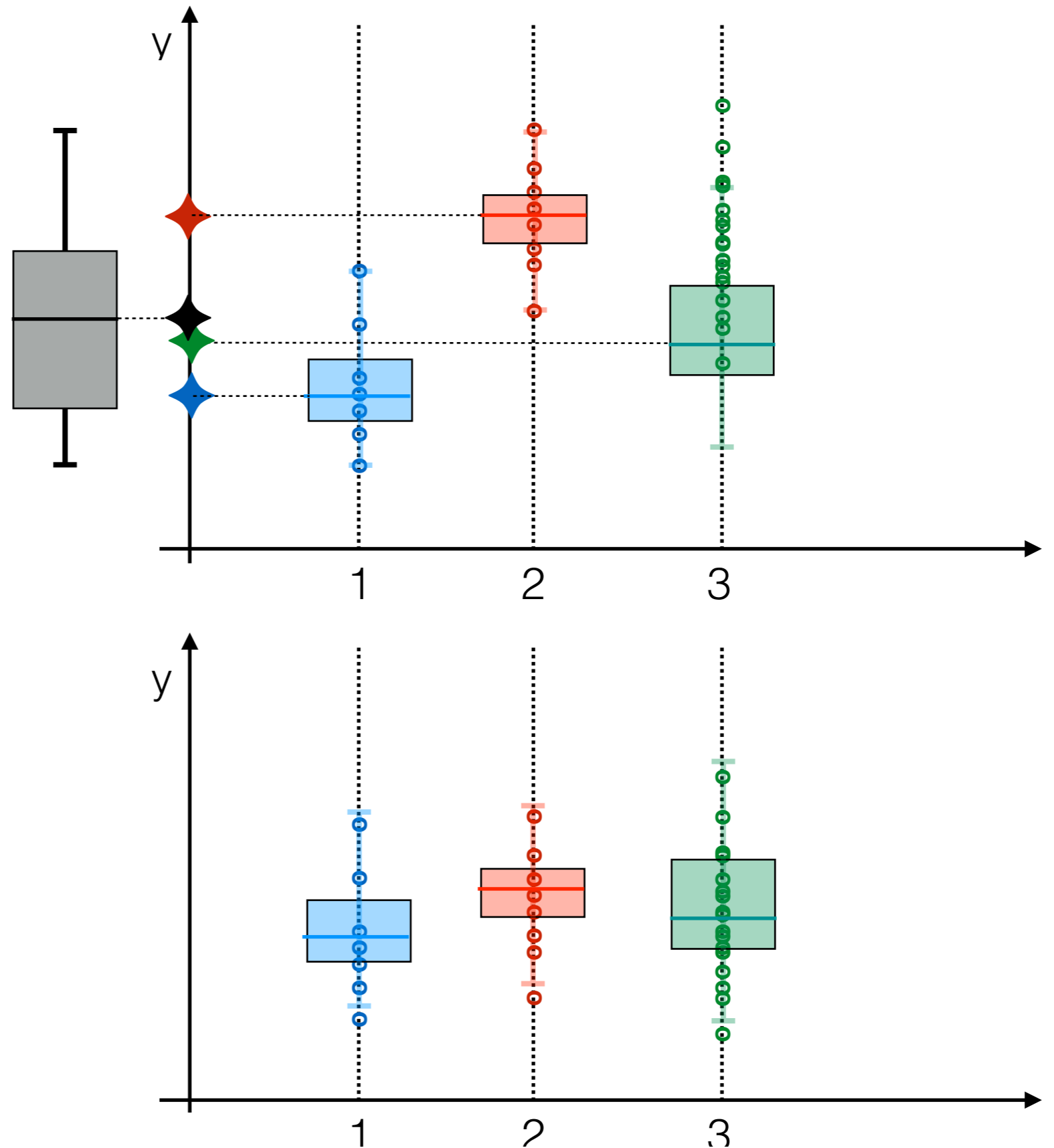
Srovnání více náhodných veličin



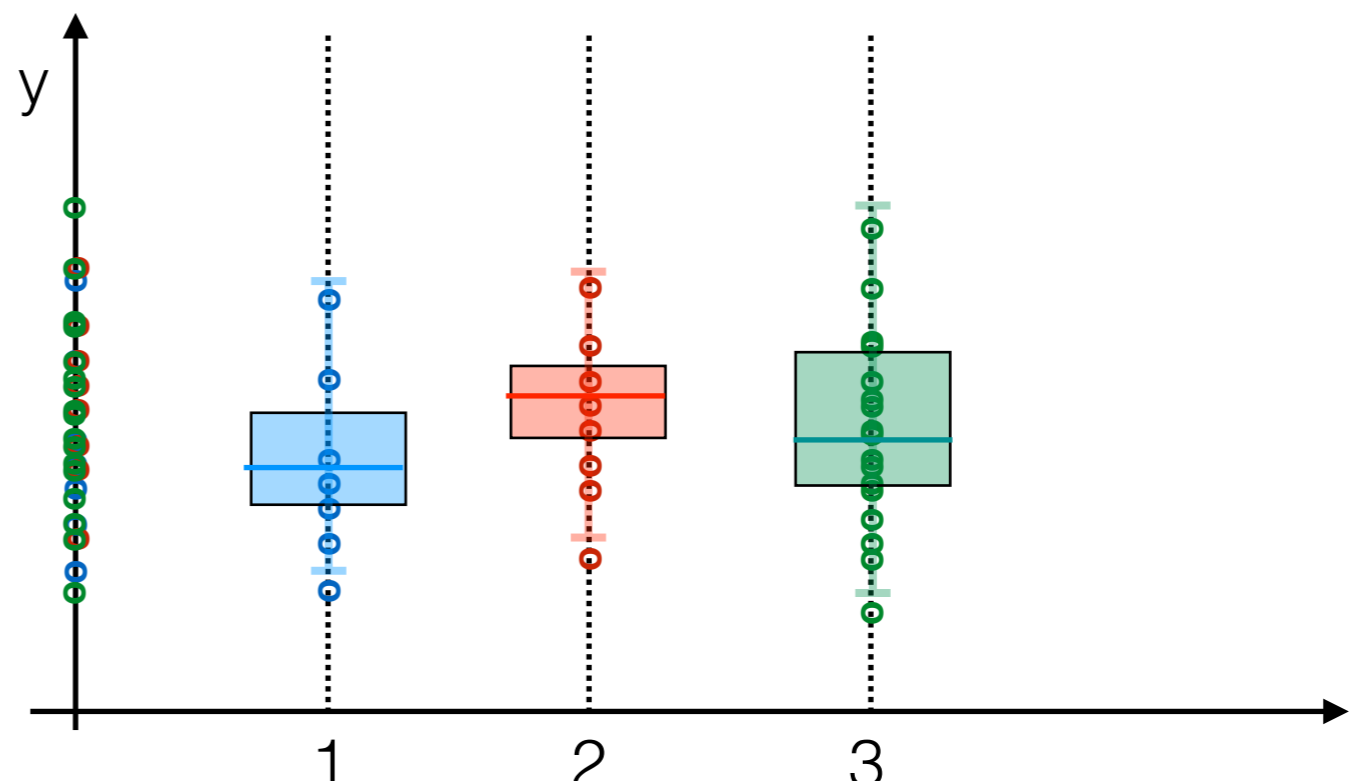
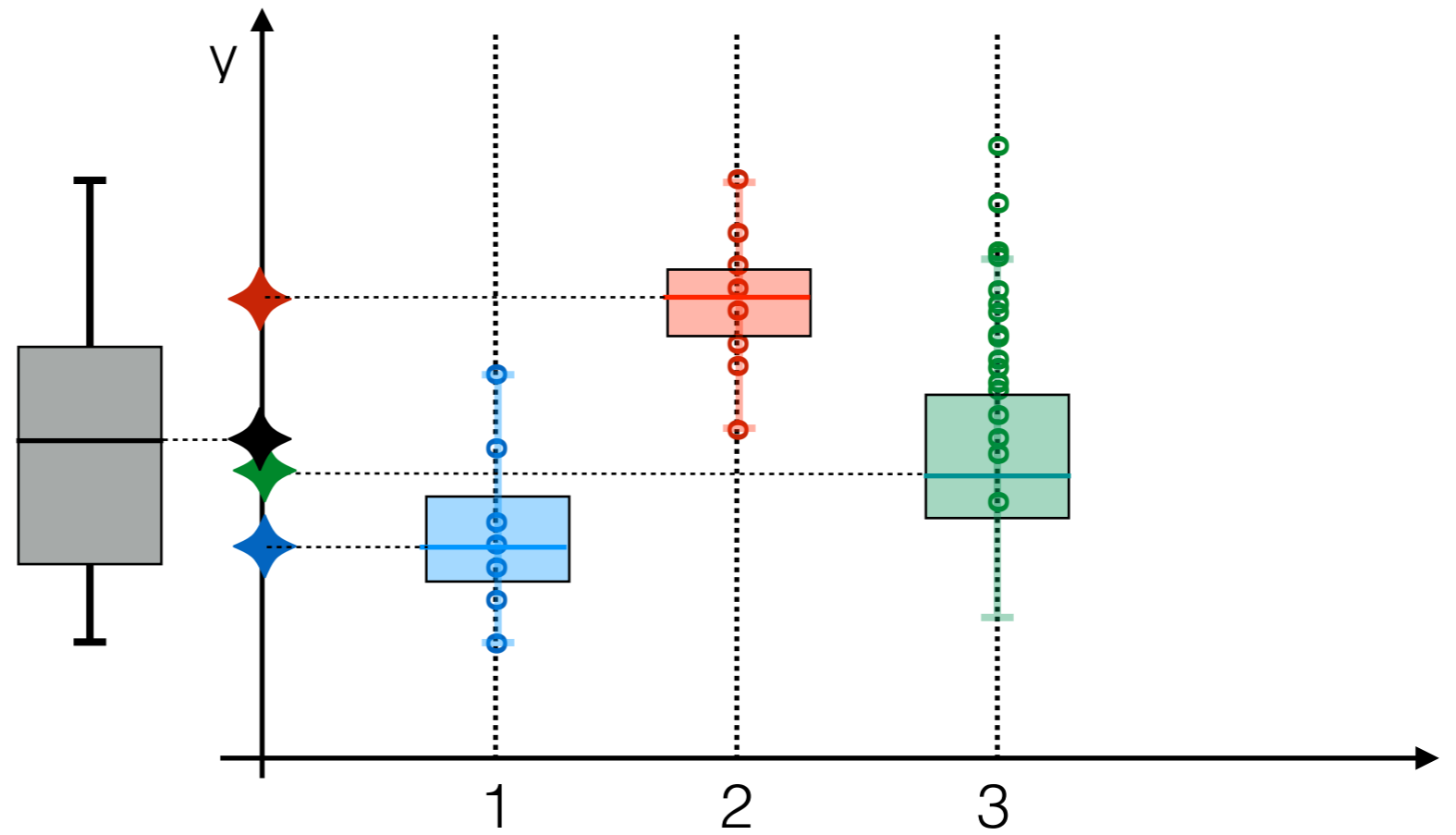
Srovnání více náhodných veličin



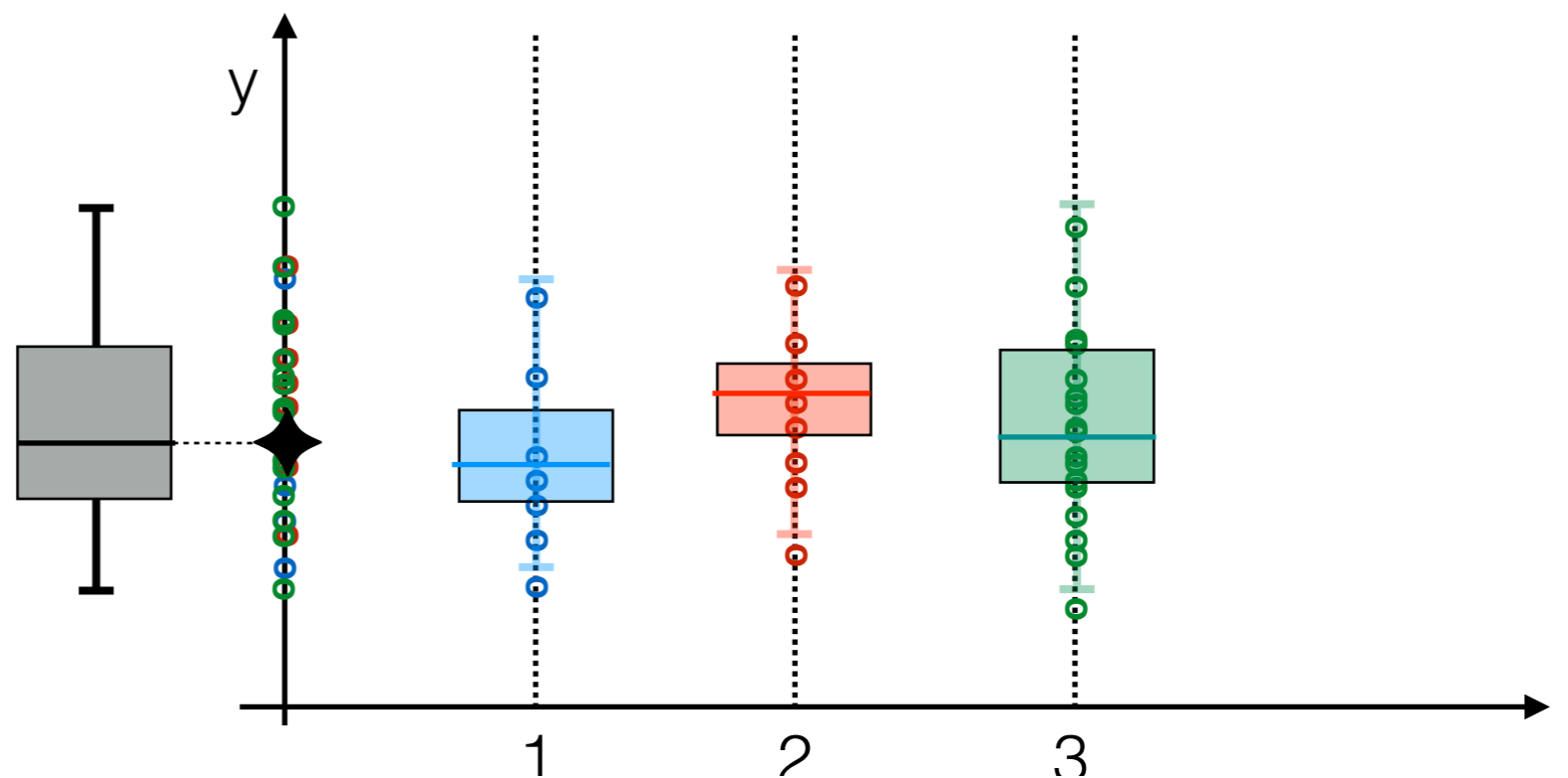
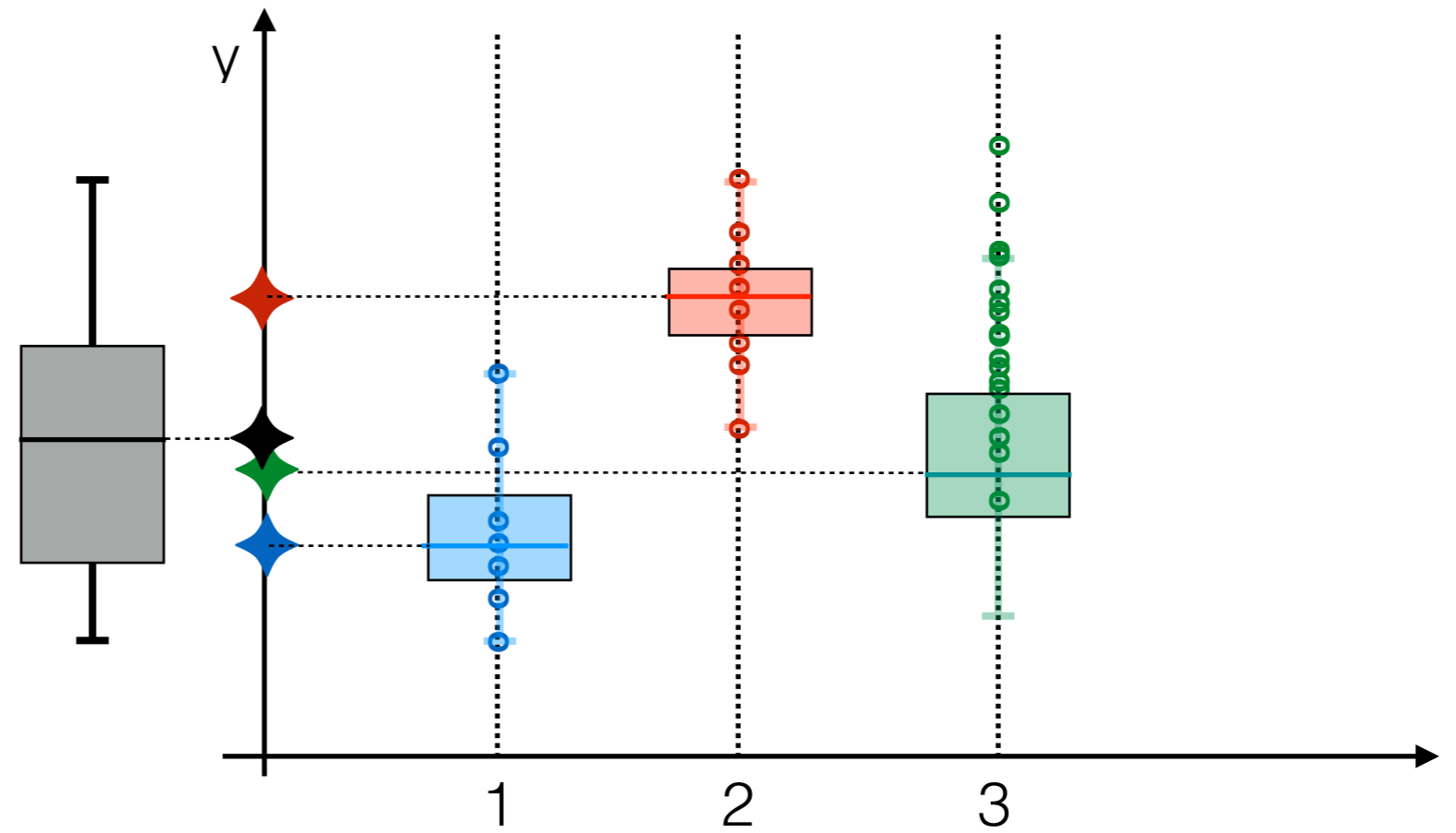
Srovnání více náhodných veličin



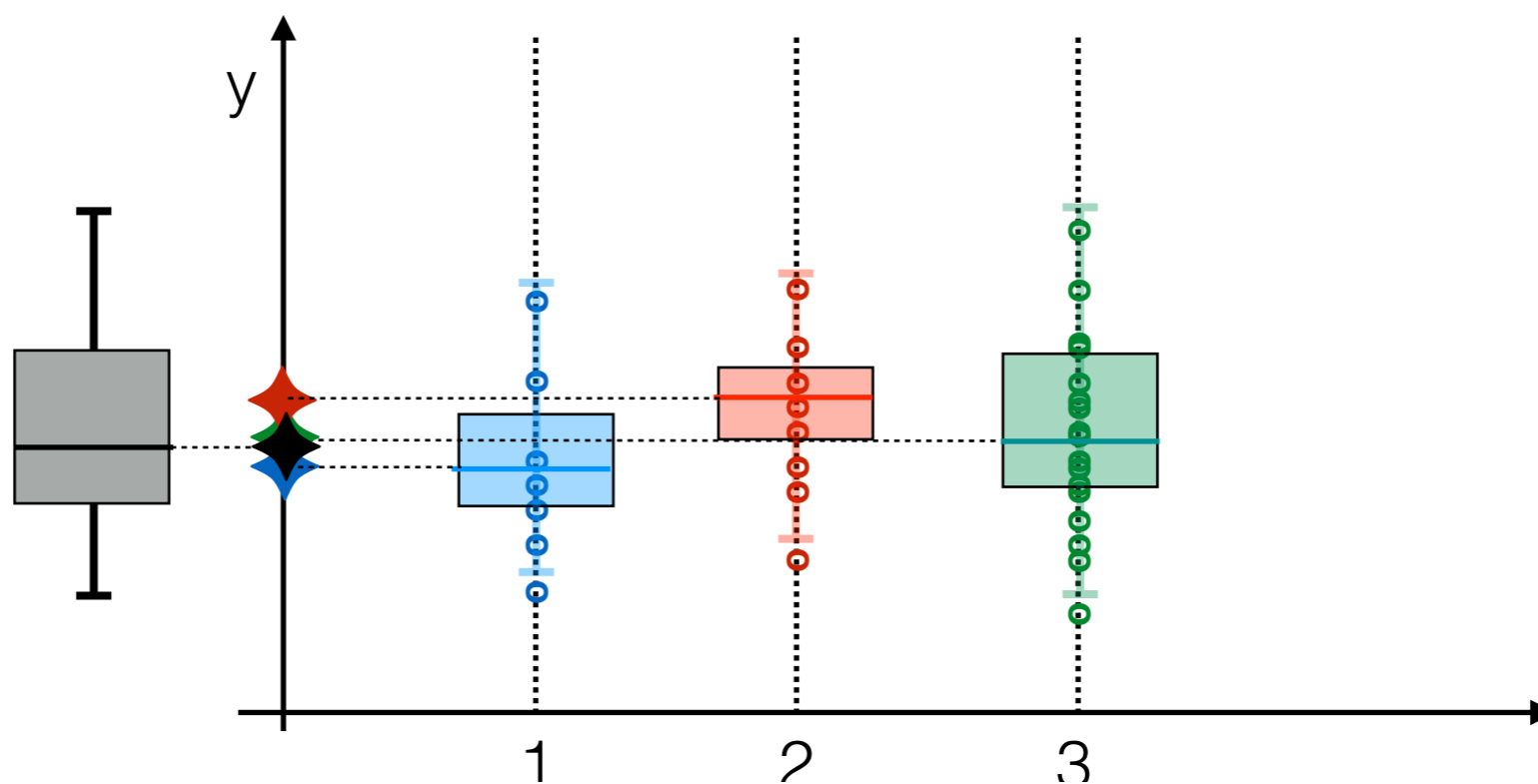
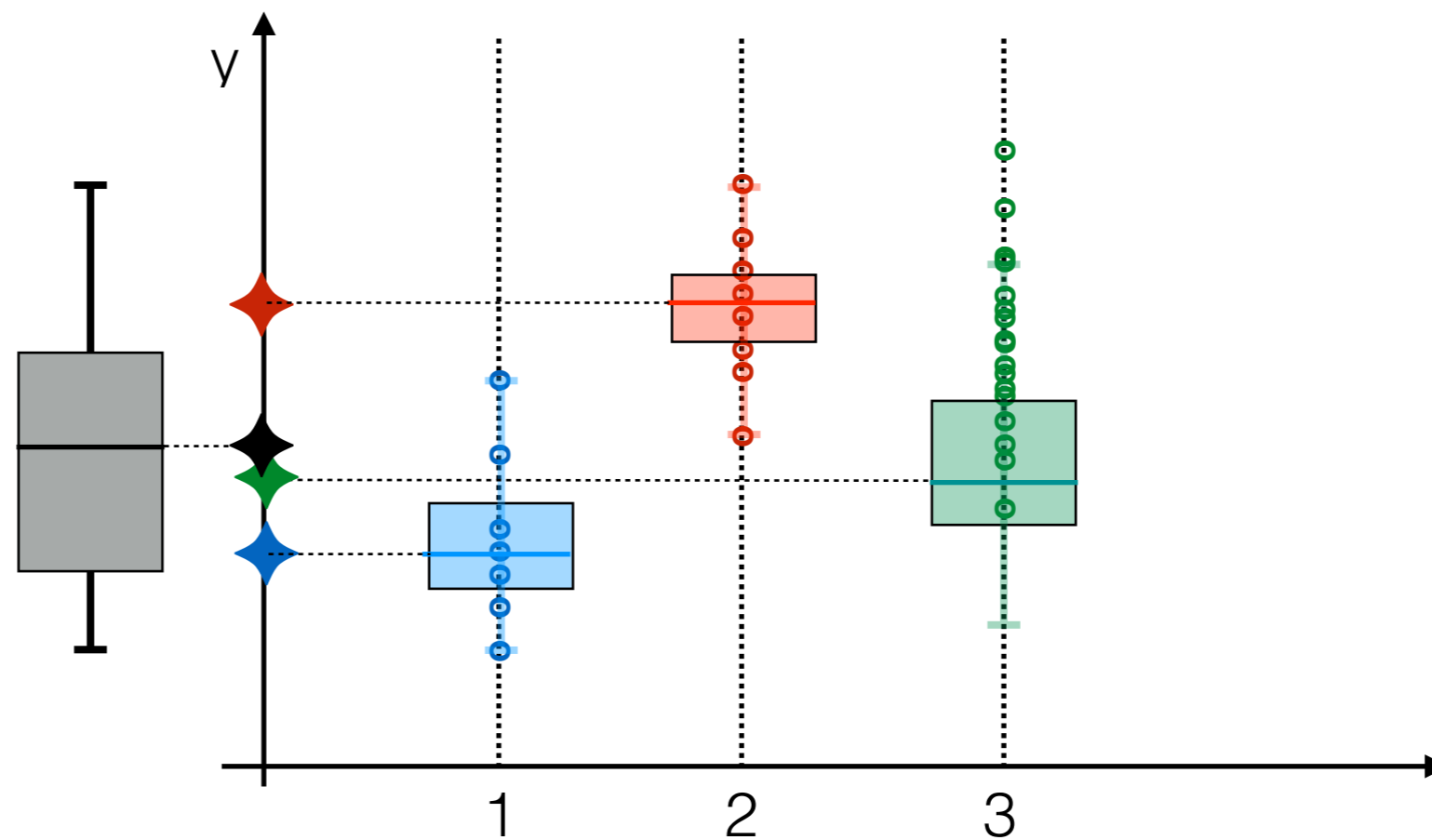
Srovnání více náhodných veličin



Srovnání více náhodných veličin

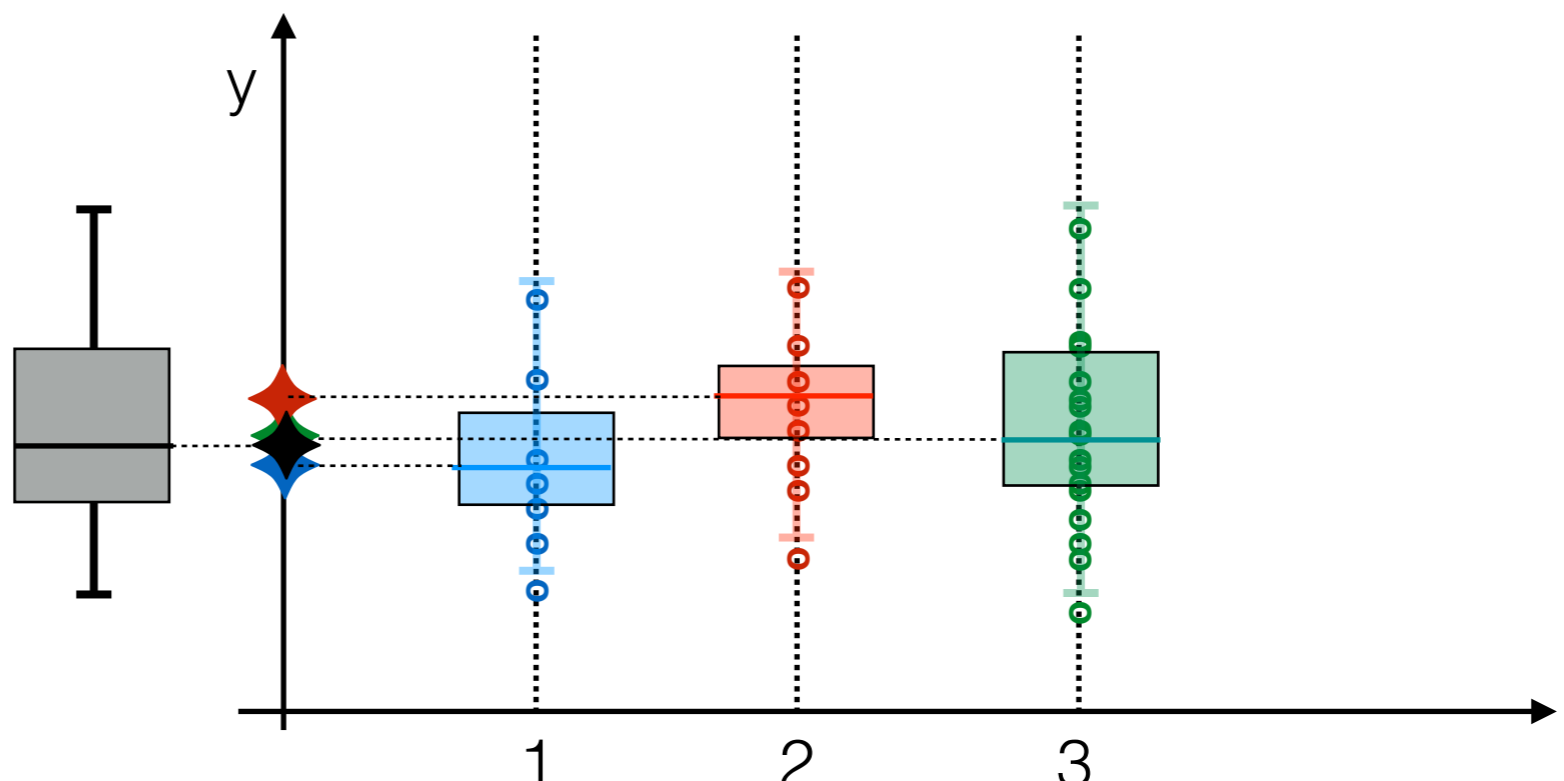
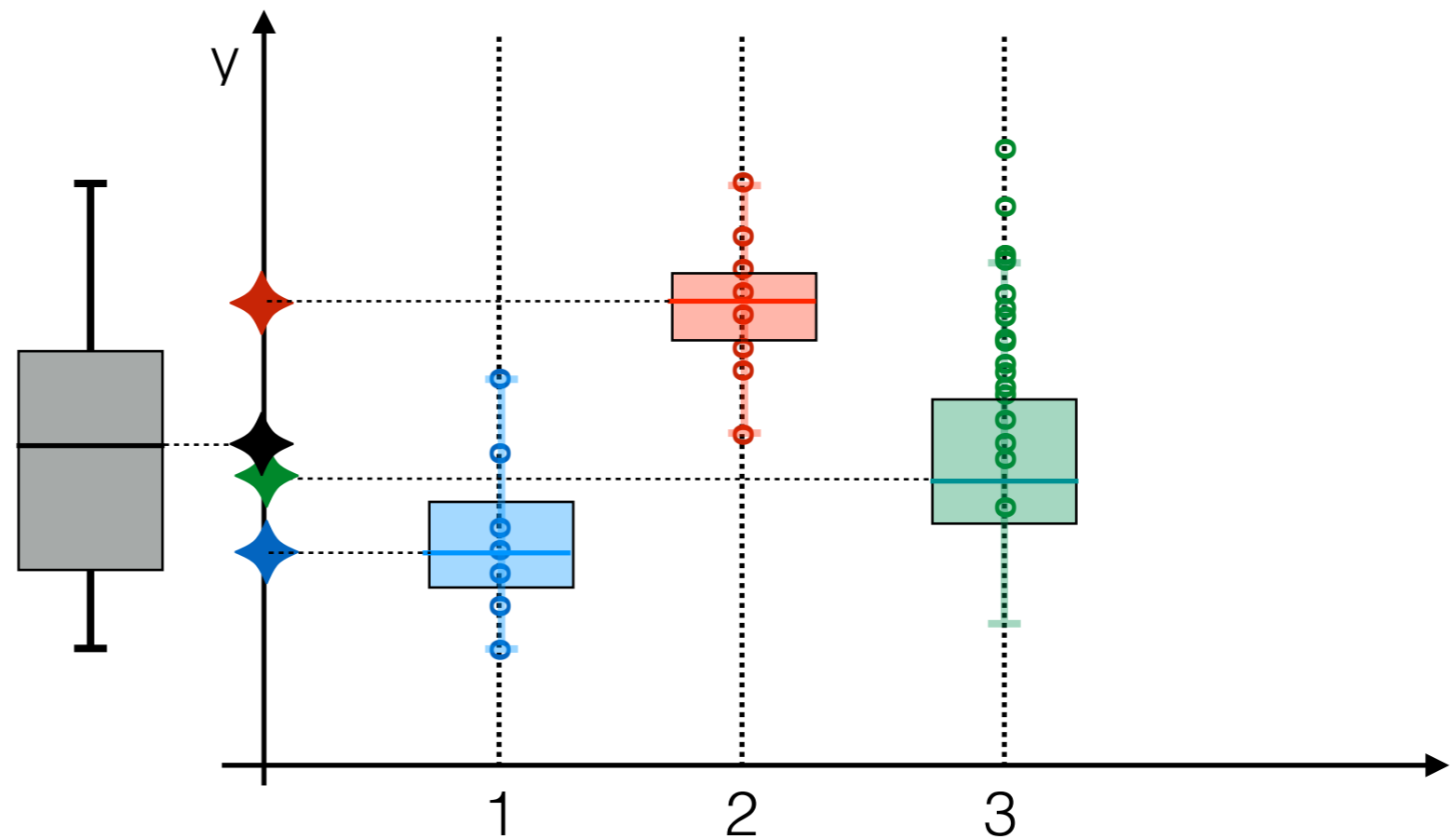


