Laborator 3

Intervale de încredere și teste statistice clasice

Obiectivul acestui laborator este de a ilustra noțiunea de interval de încredere și de a prezenta o parte din testele statistice clasice pentru o populație normală.

1 Ilustrarea intervalelor de încredere pentru o populație normală

Generarea intervalelor de încredere:

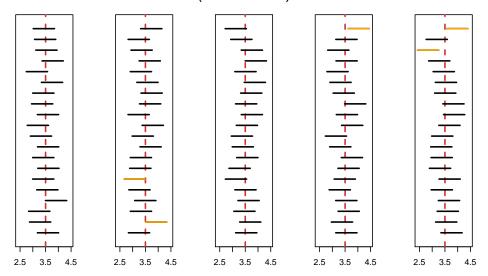
```
# cate panouri sa avem
p = 5
# nr de intervale de incredere per panou
n = 20
# talia esantionului
m = 50
# coeficient de incredere
alpha = 0.05
# media si sd populatia normala
mu = 3.5
sd = 1.5
lo3 <- hi3 <- lo2 <- hi2 <- lo <- hi <- vector("list", p)
for(i in 1:p) {
  dat = matrix(rnorm(n*m, mean = mu, sd = sd), ncol = m)
  # media si vaianta esantionului
  me = apply(dat,1,mean)
  se = apply(dat,1,sd)
  # calcul intervale de incredere
  lo[[i]] = me - qnorm(1-alpha/2)*sd/sqrt(m)
  hi[[i]] = me + qnorm(1-alpha/2)*sd/sqrt(m)
  lo2[[i]] = me - qnorm(1-alpha/2)*se/sqrt(m)
  hi2[[i]] = me + qnorm(1-alpha/2)*se/sqrt(m)
  lo3[[i]] = me - qt(1-alpha/2, m-1)*se/sqrt(m)
  hi3[[i]] = me + qt(1-alpha/2, m-1)*se/sqrt(m)
```

Intervale de încredere atunci când σ este cunoscut:

```
r = range(unlist(c(lo,hi,lo2,hi2,lo3,hi3)))
par(mfrow=c(1,5), las=1, mar=c(5.1,2.1,6.1,2.1))
```

```
for(i in 1:p) {
  plot(0, 0, type="n",
       ylim = 0.5+c(0,n),
       xlim = r,
       ylab = "",
       xlab = "",
       yaxt = "n")
  abline(v = mu, lty=2, col="brown3", lwd=2)
  segments(lo[[i]], 1:n,
           hi[[i]], 1:n,
           lwd=2)
  o = (1:n)[lo[[i]] > 3.5 | hi[[i]] < 3.5]
  segments(lo[[i]][o], o,
           hi[[i]][o], o,
           lwd=2,col="orange")
}
par(mfrow=c(1,1))
mtext(expression(paste("100 intervale de încredere pentru ", mu)),
      side=3, cex=1.5, xpd=TRUE, line=4)
mtext(expression(paste("(",sigma," cunoscut)")), side=3, cex=1.3,
      xpd=TRUE,line=2.7)
```

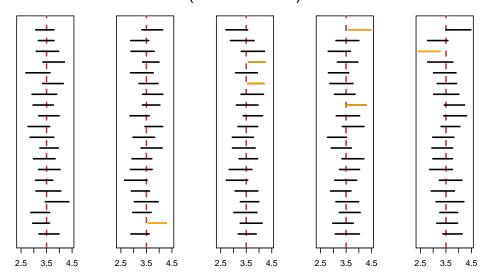
100 intervale de încredere pentru μ (σ cunoscut)



