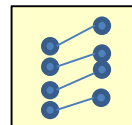


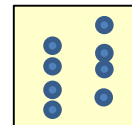
今回とりあげる検定の種類

(正規分布に従うという仮説)

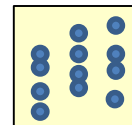
- ・関連ある2群の検定(1標本t検定)



- ・独立した2群の検定(2標本t検定)



- ・多群間の検定(1条件:一元配置分散分析)



- ・多群間の検定(2条件:二元配置分散分析)

検定の種類(一例)

検定の目的	検定対象群の数	検定手法	概要
母平均に差があるかどうかを確認する	2群	t検定	母平均に差がないという帰無仮説。分散は等質。独立な2群。
		対応のあるt検定	母平均に差がないという帰無仮説。対応のある2群。
		welchの検定	母平均に差がないという帰無仮説。分散は等質でなくてよい。独立な2群
		ウィルコクソンの順位和検定	ノンパラメトリック検定。代表値 (中央値) に差がないという帰無仮説。主にサンプル数が少なく得られたデータに正規性を仮定できないときに用いられる。
	3群以上	一元配置分散分析	母平均に差がないという帰無仮説。1つの条件が異なる場合。
		二元配置分散分析	母平均に差がないという帰無仮説。2つの条件が異なる場合。
母分散に差があるかどうかを確認する	2群	F検定(分散の等質性の検定)	母分散が等しいという帰無仮説。
	3群以上	バートレット検定	母分散が等しいという帰無仮説。
正規性があるかどうかを確認する	2群	コルモゴロフ-スミルノフ検定	正規性があるという帰無仮説。
	2群	シャピロ-ウィルク検定	正規性があるという帰無仮説。

検定の方法

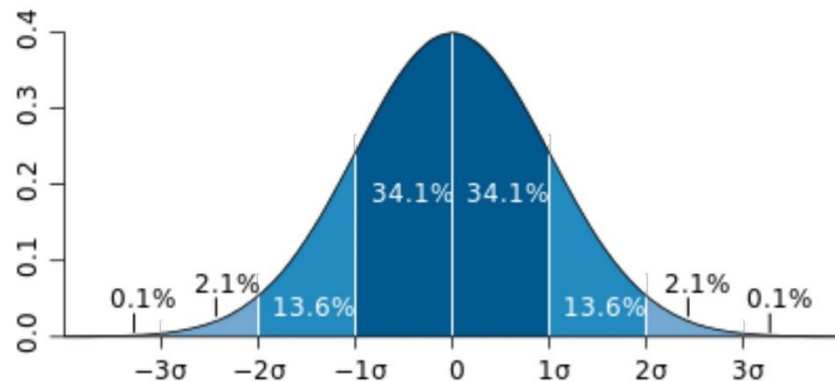
- (1) 仮説の設定 (H_0 : 帰無仮説 = 差がない)
- (2) 検定統計量を求める (p値を求める)
- (3) 有意水準を設定し棄却域を求める。(一般に有意水準は5%か1%)
- (4) 判定 (有意水準XX%で差がある・ない)

仮説検定で出てくる主な用語

- **帰無仮説**とは、最初に立てる仮説。
- **対立仮説**とは、帰無仮説が棄却されたときに採択する仮説。
- **検定統計量**とは、仮説検定を行う際に求める値。求めた値のことを検定統計量の実現値という。実現値を算出した後に、この値はよくおこるものか、珍しいものかを判断する。
- **有意水準**とは、帰無仮説を棄却する際の基準値。記号には α を用いられることが多い。
- **棄却域**とは、帰無仮説が棄却される検定統計量の範囲。
- **p値**とは、検定統計量の実現値から求められる確率。