Srovnání více náhodných veličin



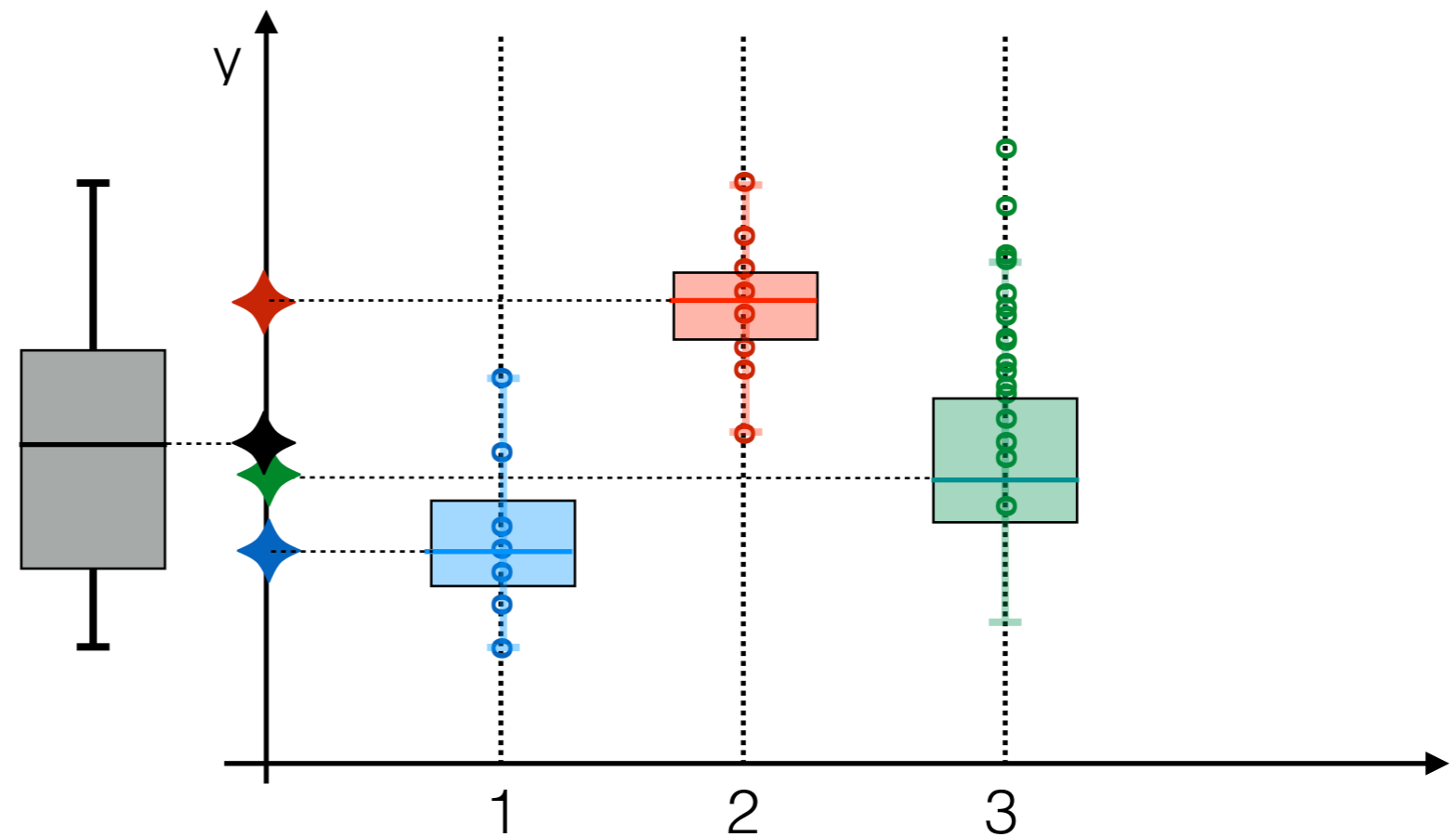
Srovnání více náhodných veličin

Rozptyl mezi skupinami je **velký** vzhledem k součtu rozptylů uvnitř skupin => střední hodnoty **jsou různé** => nulovou hypotézu **zamítáme**

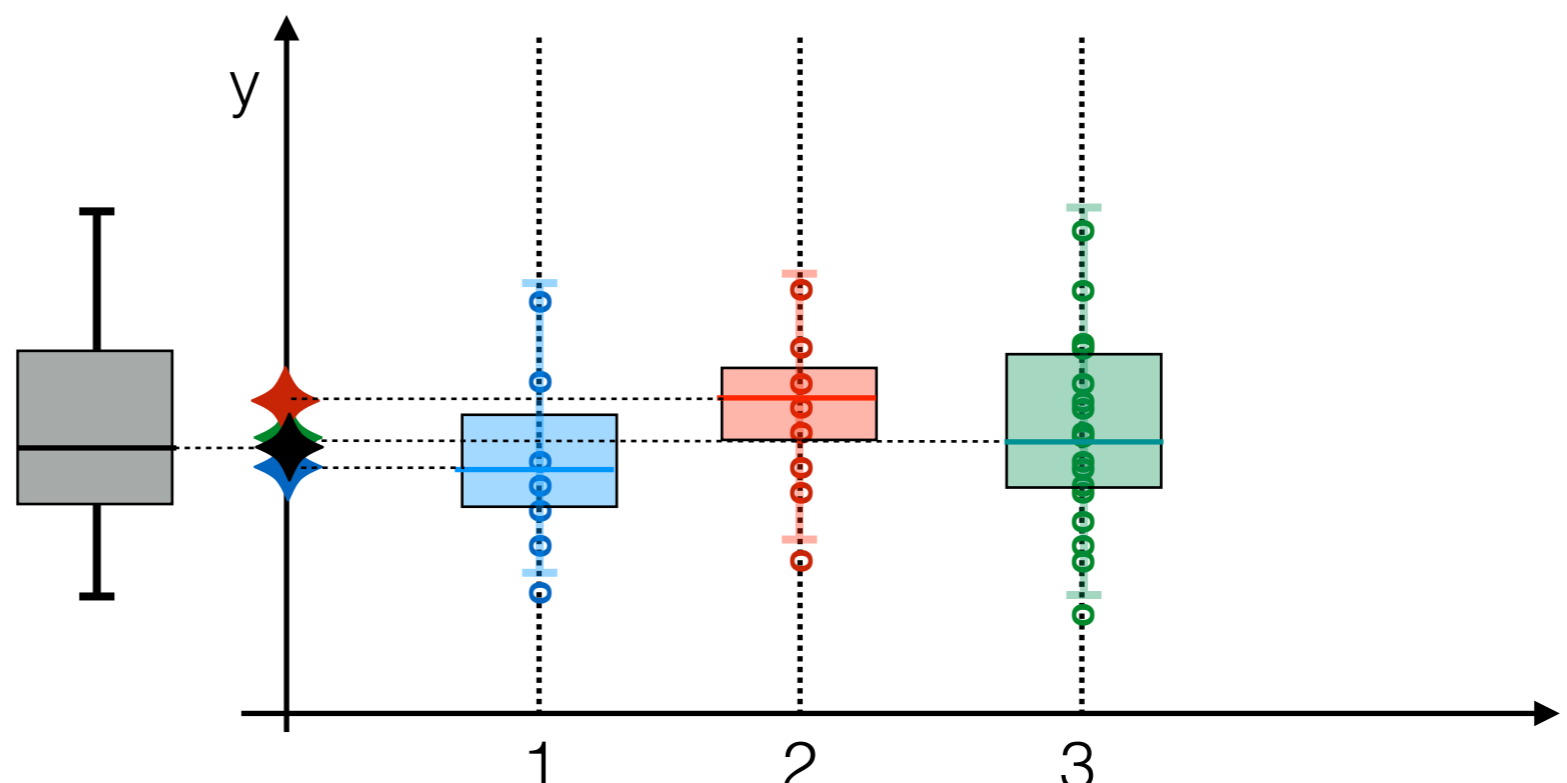


Srovnání více náhodných veličin

Rozptyl mezi skupinami je **velký** vzhledem k součtu rozptylů uvnitř skupin => střední hodnoty **jsou různé** => nulovou hypotézu **zamítáme**



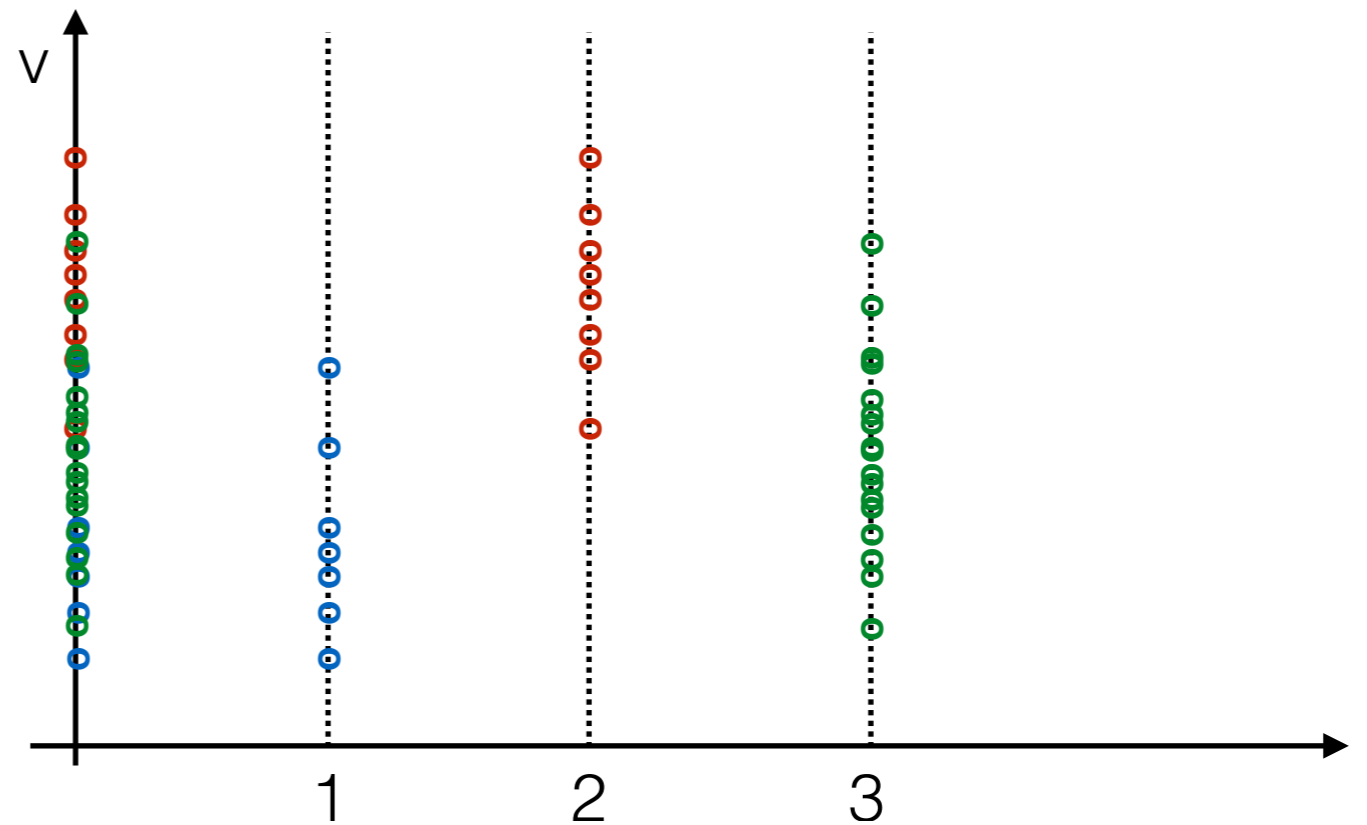
Rozptyl mezi skupinami je **malý** vzhledem k součtu rozptylů uvnitř skupin => střední hodnoty lze považovat **za nerozlišitelné** => nulovou hypotézu **nelze zamítnout**



Metoda ANOVA

ANalysis Of VAriance = ANOVA

pro 1 faktor = všechna data rozdělíme do skupin podle jednoho hlediska (úrovní jednoho faktoru)



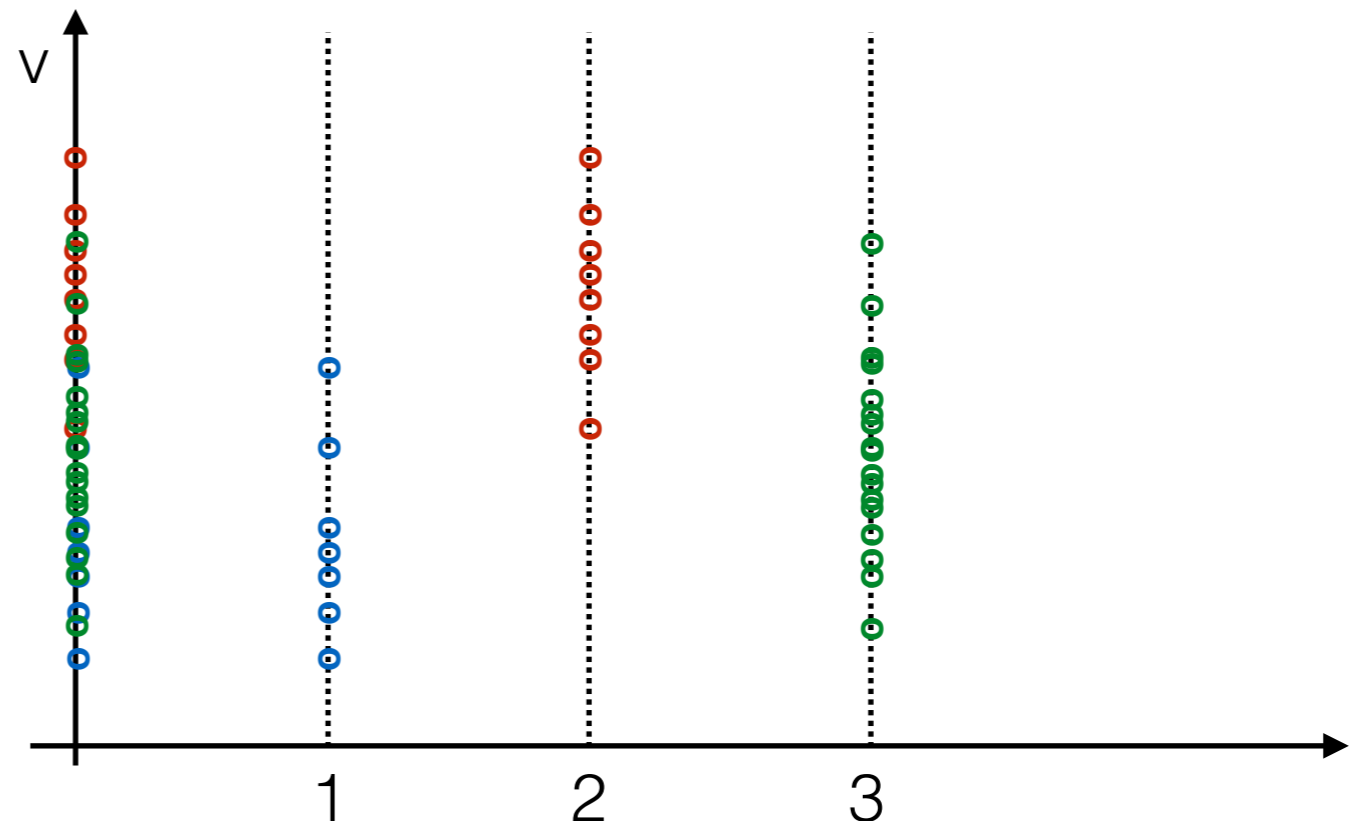
Metoda ANOVA

ANalysis Of VAriance = ANOVA

pro 1 faktor = všechna data rozdělíme do skupin podle jednoho hlediska (úrovní jednoho faktoru)

k úrovní = k skupin

v každé skupině n měření



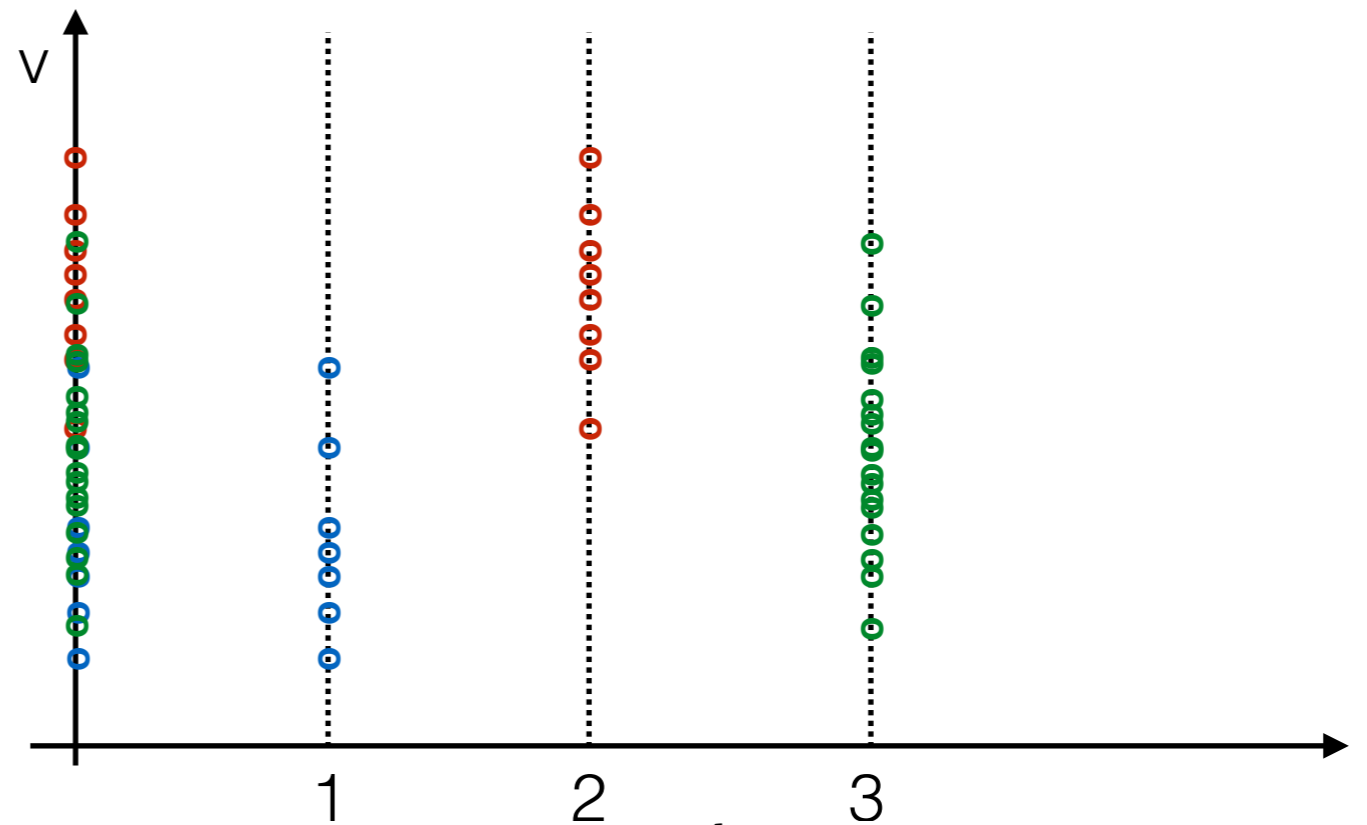
Metoda ANOVA

ANalysis Of VAriance = ANOVA

pro 1 faktor = všechna data rozdělíme do skupin podle jednoho hlediska (úrovní jednoho faktoru)

k úrovní = k skupin

v každé skupině n měření



1) celkový průměr všech naměřených hodnot:

$$\bar{y} = \frac{1}{n \cdot k} \sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^n y_{ij}$$

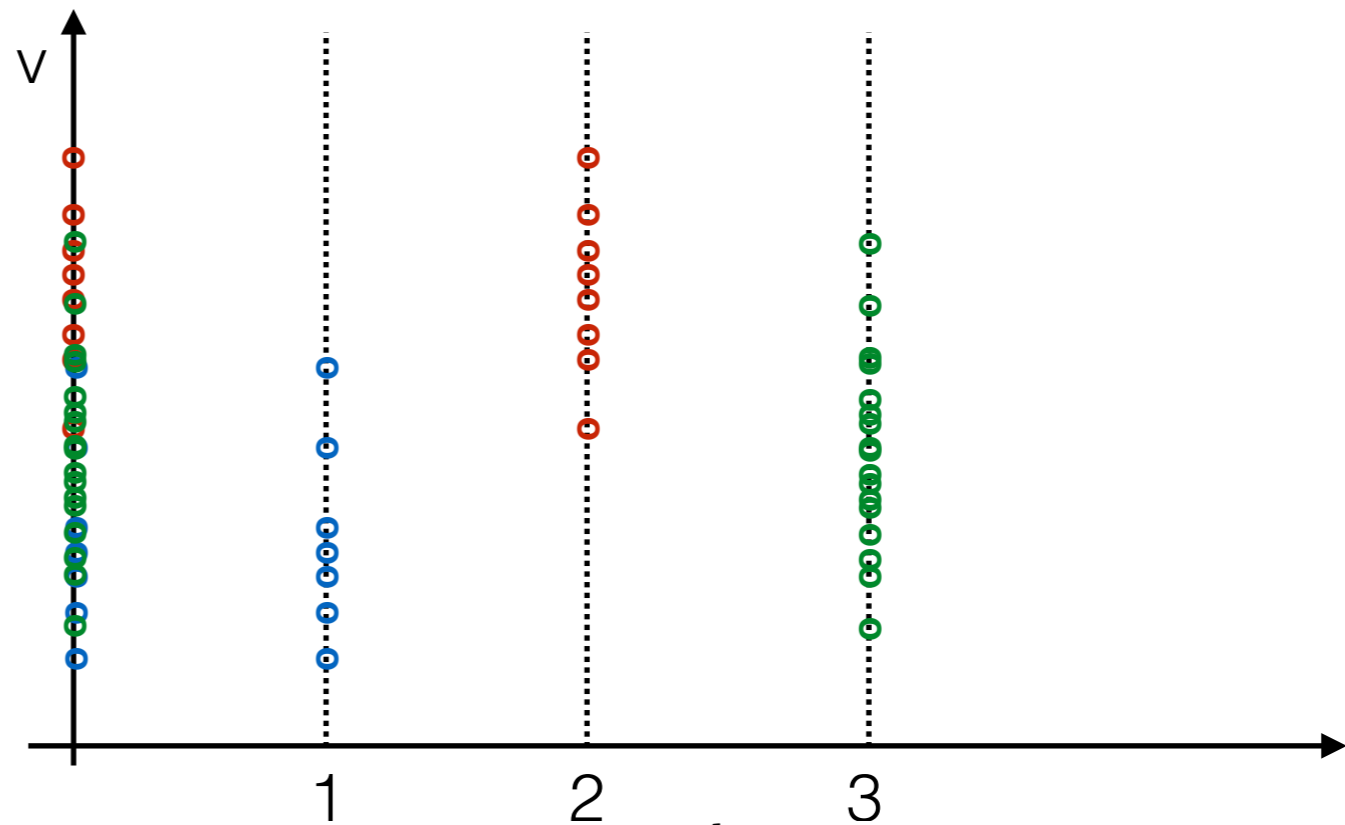
Metoda ANOVA

ANalysis Of VAriance = ANOVA

pro 1 faktor = všechna data rozdělíme do skupin podle jednoho hlediska (úrovní jednoho faktoru)

k úrovní = k skupin

v každé skupině n měření



1) celkový průměr všech naměřených hodnot:

$$\bar{y} = \frac{1}{n \cdot k} \sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^n y_{ij}$$

2) průměry v jednotlivých skupinách:

$$\bar{y}_i = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n y_{ij}$$

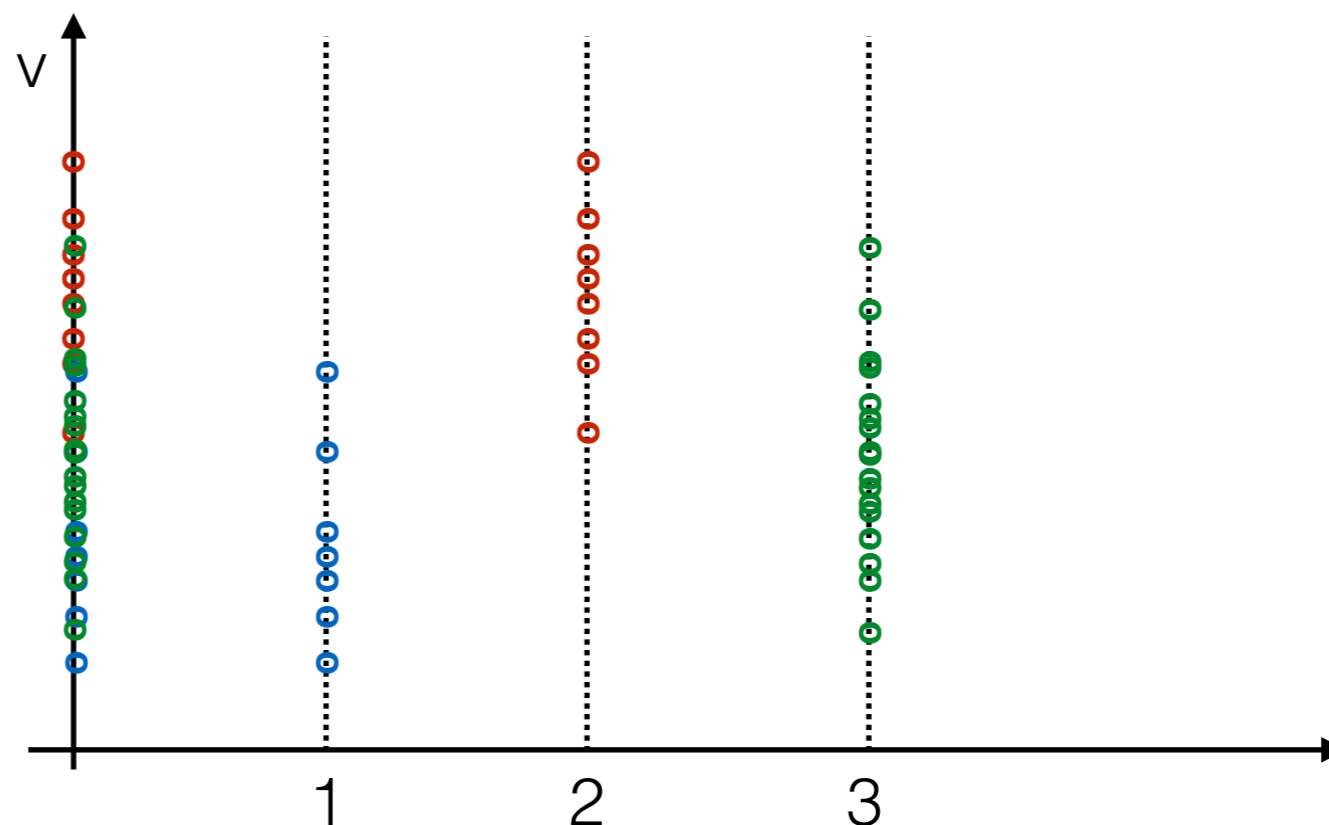
Metoda ANOVA

ANalysis Of VAriance = ANOVA

pro 1 faktor = všechna data rozdělíme do skupin podle jednoho hlediska (úrovní jednoho faktoru)

k úrovní = k skupin

v každé skupině n měření



1) celkový průměr všech naměřených hodnot:

$$\bar{y} = \frac{1}{n \cdot k} \sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^n y_{ij}$$

2) průměry v jednotlivých skupinách:

$$\bar{y}_i = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n y_{ij}$$

3) celkový součet čtvercových odchylek:

$$SS_T = \sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^n (y_{ij} - \bar{y})^2$$

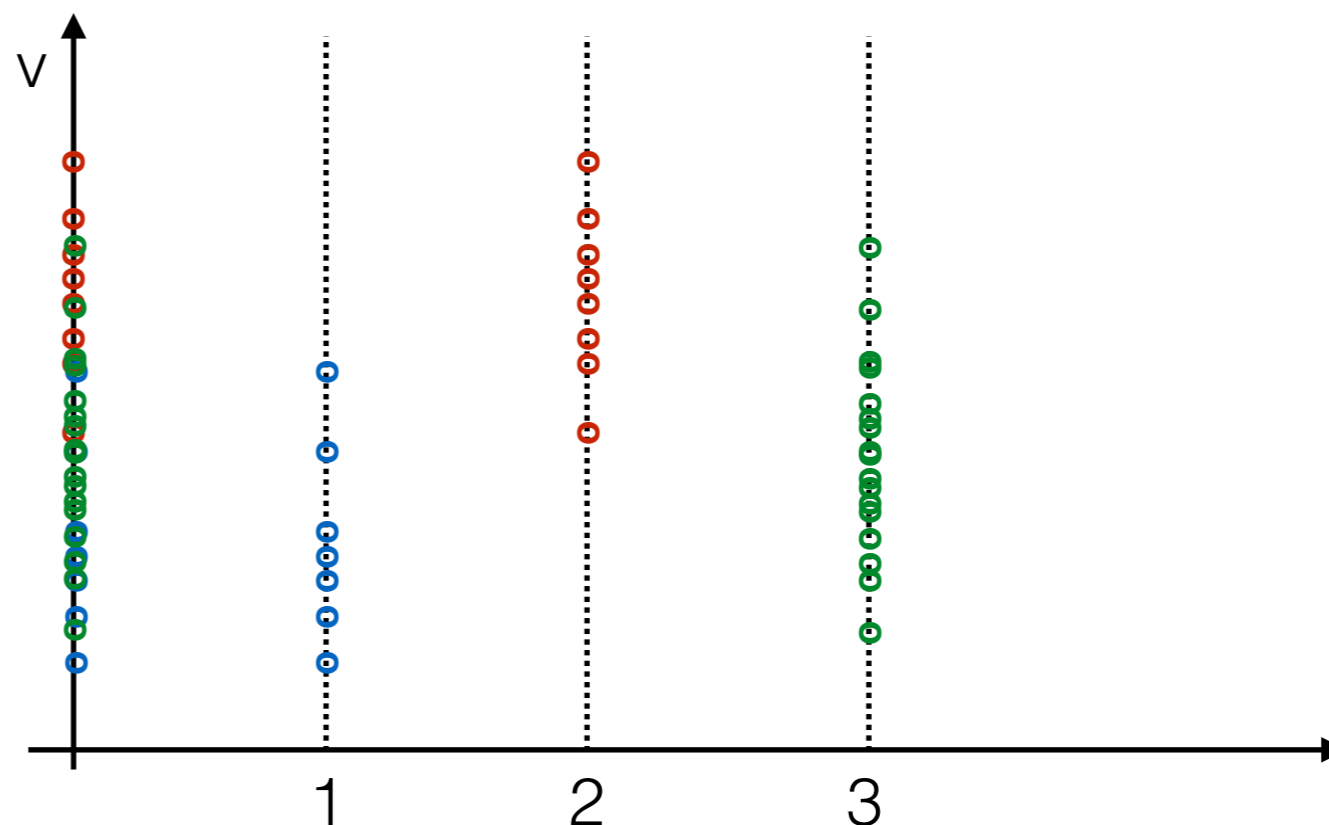
Metoda ANOVA

ANalysis Of VAriance = ANOVA

pro 1 faktor = všechna data rozdělíme do skupin podle jednoho hlediska (úrovní jednoho faktoru)

k úrovní = k skupin

v každé skupině n měření



1) celkový průměr všech naměřených hodnot:

$$\bar{y} = \frac{1}{n \cdot k} \sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^n y_{ij}$$

2) průměry v jednotlivých skupinách:

$$\bar{y}_i = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n y_{ij}$$

3) celkový součet čtvercových odchylek:

$$SS_T = \sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^n (y_{ij} - \bar{y})^2$$

4) součet čtvercových odchylek uvnitř skupin

$$SS_E = \sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^n (y_{ij} - \bar{y}_i)^2$$