Intervale de încredere **incorecte** atunci când σ nu este cunoscut:

```
par(mfrow=c(1,5), las=1, mar=c(5.1,2.1,6.1,2.1))
for(i in 1:p) {
  plot(0, 0,
       type="n",
       ylim=0.5+c(0,n),
       xlim=r,
       ylab="",
       xlab="".
       yaxt="n")
  abline(v = mu,lty = 2, col="brown3", lwd=2)
  segments(lo2[[i]], 1:n,
           hi2[[i]], 1:n,
           lwd=2)
  o = (1:n)[lo2[[i]] > 3.5 | hi2[[i]] < 3.5]
  segments(lo2[[i]][o],o,
           hi2[[i]][o],o,
           lwd=2, col="orange")
}
par(mfrow=c(1,1))
mtext(expression(paste("100 intervale de încredere incorecte pentru ", mu)),
      side=3, cex=1.5, xpd=TRUE, line=4)
mtext(expression(paste("(",sigma," necunoscut)")),
      side=3,cex=1.3,xpd=TRUE,line=2.7)
```

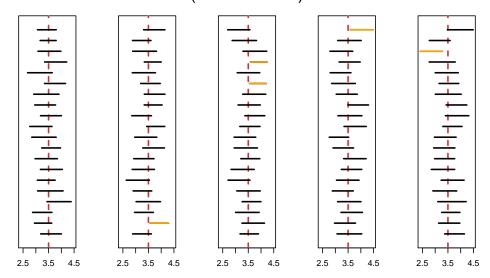
100 intervale de încredere incorecte pentru μ (σ necunoscut)



Intervale de încredere **corecte** atunci când σ nu este cunoscut:

```
par(mfrow=c(1,5), las=1, mar=c(5.1,2.1,6.1,2.1))
for(i in 1:p) {
  plot(0,0,
       type="n",
       ylim=0.5+c(0,n),
       xlim=r,
       ylab="",
       xlab="",
       yaxt="n")
  abline(v = mu, lty=2, col="brown3", lwd=2)
  segments(lo3[[i]],1:n,
           hi3[[i]],1:n,
           lwd=2)
  o = (1:n)[lo3[[i]] > 3.5 | hi3[[i]] < 3.5]
  segments(lo3[[i]][o],o,
           hi3[[i]][o],o,
           lwd=2, col="orange")
par(mfrow=c(1,1))
mtext(expression(paste("100 intervale de încredere pentru ", mu)),
      side=3, cex=1.5, xpd=TRUE, line=4)
mtext(expression(paste("(",sigma," necunoscut)")),
      side=3, cex=1.3, xpd=TRUE, line=2.7)
```

100 intervale de încredere pentru μ (σ necunoscut)



2 Ilustrarea probabilității de acoperire

2.1 Intervale de încredere de tip Wald



Fie X_1, X_2, \ldots, X_n un eșantion de talie n dintr-o populație Bernoulli de medie θ . Determinați un interval de încredere asimptotic pentru θ cu un coeficient de încredere $1 - \alpha$.

Ilustrați grafic probabilitatea de acoperire $\mathbb{P}_{\theta}\left(IC^{1-\alpha}(\theta)\ni\theta\right)$ ca funcție de θ pentru diferite valori ale lui $n\in\{50,100\}$ și $\alpha=0.05$. Ce observați?

Știm că $\hat{\theta}_n = \bar{X}_n$ este estimatorul de verosimilitate maximă pentru θ și folosind proprietatea asimptotică a estimatorilor de verosimilitate maximă găsim că un interval de încredere asimptotic pentru θ este (folosid o înlocuire de tip Wald)

$$IC^{1-\alpha}(\theta) = \bar{X}_n \pm z_{1-\frac{\alpha}{2}} \sqrt{\frac{\bar{X}_n(1-\bar{X}_n)}{n}}.$$

Probabilitatea de acoperire este:

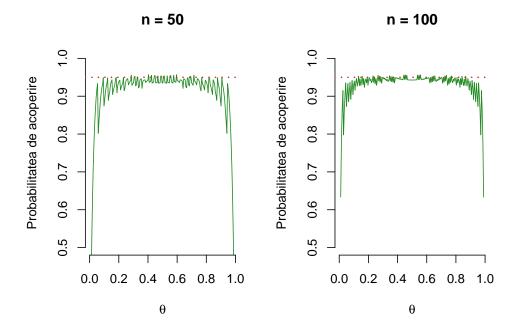
```
binom.wald.cvg = function(theta, n, alpha) {
  z = qnorm(1 - alpha / 2)

f = function(p) {
  t = 0:n

  s = sqrt(t * (n - t) / n)
  o = (t - z * s <= n * p & t + z * s >= n * p)

  return(sum(o * dbinom(t, size = n, prob = p)))
}

out = sapply(theta, f)
  return(out)
}
```



Observăm că probabilitatea de acoperire tinde să fie mai scăzută decât pragul $1 - \alpha = 0.95$ ales pentru majoritatea valorilor lui θ .



Fie X_1, X_2, \ldots, X_n un eșantion de talie n dintr-o populație Exponențială de parametru θ . Determinați un interval de încredere asimptotic pentru θ cu un coeficient de încredere $1 - \alpha$.

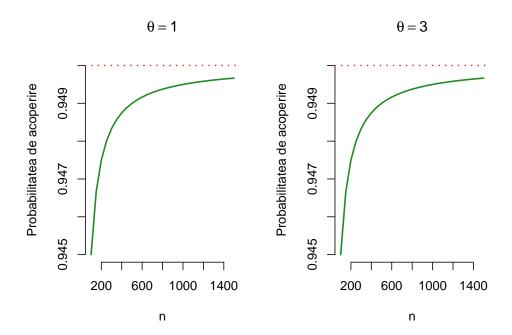
Ilustrați grafic probabilitatea de acoperire $\mathbb{P}_{\theta}\left(IC^{1-\alpha}(\theta)\ni\theta\right)$ ca funcție de n pentru diferite valori ale lui $\theta\in\{1,3\}$ și $\alpha=0.05$. Ce observați?

Știm că $\hat{\theta}_n = \bar{X}_n$ este estimatorul de verosimilitate maximă pentru θ și folosind proprietatea asimptotică a estimatorilor de verosimilitate maximă găsim că un interval de încredere asimptotic pentru θ este (folosid o înlocuire de tip Wald)

$$IC^{1-\alpha}(\theta) = \bar{X}_n \pm z_{1-\frac{\alpha}{2}} \frac{\bar{X}_n}{\sqrt{n}}.$$

```
expo.wald.cvg = function(N, theta, alpha) {
    z = qnorm(1 - alpha / 2)
 f = function(n) {
    f1 = 1 - pgamma(n * theta / (1 - z / sqrt(n)),
                    shape=n, rate=1/theta)
    f2 = pgamma(n * theta / (1 + z / sqrt(n)),
               shape=n, rate=1/theta)
    return(1 - f1 - f2)
 out = sapply(N, f)
 return(out)
alpha = 0.05
n = seq(100, 1500, by=50)
par(mfrow = c(1,2))
plot(n, expo.wald.cvg(n, 1, alpha),
     ylim=c(0.945, 0.95), type="1", lwd=2,
     bty = "n", col = "forestgreen",
     main = TeX("\$\backslash theta = 1\$"),
     xlab="n", ylab="Probabilitatea de acoperire")
abline(h=1-alpha, lty=3, lwd=2,
       col = "brown3")
plot(n, expo.wald.cvg(n, 3, alpha),
     ylim=c(0.945, 0.95), type="1", lwd=2,
     bty = "n", col = "forestgreen",
     main = TeX("\$\backslash theta = 3\$"),
     xlab="n", ylab="Probabilitatea de acoperire")
abline(h=1-alpha, lty=3, lwd=2,
col = "brown3")
```

Curs: Biostatistică Instructor: A. Amărioarei



2.2 Intervale de încredere folosid transformări stabilizatoare de varianță



Spune că o funcție g este stabilizatoare de varianță dacă verifică ecuația diferențială:

$$[g'(\theta)]^2 = c^2 I_1(\theta), \quad c > 0$$

unde $I_1(\theta)$ este informația lui Fisher.