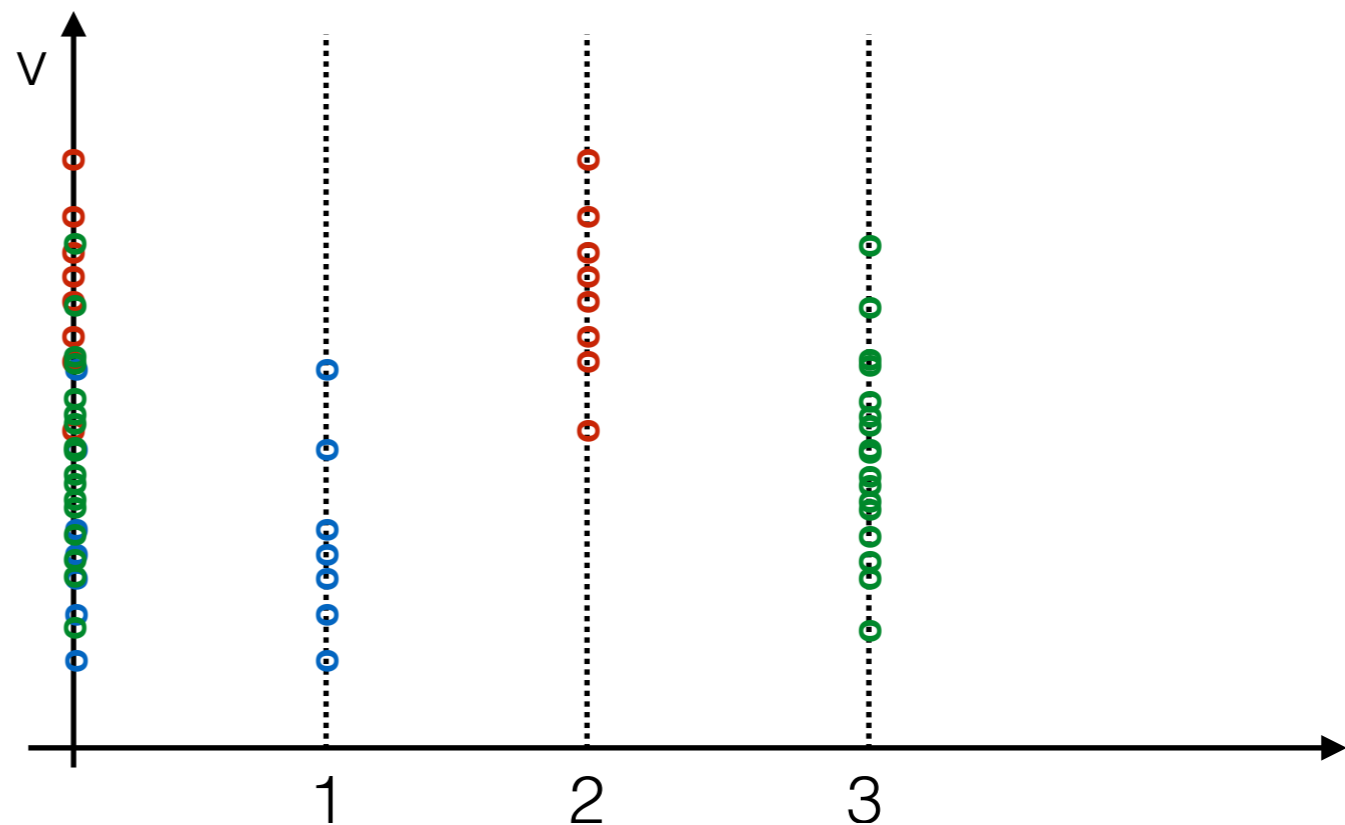
Metoda ANOVA

ANalysis Of VAriance = ANOVA

pro 1 faktor = všechna data rozdělíme do skupin podle jednoho hlediska (úrovní jednoho faktoru)

k úrovní = k skupin

v každé skupině n měření



1) celkový průměr všech naměřených hodnot:

$$\bar{y} = \frac{1}{n \cdot k} \sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^n y_{ij}$$

2) průměry v jednotlivých skupinách:

$$\bar{y}_i = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n y_{ij}$$

3) celkový součet čtvercových odchylek:

$$SS_T = \sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^n (y_{ij} - \bar{y})^2$$

4) součet čtvercových odchylek uvnitř skupin

$$SS_E = \sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^n (y_{ij} - \bar{y}_i)^2$$

5) součet čtvercových odchylek mezi skupinami

$$SS_F = n \sum_{i=1}^k (\bar{y}_i - \bar{y})^2$$

Metoda ANOVA

Tabulka analýzy rozptylu:

Zdroj variability	Součet čtverců	Stupně volnosti	Průměrný čtverec	Testová statistika	p-hodnota
-------------------	----------------	-----------------	------------------	--------------------	-----------

Metoda ANOVA

Tabulka analýzy rozptylu:

Zdroj variability	Součet čtverců	Stupně volnosti	Průměrný čtverec	Testová statistika	p-hodnota
faktor (mezi skupinami)	SS_F	$k-1$	$MS_F = \frac{SS_F}{k-1}$		

Metoda ANOVA

Tabulka analýzy rozptylu:

Zdroj variability	Součet čtverců	Stupně volnosti	Průměrný čtverec	Testová statistika	p-hodnota
faktor (mezi skupinami)	SS_F	$k-1$	$MS_F = \frac{SS_F}{k-1}$		
rezidua (uvnitř skupin)	SS_E	$k(n-1)$	$MS_E = \frac{SS_E}{k(n-1)}$		

Metoda ANOVA

Tabulka analýzy rozptylu:

Zdroj variability	Součet čtverců	Stupně volnosti	Průměrný čtverec	Testová statistika	p-hodnota
faktor (mezi skupinami)	SS_F	$k-1$	$MS_F = \frac{SS_F}{k-1}$		
rezidua (uvnitř skupin)	SS_E	$k(n-1)$	$MS_E = \frac{SS_E}{k(n-1)}$		
celkový	SS_T	$kn-1$			

Metoda ANOVA

Tabulka analýzy rozptylu:

Zdroj variability	Součet čtverců	Stupně volnosti	Průměrný čtverec	Testová statistika	p-hodnota
faktor (mezi skupinami)	SS_F	$k-1$	$MS_F = \frac{SS_F}{k-1}$	$F = \frac{MS_F}{MS_E}$	
rezidua (uvnitř skupin)	SS_E	$k(n-1)$	$MS_E = \frac{SS_E}{k(n-1)}$		
celkový	SS_T	$kn-1$			

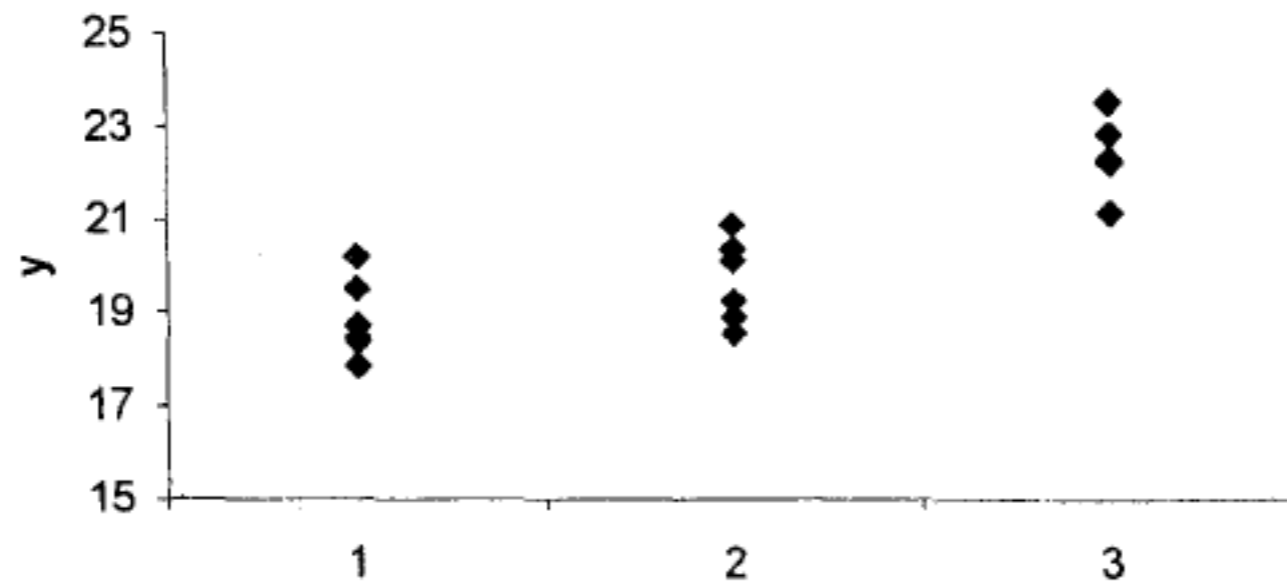
Metoda ANOVA

Tabulka analýzy rozptylu:

Zdroj variability	Součet čtverců	Stupně volnosti	Průměrný čtverec	Testová statistika	p-hodnota
faktor (mezi skupinami)	SS_F	$k-1$	$MS_F = \frac{SS_F}{k-1}$	$F = \frac{MS_F}{MS_E}$	
rezidua (uvnitř skupin)	SS_E	$k(n-1)$	$MS_E = \frac{SS_E}{k(n-1)}$		
celkový	SS_T	$kn-1$			
testová statistika	$F = \frac{\frac{SS_F}{k-1}}{\frac{SS_E}{k(n-1)}} = \frac{MS_F}{MS_E}$			má Fisherovo-Snedecorovo rozdělení o $(k-1)$ a $k(n-1)$ stupních volnosti	

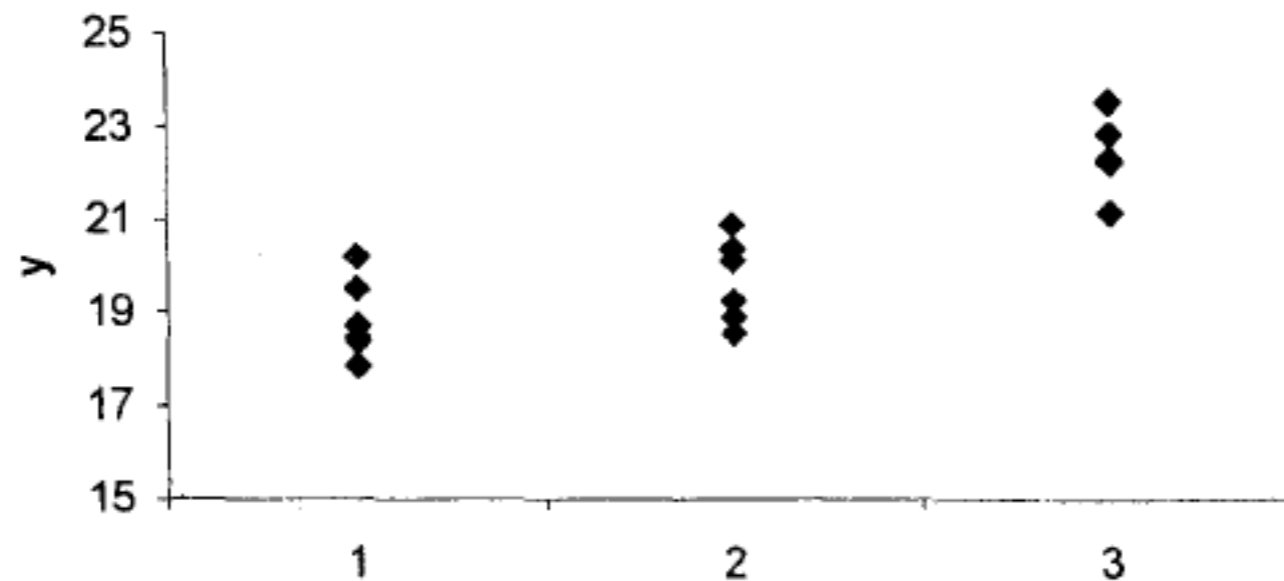
Metoda ANOVA

Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.



Metoda ANOVA

Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.

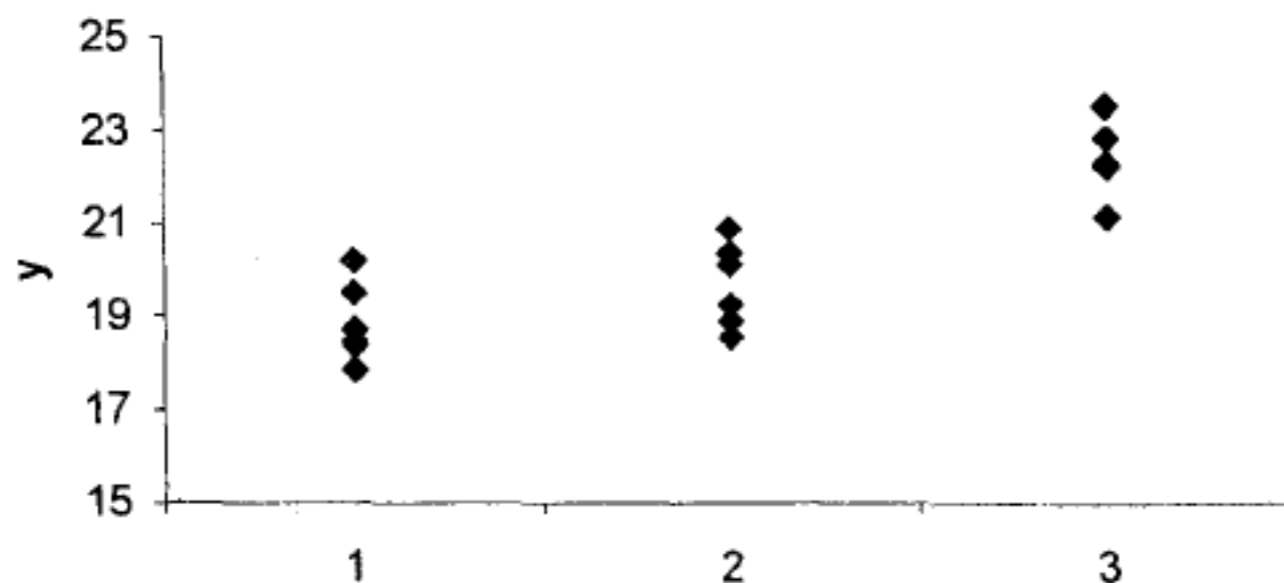


ANOVA

Zdroj variability	SS	St. vol.	MS	F	Hodnota P	F krit
faktor A	40,52333	2	20,26167	29,0513	6,94E-06	3,682317
reziduální	10,46167	15	0,697444			
celkový	50,985	17				

Metoda ANOVA

Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.



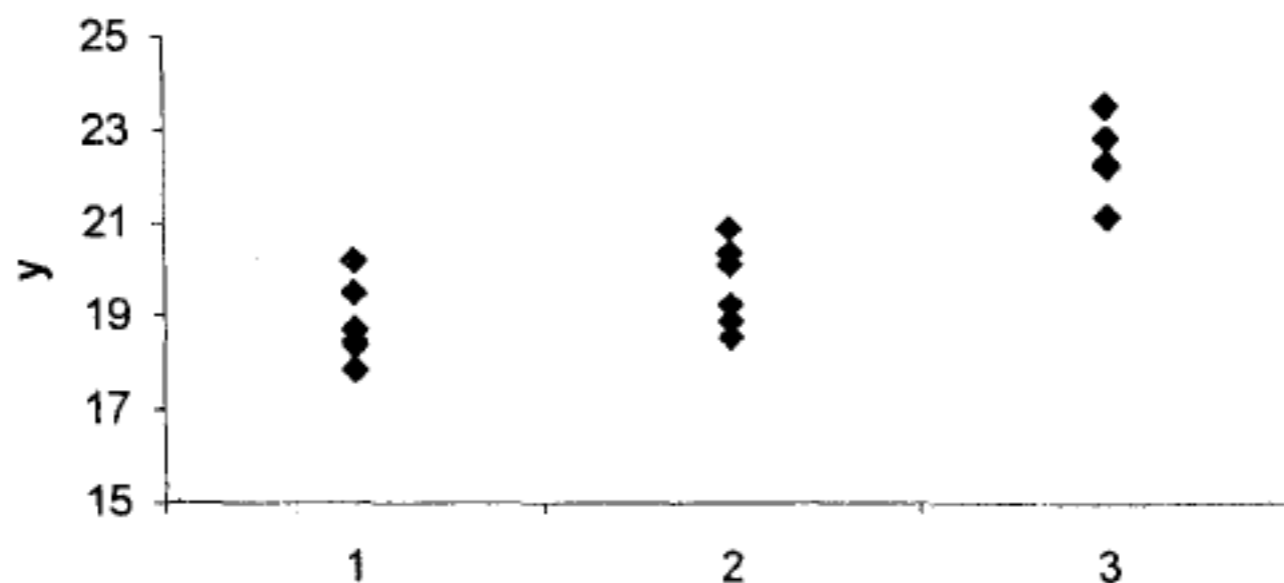
ANOVA

Zdroj variability	SS	St. vol.	MS	F	Hodnota P	F krit
faktor A	40,52333	2	20,26167	29,0513	6,94E-06	3,682317
reziduální	10,46167	15	0,697444			
celkový	50,985	17				

Závěr: nulovou hypotézu zamítáme. Pevnost vláken různých dodavatelů se statisticky významně liší.

Metoda ANOVA

Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.



ANOVA

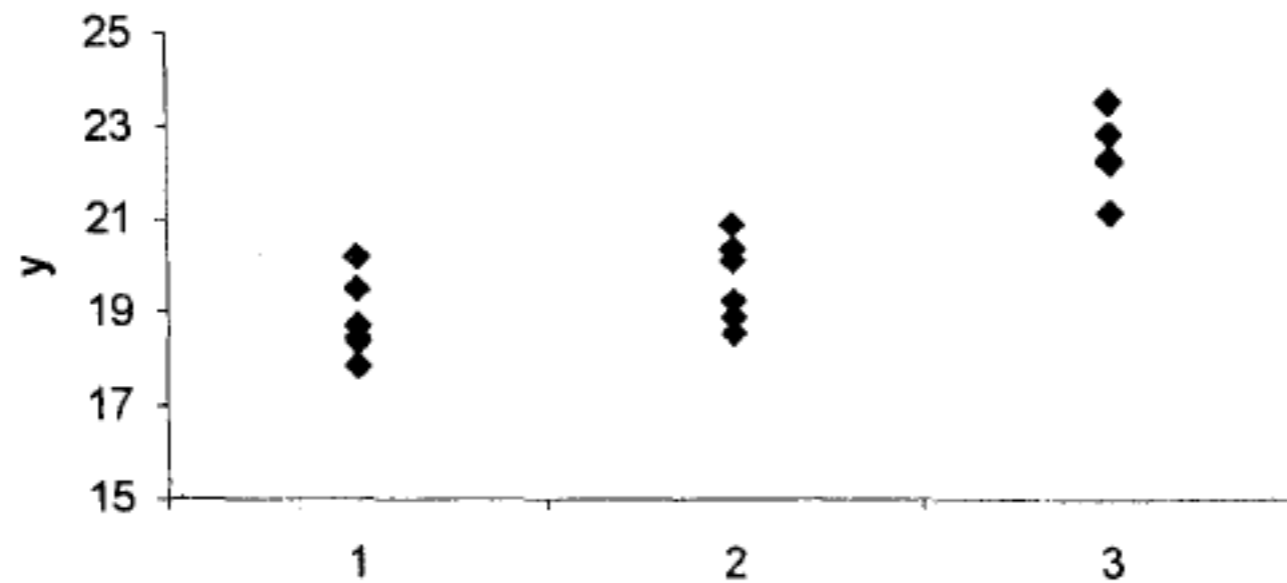
Zdroj variability	SS	St. vol.	MS	F	Hodnota P	F krit
faktor A	40,52333	2	20,26167	29,0513	6,94E-06	3,682317
reziduální	10,46167	15	0,697444			
celkový	50,985	17				

Závěr: nulovou hypotézu zamítáme. Pevnost vláken různých dodavatelů se statisticky významně liší.

Jak se liší dodavatelé mezi sebou?

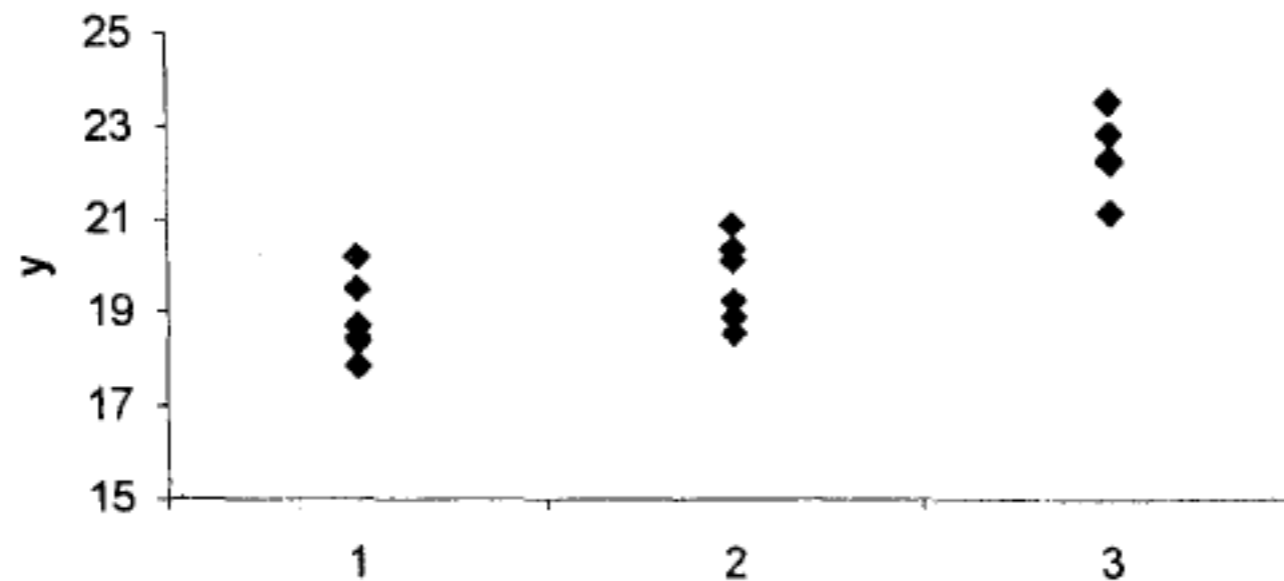
Metoda ANOVA

Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.



Metoda ANOVA

Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.

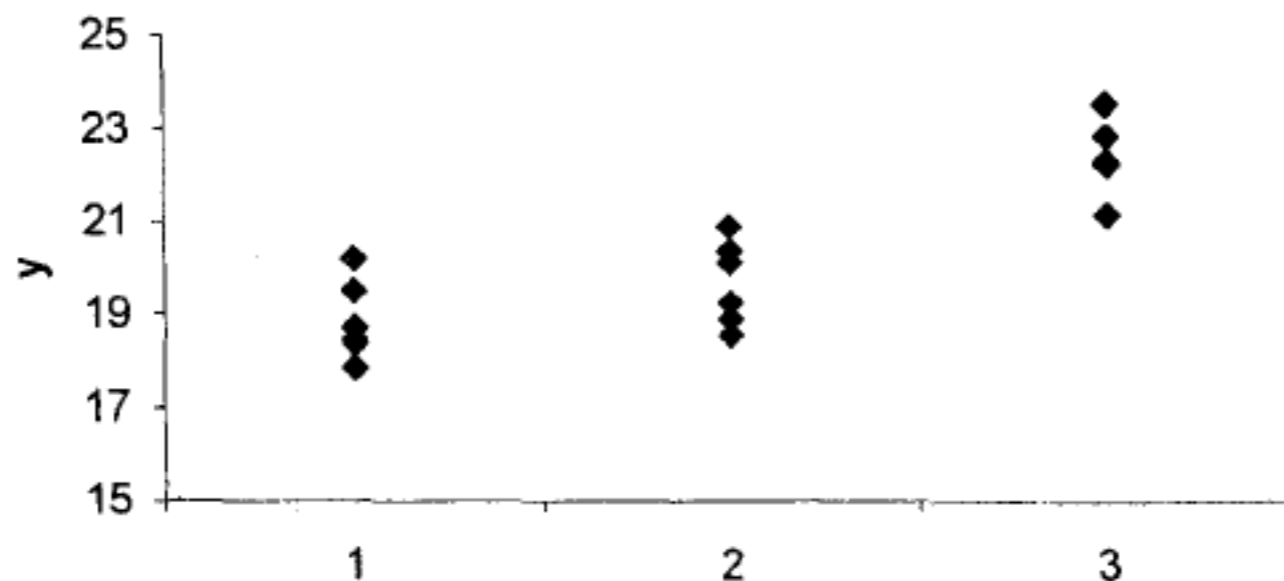


ANOVA

Zdroj variability	SS	St. vol.	MS	F	Hodnota P	F krit
faktor A	40,52333	2	20,26167	29,0513	6,94E-06	3,682317
reziduální	10,46167	15	0,697444			
celkový	50,985	17				

Metoda ANOVA

Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.



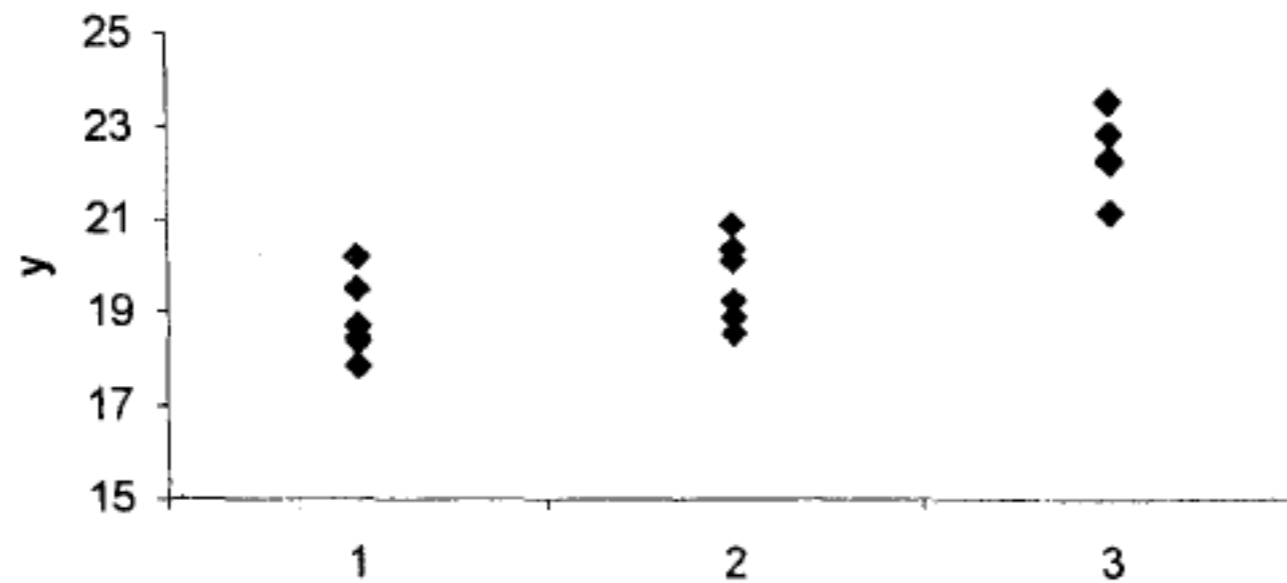
ANOVA

Zdroj variability	SS	St. vol.	MS	F	Hodnota P	F krit
faktor A	40,52333	2	20,26167	29,0513	6,94E-06	3,682317
reziduální	10,46167	15	0,697444			
celkový	50,985	17				

Pokud zamítneme nulovou hypotézu v ANOVA, měli bychom provést tzv. Mnohonásobné porovnání

Metoda ANOVA

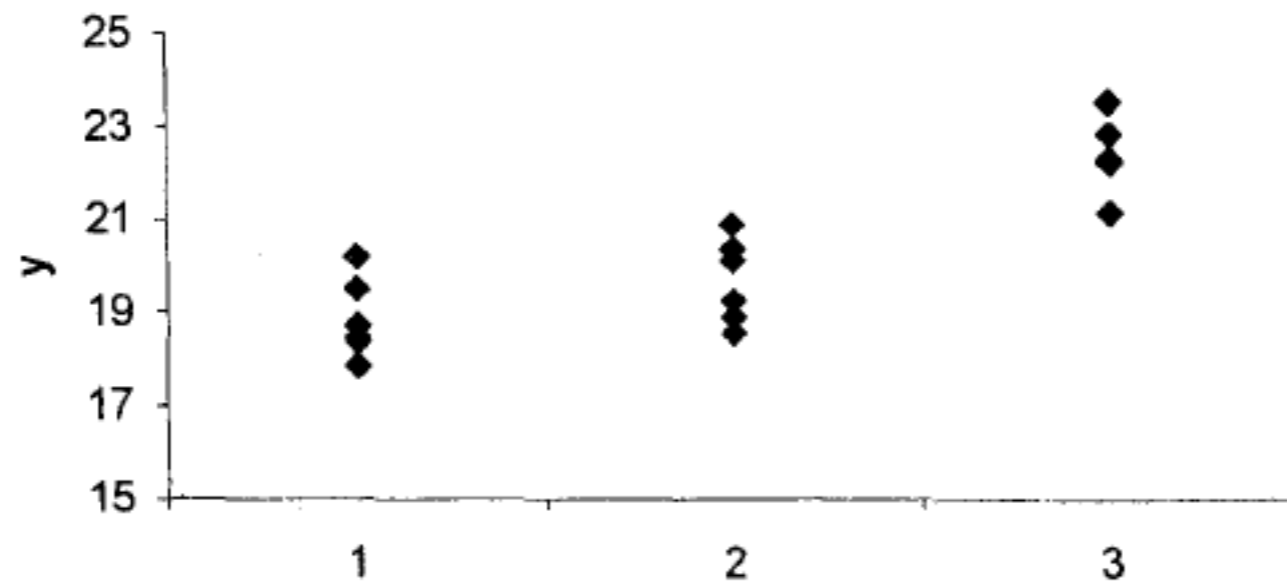
Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.



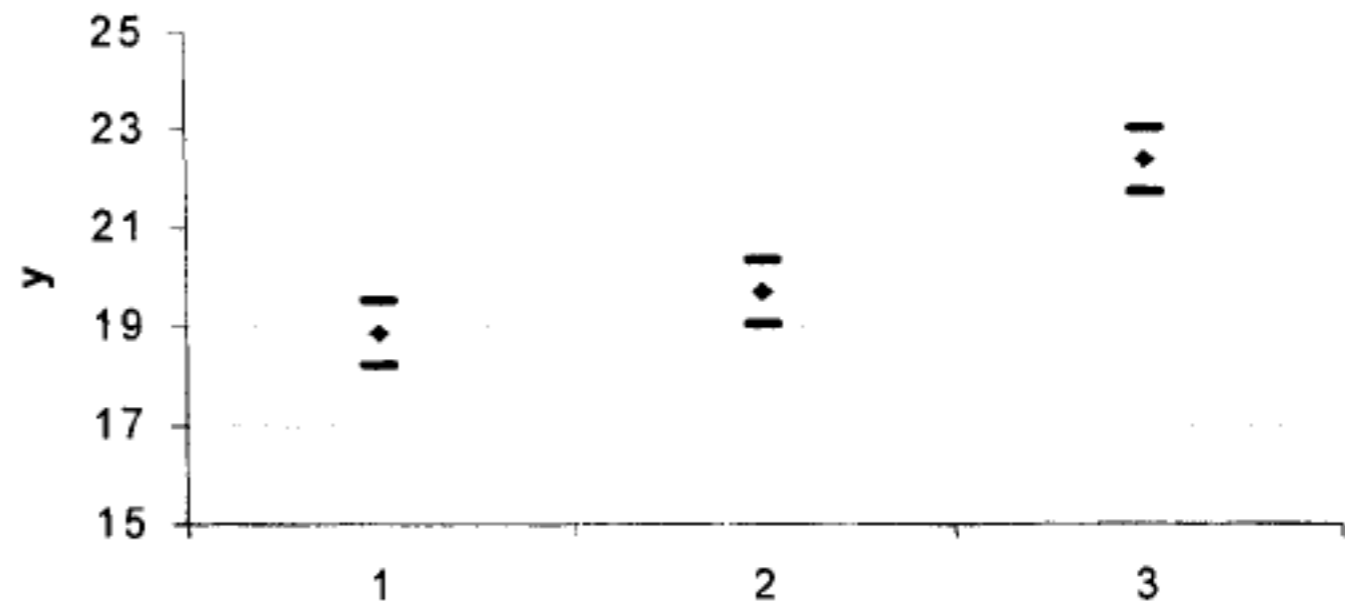
Metody mnohonásobného srovnávání:

Metoda ANOVA

Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.

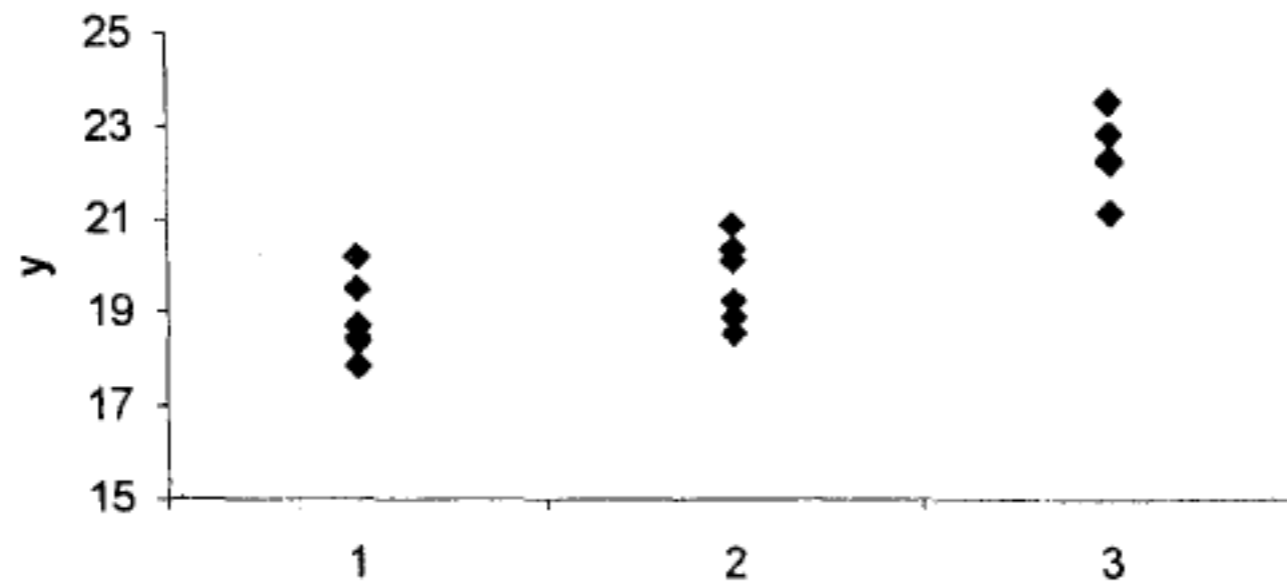


Metody mnohonásobného srovnávání:



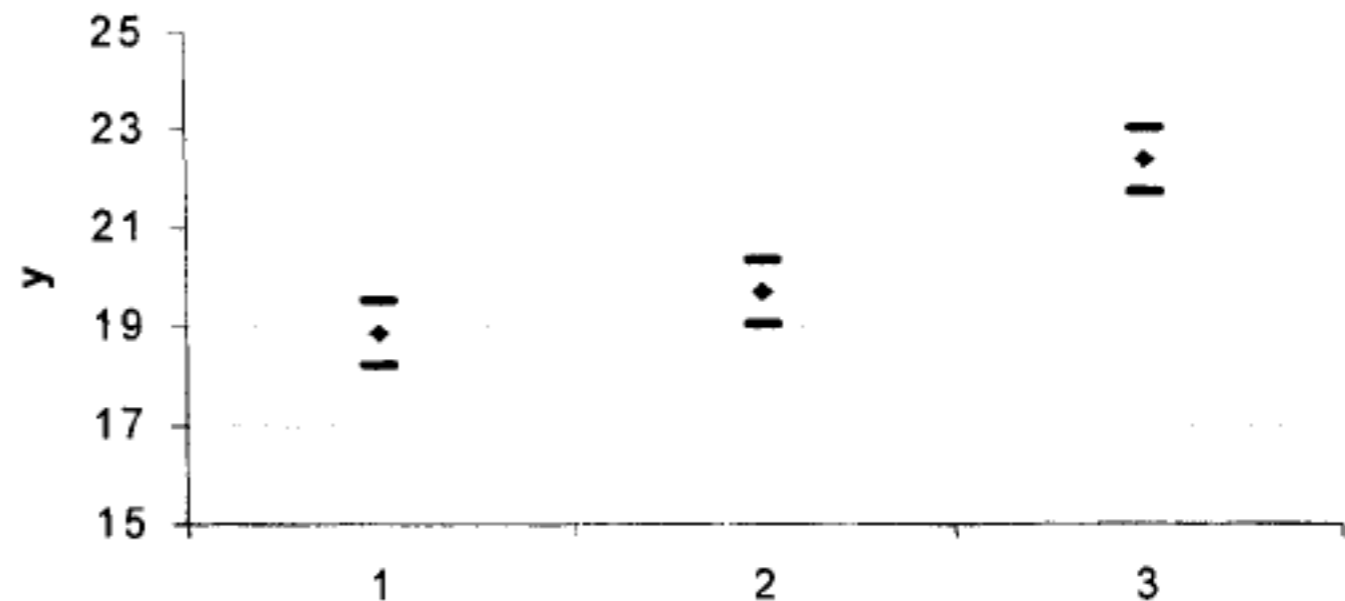
Metoda ANOVA

Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.



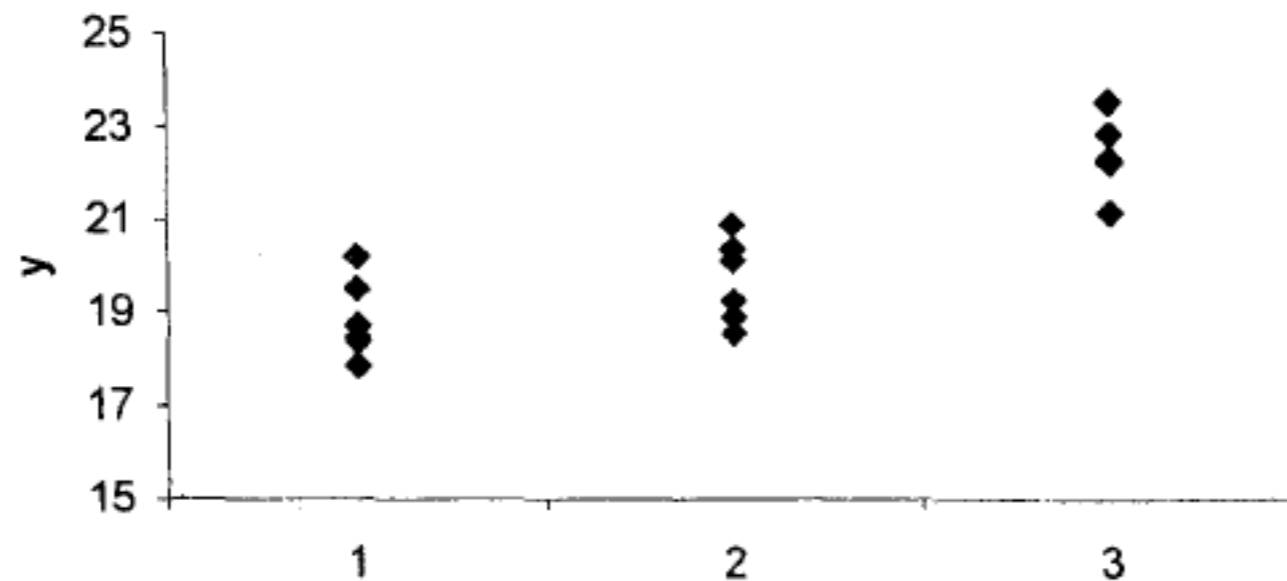
Metody mnohonásobného srovnávání:

- Tukeyova metoda
- Scheffého metoda
- Bonferroniho metoda
- Duncanova metoda
- ...



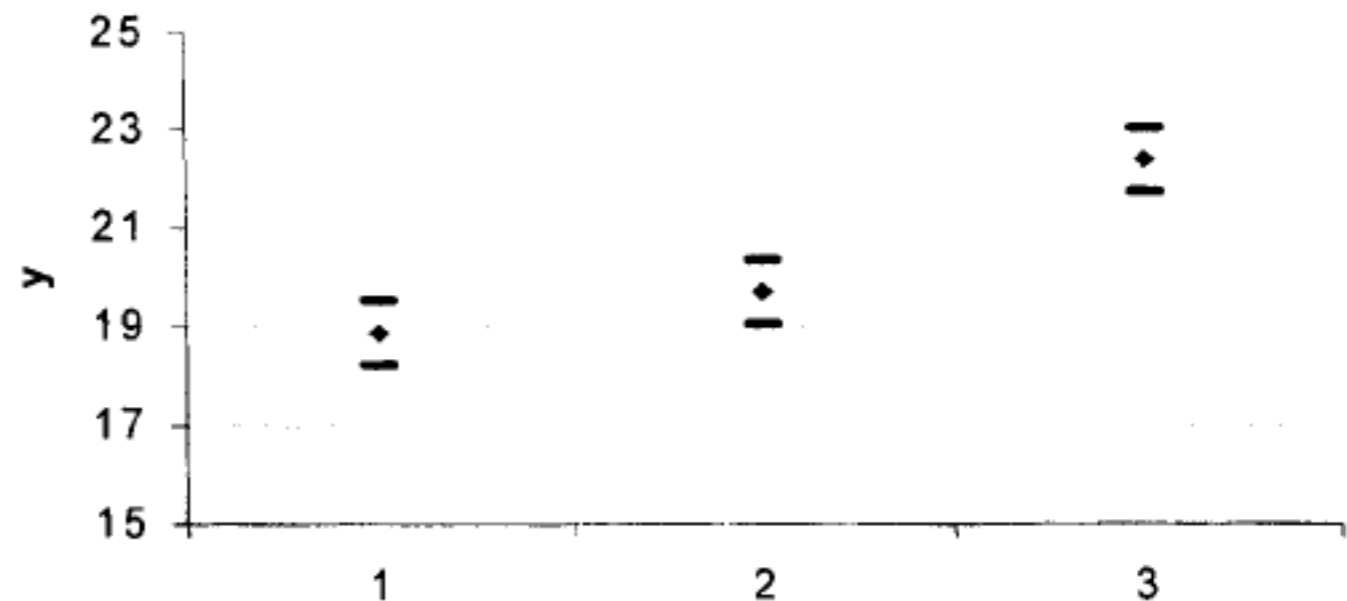
Metoda ANOVA

Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.



Metody mnohonásobného srovnávání:

- Tukeyova metoda
- Scheffého metoda
- Bonferroniho metoda
- Duncanova metoda
- ...



$$T = \frac{|\hat{\mu}_i - \hat{\mu}_j|}{S_*}, \quad i, j = 1, 2, \dots, k, \quad i \neq j$$

Metoda ANOVA

Metody mnohonásobného srovnávání:

označme k počet tříd a $N = \sum_{i=1}^k n_i$

Metoda ANOVA

Metody mnohonásobného srovnávání:

označme k počet tříd a $N = \sum_{i=1}^k n_i$

- Tukeyova metoda

Metoda ANOVA

Metody mnohonásobného srovnávání:

označme k počet tříd a $N = \sum_{i=1}^k n_i$

- Tukeyova metoda

$$Q = \frac{|\hat{\mu}_i - \hat{\mu}_j|}{S_*}, \quad S_* = \sqrt{\frac{S_E}{n(N - k)}}$$

- musí být $n_1 = n_2 = \dots = n_k$

$$Q < q_{1-\alpha}(k, N - k)$$

Metoda ANOVA

Metody mnohonásobného srovnávání:

označme k počet tříd a $N = \sum_{i=1}^k n_i$

- Tukeyova metoda

$$Q = \frac{|\hat{\mu}_i - \hat{\mu}_j|}{S_*}, \quad S_* = \sqrt{\frac{S_E}{n(N-k)}}$$

- musí být $n_1 = n_2 = \dots = n_k$

$$Q < q_{1-\alpha}(k, N-k)$$

- Scheffého metoda

$$S = \frac{|\hat{\mu}_i - \hat{\mu}_j|}{S_*}, \quad S_* = \sqrt{\frac{S_E}{N-k}(k-1)\left(\frac{1}{n_i} + \frac{1}{n_j}\right)} \quad S < \sqrt{F_{1-\alpha}(k-1, N-k)}$$

Metoda ANOVA

Metody mnohonásobného srovnávání:

označme k počet tříd a $N = \sum_{i=1}^k n_i$

- Tukeyova metoda

$$Q = \frac{|\hat{\mu}_i - \hat{\mu}_j|}{S_*}, \quad S_* = \sqrt{\frac{S_E}{n(N-k)}}$$

- musí být $n_1 = n_2 = \dots = n_k$

$$Q < q_{1-\alpha}(k, N-k)$$

- Scheffého metoda

$$S = \frac{|\hat{\mu}_i - \hat{\mu}_j|}{S_*}, \quad S_* = \sqrt{\frac{S_E}{N-k} (k-1) \left(\frac{1}{n_i} + \frac{1}{n_j} \right)}$$

$$S < \sqrt{F_{1-\alpha}(k-1, N-k)}$$

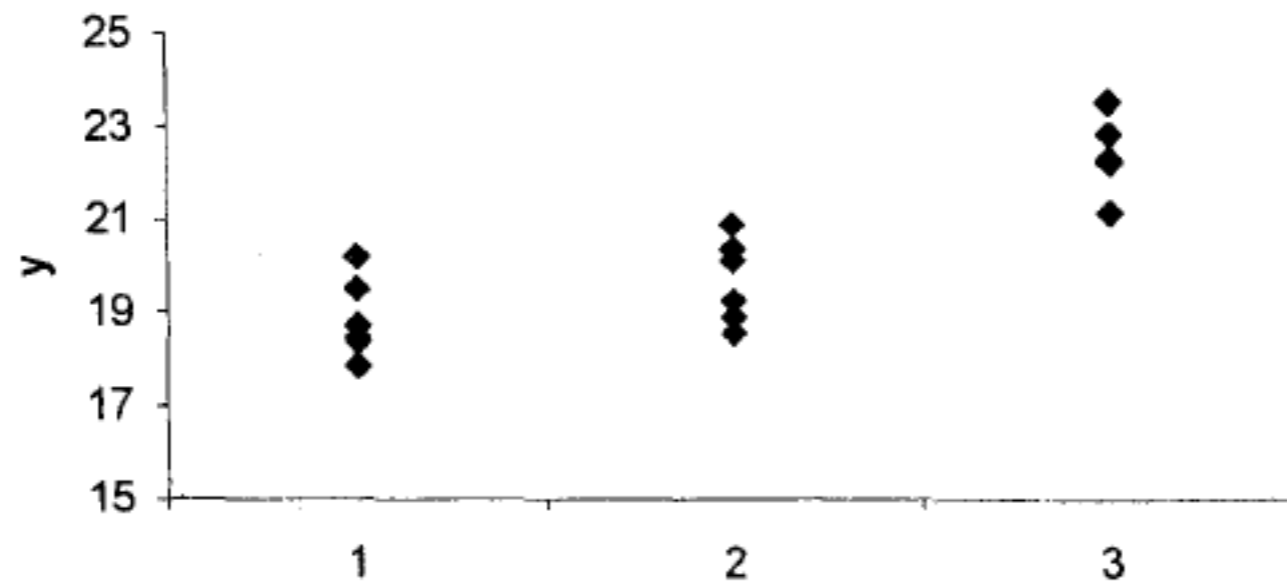
- Bonferroniho metoda

$$T = \frac{|\hat{\mu}_i - \hat{\mu}_j|}{S_*}, \quad S_* = \sqrt{\frac{S_E}{N-k} \left(\frac{1}{n_i} + \frac{1}{n_j} \right)}$$

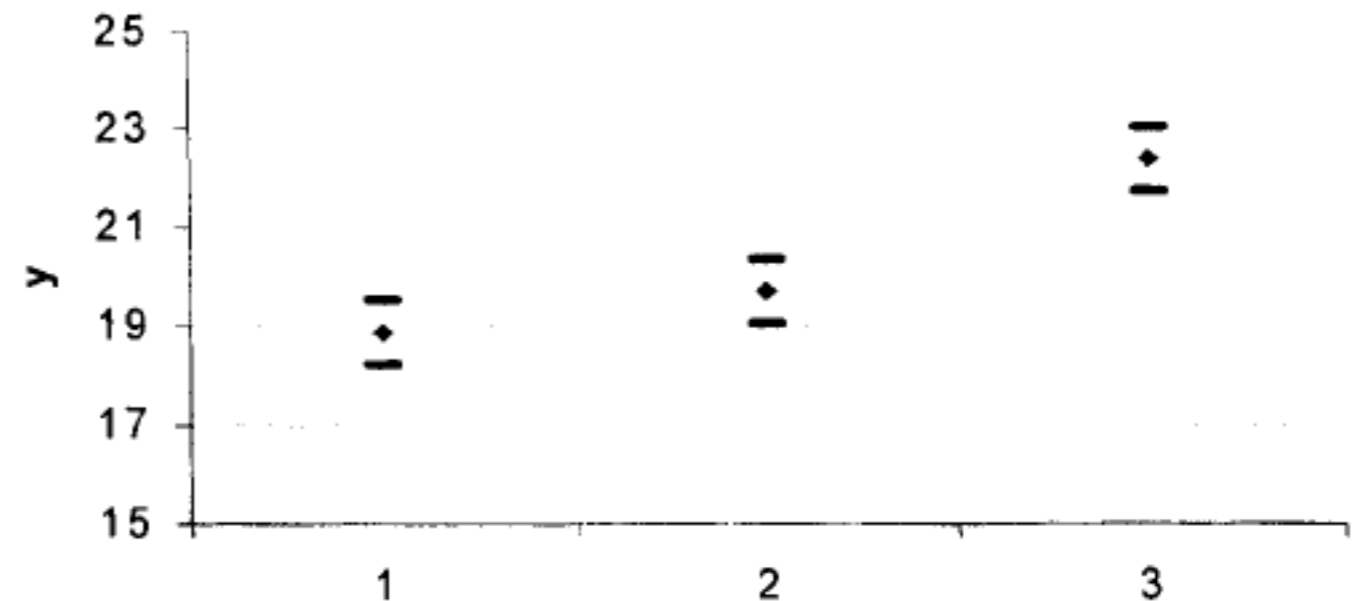
$$T < t_{1-\alpha/2}(N-k)$$

Metoda ANOVA

Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.

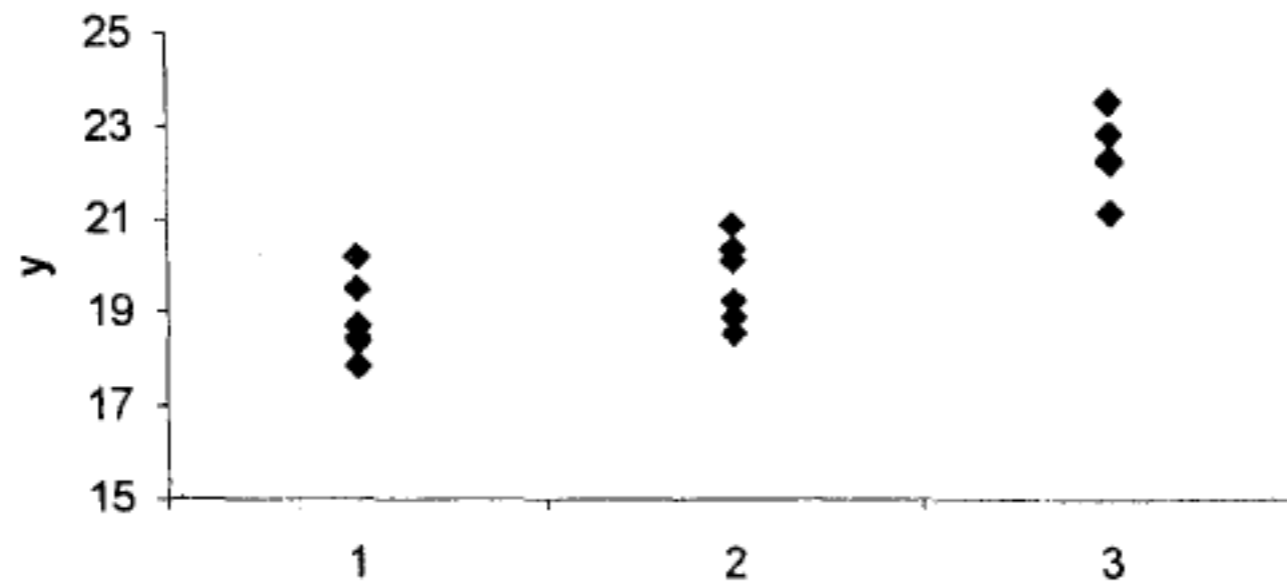


Bonferroniho metoda mnohonásobného srovnání úrovní faktorů:

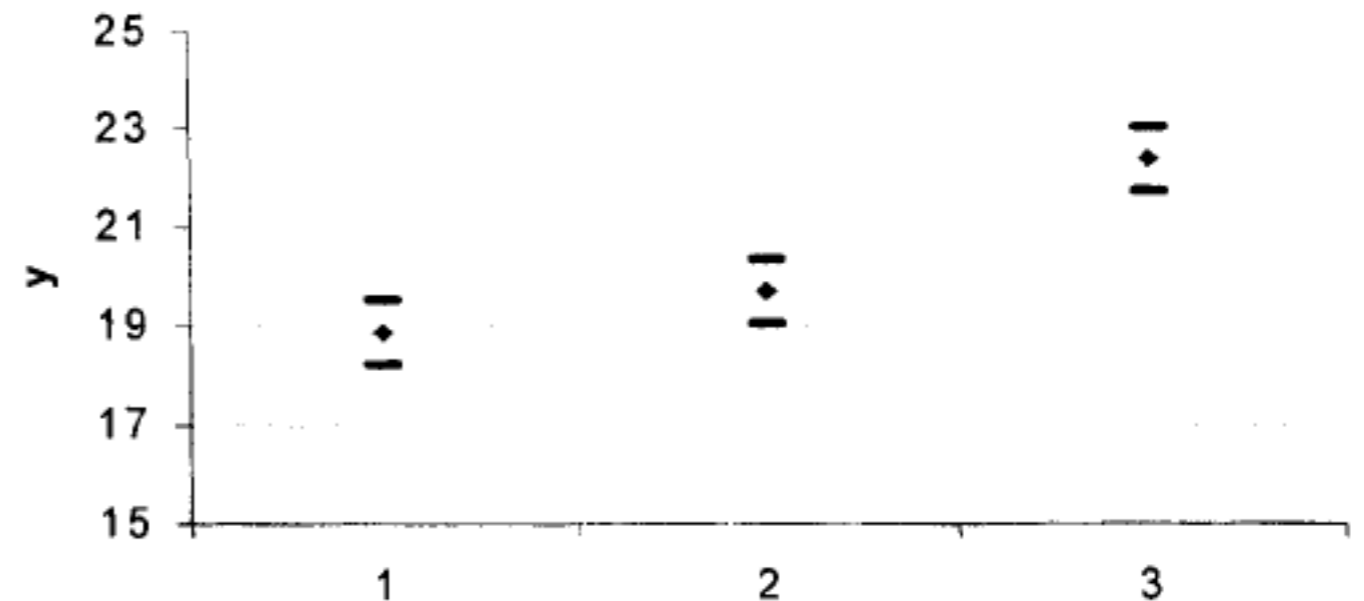


Metoda ANOVA

Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.

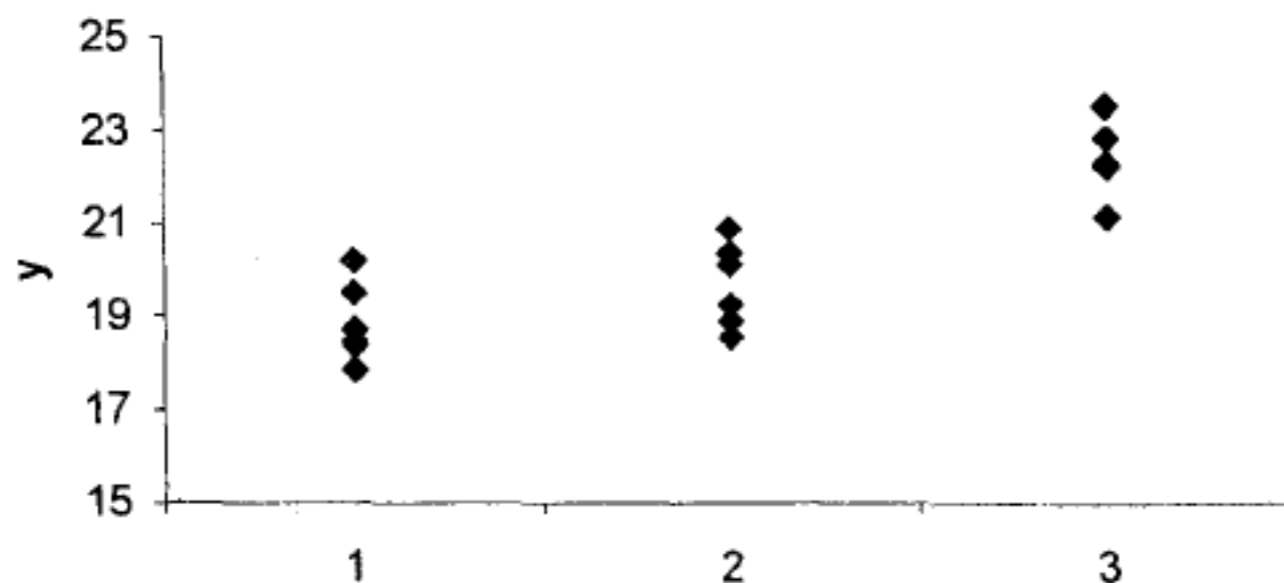


Bonferroniho metoda mnohonásobného srovnání úrovní faktorů: $\bar{y}_i \pm t_{1-\alpha/2p} \cdot \sqrt{\frac{MS_E}{2 \cdot a}}$



Metoda ANOVA

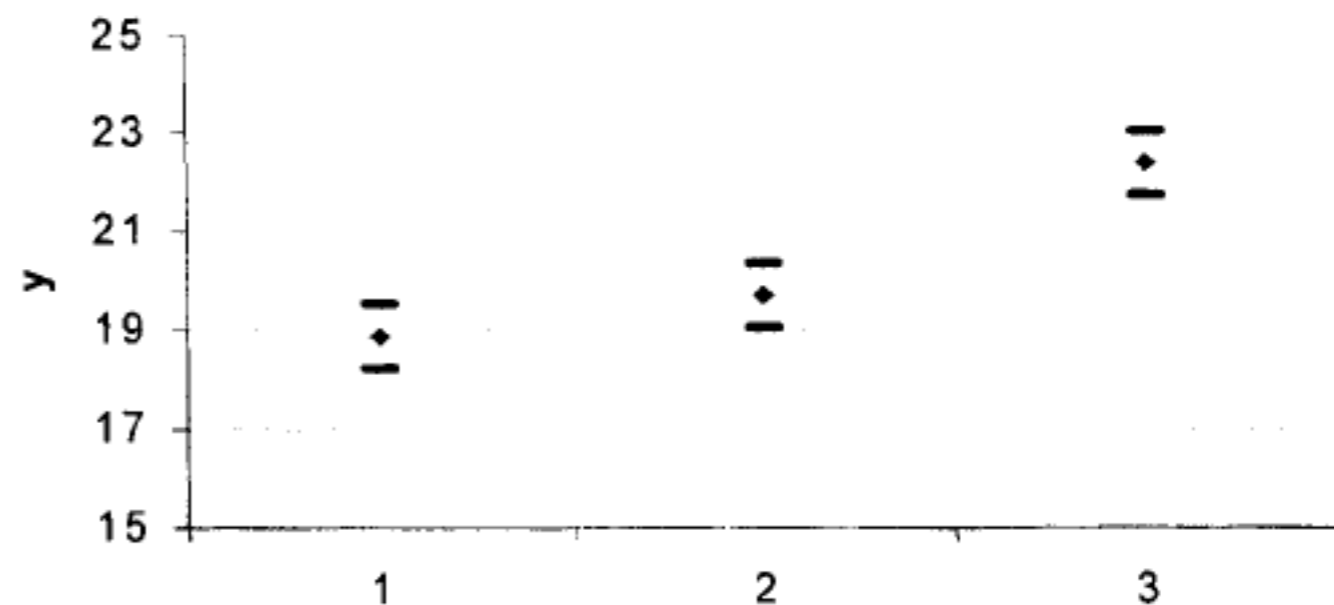
Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.



Bonferroniho metoda mnohonásobného srovnání úrovní faktorů:

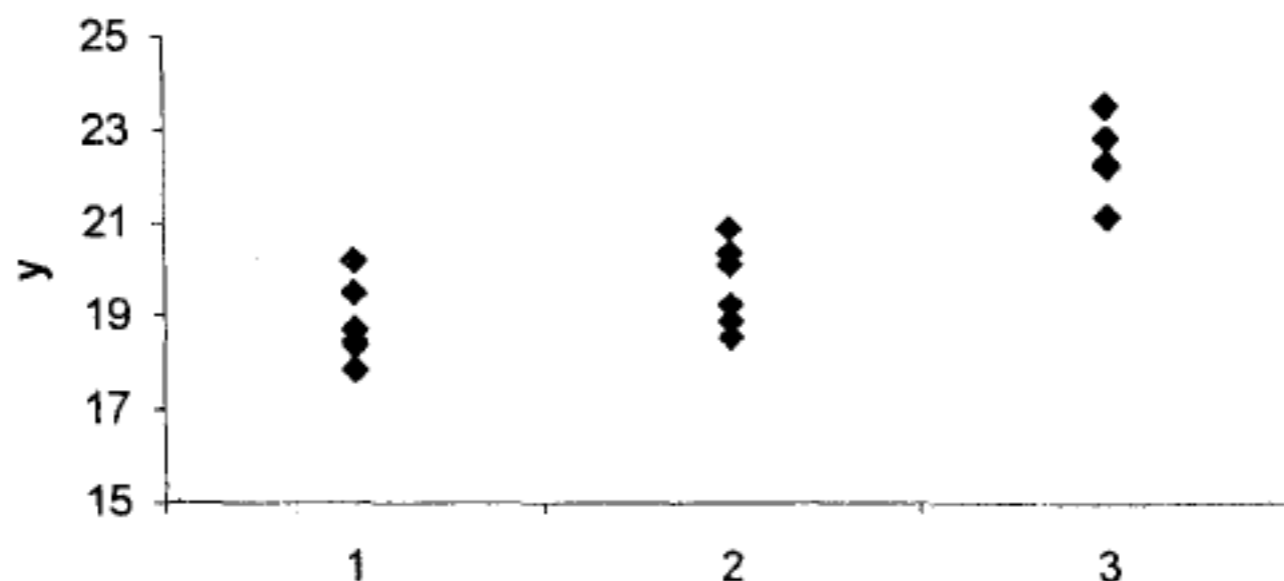
$$\bar{y}_i \pm t_{1-\alpha/2p} \cdot \sqrt{\frac{MS_E}{2 \cdot a}}$$

Úroveň	Průměr	Dolní mez	Horní mez
A ₁	18,867	18,217	19,516
A ₂	19,700	19,051	20,349
A ₃	22,383	21,734	23,033



Metoda ANOVA

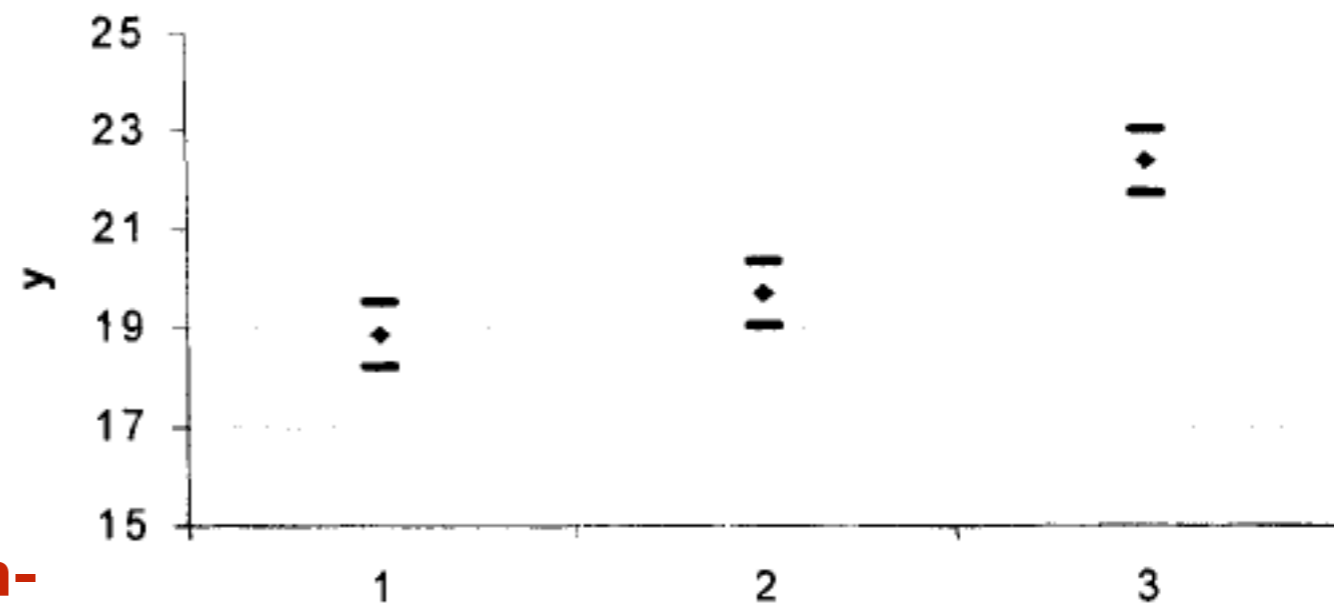
Příklad: Chceme porovnat kvalitu vláken dodávaných třemi různými výrobci. Jako kritérium kvality je zvolena pevnost vláken v tahu.