Fie X_1, X_2, \ldots, X_n un eșantion de talie n dintr-o populație Bernoulli de medie θ . Determinați o funcție stabilizatoare de varianță și găsiâi un interval de încredere asimptotic pentru θ cu un coeficient de încredere $1-\alpha$.

Ilustrați grafic probabilitatea de acoperire $\mathbb{P}_{\theta}\left(IC^{1-\alpha}(\theta)\ni\theta\right)$ ca funcție de θ pentru diferite valori ale lui $n\in\{50,100\}$ și $\alpha=0.05$. Ce observați acum?

Observăm că pentru $g(\theta) = \arcsin \sqrt{\theta}$ avem

$$g'(\theta) = \frac{1}{2} \frac{1}{\sqrt{\theta(1-\theta)}}$$

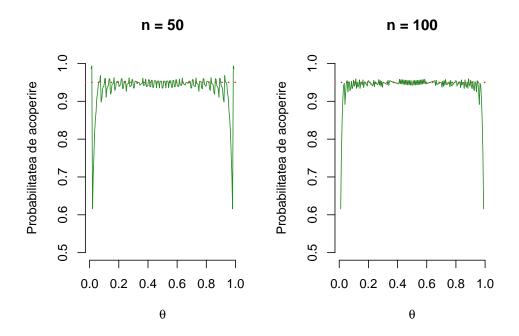
deci

$$[g'(\theta)]^2 = \frac{1}{4}I_1(\theta)$$

și găsim un interval de încredere de tipul

```
IC^{1-\alpha}(\theta) = \sin^2\left(\arcsin\sqrt{\bar{X}_n} \pm z_{1-\frac{\alpha}{2}} \frac{1}{16n^2}\right)
```

```
binom.vst.cvg = function(theta, n, alpha) {
  z = qnorm(1 - alpha / 2)
  f = function(p) {
   t = 0:n
    a = asin(sqrt(t / n))
    s = z / 2 / sqrt(n)
    o = (a - s \le asin(sqrt(p)) & a + s >= asin(sqrt(p)))
   return(sum(o * dbinom(t, size=n, prob=p)))
  }
  out = sapply(theta, f)
  return(out)
# date intrare
par(mfrow = c(1,2))
n = 50
alpha = 0.05
theta = seq(0.01, 0.99, len=200)
plot(theta, binom.vst.cvg(theta, n, alpha),
     ylim=c(0.5, 1), type="l", lwd=1,
     bty = "n",
     col = "forestgreen",
    main = paste0("n = ", n),
     xlab = expression(theta),
     ylab = "Probabilitatea de acoperire")
abline(h = 1-alpha, lty=3, lwd=2,
       col = "brown3")
# al doilea grafic
n = 100
plot(theta, binom.vst.cvg(theta, n, alpha),
     ylim=c(0.5, 1), type="l", lwd=1,
     bty = "n",
     col = "forestgreen",
     main = paste0("n = ", n),
     xlab = expression(theta),
     ylab = "Probabilitatea de acoperire")
abline(h = 1-alpha, lty=3, lwd=2,
 col = "brown3")
```



Observăm că probabilitatea de acoperire în acest caz este mai aproape de ținta de $1-\alpha=0.95$ comparativ cu exemplul anterior.

3 Testarea ipotezelor statistice: inferență asupra unui eșantion

3.1 Exemplul 1



Care este temperatura normală a corpului uman ? (vezi articol) Ne dorim să testăm din punct de vedere statistic dacă temperatura medie a corpului uman este de 37°C plecând de la următorul set de date descarcă (sursa originală a datelor este Mackowiak, P. A., Wasserman, S. S., and Levine, M. M. (1992). A Critical Appraisal of 98.6 Degrees F, the Upper Limit of the Normal Body Temperature, and Other Legacies of Carl Reinhold August Wunderlich. Journal of the American Medical Association, 268, 1578-1580).