Bonferroniho metoda mnohonásobného srovnání úrovní faktorů:

$$\bar{y}_i \pm t_{1-\alpha/2p} \cdot \sqrt{\frac{MS_E}{2 \cdot a}}$$

Úroveň	Průměr	Dolní mez	Horní mez
A ₁	18,867	18,217	19,516
A ₂	19,700	19,051	20,349
A ₃	22,383	21,734	23,033



=> dodavatele 1 a 2 nelze statisticky odlišit, dodavatel 3 je významně lepší (jeho vlákna dosahují statisticky významně vyšší pevnosti než od dodavatelů 1 a 2).

Metoda ANOVA

Ověření podmínek pro použití ANOVA

- Reprezentativnost výběru, náhodnost
- Nezávislost pozorování
- Normalita dat
- Stejné rozptyly (homoskedasticita)

Metoda ANOVA

Nezávislost měření

Závislost v posloupnosti měření se zjišťuje prostřednictvím reziduí

$$r_{ij} = y_{ij} - \bar{y}_i.$$

Tato "pořadová závislost" může vznikat posunem v měřicím zařízení, únavou operátora, změnou podmínek měření apod.

Metoda ANOVA

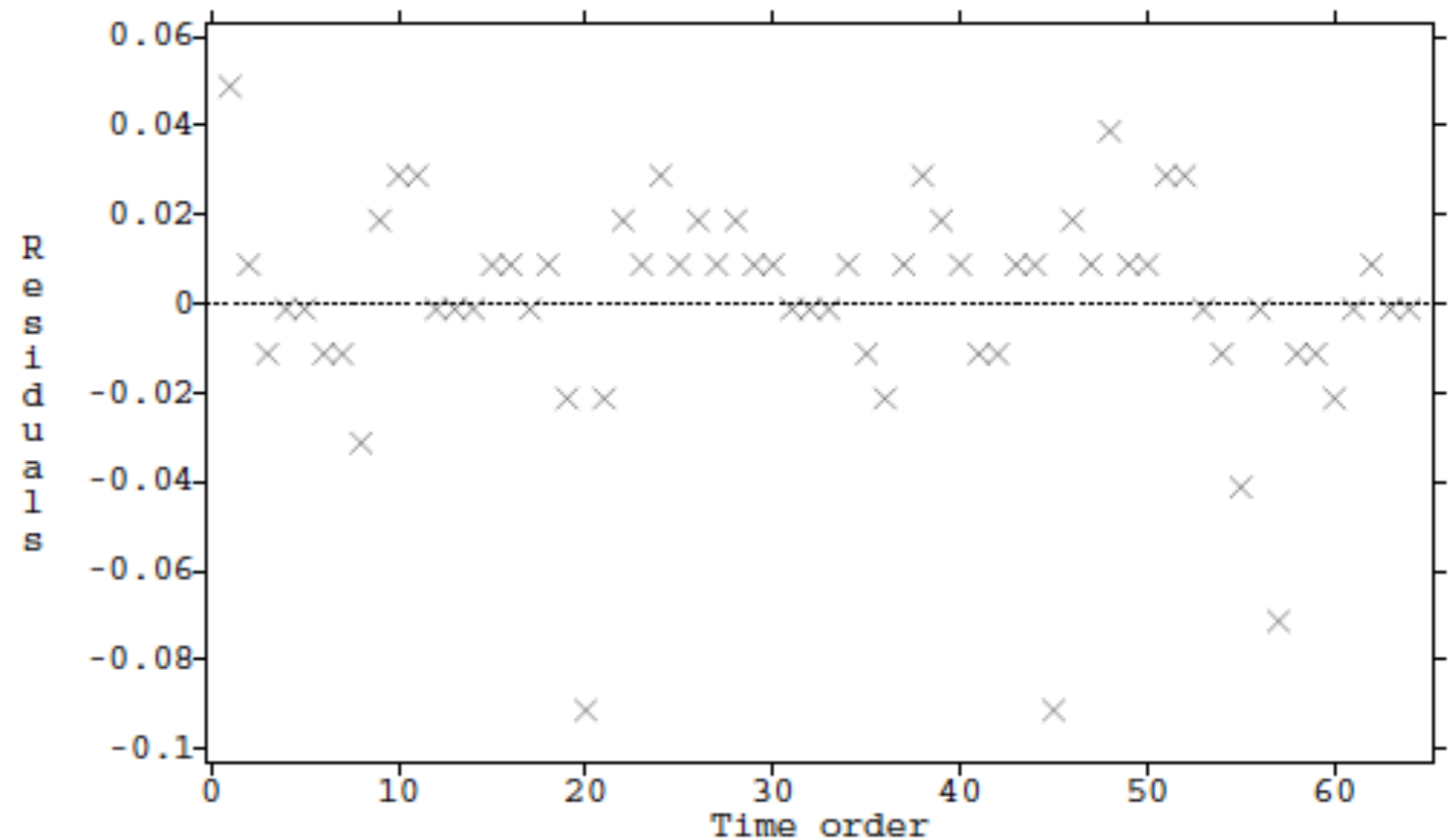
Nezávislost měření

Závislost v posloupnosti měření se zjišťuje prostřednictvím reziduí

$$r_{ij} = y_{ij} - \bar{y}_i.$$

Tato "pořadová závislost" může vznikat posunem v měřicím zařízení, únavou operátora, změnou podmínek měření apod.

Grafická analýza - graf reziduí v čase (indexový graf)



Metoda ANOVA

Nezávislost měření

Závislost v posloupnosti měření se zjišťuje prostřednictvím reziduí

$$r_{ij} = y_{ij} - \bar{y}_i.$$

Tato "pořadová závislost" může vznikat posunem v měřicím zařízení, únavou operátora, změnou podmínek měření apod.

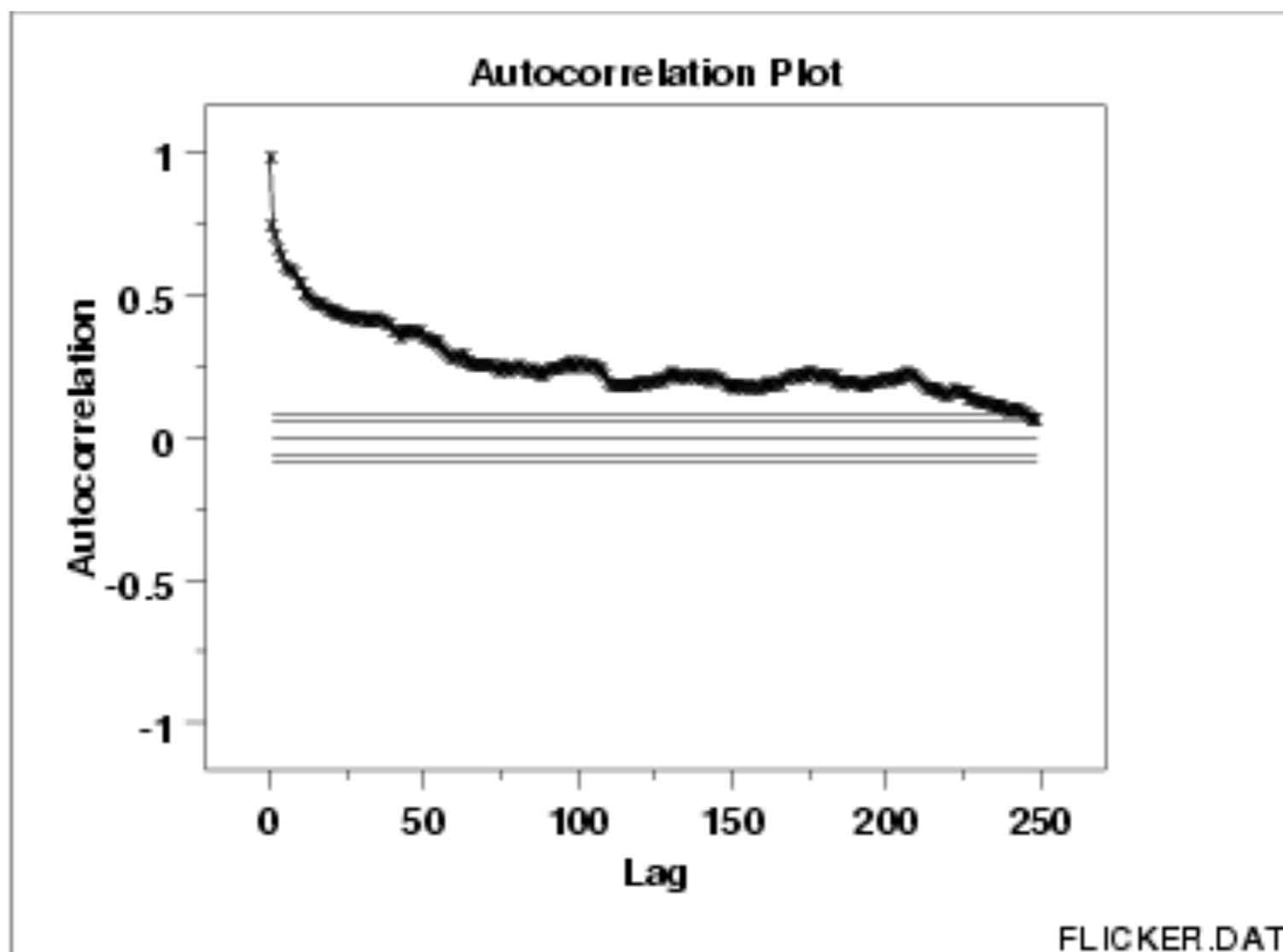
Grafická analýza - graf reziduí v čase (indexový graf)

Autokorelační funkce reziduí

$$c_{i,k} = \text{Cov}(r_{i,j}, r_{i,j-k})$$

$$\hat{c}_{i,k} = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^{n-k} r_{i,j} r_{i,j+k}$$

$$\hat{r}_{i,k} = \frac{\sum_{j=1}^{n-k} r_{i,j} r_{i,j+k}}{\sum_{j=1}^n r_{i,j}^2}$$



Metoda ANOVA

Nezávislost měření

Závislost v posloupnosti měření se zjišťuje prostřednictvím reziduí

$$r_{ij} = y_{ij} - \bar{y}_i.$$

Tato "pořadová závislost" může vznikat posunem v měřicím zařízení, únavou operátora, změnou podmínek měření apod.

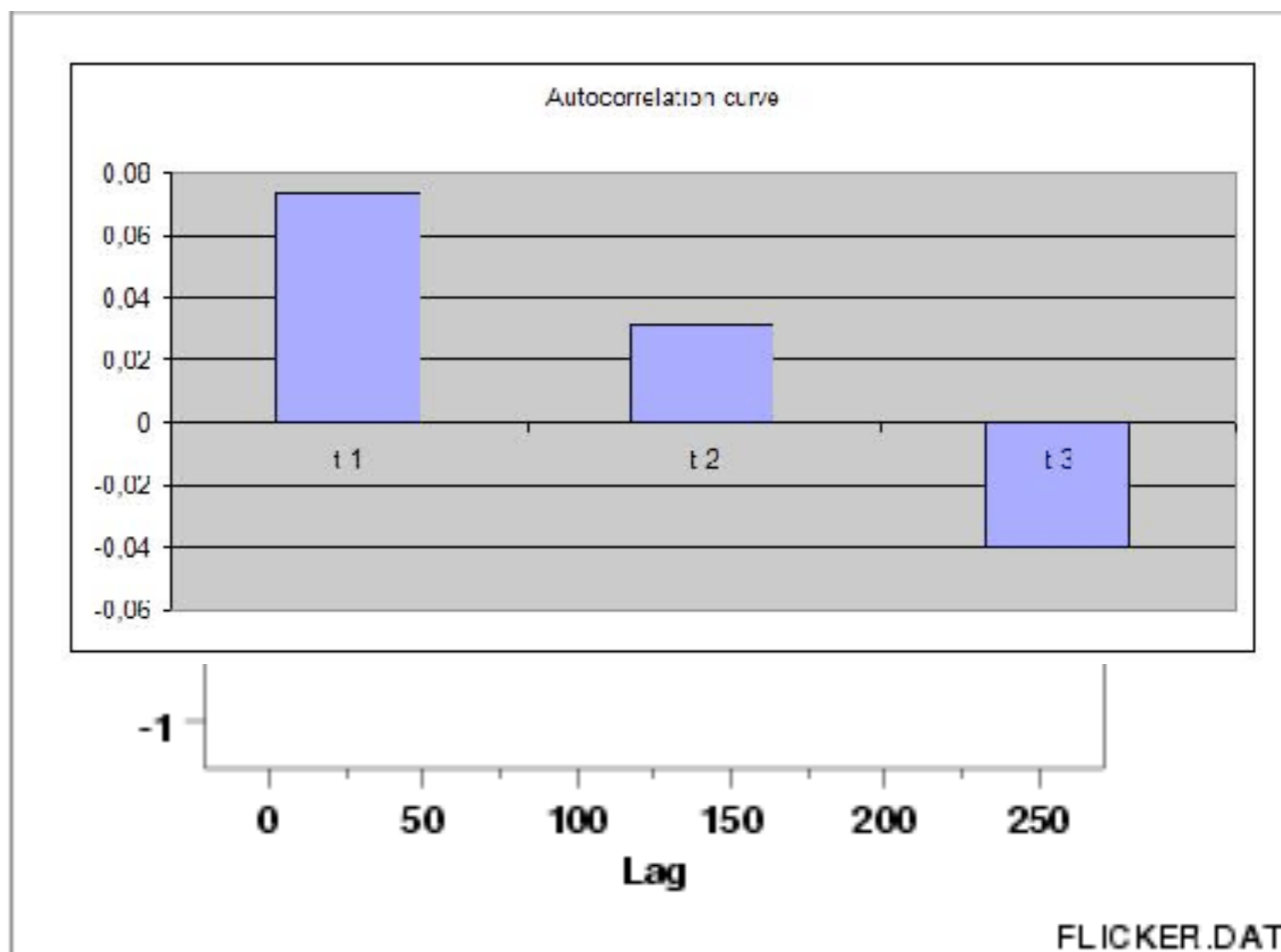
Grafická analýza - graf reziduí v čase (indexový graf)

Autokorelační funkce reziduí

$$c_{i,k} = \text{Cov}(r_{i,j}, r_{i,j-k})$$

$$\hat{c}_{i,k} = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^{n-k} r_{i,j} r_{i,j+k}$$

$$\hat{r}_{i,k} = \frac{\sum_{j=1}^{n-k} r_{i,j} r_{i,j+k}}{\sum_{j=1}^n r_{i,j}^2}$$



Metoda ANOVA

Nezávislost měření

Závislost v posloupnosti měření se zjišťuje prostřednictvím reziduí

$$r_{ij} = y_{ij} - \bar{y}_i.$$

Tato "pořadová závislost" může vznikat posunem v měřicím zařízení, únavou operátora, změnou podmínek měření apod.

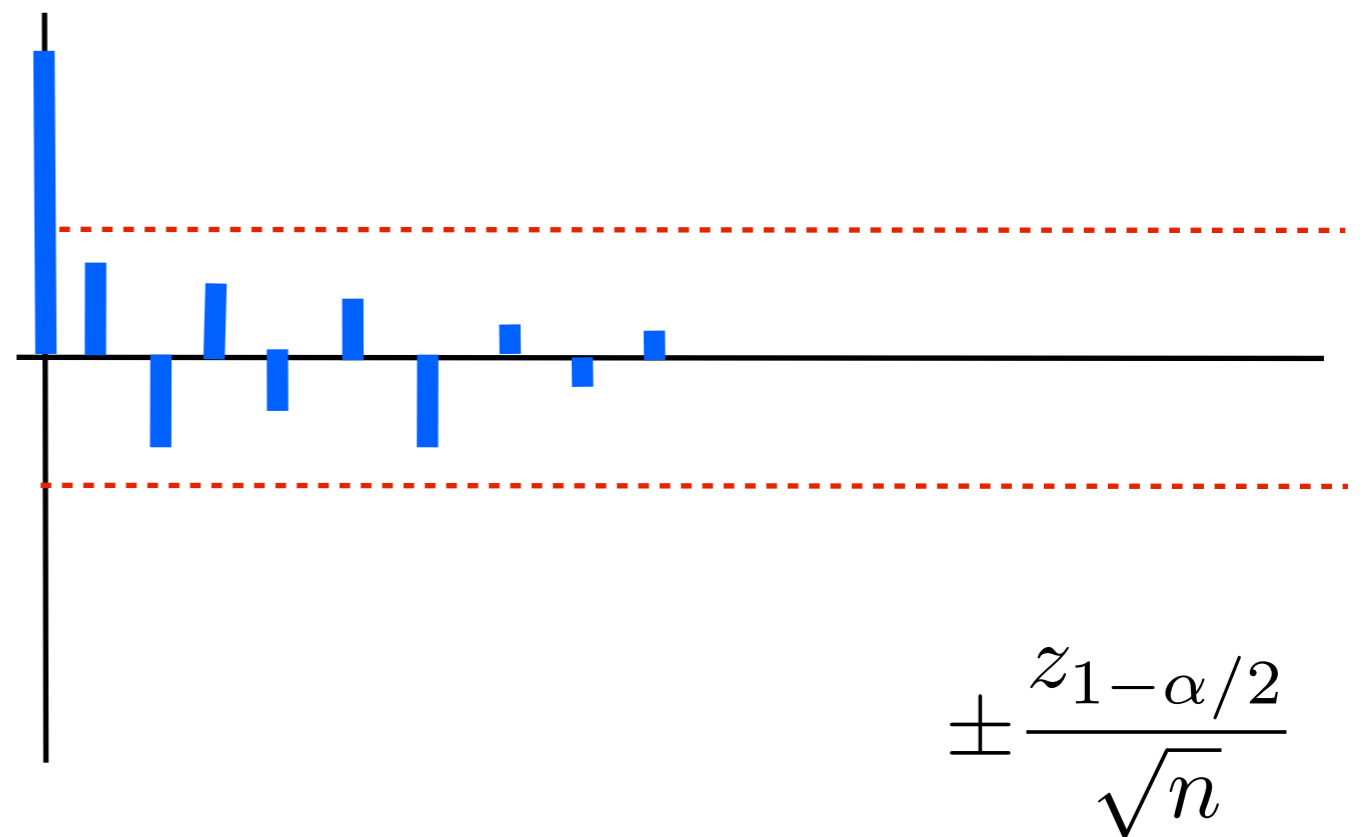
Grafická analýza - graf
reziduí v čase (indexový graf)

Autokorelační funkce reziduí

$$c_{i,k} = \text{Cov}(r_{i,j}, r_{i,j-k})$$

$$\hat{c}_{i,k} = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^{n-k} r_{i,j} r_{i,j+k}$$

$$\hat{r}_{i,k} = \frac{\sum_{j=1}^{n-k} r_{i,j} r_{i,j+k}}{\sum_{j=1}^n r_{i,j}^2}$$



Metoda ANOVA

Nezávislost měření

Závislost v posloupnosti měření se zjišťuje prostřednictvím reziduí

$$r_{ij} = y_{ij} - \bar{y}_i.$$

Tato "pořadová závislost" může vznikat posunem v měřicím zařízení, únavou operátora, změnou podmínek měření apod.

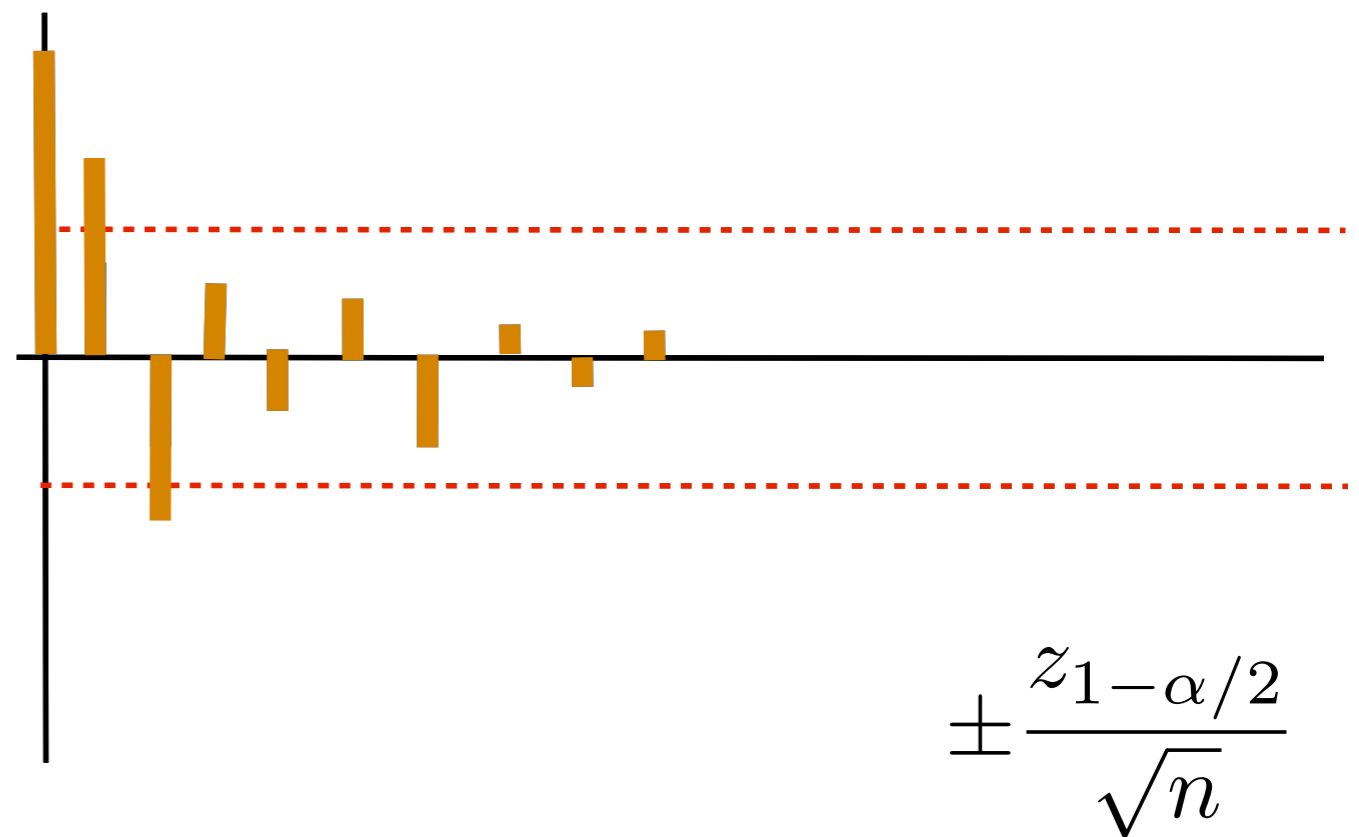
Grafická analýza - graf reziduí v čase (indexový graf)

Autokorelační funkce reziduí

$$c_{i,k} = \text{Cov}(r_{i,j}, r_{i,j-k})$$

$$\hat{c}_{i,k} = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^{n-k} r_{i,j} r_{i,j+k}$$

$$\hat{r}_{i,k} = \frac{\sum_{j=1}^{n-k} r_{i,j} r_{i,j+k}}{\sum_{j=1}^n r_{i,j}^2}$$

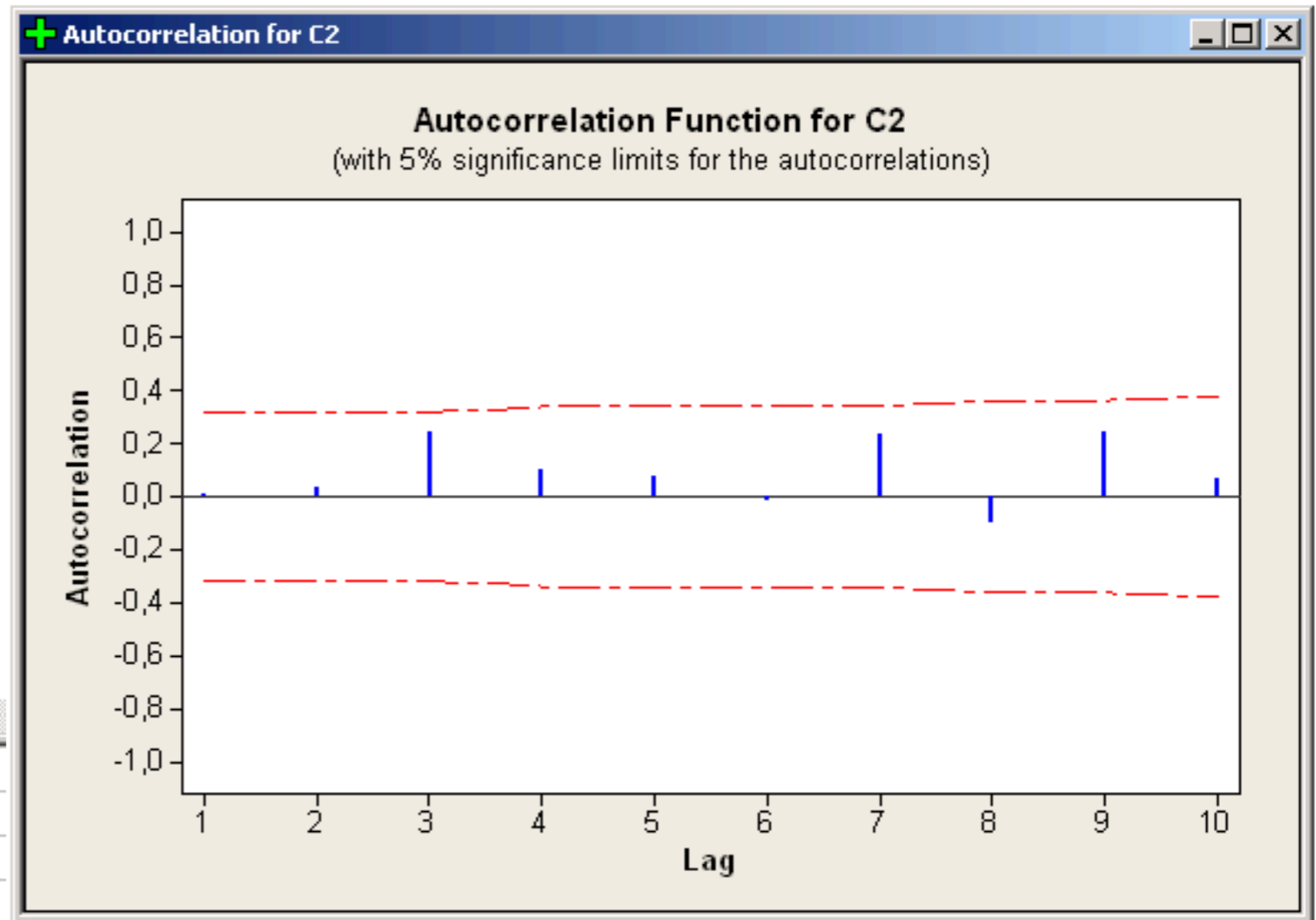


Metoda ANOVA

Nezávislost měření

Autocorrelation Function: C2

Lag	ACF	T	LBQ
1	0,006385	0,04	0,00
2	0,029956	0,19	0,04
3	0,244418	1,54	2,75
4	0,103208	0,62	3,25
5	0,072088	0,43	3,50
6	-0,018962	-0,11	3,52
7	0,231183	1,36	6,24
8	-0,102598	-0,58	6,79
9	0,240214	1,34	9,92
10	0,066817	0,36	10,17



12	2	04			
13	2	64			
14	2	128			
15	2	79			
16	3	81			
17	3	91			
18	3	142			
19	3	84			
20	3	85			
21	3	93			
22	3	99			
23	3	119			
24	3	92			

Metoda ANOVA

Nezávislost měření

- Analýza reziduí $r_{ij} = y_{ij} - \bar{y}_i$.

Durbin-Watsonův test:
$$DW = \frac{\sum_{k=1}^{n-1} (r_k - r_{k+1})^2}{\sum_{k=1}^{n-1} r_k^2}$$

Metoda ANOVA

Nezávislost měření

- Analýza reziduí $r_{ij} = y_{ij} - \bar{y}_i$.

Durbin-Watsonův test:
$$DW = \frac{\sum_{k=1}^{n-1} (r_k - r_{k+1})^2}{\sum_{k=1}^{n-1} r_k^2}$$

Hodnoty této statistiky se pohybují od nuly do čtyř. Pokud je tato statistika rovna číslu 2, rezidua nevykazují žádnou autokorelaci, hodnoty DW menší než 2 značí pozitivní autokorelaci a hodnoty větší než 2 značí autokorelaci negativní.

Orientační vodítko: leží-li hodnota testové statistiky DW v intervalu (1,4;2,6), rezidua nevykazují autokorelaci, hodnota pod 1,4 značí kladnou autokorelaci, hodnota nad 2,6 značí zápornou autokorelaci

Metoda ANOVA

Nezávislost měření

Co se stane, když jsou data závislá?

Metoda ANOVA

Nezávislost měření

Co se stane, když jsou data závislá?

- Největší změnou je to, že rozptyly průměrů se stávají vychýlené (velikost vychýlení závisí na typu závislosti). To způsobí vychýlenost odhadů pro jednotlivé skupiny a pro efekty faktorů a jejich interakcí.

Metoda ANOVA

Nezávislost měření

Co se stane, když jsou data závislá?

- Největší změnou je to, že rozptyly průměrů se stávají vychýlené (velikost vychýlení závisí na typu závislosti). To způsobí vychýlenost odhadů pro jednotlivé skupiny a pro efekty faktorů a jejich interakcí.
- Vliv randomizace může být na závislých datech různý účinek. Na stejných datech může jedno znáhodnění pořadí zvýšit pravděpodobnost chyby I. druhu, jiné naopak snížit.

Metoda ANOVA

Nezávislost měření

Co se stane, když jsou data závislá?

- Největší změnou je to, že rozptyly průměrů se stávají vychýlené (velikost vychýlení závisí na typu závislosti). To způsobí vychýlenost odhadů pro jednotlivé skupiny a pro efekty faktorů a jejich interakcí.
- Vliv randomizace může být na závislých datech různý účinek. Na stejných datech může jedno znáhodnění pořadí zvýšit pravděpodobnost chyby I. druhu, jiné naopak snížit.
- Náhodné seřazení kombinací v blocích také nepomůže, pokud není znáhodněno pořadí měření.

Metoda ANOVA

Nezávislost měření

Co se stane, když jsou data závislá?

- Největší změnou je to, že rozptyly průměrů se stávají vychýlené (velikost vychýlení závisí na typu závislosti). To způsobí vychýlenost odhadů pro jednotlivé skupiny a pro efekty faktorů a jejich interakcí.
- Vliv randomizace může být na závislých datech různý účinek. Na stejných datech může jedno znáhodnění pořadí zvýšit pravděpodobnost chyby I. druhu, jiné naopak snížit.
- Náhodné seřazení kombinací v blocích také nepomůže, pokud není znáhodněno pořadí měření.

Jak se vypořádat se závislostí dat?

Metoda ANOVA

Nezávislost měření

Co se stane, když jsou data závislá?

- Největší změnou je to, že rozptyly průměrů se stávají vychýlené (velikost vychýlení závisí na typu závislosti). To způsobí vychýlenost odhadů pro jednotlivé skupiny a pro efekty faktorů a jejich interakcí.
- Vliv randomizace může být na závislých datech různý účinek. Na stejných datech může jedno znáhodnění pořadí zvýšit pravděpodobnost chyby I. druhu, jiné naopak snížit.
- Náhodné seřazení kombinací v blocích také nepomůže, pokud není znáhodněno pořadí měření.

Jak se vypořádat se závislostí dat?

- Použít analýzu časových řad ke zjištění trendu a případné periodicity časové řady měření

Metoda ANOVA

Nezávislost měření

Co se stane, když jsou data závislá?

- Největší změnou je to, že rozptyly průměrů se stávají vychýlené (velikost vychýlení závisí na typu závislosti). To způsobí vychýlenost odhadů pro jednotlivé skupiny a pro efekty faktorů a jejich interakcí.
- Vliv randomizace může být na závislých datech různý účinek. Na stejných datech může jedno znáhodnění pořadí zvýšit pravděpodobnost chyby I. druhu, jiné naopak snížit.
- Náhodné seřazení kombinací v blocích také nepomůže, pokud není znáhodněno pořadí měření.

Jak se vypořádat se závislostí dat?

- Použít analýzu časových řad ke zjištění trendu a případné periodicity časové řady měření
- Pomocí autokorelační (parciální autokorelační) funkce zjistit závislosti v čase a určit ARMA model pro časovou řadu měření

Metoda ANOVA

Nezávislost měření

Co se stane, když jsou data závislá?

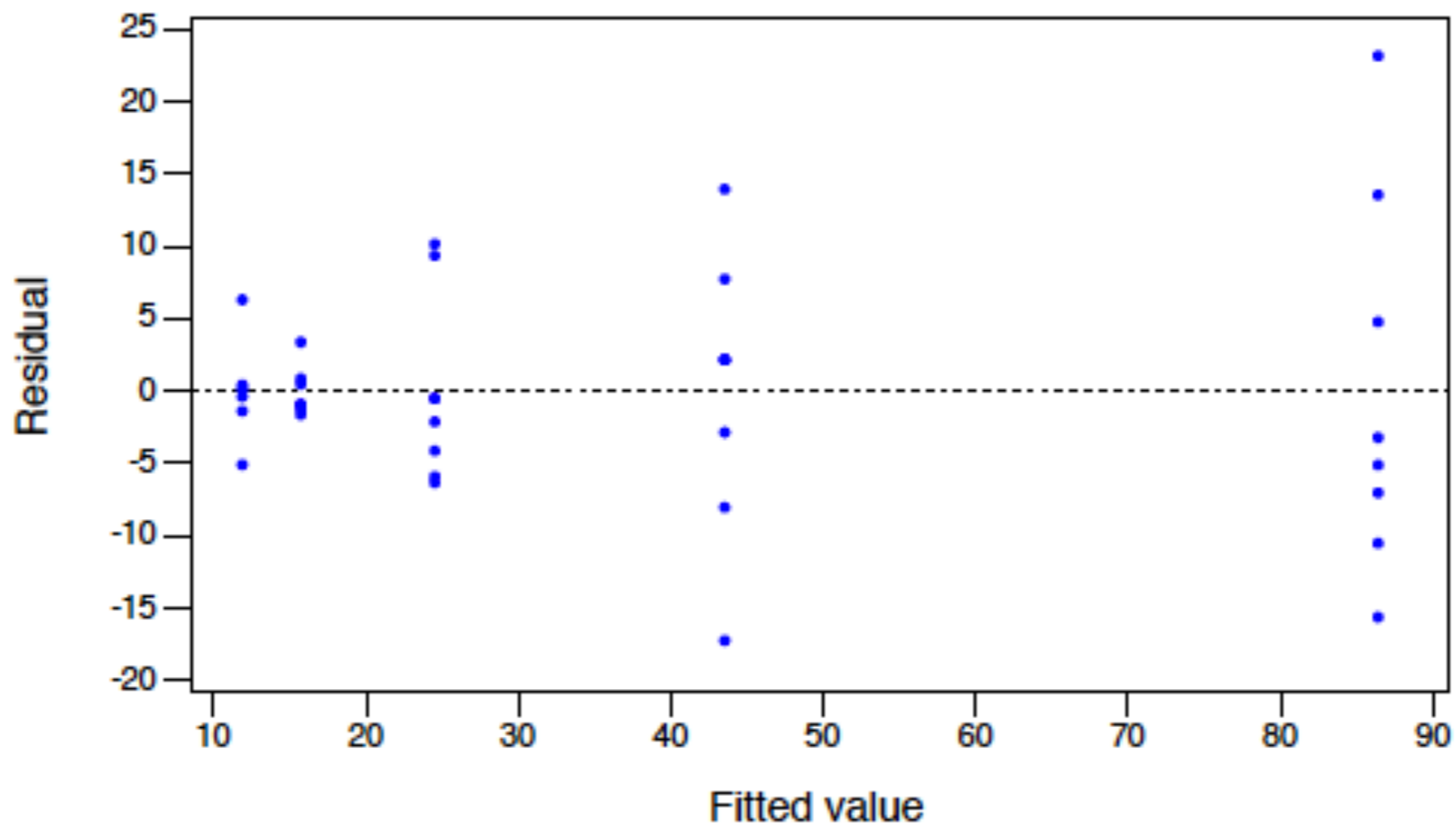
- Největší změnou je to, že rozptyly průměrů se stávají vychýlené (velikost vychýlení závisí na typu závislosti). To způsobí vychýlenost odhadů pro jednotlivé skupiny a pro efekty faktorů a jejich interakcí.
- Vliv randomizace může být na závislých datech různý účinek. Na stejných datech může jedno znáhodnění pořadí zvýšit pravděpodobnost chyby I. druhu, jiné naopak snížit.
- Náhodné seřazení kombinací v blocích také nepomůže, pokud není znáhodněno pořadí měření.

Jak se vypořádat se závislostí dat?

- Použít analýzu časových řad ke zjištění trendu a případné periodicity časové řady měření
- Pomocí autokorelační (parciální autokorelační) funkce zjistit závislosti v čase a určit ARMA model pro časovou řadu měření
- Na základě předchozích kroků provést "očistění" časové řady měření a dále pracovat pouze s rezidui, která by už měla být nezávislá

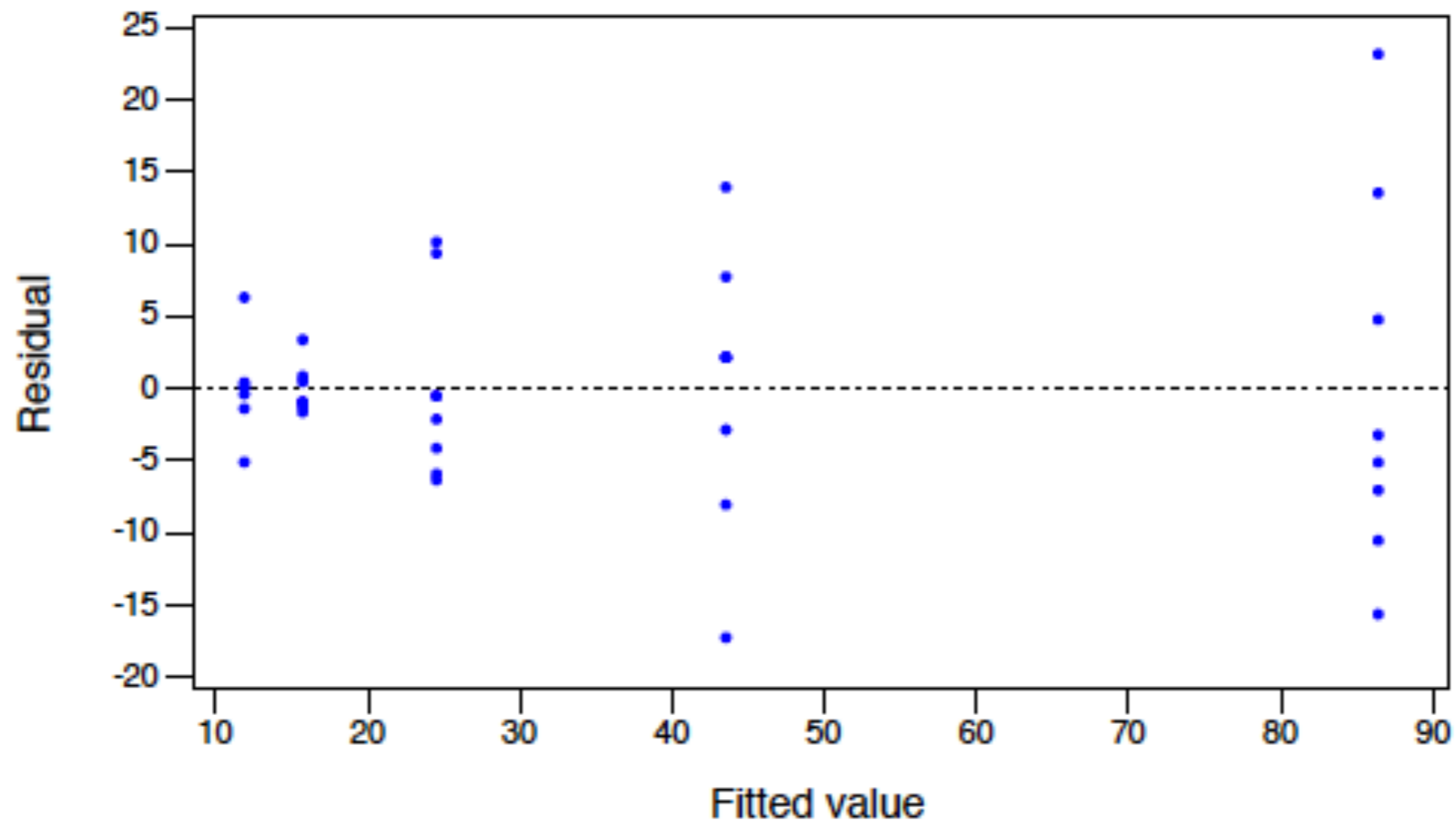
Metoda ANOVA

Homoskedasticita (konstantní rozptyl)



Metoda ANOVA

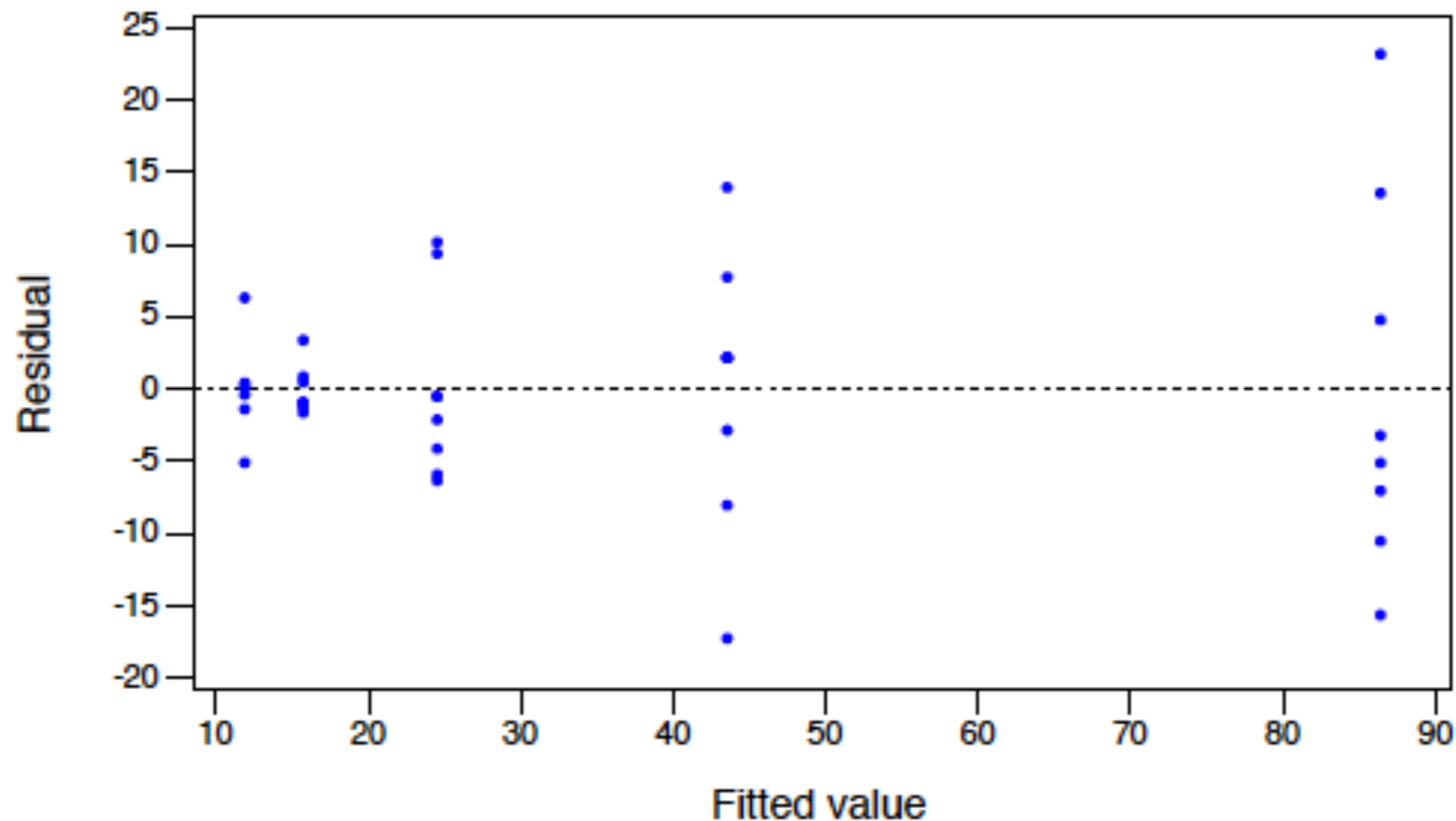
Homoskedasticita (konstantní rozptyl)



- O'Brienův test
- Brown-Forsythův test
- Levenův test
- Bartlettův test

Metoda ANOVA

Homoskedasticita (konstantní rozptyl)

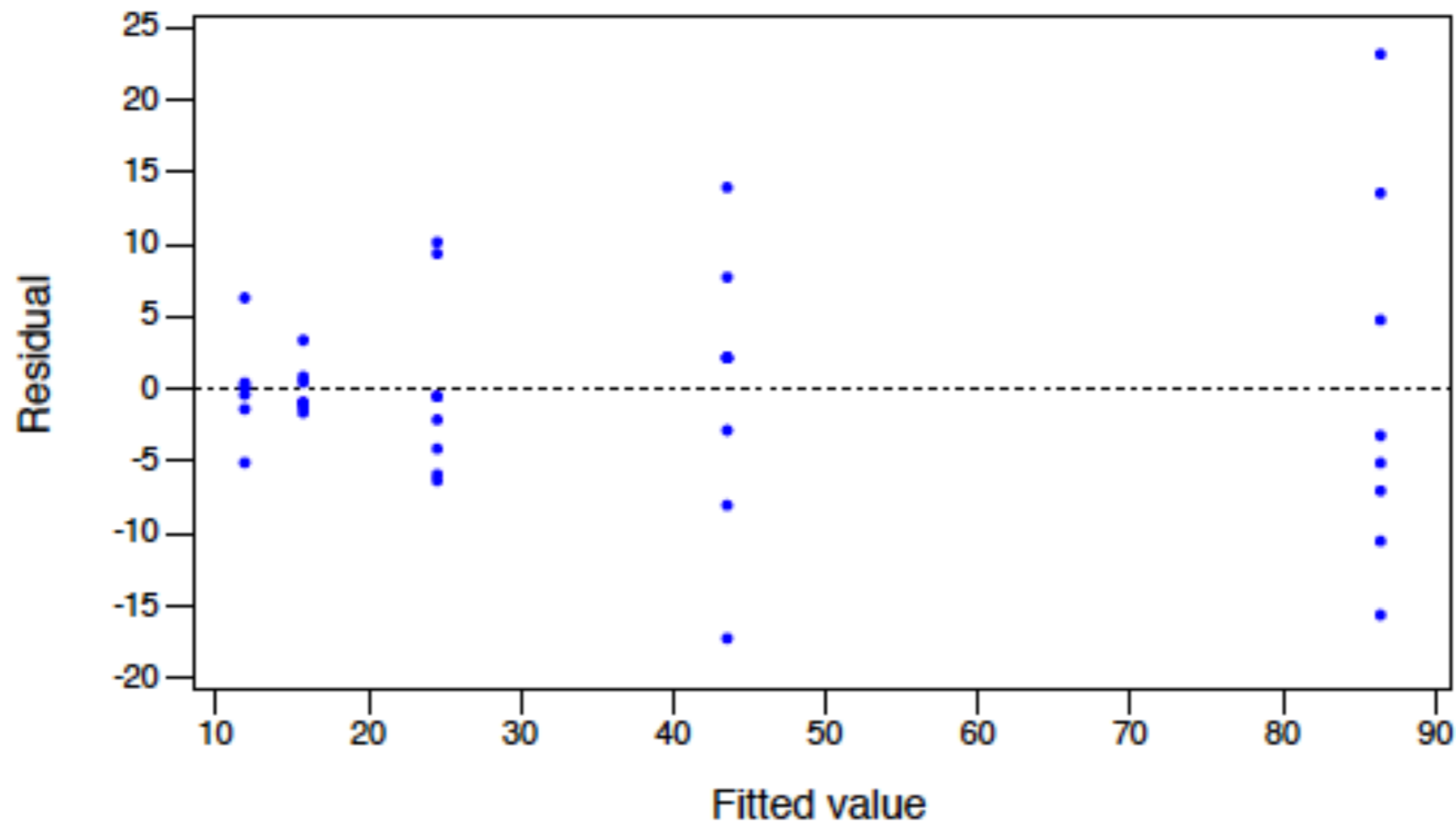


- O'Brienův test
- Brown-Forsythův test
- Levenův test
- Bartlettův test

první tři jsou založeny na transformaci veličiny z_{ij} a použití ANOVA

Metoda ANOVA

Homoskedasticita (konstantní rozptyl)



- O'Brienův test
- Brown-Forsythův test
- Levenův test
- Bartlettův test

první tři jsou založeny na transformaci veličiny z_{ij} a použití ANOVA

vyžaduje předpoklad normality!

Metoda ANOVA

Homoskedasticita (konstantní rozptyl)

- O'Brien
$$z_{ij} = \frac{(n_j + w - 2)n_j (y_{ij} - \bar{y}_{j.})^2 - w s_j^2 (n_j - 1)}{(n_j - 1)(n_j - 2)}$$

- Brown-Forsythe
$$z_{ij} = |y_{ij} - \tilde{y}_j|$$

y_{ij} - odezva pro i-té měření v j-té skupině
 \bar{y}_j - průměr odezvy ve skupině j
 s_j^2 - rozptyl odezvy ve skupině j
 n_j - je počet měření ve skupině j
 w - konstanta (0,5)
 \tilde{y}_j - medián odezvy ve skupině j
 p - počet skupin

- Levene
$$z_{ij} = |y_{ij} - \bar{y}_j|$$

Metoda ANOVA

Homoskedasticita (konstantní rozptyl)

- O'Brien
$$z_{ij} = \frac{(n_j + w - 2)n_j (y_{ij} - \bar{y}_{j.})^2 - w s_j^2 (n_j - 1)}{(n_j - 1)(n_j - 2)}$$

- Brown-Forsythe
$$z_{ij} = |y_{ij} - \tilde{y}_j|$$

- Levene
$$z_{ij} = |y_{ij} - \bar{y}_j|$$

y_{ij} - odezva pro i -té měření v j -té skupině

\bar{y}_j - průměr odezvy ve skupině j

s_j^2 - rozptyl odezvy ve skupině j

n_j - je počet měření ve skupině j

w - konstanta (0,5)

\tilde{y}_j - medián odezvy ve skupině j

p - počet skupin

testová statistika (ANOVA)
má F-rozdělení o $(p-1)$ a $(N-p)$
stupních volnosti

$$F = \frac{(N - p) \sum_{j=1}^p n_j (\bar{z}_{j.} - \bar{\bar{z}})^2}{(p - 1) \sum_{j=1}^p \sum_{i=1}^N (z_{ij} - \bar{z}_{j.})^2}$$

Metoda ANOVA

Homoskedasticita (konstantní rozptyl)

Grp 1	Grp 2	Grp 3	Grp 4	Grp 5	Grp 6
95	112				
123	107				
74	67				
145	98				
64	105				
84	95				
128	79				
79	.				
.	.				
.	.				
.	.				
.	.				

Test for Homogeneity of Variances

Number of Observations = 40
 Number of Groups = 6

Group Statistics:

Group	Median	Mean	Std.Dev	N
1	89.5000	99.0000	29.3355	8
2	98.0000	94.7143	16.2349	7
3	96.0000	100.8333	17.7551	12
4	106.0000	108.2857	10.8737	7
5	115.0000	118.3333	8.5049	3
6	134.0000	140.6667	28.5890	3

The p-value for rejecting = .05

Test	F-Ratio	p-value		
Levene	3.0079	0.0236	Reject H0	
Brown-Forsythe	2.1035	0.0890	Accept H0	
O'Brien	2.0498	0.0963	Accept H0	
Bartlett	Chi2 = 8.1337	1.6267	0.1490	Accept H0

Bartlett's test is chi-square with df = 5

All F tests are done with df = 5 and 34

Welch 1 way ANOVA 2.4737 0.1120 Accept H0

Here, the variances may be unequal. The df are 5, 10.112

Metoda ANOVA

Homoskedasticita (konstantní rozptyl)

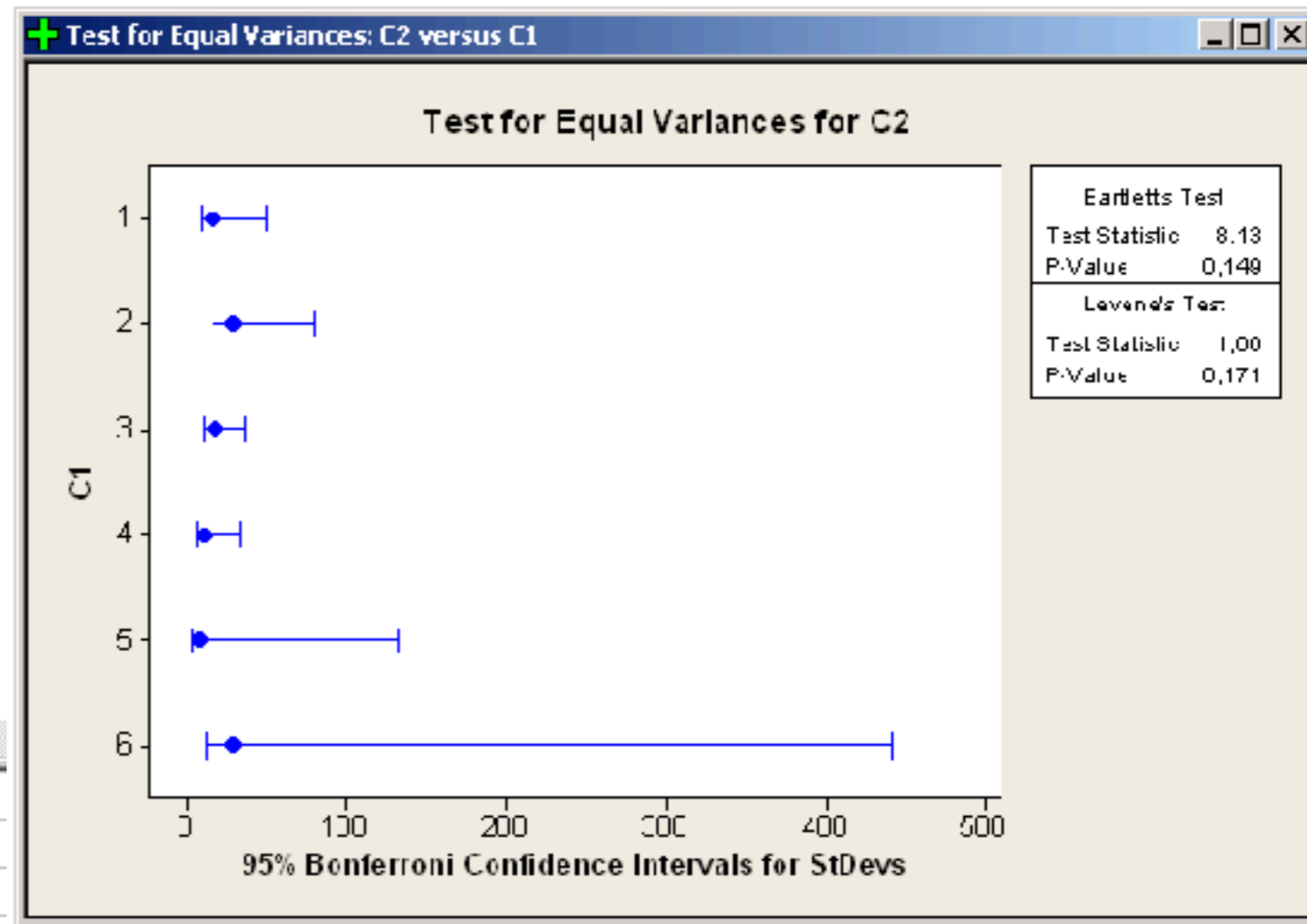
Test for Equal Variances: C2 versus C1

95% Bonferroni confidence intervals for standard deviations

C1	N	Lower	StDev	Upper
1	7	5,1236	15,2349	50,002
2	8	17,0400	29,3343	80,335
3	12	11,2743	17,7551	37,252
4	7	6,1108	10,8737	33,490
5	3	0,6029	0,5049	101,020
6	3	12,2119	23,5890	442,438

Bartlett's Test (normal distribution)
Test statistic = 8,13; p-value = 0,149

Levene's Test (any continuous distribution)
Test statistic = 1,66; p-value = 0,171



12	2	04							
13	2	64							
14	2	128							
15	2	79							
16	3	81							
17	3	91							
18	3	142							
19	3	84							
20	3	85							
21	3	93							
22	3	99							
23	3	119							
24	3	92							

Metoda ANOVA

Homoskedasticita (konstantní rozptyl)

Co se stane, když jsou rozptyly nehomogenní?

Metoda ANOVA

Homoskedasticita (konstantní rozptyl)

Co se stane, když jsou rozptyly nehomogenní?

- Jsou-li stejné rozsahy skupin (n_1, \dots, n_g), potom je vliv nestejných rozptylů na p -hodnotu F-testu relativně malý

Metoda ANOVA

Homoskedasticita (konstantní rozptyl)

Co se stane, když jsou rozptyly nehomogenní?

- Jsou-li stejné rozsahy skupin (n_1, \dots, n_g), potom je vliv nestejných rozptylů na p -hodnotu F-testu relativně malý
- Při větším rozsahu skupin s větším rozptylem se p -hodnota zmenšuje oproti nominální (nadhodnocujeme odhad a dostáváme konzervativní test)

Metoda ANOVA

Homoskedasticita (konstantní rozptyl)

Co se stane, když jsou rozptyly nehomogenní?

- Jsou-li stejné rozsahy skupin (n_1, \dots, n_g), potom je vliv nestejných rozptylů na p -hodnotu F-testu relativně malý
- Při větším rozsahu skupin s větším rozptylem se p -hodnota zmenšuje oproti nominální (nadhodnocujeme odhad a dostáváme konzervativní test)
- Při větším rozsahu skupin s menším rozptylem je skutečná p -hodnota větší oproti nominální (podhodnocujeme odhad a dostáváme liberální test)

Metoda ANOVA

Homoskedasticita (konstantní rozptyl)

Co se stane, když jsou rozptyly nehomogenní?

- Jsou-li stejné rozsahy skupin (n_1, \dots, n_g), potom je vliv nestejných rozptylů na p -hodnotu F-testu relativně malý
- Při větším rozsahu skupin s větším rozptylem se p -hodnota zmenšuje oproti nominální (nadhodnocujeme odhad a dostáváme konzervativní test)
- Při větším rozsahu skupin s menším rozptylem je skutečná p -hodnota větší oproti nominální (podhodnocujeme odhad a dostáváme liberální test)

g	σ_i^2	n_i	ε
3	1, 1, 1	5, 5, 5	.05
	1, 2, 3	5, 5, 5	.0579
	1, 2, 5	5, 5, 5	.0685
	1, 2, 10	5, 5, 5	.0864
	1, 1, 10	5, 5, 5	.0954
	1, 1, 10	50, 50, 50	.0748
	3	1, 2, 5	2, 5, 8
1, 2, 5		8, 5, 2	.1833
1, 2, 10		2, 5, 8	.0178
1, 2, 10		8, 5, 2	.2831
1, 2, 10		20, 50, 80	.0116
1, 2, 10		80, 50, 20	.2384
5		1, 2, 2, 2, 5	5, 5, 5, 5, 5
	1, 2, 2, 2, 5	2, 2, 5, 8, 8	.0292
	1, 2, 2, 2, 5	8, 8, 5, 2, 2	.1453
	1, 1, 1, 1, 5	5, 5, 5, 5, 5	.0908
	1, 1, 1, 1, 5	2, 2, 5, 8, 8	.0347
	1, 1, 1, 1, 5	8, 8, 5, 2, 2	.2029

Přibližná pravděpodobnost chyby I. druhu ε při nominální hodnotě $\alpha=5\%$ pro různé rozptyly ve skupinách

Metoda ANOVA

Homoskedasticita (konstantní rozptyl)

Jak lze nehomogenitu rozptylů odstranit?

V podstatě jediný způsob "napravení" nehomogenity rozptylů je transformace.
V následující tabulce jsou některé uvedeny:

Rozdělení	Transformace	Nový rozptyl
Binomické rozdělení $X \approx Binom(n, p)$ $Var(\hat{p}) = p(1 - p)/n$	$\arcsin(\sqrt{\hat{p}})$	
Poissonovo rozdělení $X \approx Poisson(\lambda)$ $Var(X) = \lambda$	\sqrt{X}	
Pokud lze vyjádřit $Var(X) = g(\mu)$ pomocí $E(X) = \mu$	$y = \int_a^x \frac{1}{\sqrt{g(v)}} dv$	1

Metoda ANOVA

Homoskedasticita (konstantní rozptyl)

Jak lze nehomogenitu rozptylů odstranit?