Pentru a citi datele putem folosi două metode: sau să le citim direct din pagina de internet (prin comanda read.table)

file = "https://alexamarioarei.github.io/Teaching/Biostat web page/labs/dataIn/normtemp.txt"

sau descărcând local fișierul cu date și înlocuind adresa de internet din file cu cea locală

```
file = "dataIn/normtemp.txt"
normtemp = read.table(file, header=F, col.names=c("temp","sex","hr"))
head(normtemp)
  temp sex hr
1 96.3     1 70
2 96.7     1 71
3 96.9     1 74
4 97.0     1 80
```

Curs: Biostatistică Instructor: A. Amărioarei

```
5 97.1 1 73
6 97.1 1 75
```

Temperatura apare în grade Fahrenheit și am dori să transformăm în grade Celsius folosind formula:

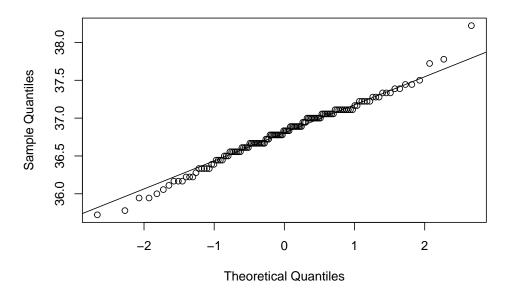
$$T_C = 5(T_F - 32)/9$$

```
normtemp$tempC = (normtemp$temp - 32)*5/9
degreesC = normtemp$tempC
```

Testul t-student presupune că eșantionul (independent) a provenit dintr-o populație normală și pentru aceasta putem verifica ipoteza de normalitate (QQ plot):

```
qqnorm(degreesC)
qqline(degreesC)
```

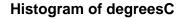
Normal Q-Q Plot

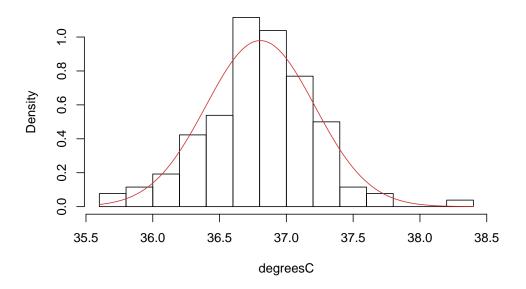


Trasăm histograma:

```
hist(degreesC, probability = T)
degM = mean(degreesC)
degSD = sd(degreesC)
curve(dnorm(x, degM, degSD), add = T, col = "brown3")
```

Curs: Biostatistică Instructor: A. Amărioarei

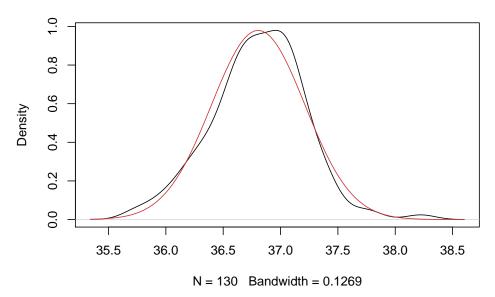




Trasăm densitatea:

```
plot(density(degreesC))
curve(dnorm(x, degM, degSD), add = T, col = "brown3")
```

density.default(x = degreesC)



Testăm ipoteza de normalitate (folosind testul Shapiro-Wilk):

shapiro.test(degreesC)# distributia pare sa fie aproape de normala si testul nu detecteaza
Shapiro-Wilk normality test

```
data: degreesC
W = 0.98658, p-value = 0.2332
# o abatere semnificativa fata de normala
```

Distribuția pare să fie aproape de normală, testul Shapiro-Wilk nu detectează o deviație semnificantă de la normalitate.

```
t.test(degreesC, mu = 37, alternative = "two.sided") # respingem HO
    One Sample t-test
data: degreesC
t = -5.4548, df = 129, p-value = 2.411e-07
alternative hypothesis: true mean is not equal to 37
95 percent confidence interval:
36.73445 36.87581
sample estimates:
mean of x
36.80513
ttest_deg = t.test(degreesC, mu = 37)
ttest_deg$statistic
       t
-5.454823
ttest_deg$p.value
[1] 2.410632e-07
ttest_deg$conf.int
[1] 36.73445 36.87581
attr(,"conf.level")
[1] 0.95
```

Dacă nu avem datele și avem o problemă de tipul: un eșantion de 130 de persoane a fost selectionat și temperatura corpului a fost masurată. Media eșantionului a fost 36.805 iar abaterea standard 0.4073. Testati ipoteza nulă că media temperaturii corpului uman este de 37 grade Celsius.

În acest caz avem:

```
t.obt = (36.805 - 37)/(0.4073/sqrt(130))
t.obt
[1] -5.458733

qt(c(0.25, 0.975), df = 129) # valorile critice pentru alpha = 0.05
[1] -0.6763963  1.9785245
2*pt(t.obt, df = 129) # p valoarea pentru testul two-tailed
[1] 2.367923e-07
```

Ca să automatizăm aceste calcule putem crea o funcție:

```
t.single = function(obs.mean, mu, SD, n) {
  t.obt = (obs.mean - mu) / (SD / sqrt(n))
  p.value = pt(abs(t.obt), df=n-1, lower.tail=F)
  print(c(t.obt = t.obt, p.value = p.value))
  warning("P-value pentru one-sided. Dubleaza pentru two-sided.")
}
```

Curs: Biostatistică Instructor: A. Amărioarei

4 Testarea ipotezelor statistice: inferență asupra a două eșantioane

4.1 Exemplul 1

În contextul exemplului anterior, să presupunem că vrem să vedem dacă există vreo diferență între temperatura medie la bărbați și temperatura medie la femei.

```
str(normtemp)
'data.frame': 130 obs. of 4 variables:
$ temp: num 96.3 96.7 96.9 97 97.1 97.1 97.1 97.2 97.3 97.4 ...
$ sex : int 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 ...
$ hr : int 70 71 74 80 73 75 82 64 69 70 ...
$ tempC: num 35.7 35.9 36.1 36.1 36.2 ...

tempB = normtemp$tempC[which(normtemp$sex == 1)]
tempF = normtemp$tempC[which(normtemp$sex == 2)]
```

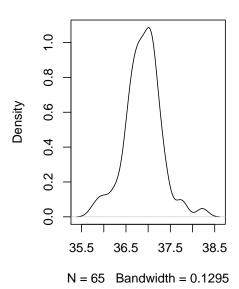
Ilustrare a temperaturii bărbaților și a femeilor:

```
par(mfrow=c(1,2))
plot(density(tempB), main="Temperatura Barbatilor")
plot(density(tempF), main="Temperatura Femeilor")
```

Temperatura Barbatilor

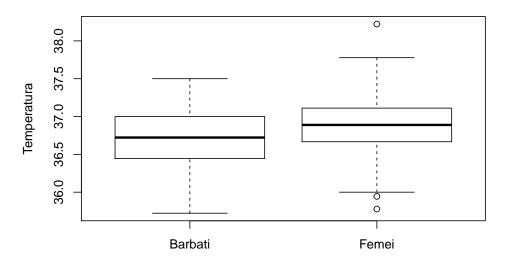
8.0 Pensity 35.5 36.5 37.5 N = 65 Bandwidth = 0.1516

Temperatura Femeilor



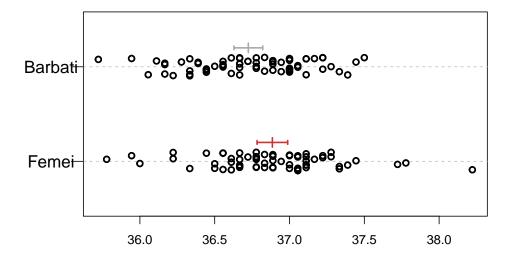
Sub formă de boxplot:

Temperatura in functie de sex



Trasarea datelor împreună cu intervalele de încredere:

```
source("lab_functions/dotplot.R")
dotplot(tempB, tempF, labels=c("Barbati","Femei"))
```



Testarea ipotezelor statistice cu ajutorul testului t-student (corecția lui Welch):

```
t.test(tempB, tempF) # Welch correction

Welch Two Sample t-test

data: tempB and tempF
t = -2.2854, df = 127.51, p-value = 0.02394
alternative hypothesis: true difference in means is not equal to 0
95 percent confidence interval:
    -0.29980476 -0.02156277
sample estimates:
mean of x mean of y
36.72479 36.88547
```

Verificăm dacă cele două eșantioane au varianțe egale (folosim testul lui Fisher):

```
var.test(tempB, tempF)

F test to compare two variances

data: tempB and tempF
F = 0.88329, num df = 64, denom df = 64, p-value = 0.6211
alternative hypothesis: true ratio of variances is not equal to 1
95 percent confidence interval:
    0.5387604 1.4481404
sample estimates:
ratio of variances
    0.8832897
```

Aplicăm acum testul t-student cu opțiunea de varianțe egale (pooled variance):

```
t.test(tempB, tempF, var.equal = T) # without Welch correction
```

Curs: Biostatistică Instructor: A. Amărioarei

```
Two Sample t-test

data: tempB and tempF

t = -2.2854, df = 128, p-value = 0.02393

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

95 percent confidence interval:
-0.29979966 -0.02156786

sample estimates:
mean of x mean of y
36.72479 36.88547
```

4.2 Exemplul 2

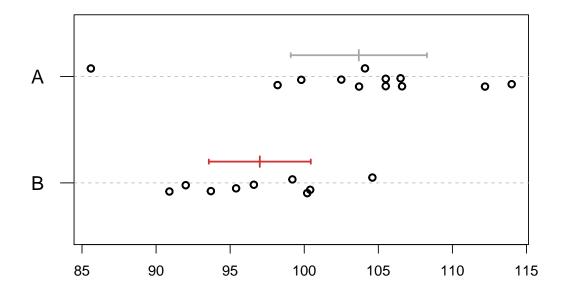
```
# Example data
x <- c(102.5, 106.6, 99.8, 106.5, 103.7, 105.5, 98.2, 104.1, 85.6, 105.5, 114.0, 112.2)
y <- c( 93.7, 90.9, 100.4, 92.0, 100.2, 104.6, 95.4, 96.6, 99.2)

# Two-sided t-test allowing un-equal population SDs
t.test(x,y)

Welch Two Sample t-test

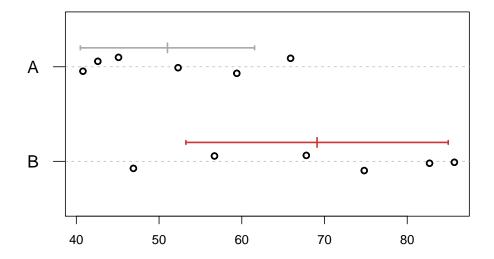
data: x and y
t = 2.6041, df = 18.475, p-value = 0.01769
alternative hypothesis: true difference in means is not equal to 0
95 percent confidence interval:
    1.30124 12.06543
sample estimates:
mean of x mean of y
    103.6833 97.0000

dotplot(x,y)</pre>
```