V podstatě jediný způsob "napravení" nehomogenity rozptylů je transformace.
V následující tabulce jsou některé uvedeny:

Rozdělení	Transformace	Nový rozptyl
Binomické rozdělení $X \approx Binom(n, p)$ $Var(\hat{p}) = p(1 - p)/n$	$\arcsin(\sqrt{\hat{p}})$	
Poissonovo rozdělení $X \approx Poisson(\lambda)$ $Var(X) = \lambda$	\sqrt{X}	
Pokud lze vyjádřit $Var(X) = g(\mu)$ pomocí $E(X) = \mu$	$y = \int_a^x \frac{1}{\sqrt{g(v)}} dv$	1

Alternativou je použití neparametrického testu (Kruskal-Wallis) namísto F-testu v ANOVA

Metoda ANOVA

Normalit reziduí

Metoda ANOVA

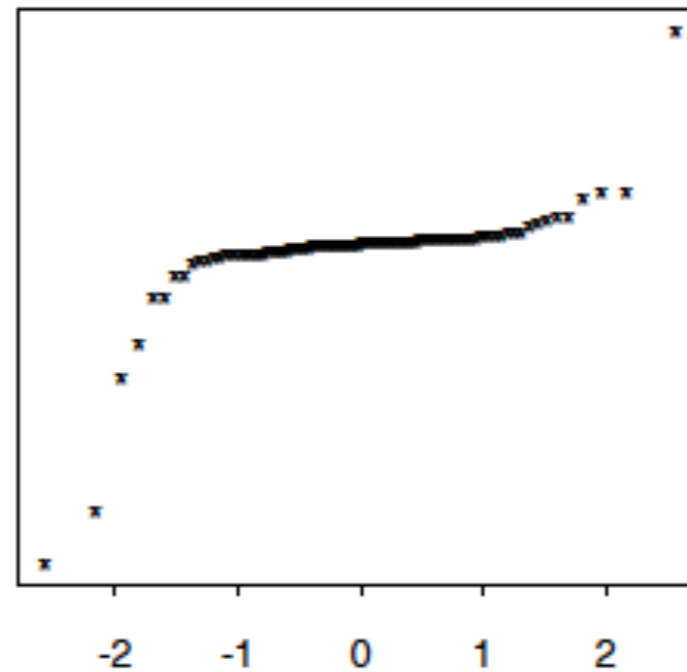
Normalit reziduí

Normální pravděpodobnostní graf
(rankitový graf, Q-Q graf)

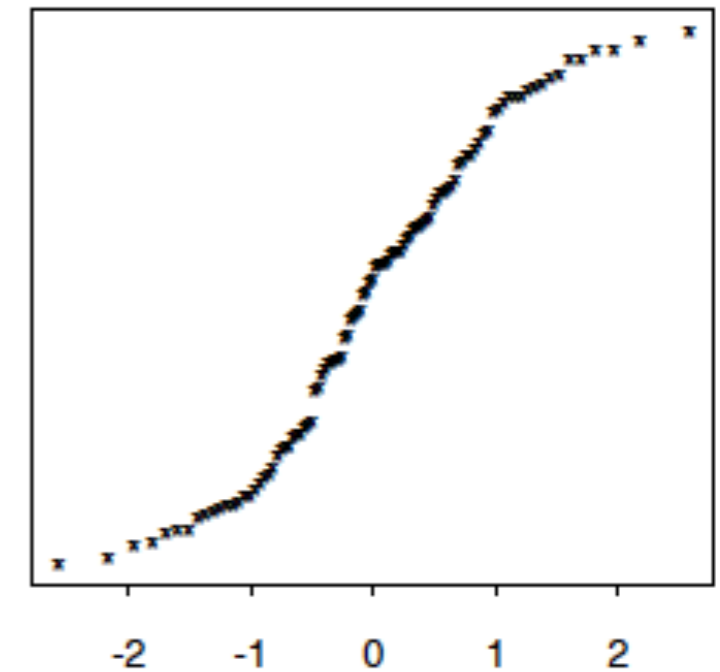
rankit je aproximace normálního
rozdělení:

$$\frac{i - 3/8}{n + 1/4}$$

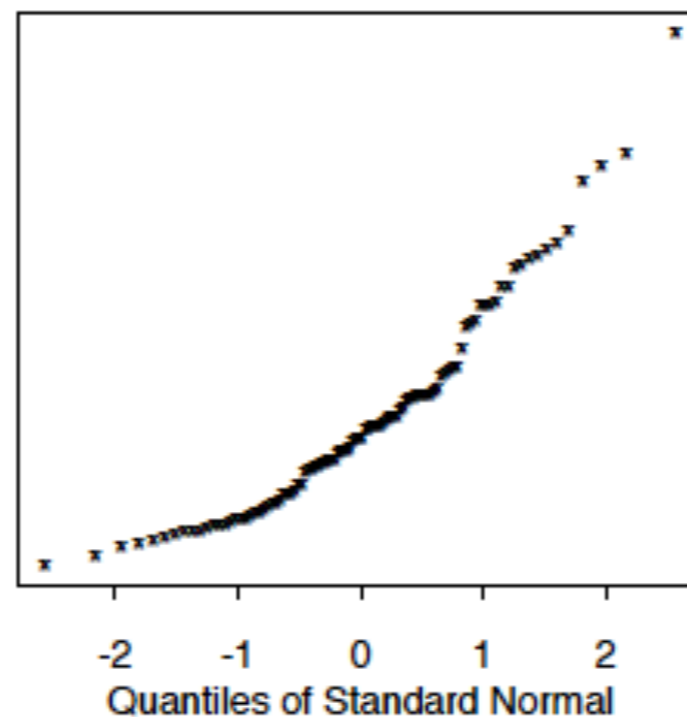
Long tails



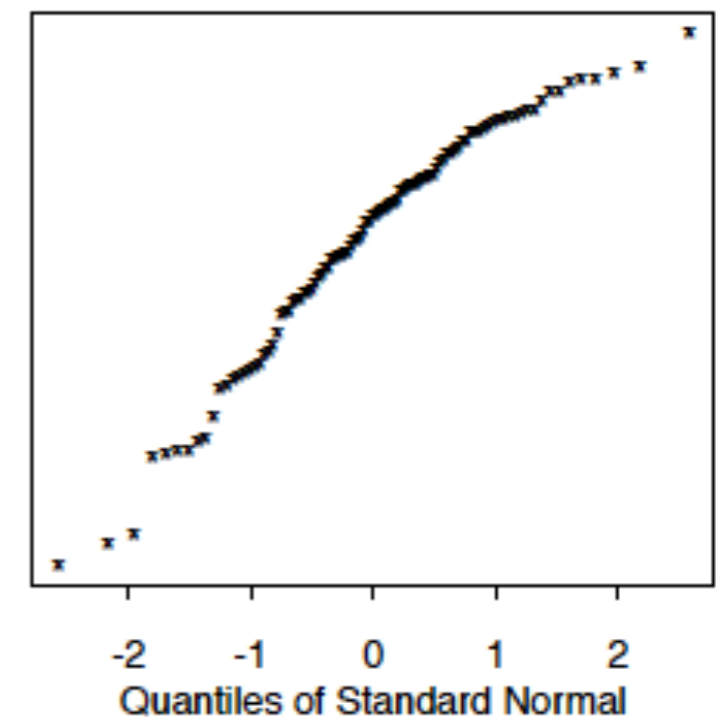
Short tails



Skewed right



Skewed left



Metoda ANOVA

Normalit reziduí

Testy normality:

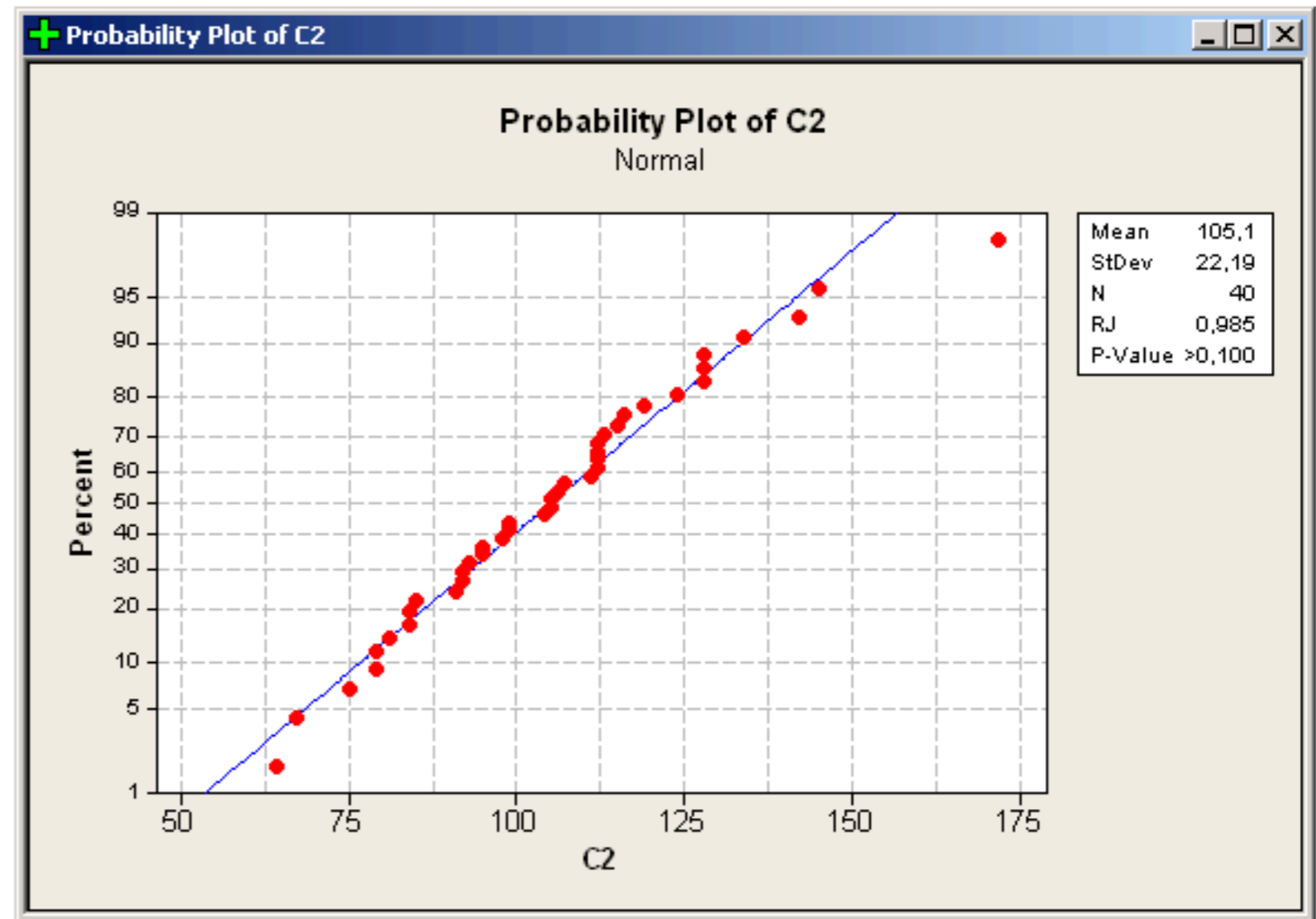
- Chí-kvadrát test
- Anderson-Darling
- Shapiro-Wilk (Ryan-
Joiner)

Metoda ANOVA

Normalit reziduí

Testy normality:

- Chí-kvadrát test
- Anderson-Darling
- Shapiro-Wilk (Ryan-Joiner)

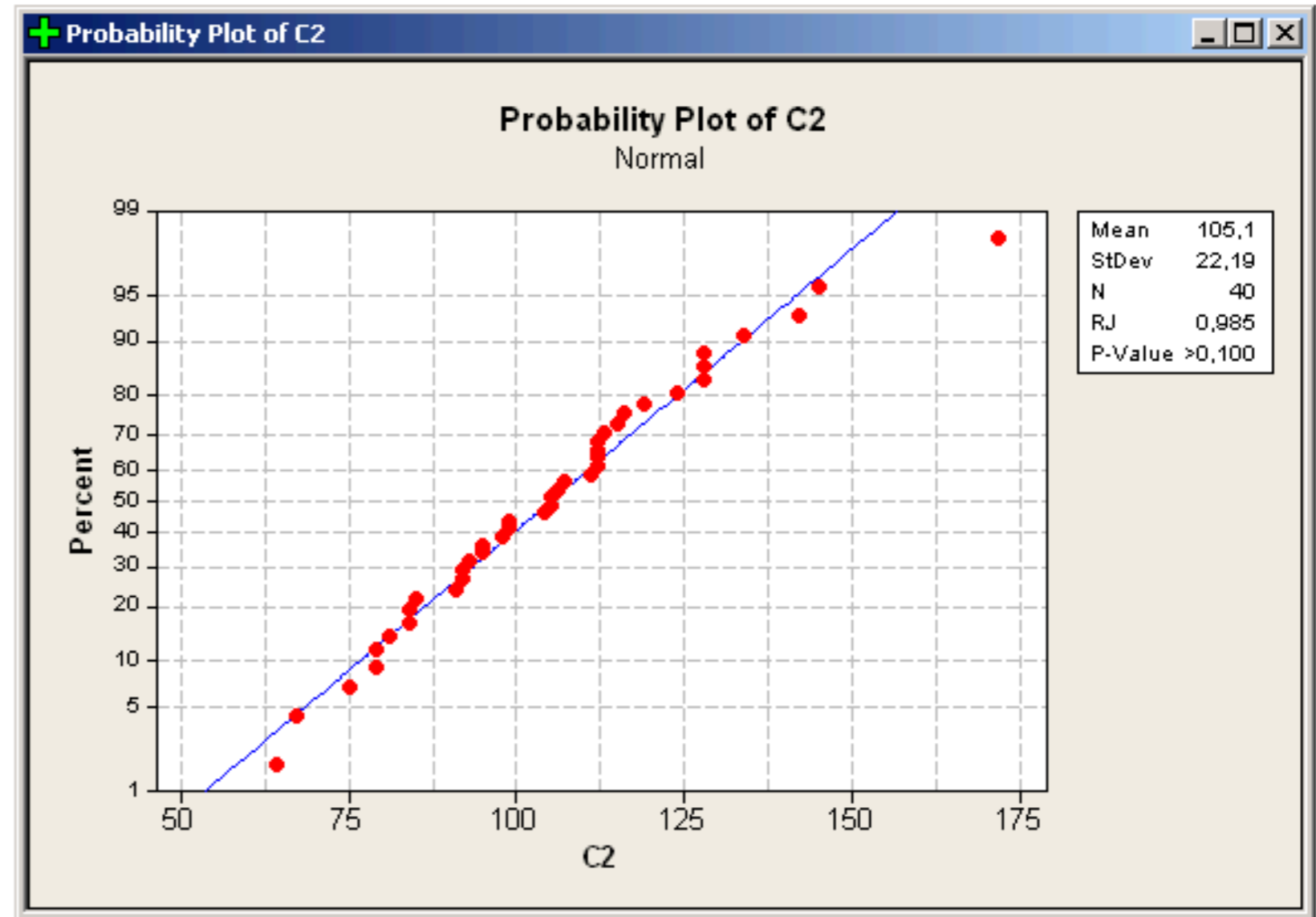


Metoda ANOVA

Normalit reziduí

Testy normality:

- Chí-kvadrát test
- Anderson-Darling
- Shapiro-Wilk (Ryan-Joiner)
- Test normality založený na šikmosti a špičatosti



Metoda ANOVA

Normalit reziduí

Test normality založený na šikmosti a špičatosti

výběrový koeficient
šikmosti:

$$S_k = \frac{M_3}{s^3} = \frac{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (X_i - \bar{x})^3}{\left(\sqrt{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (X_i - \bar{x})^2} \right)^3},$$

$$ES_k = 0,$$

$$DS_k = \frac{6(n-2)}{(n+1)(n+3)}$$

$$\frac{|S_k|}{\sqrt{DS_k}} \geq z_\alpha$$

výběrový koeficient
špičatosti:

$$E_k = \frac{M_4}{s^4} - 3 = \frac{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (X_i - \bar{x})^4}{\left(\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (X_i - \bar{x})^2 \right)^2} - 3,$$

$$EE_k = \frac{-6}{n+1},$$

$$DE_k = \frac{24n(n-2)(n-3)}{(n+1)^2(n+3)(n+5)}$$

$$\frac{|E_k - EE_k|}{\sqrt{DE_k}} \geq z_\alpha$$

kde $z_\alpha = \Phi^{-1}(1 - \alpha/2)$

Metoda ANOVA

Normalit reziduí

Co se stane, když jsou data nenormální?

Změní se hladina významnosti:

<u>Čtyři skupiny po 5 měřeních</u>							
K							
S	-1	-.5	0	.5	1	1.5	2
0	.0527	.0514	.0500	.0486	.0473	.0459	.0446
.5	.0530	.0516	.0503	.0489	.0476	.0462	.0448
1	.0538	.0524	.0511	.0497	.0484	.0470	.0457
1.5	.0552	.0538	.0525	.0511	.0497	.0484	.0470

Metoda ANOVA

Normalit reziduí

Co se stane, když jsou data nenormální?

Změní se hladina významnosti:

<u>Čtyři skupiny po 5 měřeních</u>							
K							
S	-1	-.5	0	.5	1	1.5	2
0	.0527	.0514	.0500	.0486	.0473	.0459	.0446
.5	.0530	.0516	.0503	.0489	.0476	.0462	.0448
1	.0538	.0524	.0511	.0497	.0484	.0470	.0457
1.5	.0552	.0538	.0525	.0511	.0497	.0484	.0470

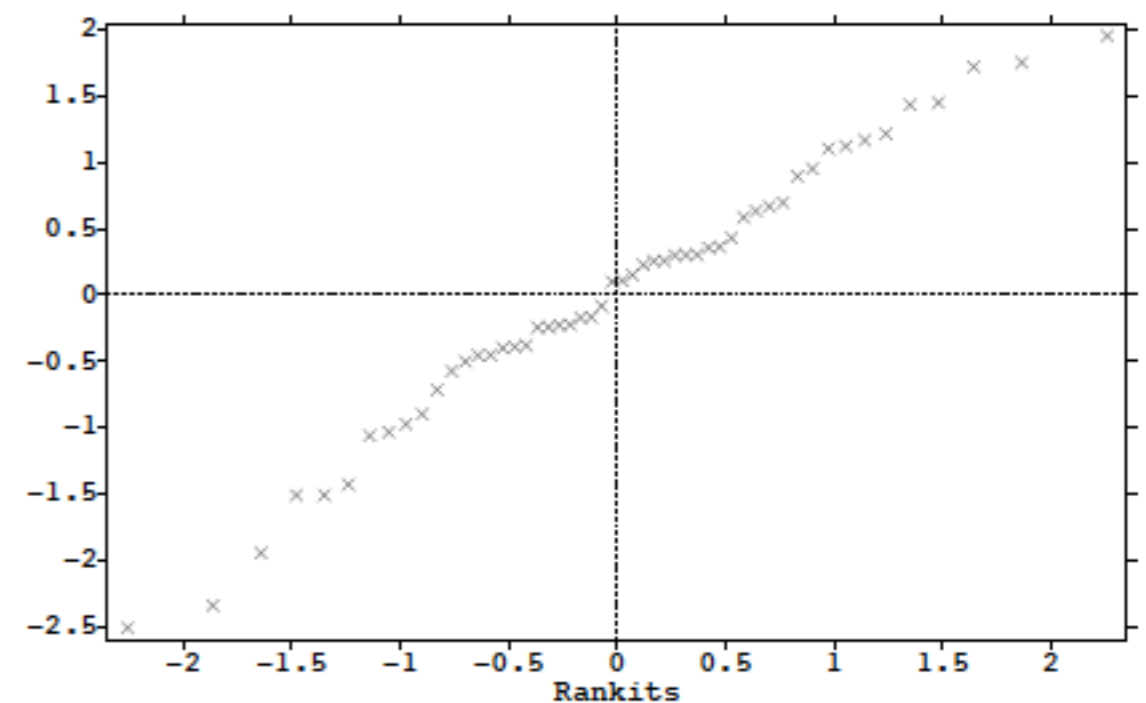
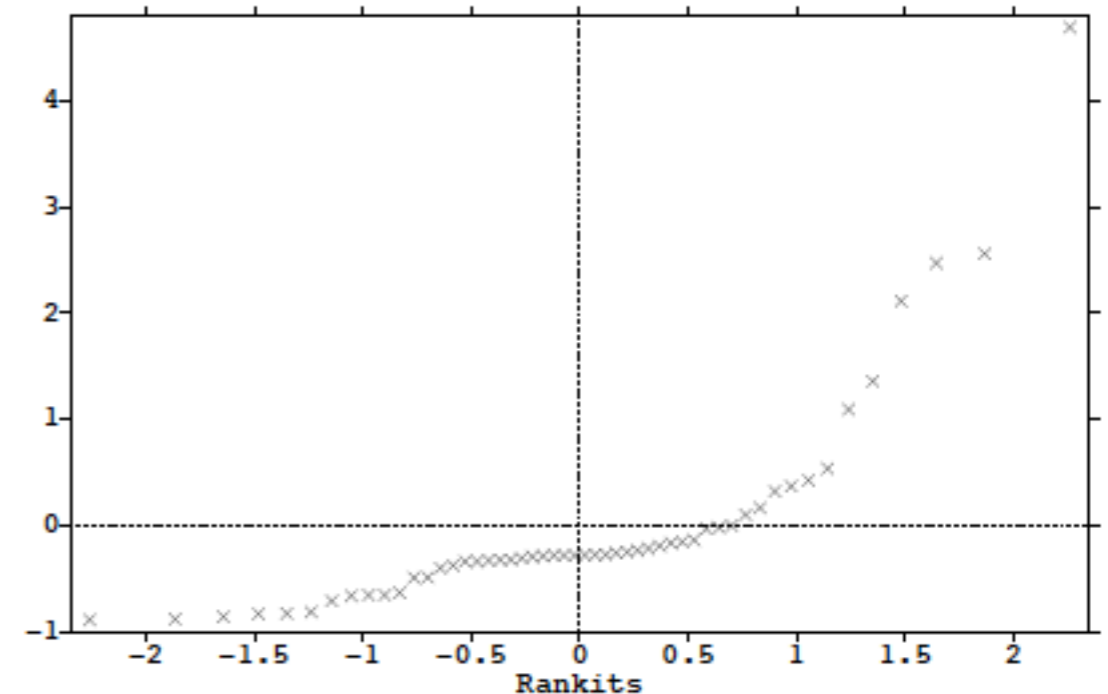
<u>S = 0 a K = 1.5</u>						
4 skupiny po k		k skupin po 5		(k_1, k_1, k_2, k_2)		
k	α	k	α	k_1, k_2	α	
2	.0427	4	.0459	10,10	.0480	
10	.0480	8	.0474	8,12	.0483	
20	.0490	16	.0485	5,15	.0500	
40	.0495	32	.0492	2,18	.0588	

Metoda ANOVA

Normalit reziduí

Nejčastější způsob "napravení" normality je opět transformace. Na obr. vpravo nahoře jsou původní data a dole jsou tatáž data po logaritmické transformaci.

Jak data "znormalizovat"?



Metoda ANOVA

Normalit reziduí

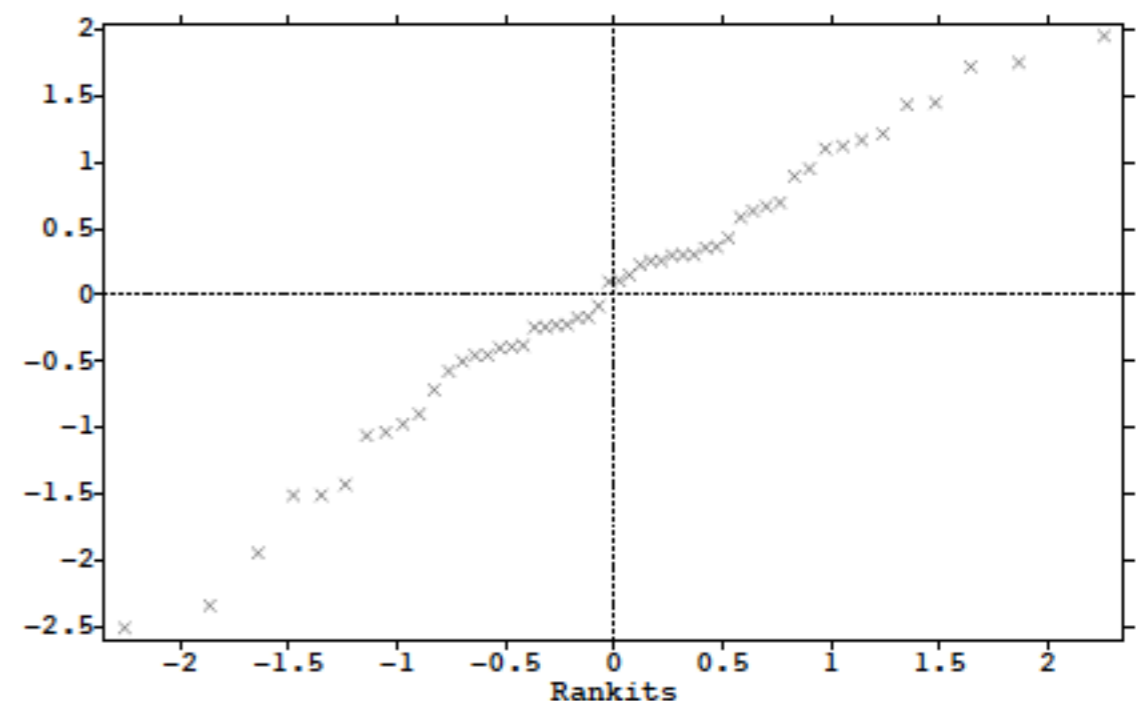
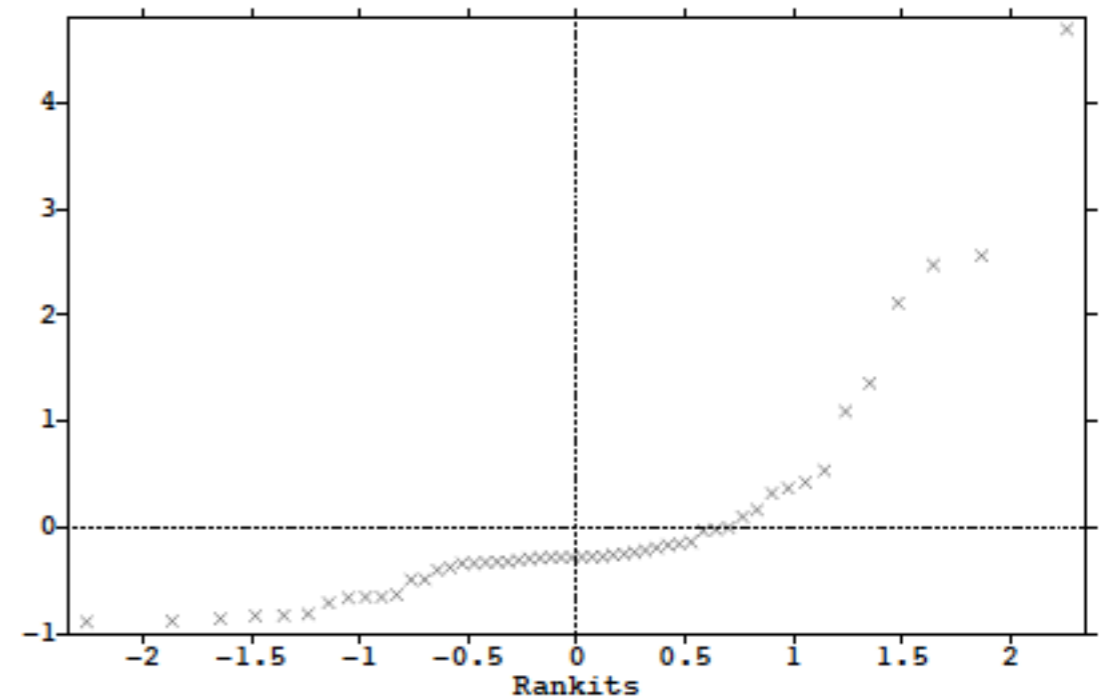
Nejčastější způsob "napravení" normality je opět transformace. Na obr. vpravo nahoře jsou původní data a dole jsou tatáž data po logaritmické transformaci.

Nejjednodušší je transformace v případě sešikmení původních dat. Zešikmení napravo pomůže transformace odmocninou, logaritmem nebo jinou mocninou transformací s exponentem menším než 1.

Data zešikmená doleva lze úspěšně transformovat mocninnou transformací s exponentem větším než 1.

Problematický je případ symetrického rozdělení se špičatostí různou od 3.

Jak data "znormalizovat"?



Metoda ANOVA

Normalit reziduí

Nejčastější způsob "napravení" normality je opět transformace. Na obr. vpravo nahoře jsou původní data a dole jsou tatáž data po logaritmické transformaci.

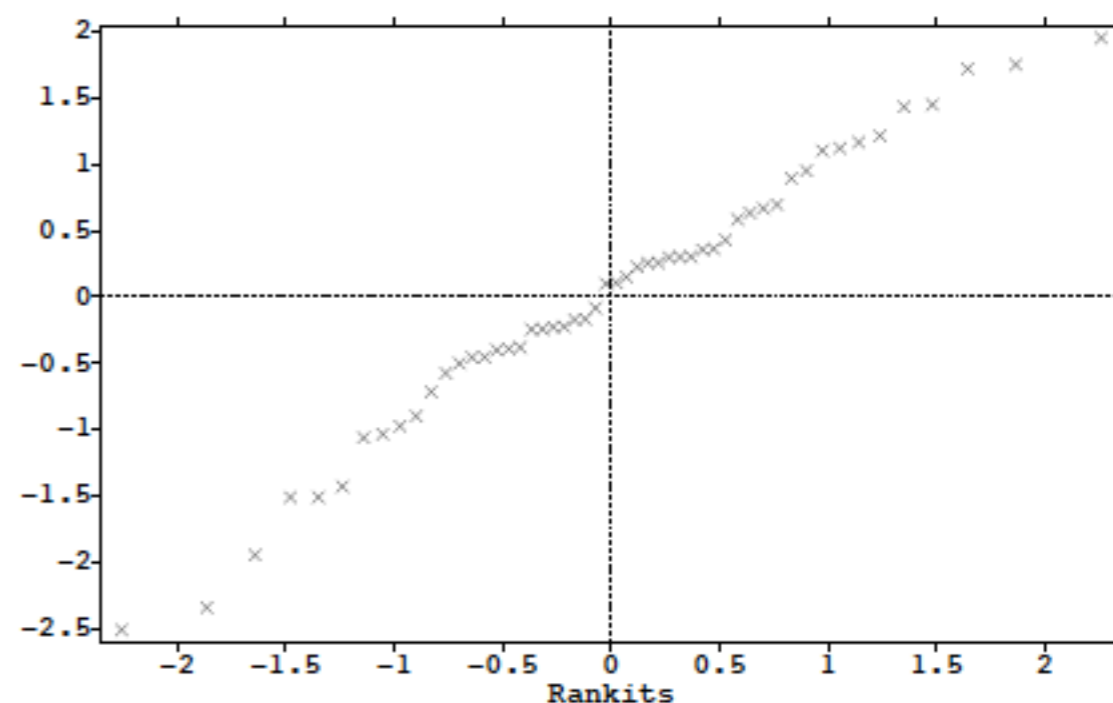
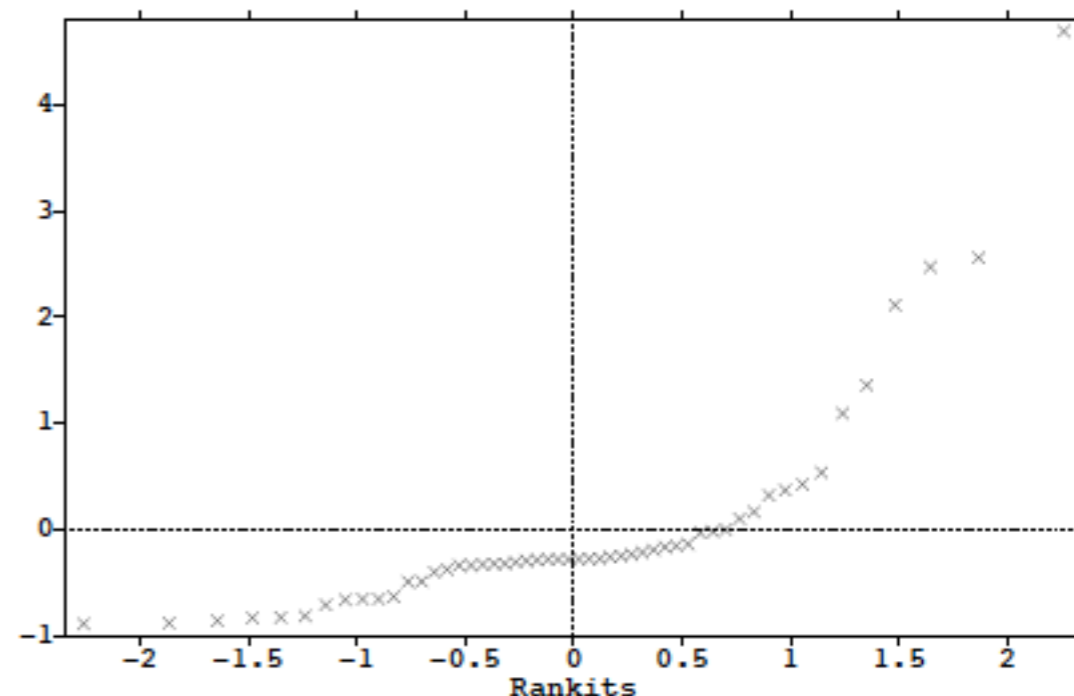
Nejjednodušší je transformace v případě sešikmení původních dat. Zešikmení napravo pomůže transformace odmocninou, logaritmem nebo jinou mocninou transformací s exponentem menším než 1.

Data zešikmená doleva lze úspěšně transformovat mocninnou transformací s exponentem větším než 1.

Problematický je případ symetrického rozdělení se špičatostí různou od 3.

Zvláštní přístup je třeba zaujmout k odlehlým měřením.

Jak data "znormalizovat"?



Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením => nelze použít ANOVA.

Kruskal – Wallisův test

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením => nelze použít ANOVA.

Kruskal – Wallisův test

- Je neparametrickou obdobou analýzy rozptylu jednoduchého třídění.

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením => nelze použít ANOVA.

Kruskal – Wallisův test

- Je neparametrickou obdobou analýzy rozptylu jednoduchého třídění.
- Slouží k ověření nulové hypotézy H_0 , že $k > 2$ nezávislých náhodných výběrů o rozsazích n_1, n_2, \dots, n_k pochází z jednoho základního souboru.

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením => nelze použít ANOVA.

Kruskal – Wallisův test

- Je neparametrickou obdobou analýzy rozptylu jednoduchého třídění.
- Slouží k ověření nulové hypotézy H_0 , že $k > 2$ nezávislých náhodných výběrů o rozsazích n_1, n_2, \dots, n_k pochází z jednoho základního souboru.
- Předpokládáme, že tyto náhodné výběry byly pořízeny ze základních souborů se spojitými distribučními funkcemi $F_1(x), F_2(x), \dots, F_k(x)$.

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením => nelze použít ANOVA.

Kruskal – Wallisův test

- Je neparametrickou obdobou analýzy rozptylu jednoduchého třídění.
- Slouží k ověření nulové hypotézy H_0 , že $k > 2$ nezávislých náhodných výběrů o rozsazích n_1, n_2, \dots, n_k pochází z jednoho základního souboru.
- Předpokládáme, že tyto náhodné výběry byly pořízeny ze základních souborů se spojitými distribučními funkcemi $F_1(x), F_2(x), \dots, F_k(x)$.
- Nulovou hypotézu H_0 můžeme zapsat takto
$$H_0: F_1(x) = F_2(x) = \dots = F_k(x) \text{ pro všechna } x.$$

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením => nelze použít ANOVA.

Kruskal – Wallisův test

- Je neparametrickou obdobou analýzy rozptylu jednoduchého třídění.
- Slouží k ověření nulové hypotézy H_0 , že $k > 2$ nezávislých náhodných výběrů o rozsazích n_1, n_2, \dots, n_k pochází z jednoho základního souboru.
- Předpokládáme, že tyto náhodné výběry byly pořízeny ze základních souborů se spojitými distribučními funkcemi $F_1(x), F_2(x), \dots, F_k(x)$.
- Nulovou hypotézu H_0 můžeme zapsat takto
$$H_0: F_1(x) = F_2(x) = \dots = F_k(x) \text{ pro všechna } x.$$

Postup při stanovení testového kritéria:

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením => nelze použít ANOVA.

Kruskal – Wallisův test

- Je neparametrickou obdobou analýzy rozptylu jednoduchého třídění.
- Slouží k ověření nulové hypotézy H_0 , že $k > 2$ nezávislých náhodných výběrů o rozsazích n_1, n_2, \dots, n_k pochází z jednoho základního souboru.
- Předpokládáme, že tyto náhodné výběry byly pořízeny ze základních souborů se spojitými distribučními funkcemi $F_1(x), F_2(x), \dots, F_k(x)$.
- Nulovou hypotézu H_0 můžeme zapsat takto
$$H_0: F_1(x) = F_2(x) = \dots = F_k(x) \text{ pro všechna } x.$$

Postup při stanovení testového kritéria:

- 1) Máme k dispozici k výběrových souborů o četnostech n_1, n_2, \dots, n_k .