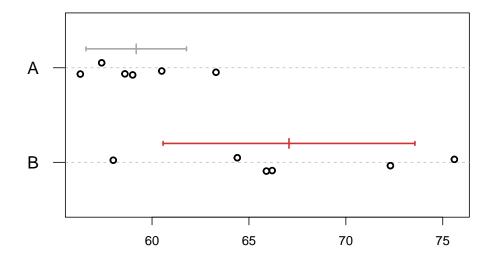


4.3 Exemplul 3

```
# One-tailed test example
x \leftarrow c(59.4, 52.3, 42.6, 45.1, 65.9, 40.8)
y <- c(82.7, 56.7, 46.9, 67.8, 74.8, 85.7)
# One-tailed t-test
t.test(x,y,alt="less")
    Welch Two Sample t-test
data: x and y
t = -2.4421, df = 8.6937, p-value = 0.01907
alternative hypothesis: true difference in means is less than 0
95 percent confidence interval:
      -Inf -4.454703
sample estimates:
mean of x mean of y
51.01667 69.10000
# The dotplot
dotplot(x,y)
```



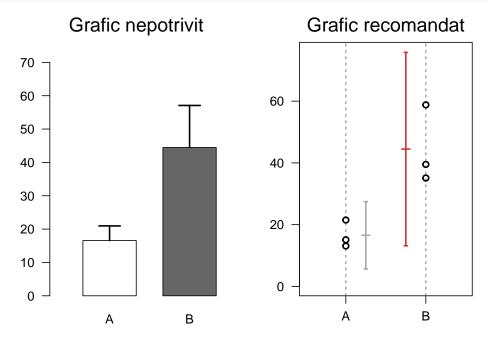
4.4 Exemplul 4



4.5 Un model de grafic

```
x \leftarrow c(15.1, 13.1, 21.5)
y \leftarrow c(35.1, 39.5, 58.8)
par(mar=c(4,4,2,1),mfrow=c(1,2),las=1)
barplot(c(mean(x),mean(y)),width=1,space=c(0.5,0.5),
        col=c("white","gray40"),xlim=c(0,3),names=c("A","B"),
        ylim=c(0,76))
segments(1, mean(x), 1, mean(x) + sd(x), lwd=2)
segments(0.8, mean(x)+sd(x), 1.2, mean(x)+sd(x), lwd=2)
segments(2.5, mean(y), 2.5, mean(y)+sd(y), lwd=2)
segments(2.3, mean(y)+sd(y), 2.7, mean(y)+sd(y), lwd=2)
mtext("Grafic nepotrivit",cex=1.5,line=0.5)
plot(rep(0:1,c(3,3)),c(x,y),xaxt="n",ylim=c(0,76),
     xlim=c(-0.5,1.5),ylab="",xlab="")
abline(v=0:1,col="gray40",lty=2)
points(rep(0:1,c(3,3)),c(x,y),lwd=2)
mtext("Grafic recomandat",cex=1.5,line=0.5)
xci <- t.test(x)$conf.int</pre>
yci <- t.test(y)$conf.int</pre>
segments(0.25,xci[1],0.25,xci[2],lwd=2,col="darkgray")
segments(c(0.23,0.23,0.2),c(xci,mean(x)),c(0.27,0.27,0.3),
         c(xci,mean(x)),lwd=2,col="darkgray")
segments(1-0.25,yci[1],1-0.25,yci[2],lwd=2,col="brown3")
segments (1-c(0.23,0.23,0.2),c(yci,mean(y)),1-c(0.27,0.27,0.3),
         c(yci,mean(y)),lwd=2,col="brown3")
u <- par("usr")
```

```
segments(0:1,u[3],0:1,u[3]-diff(u[3:4])*0.03,xpd=TRUE)
text(0:1,u[3]-diff(u[3:4])*0.08,c("A","B"),xpd=TRUE)
```



5 Testarea ipotezelor statistice: inferență asupra a două eșantioane dependente (perechi)

Considerăm următorul set de date din pachetul MASS (luarea in greutate de catre femei anorexice):

Testăm dacă există diferențe între luarea în greutate înainte de tratament și după tratament:

Curs: Biostatistică Instructor: A. Amărioarei