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením => nelze použít ANOVA.

Kruskal – Wallisův test

- Je neparametrickou obdobou analýzy rozptylu jednoduchého třídění.
- Slouží k ověření nulové hypotézy H_0 , že $k > 2$ nezávislých náhodných výběrů o rozsazích n_1, n_2, \dots, n_k pochází z jednoho základního souboru.
- Předpokládáme, že tyto náhodné výběry byly pořízeny ze základních souborů se spojitými distribučními funkcemi $F_1(x), F_2(x), \dots, F_k(x)$.
- Nulovou hypotézu H_0 můžeme zapsat takto
$$H_0: F_1(x) = F_2(x) = \dots = F_k(x) \text{ pro všechna } x.$$

Postup při stanovení testového kritéria:

- 1) Máme k dispozici k výběrových souborů o četnostech n_1, n_2, \dots, n_k .
- 2) Všechny výběrové soubory sloučíme do jediného souboru.

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením => nelze použít ANOVA.

Kruskal – Wallisův test

- Je neparametrickou obdobou analýzy rozptylu jednoduchého třídění.
- Slouží k ověření nulové hypotézy H_0 , že $k > 2$ nezávislých náhodných výběrů o rozsazích n_1, n_2, \dots, n_k pochází z jednoho základního souboru.
- Předpokládáme, že tyto náhodné výběry byly pořízeny ze základních souborů se spojitými distribučními funkcemi $F_1(x), F_2(x), \dots, F_k(x)$.
- Nulovou hypotézu H_0 můžeme zapsat takto
$$H_0: F_1(x) = F_2(x) = \dots = F_k(x) \text{ pro všechna } x.$$

Postup při stanovení testového kritéria:

- 1) Máme k dispozici k výběrových souborů o četnostech n_1, n_2, \dots, n_k .
- 2) Všechny výběrové soubory sloučíme do jediného souboru.
- 3) Každé hodnotě souboru přiřadíme vzestupně pořadové číslo, stejným hodnotám pak pořadí průměrné.

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením => nelze použít ANOVA.

Kruskal – Wallisův test

- Je neparametrickou obdobou analýzy rozptylu jednoduchého třídění.
- Slouží k ověření nulové hypotézy H_0 , že $k > 2$ nezávislých náhodných výběrů o rozsazích n_1, n_2, \dots, n_k pochází z jednoho základního souboru.
- Předpokládáme, že tyto náhodné výběry byly pořízeny ze základních souborů se spojitými distribučními funkcemi $F_1(x), F_2(x), \dots, F_k(x)$.
- Nulovou hypotézu H_0 můžeme zapsat takto
$$H_0: F_1(x) = F_2(x) = \dots = F_k(x) \text{ pro všechna } x.$$

Postup při stanovení testového kritéria:

- 1) Máme k dispozici k výběrových souborů o četnostech n_1, n_2, \dots, n_k .
- 2) Všechny výběrové soubory sloučíme do jediného souboru.
- 3) Každé hodnotě souboru přiřadíme vzestupně pořadové číslo, stejným hodnotám pak pořadí průměrné.
- 4) Následně sečteme pořadová čísla jednotlivých pozorování pro každý původní výběrový soubor zvlášť a získáme součty T_1, T_2, \dots, T_k ($T_i; i = 1, \dots, k$, je tedy součet pořadových čísel pro i -tý výběr)

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením \Rightarrow nelze použít ANOVA.

Kruskal – Wallisův test

Testová statistika má tvar:
$$KW = \frac{12}{n(n+1)} \sum_{i=1}^k \frac{T_i^2}{n_i} - 3(n+1)$$

kde $n = n_1 + n_2 + \dots + n_k$.

Statistika KW má za platnosti H_0 při $n_i \rightarrow \infty$ asymptoticky χ^2 – rozdělení o $k-1$ stupních volnosti.

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením => nelze použít ANOVA.

Kruskal – Wallisův test

Testová statistika má tvar:
$$KW = \frac{12}{n(n+1)} \sum_{i=1}^k \frac{T_i^2}{n_i} - 3(n+1)$$

kde $n = n_1 + n_2 + \dots + n_k$.

Statistika KW má za platnosti H_0 při $n_i \rightarrow \infty$ asymptoticky χ^2 – rozdělení o $k-1$ stupních volnosti.

Pokud $KW > \chi_{\alpha}^2(n-1)$, přijímáme hypotézu alternativní, podle které se hodnoty nejméně dvou porovnávaných výběrových souborů od sebe statisticky významně liší.

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením \Rightarrow nelze použít ANOVA.

Kruskal – Wallisův test

Testová statistika má tvar:
$$KW = \frac{12}{n(n+1)} \sum_{i=1}^k \frac{T_i^2}{n_i} - 3(n+1)$$
 kde $n = n_1 + n_2 + \dots + n_k$.

Statistika KW má za platnosti H_0 při $n_i \rightarrow \infty$ asymptoticky χ^2 – rozdělení o $k-1$ stupních volnosti.

Pokud $KW > \chi_{\alpha}^2(n-1)$, přijímáme hypotézu alternativní, podle které se hodnoty nejméně dvou porovnávaných výběrových souborů od sebe statisticky významně liší.

Jestliže se v posloupnosti zjištěných údajů vyskytnou shodné hodnoty, kterým se přiřazuje průměrné pořadí, je nutno hodnotu KW dělit korekčním faktorem

$$K = 1 - \frac{1}{n^3 - n} \sum_{j=1}^p (t_j^3 - t_j)$$

kde p je počet tříd se stejným pořadím a t_i počet pořadí v i -té třídě.

Opravené testové kritérium se stanoví jako
$$KW_{opr} = \frac{KW}{K}$$

Neparametrická analýza rozptylu

The screenshot shows the Minitab software interface. The 'Stat' menu is open, and the 'Nonparametrics' option is selected. A sub-menu is displayed, listing various nonparametric tests. The 'Kruskal-Wallis...' option is highlighted. The main window displays the results of a Kruskal-Wallis Test for C1 versus C3. The test results include a table of statistics for each group and overall, and a p-value of 0,169.

Stat | **Graph** | **Editor** | **Tools** | **Window** | **Help**

Basic Statistics
Regression
ANOVA
DOF
Control Charts
Quality Tools
Reliability/Survival
Multivariate
Time Series
Tables
Nonparametrics
EDA
Power and Sample Size

1+ 1-Sample Sign...
1W 1-Sample Wilcoxon...
M-W Mann-Whitney...
KW Kruskal-Wallis...
1-M TEST Mood's Median Test...
F Friedman...
Runs Test...
A Pairwise Averages ..
D Pairwise Differences...
S Pairwise Slopes...

Session

Kruskal-Wallis Test

C3	N	Međi
1	2	16,
2	2	16,
3	2	17,
4	2	16,
5	2	16,
Overall	10	

H = 6,44 DF = 4

* NCTE * One or more small samples

Kruskal-Wallis Test: C1 versus C3

Kruskal-Wallis Test on C1

C3	N	Median	Ave Rank	Z
1	2	16,95	7,0	0,78
2	2	16,68	4,5	-0,52
3	2	17,18	9,5	2,09
4	2	16,47	3,0	-1,31
5	2	16,55	3,5	-1,04
Overall	10		5,5	

H = 6,44 DF = 4 P = 0,169

* NCTE * One or more small samples

Neparametrická analýza rozptylu

The screenshot shows the Minitab software interface. The 'Stat' menu is open, and 'Nonparametrics' is selected. The 'Kruskal-Wallis...' option is highlighted in the submenu. The 'Kruskal-Wallis' dialog box is open, showing 'C1' as the Response and 'C3' as the Factor. The main window displays the results of a Kruskal-Wallis Test on C1.

Stat menu options:

- Basic Statistics
- Regression
- ANOVA
- DOF
- Control Charts
- Quality Tools
- Reliability/Survival
- Multivariate
- Time Series
- Tables
- Nonparametrics**
 - 1-Sample Sign...
 - 1-Sample Wilcoxon...
 - Mann-Whitney...
 - Kruskal-Wallis...**
 - Mood's Median Test...
 - Friedman...
 - Runs Test...
 - Pairwise Averages ..
 - Pairwise Differences...
 - Pairwise Slopes...
- EDA
- Power and Sample Size

Kruskal-Wallis dialog box:

Response:

Factor:

Kruskal-Wallis Test: C1 versus C3

Kruskal-Wallis Test on C1

C3	N	Median	Rank	Ave	Z
1	2	16,95	7,0	0,78	
2	2	16,68	4,5	-0,52	
3	2	17,18	9,5	2,09	
4	2	16,47	3,0	-1,31	
5	2	16,55	3,5	-1,04	
Overall	10		5,5		

H = 6,44 DF = 4 P = 0,169

* NCTE * One or more small samples

Neparametrická analýza rozptylu

Neparametrické metody mnohonásobného porovnávání.

Neparametrická analýza rozptylu

Neparametrické metody mnohonásobného porovnávání.

Neményiho metoda

Neparametrická analýza rozptylu

Neparametrické metody mnohonásobného porovnávání.

Neményiho metoda

- Předpokládáme tzv. „vyvážený pokusný plán“, tzn., že všech k výběrů má stejný rozsah (tedy $n_1 = n_2 = \dots = n_k = N$).

Neparametrická analýza rozptylu

Neparametrické metody mnohonásobného porovnávání.

Neményiho metoda

- Předpokládáme tzv. „vyvážený pokusný plán“, tzn., že všech k výběrů má stejný rozsah (tedy $n_1 = n_2 = \dots = n_k = N$).
- Spočítáme $\frac{k(k-1)}{2}$ diferencí $|T_i - T_j|$ které porovnááme s kritickými hodnotami.

Neparametrická analýza rozptylu

Neparametrické metody mnohonásobného porovnávání.

Neményiho metoda

- Předpokládáme tzv. „vyvážený pokusný plán“, tzn., že všech k výběrů má stejný rozsah (tedy $n_1 = n_2 = \dots = n_k = N$).
- Spočítáme $\frac{k(k-1)}{2}$ diferencí $|T_i - T_j|$ které porovnááme s kritickými hodnotami.
- Kritické hodnoty D_α se hledají pro hladinu významnosti α , pro k porovnávaných tříd a N opakování v každé třídě ($n_1 = n_2 = \dots = n_k = N$).

Neparametrická analýza rozptylu

Neparametrické metody mnohonásobného porovnávání.

Neményiho metoda

- Předpokládáme tzv. „vyvážený pokusný plán“, tzn., že všech k výběrů má stejný rozsah (tedy $n_1 = n_2 = \dots = n_k = N$).
- Spočítáme $\frac{k(k-1)}{2}$ diferencí $|T_i - T_j|$ které porovnááme s kritickými hodnotami.
- Kritické hodnoty D_α se hledají pro hladinu významnosti α , pro k porovnávaných tříd a N opakování v každé třídě ($n_1 = n_2 = \dots = n_k = N$).
- Je-li nějaká diference větší nebo rovna kritické hodnotě D_α pro Neményiho metodu, zamítá se hypotéza o neprůkaznosti difference, tzn. že i -tý a j -tý výběr pocházejí z téhož rozdělení.

Neparametrická analýza rozptylu

Neparametrické metody mnohonásobného porovnávání.

Dunnova metoda

Neparametrická analýza rozptylu

Neparametrické metody mnohonásobného porovnávání.

Dunnova metoda

- Použijeme ji v případě „nevyváženého pokusného plánu“, tzn., že výběry nemají stejný rozsah (tedy nemusí být $n_1 = n_2 = \dots = n_k$).

Neparametrická analýza rozptylu

Neparametrické metody mnohonásobného porovnávání.

Dunnova metoda

- Použijeme ji v případě „nevyváženého pokusného plánu“, tzn., že výběry nemají stejný rozsah (tedy nemusí být $n_1 = n_2 = \dots = n_k$).
- Spočítáme $\frac{k(k-1)}{2}$ diferencí $|T_i - T_j|$ které porovnááme s kritickými hodnotami.

Neparametrická analýza rozptylu

Neparametrické metody mnohonásobného porovnávání.

Dunnova metoda

- Použijeme ji v případě „nevyváženého pokusného plánu“, tzn., že výběry nemají stejný rozsah (tedy nemusí být $n_1 = n_2 = \dots = n_k$).
- Spočítáme $\frac{k(k-1)}{2}$ diferencí $|T_i - T_j|$ které porovnááme s kritickými hodnotami.
- Pokud pro nějakou diferenci platí

$$|T_i - T_j| > u_\beta \sqrt{\frac{n(n-1)}{12} \left(\frac{1}{n_i} + \frac{1}{n_j} \right)}$$

kde u_β je β - kvantil standardního normálního rozdělení, $\beta = \frac{\alpha}{k(k-1)}$, zamítáme na hladině významnosti α hypotézu, že i -tý výběr (s rozsahem n_i) a j -tý výběr (s rozsahem n_j) pocházejí z téhož rozdělení.

Neparametrická analýza rozptylu

Neparametrické metody mnohonásobného porovnávání.

Dunnova metoda

- Použijeme ji v případě „nevyváženého pokusného plánu“, tzn., že výběry nemají stejný rozsah (tedy nemusí být $n_1 = n_2 = \dots = n_k$).
- Spočítáme $\frac{k(k-1)}{2}$ diferencí $|T_i - T_j|$ které porovnááme s kritickými hodnotami.
- Pokud pro nějakou diferenci platí

$$|T_i - T_j| > u_\beta \sqrt{\frac{n(n-1)}{12} \left(\frac{1}{n_i} + \frac{1}{n_j} \right)}$$

kde u_β je β - kvantil standardního normálního rozdělení, $\beta = \frac{\alpha}{k(k-1)}$, zamítáme na hladině významnosti α hypotézu, že i -tý výběr (s rozsahem n_i) a j -tý výběr (s rozsahem n_j) pocházejí z téhož rozdělení.

Neparametrická analýza rozptylu

Příklad

Úloha: Ověřit, zda výnosy silážní kukuřice jsou ovlivněny rozdílnou dávkou NPK v hnojení.

Neparametrická analýza rozptylu

Příklad

Úloha: Ověřit, zda výnosy silážní kukuřice jsou ovlivněny rozdílnou dávkou NPK v hnojení.

- Odezva: výnos v t/ha
- Faktor: způsob hnojení (4 úrovně lišící se dávkou NPK)

Neparametrická analýza rozptylu

Příklad

Úloha: Ověřit, zda výnosy silážní kukuřice jsou ovlivněny rozdílnou dávkou NPK v hnojení.

- Odezva: výnos v t/ha
- Faktor: způsob hnojení (4 úrovně lišící se dávkou NPK)

Provedeme polní experiment, v němž budeme sledovat výnosy pro čtyři varianty hnojení silážní kukuřice rozdílnou dávkou NPK v hnojivech, označené jako V_1 až V_4 . Každá varianta bude ověřována na 8 parcelách a budou měřeny výnosy sklizené hmoty v tunách na hektar.

Neparametrická analýza rozptylu

Příklad

Úloha: Ověřit, zda výnosy silážní kukuřice jsou ovlivněny rozdílnou dávkou NPK v hnojení.

- Odezva: výnos v t/ha
- Faktor: způsob hnojení (4 úrovně lišící se dávkou NPK)

Provedeme polní experiment, v němž budeme sledovat výnosy pro čtyři varianty hnojení silážní kukuřice rozdílnou dávkou NPK v hnojivech, označené jako V_1 až V_4 . Každá varianta bude ověřována na 8 parcelách a budou měřeny výnosy sklizené hmoty v tunách na hektar.

H_0 : výnosy jednotlivých variant jsou shodné

H_1 : výnosy jednotlivých variant jsou rozdílné

Neparametrická analýza rozptylu

Příklad

Úloha: Ověřit, zda výnosy silážní kukuřice jsou ovlivněny rozdílnou dávkou NPK v hnojení.

- Odezva: výnos v t/ha
- Faktor: způsob hnojení (4 úrovně lišící se dávkou NPK)

Provedeme polní experiment, v němž budeme sledovat výnosy pro čtyři varianty hnojení silážní kukuřice rozdílnou dávkou NPK v hnojivech, označené jako V_1 až V_4 . Každá varianta bude ověřována na 8 parcelách a budou měřeny výnosy sklizené hmoty v tunách na hektar.

H_0 : výnosy jednotlivých variant jsou shodné

H_1 : výnosy jednotlivých variant jsou rozdílné

Hypotéza o normalitě napozorovaných dat byla zamítnuta. Proto použijeme Kruskal-Wallisův test.

Neparametrická analýza rozptylu

Příklad

varianta	Výnos kukuřice v t z hektaru na parcele číslo:								součet T_i
	1	2	3	4	5	6	7	8	
V ₁ pořadí	1,29 23,5	1,19 8,5	1,23 15	1,33 28,5	1,27 20	1,29 23,5	1,31 27	1,20 11,5	157,5
V ₂ pořadí	1,30 26	1,33 28,5	1,29 23,5	1,37 31	1,35 30	1,25 18,5	1,38 32	1,29 23,5	213
V ₃ pořadí	1,20 11,5	1,24 16,5	1,25 18,5	1,24 16,5	1,20 11,5	1,21 14	1,28 21	1,17 7	116,5
V ₄ pořadí	1,03 2	1,14 6	1,09 5	1,20 11,5	1,07 4	1,19 8,5	1,01 1	1,05 3	41

Neparametrická analýza rozptylu

Příklad

varianta	Výnos kukuřice v t z hektaru na parcele číslo:								součet T_i
	1	2	3	4	5	6	7	8	
V ₁ pořadí	1,29 23,5	1,19 8,5	1,23 15	1,33 28,5	1,27 20	1,29 23,5	1,31 27	1,20 11,5	157,5
V ₂ pořadí	1,30 26	1,33 28,5	1,29 23,5	1,37 31	1,35 30	1,25 18,5	1,38 32	1,29 23,5	213
V ₃ pořadí	1,20 11,5	1,24 16,5	1,25 18,5	1,24 16,5	1,20 11,5	1,21 14	1,28 21	1,17 7	116,5
V ₄ pořadí	1,03 2	1,14 6	1,09 5	1,20 11,5	1,07 4	1,19 8,5	1,01 1	1,05 3	41

$$KW = \frac{12}{32 \cdot 33} \left(\frac{157,5^2}{8} + \frac{213^2}{8} + \frac{116,5^2}{8} + \frac{41^2}{8} \right) - 3 \cdot 33 = 22,3473$$

Neparametrická analýza rozptylu

Příklad

varianta	Výnos kukuřice v t z hektaru na parcele číslo:								součet T _i
	1	2	3	4	5	6	7	8	
V ₁ pořadí	1,29 23,5	1,19 8,5	1,23 15	1,33 28,5	1,27 20	1,29 23,5	1,31 27	1,20 11,5	157,5
V ₂ pořadí	1,30 26	1,33 28,5	1,29 23,5	1,37 31	1,35 30	1,25 18,5	1,38 32	1,29 23,5	213
V ₃ pořadí	1,20 11,5	1,24 16,5	1,25 18,5	1,24 16,5	1,20 11,5	1,21 14	1,28 21	1,17 7	116,5
V ₄ pořadí	1,03 2	1,14 6	1,09 5	1,20 11,5	1,07 4	1,19 8,5	1,01 1	1,05 3	41

$$KW = \frac{12}{32 \cdot 33} \left(\frac{157,5^2}{8} + \frac{213^2}{8} + \frac{116,5^2}{8} + \frac{41^2}{8} \right) - 3 \cdot 33 = 22,3473$$

Vzhledem k výskytu stejných údajů (bylo použito průměrné pořadí) je vhodné opravit testové kritérium korekčním faktorem:

$$K = 1 - \frac{(2^3 - 2) + (4^3 - 4) + (2^3 - 2) + (2^3 - 2) + (4^3 - 4) + (2^3 - 2)}{32^3 - 32} = 0,9956$$

Neparametrická analýza rozptylu

Příklad

varianta	Výnos kukuřice v t z hektaru na parcele číslo:								součet T _i
	1	2	3	4	5	6	7	8	
V ₁ pořadí	1,29 23,5	1,19 8,5	1,23 15	1,33 28,5	1,27 20	1,29 23,5	1,31 27	1,20 11,5	157,5
V ₂ pořadí	1,30 26	1,33 28,5	1,29 23,5	1,37 31	1,35 30	1,25 18,5	1,38 32	1,29 23,5	213
V ₃ pořadí	1,20 11,5	1,24 16,5	1,25 18,5	1,24 16,5	1,20 11,5	1,21 14	1,28 21	1,17 7	116,5
V ₄ pořadí	1,03 2	1,14 6	1,09 5	1,20 11,5	1,07 4	1,19 8,5	1,01 1	1,05 3	41

$$KW = \frac{12}{32 \cdot 33} \left(\frac{157,5^2}{8} + \frac{213^2}{8} + \frac{116,5^2}{8} + \frac{41^2}{8} \right) - 3 \cdot 33 = 22,3473$$

Vzhledem k výskytu stejných údajů (bylo použito průměrné pořadí) je vhodné opravit testové kritérium korekčním faktorem:

$$K = 1 - \frac{(2^3 - 2) + (4^3 - 4) + (2^3 - 2) + (2^3 - 2) + (4^3 - 4) + (2^3 - 2)}{32^3 - 32} = 0,9956$$

$$KW_{\text{opr.}} = \frac{22,3473}{0,9956} = 22,446 \quad \chi_{0,05(3)}^2 = 7,815 \quad \chi_{0,01(3)}^2 = 11,34$$

Neparametrická analýza rozptylu

Příklad

Opravené testové kritérium $KW = 22,446 > \chi^2 \Rightarrow$ na hladině významnosti $\alpha = 0,05$ i $0,01$ přijímáme alternativní hypotézu, podle které se průkazně liší hodnoty výnosu nejméně ve 2 třídách.

$$KW = \frac{12}{32 \cdot 33} \left(\frac{157,5^2}{8} + \frac{213^2}{8} + \frac{116,5^2}{8} + \frac{41^2}{8} \right) - 3 \cdot 33 = 22,3473$$

Vzhledem k výskytu stejných údajů (bylo použito průměrné pořadí) je vhodné opravit testové kritérium korekčním faktorem:

$$K = 1 - \frac{(2^3 - 2) + (4^3 - 4) + (2^3 - 2) + (2^3 - 2) + (4^3 - 4) + (2^3 - 2)}{32^3 - 32} = 0,9956$$

$$KW_{\text{opr.}} = \frac{22,3473}{0,9956} = 22,446 \quad \chi_{0,05(3)}^2 = 7,815 \quad \chi_{0,01(3)}^2 = 11,34$$

Neparametrická analýza rozptylu

Příklad

Opravené testové kritérium $KW = 22,446 > \chi^2 \Rightarrow$ na hladině významnosti $\alpha = 0,05$ i $0,01$ přijímáme alternativní hypotézu, podle které se průkazně liší hodnoty výnosu nejméně ve 2 třídách.

[Podrobnější vyhodnocení Neményiho metodou:](#)

Spočteme tabulku diferencí mezi součty pořadí pro výnosy kukuřice při jednotlivých variantách hnojení $T_i - T_j$

Neparametrická analýza rozptylu

Příklad

Opravené testové kritérium $KW = 22,446 > \chi^2 \Rightarrow$ na hladině významnosti $\alpha = 0,05$ i $0,01$ přijímáme alternativní hypotézu, podle které se průkazně liší hodnoty výnosu nejméně ve 2 třídách.

Podrobnější vyhodnocení Neményiho metodou:

Spočteme tabulku diferencí mezi součty pořadí pro výnosy kukuřice při jednotlivých variantách hnojení $T_i - T_j$

třída T_i \ třída T_j	diference $T_i - T_j$		
	V_2	V_3	V_4
V_1	55,5	41	116,5 ^x
V_2		96,5 ^x	172 ^{xx}
V_3			75,5

Neparametrická analýza rozptylu

Příklad

Opravené testové kritérium $KW = 22,446 > \chi^2 \Rightarrow$ na hladině významnosti $\alpha = 0,05$ i $0,01$ přijímáme alternativní hypotézu, podle které se průkazně liší hodnoty výnosu nejméně ve 2 třídách.

Podrobnější vyhodnocení Neményiho metodou:

Spočteme tabulku diferencí mezi součty pořadí pro výnosy kukuřice při jednotlivých variantách hnojení $T_i - T_j$

třída T_i \ třída T_j	diference $T_i - T_j$		
	V_2	V_3	V_4
V_1	55,5	41	116,5 ^x
V_2		96,5 ^x	172 ^{xx}
V_3			75,5

Kritické hodnoty:

$$D_{0,05} = 96,4 \quad (N = 8, K = 4)$$

$$D_{0,01} = 116,8 \quad (N = 8, K = 4)$$

Neparametrická analýza rozptylu

Příklad

Opravené testové kritérium $KW = 22,446 > \chi^2 \Rightarrow$ na hladině významnosti $\alpha = 0,05$ i $0,01$ přijímáme alternativní hypotézu, podle které se průkazně liší hodnoty výnosu nejméně ve 2 třídách.

Podrobnější vyhodnocení Neményiho metodou:

Spočteme tabulku diferencí mezi součty pořadí pro výnosy kukuřice při jednotlivých variantách hnojení $T_i - T_j$

třída T_i \ třída T_j	diference $T_i - T_j$		
	V_2	V_3	V_4
V_1	55,5	41	116,5 ^x
V_2		96,5 ^x	172 ^{xx}
V_3			75,5

Kritické hodnoty:

$$D_{0,05} = 96,4 \quad (N = 8, K = 4)$$

$$D_{0,01} = 116,8 \quad (N = 8, K = 4)$$

Statisticky významně se liší hodnoty výnosů kukuřice mezi variantami hnojení V_2, V_4 a to na hladině významnosti $\alpha = 0,01$ (diference $T_i - T_j$ jsou označeny ^{xx}). Na hladině významnosti $\alpha = 0,05$ se dále statisticky významně liší hodnoty výnosů kukuřice mezi variantami hnojení V_1, V_4 a V_2, V_3 .

Neparametrická analýza rozptylu

Test extrémních odchylek hodnot odezvy

V řadě pozorovaných hodnot se někdy objeví hodnota extrémně se lišící od ostatních, tzn. výrazně vybočuje z rozpětí ostatních naměřených hodnot.

Je třeba posoudit, zda je tato odchylka pouze náhodná nebo zda je uvedená hodnota zatížena „hrubou chybou“.

Pro objektivní posouzení této otázky existuje skupina testů, které se nazývají „*testy extrémních odchylek*“.

Neparametrická analýza rozptylu

Test extrémních odchylek hodnot odezvy

Dixonův test

Pozorovaná hodnota, která se extrémně liší od ostatních, je zřejmě buď nejmenší hodnotou ($x_{(1)}$) nebo největší hodnotou ($x_{(n)}$).

Neparametrická analýza rozptylu

Test extrémních odchylek hodnot odezvy

Dixonův test

Pozorovaná hodnota, která se extrémně liší od ostatních, je zřejmě buď nejmenší hodnotou ($x_{(1)}$) nebo největší hodnotou ($x_{(n)}$).

Nulová hypotéza H_0 tvrdí, že ($x_{(1)}$), resp. ($x_{(n)}$), je vybrána ze stejného normálně rozděleného základního souboru jako ostatní hodnoty.

Pro posouzení, zda hodnota ($x_{(1)}$) nebo hodnota ($x_{(n)}$) je zatížena hrubou chybou, užíváme testovacího kritéria

$$Q_1 = \frac{x_{(2)} - x_{(1)}}{x_{(n)} - x_{(1)}} \quad \text{nebo} \quad Q_n = \frac{x_{(n)} - x_{(n-1)}}{x_{(n)} - x_{(1)}}$$

Neparametrická analýza rozptylu

Test extrémních odchylek hodnot odezvy

Dixonův test

Pozorovaná hodnota, která se extrémně liší od ostatních, je zřejmě buď nejmenší hodnotou ($x_{(1)}$) nebo největší hodnotou ($x_{(n)}$).

Nulová hypotéza H_0 tvrdí, že ($x_{(1)}$), resp. ($x_{(n)}$), je vybrána ze stejného normálně rozděleného základního souboru jako ostatní hodnoty.

Pro posouzení, zda hodnota ($x_{(1)}$) nebo hodnota ($x_{(n)}$) je zatížena hrubou chybou, užíváme testovacího kritéria

$$Q_1 = \frac{x_{(2)} - x_{(1)}}{x_{(n)} - x_{(1)}} \quad \text{nebo} \quad Q_n = \frac{x_{(n)} - x_{(n-1)}}{x_{(n)} - x_{(1)}}$$

Jestliže vypočtená hodnota Q_1 , resp. Q_n , překročí kritickou hodnotu $Q_{1\alpha} = Q_{n\alpha}$ (nalezenou v tabulkách pro Dixonův test, hladinu významnosti α a rozsah souboru n), zamítáme nulovou hypotézu na hladině významnosti α a hodnotu ($x_{(1)}$), resp. ($x_{(n)}$), jako údaj zkreslený hrubou chybou, ze souboru vyloučíme.

Tzn. že nulová hypotéza se zamítá, pokud platí $Q_1 > Q_{\alpha(n)}$. nebo $Q_n > Q_{\alpha(n)}$.

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením => nelze použít ANOVA.

Friedmanův test

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením => nelze použít ANOVA.

Friedmanův test

- Je neparametrickou obdobou analýzy rozptylu dvojného třídění (pro dva faktory - například pro jeden hlavní a druhý blokový).

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením => nelze použít ANOVA.

Friedmanův test

- Je neparametrickou obdobou analýzy rozptylu dvojného třídění (pro dva faktory - například pro jeden hlavní a druhý blokový).
- Předpokládejme, že máme měření y_{ij} , kde i je označení bloku, j je označení úrovně faktoru (ošetření). Pro každou dvojici (i,j) máme jedno měření.

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením => nelze použít ANOVA.

Friedmanův test

- Je neparametrickou obdobou analýzy rozptylu dvojného třídění (pro dva faktory - například pro jeden hlavní a druhý blokový).
- Předpokládejme, že máme měření y_{ij} , kde i je označení bloku, j je označení úrovně faktoru (ošetření). Pro každou dvojici (i,j) máme jedno měření.

- Označme

k - počet úrovní faktoru

n - počet bloků

r_{ij} - pořadí naměřené hodnoty odezvy y_{ij} v bloku i

\bar{r}_j - průměrné pořadí odezvy při úrovni j přes všechny bloky

\bar{r} - průměrné pořadí přes všechny úrovně a přes všechny bloky

$$\bar{r}_j = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n r_{ij} \quad \bar{r} = \frac{1}{nk} \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^k r_{ij}$$

Neparametrická analýza rozptylu

Odezva X_1, X_2, \dots, X_n se neřídí normálním rozdělením => nelze použít ANOVA.

Friedmanův test

- Je neparametrickou obdobou analýzy rozptylu dvojného třídění (pro dva faktory - například pro jeden hlavní a druhý blokový).
- Předpokládejme, že máme měření y_{ij} , kde i je označení bloku, j je označení úrovně faktoru (ošetření). Pro každou dvojici (i,j) máme jedno měření.

- Označme

k - počet úrovní faktoru

n - počet bloků

r_{ij} - pořadí naměřené hodnoty odezvy y_{ij} v bloku i

\bar{r}_j - průměrné pořadí odezvy při úrovni j přes všechny bloky

\bar{r} - průměrné pořadí přes všechny úrovně a přes všechny bloky

$$\bar{r}_j = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n r_{ij} \quad \bar{r} = \frac{1}{nk} \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^k r_{ij}$$

Položme $SS_t = n \sum_{j=1}^k (\bar{r}_j - \bar{r})^2$ a $SS_e = \frac{1}{n(k-1)} \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^k (r_{ij} - \bar{r})^2$

Testová statistika má tvar $Q = \frac{SS_t}{SS_e}$

(Pro velká n a k ($n > 15$, $k > 4$) má přibližně chí-kvadrát rozdělení o $k-1$ stupních volnosti)

Neparametrická analýza rozptylu

The screenshot shows the Minitab software interface. The main window displays the results of a Kruskal-Wallis test and a Friedman test. The Kruskal-Wallis test results are as follows:

C3	N	Median
1	2	16,747
2	2	16,460
3	2	16,778
4	2	16,747
5	2	16,747
Overall	10	16,662

Test statistics: $H = 6,44$, $DF = 4$, $P = 0,169$.
* NOTE * One or more small samples

The Friedman test results are as follows:

C3	N	Est Median	Ranks
1	4	16,747	9,0
2	4	16,460	6,0
3	4	16,778	9,0

Grand median = 16,662

The Friedman dialog box is open, showing the following settings:

- Response: C1
- Treatment: C3
- Blocks: C2
- Store residuals:
- Store fits:

The "Select" button is highlighted, indicating that the response variable C1 has been selected.