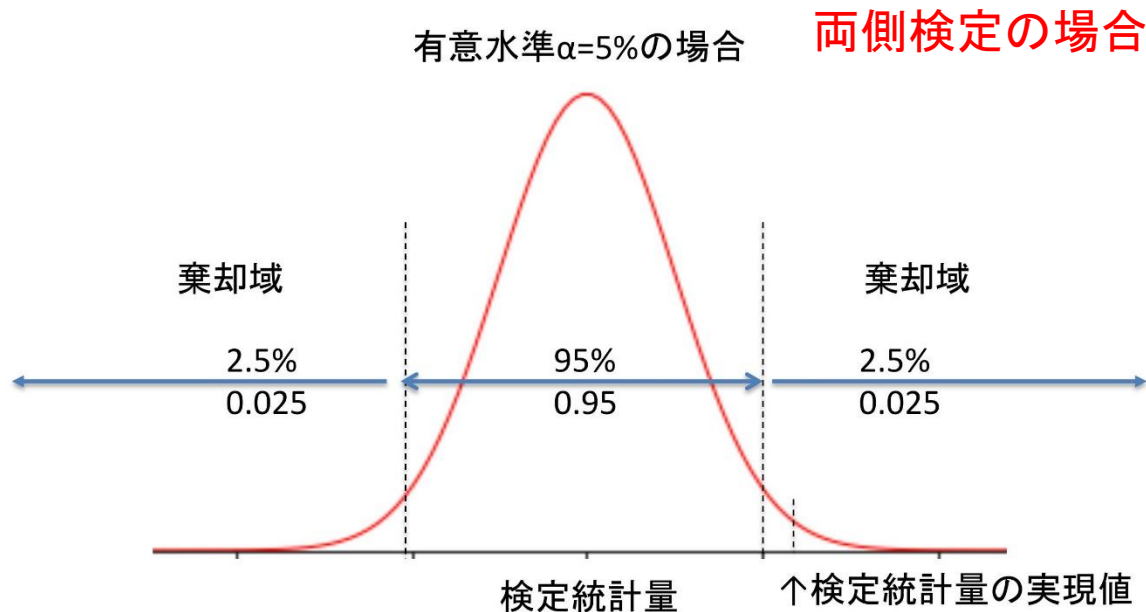
正規分布の性質

- 面積を全て積分すると1になる。(確率分布の性質)
- ある区間の面積の積分値は、その区間のデータが発生する確率として扱える。
- 標準偏差を σ としたとき、 $\pm\sigma$ の範囲には約68%のデータがおさまる。 $\pm 2\sigma$ の範囲には約95%のデータがおさまる。
- 発生する確率が低い値を観測すると異常な値であると判定したい時に使える。



「正規分布」『フリー百科事典 ウィキペディア日本語版』。
2016年8月19日 (金) 07:11 UTC URL: <http://ja.wikipedia.org>

一般的な検定の手順(棄却域で考える場合)



t検定はどこまで使えるのか？

t検定を実施するには、サンプルの背景にある母集団は、正規分布に従っていることを前提にしています。このため、t検定を行う前に、まずは正規確率プロットなどを使って、正規性の検定を行います。

正規分布に従っていれば、t検定などのパラメトリック分析を行い、正規分布に従っていなければ、1サンプル-ウィルコクソンなどのノンパラメトリック検定を行います。

しかし、厳密にこの手順を守らなければいけないのでしょうか。実は、そうでもありません。サンプルの状況によっては、守らなくてもよい場合があります。

例えば、サンプル数が少ない場合、正規性の検定を行っても、サンプル数が少ないために、正規分布に従っているという結果になることが多くあります。このため、極端に分布の形が歪んでいる場合を除いて、ほとんどの場合、サンプル数が少なければt検定が使えるという事実があります。

一方、サンプル数が多い場合、正規性の検定を行うと、わずかなズレでも正規分布に従わないという結果が出る場合があります。本来であれば、サンプル数が多いと情報量が増えるというメリットがあるわけですが、検定に厳密さを求めると、t検定が使えなくなるという結果になってしまいます。しかし、サンプル数が多ければ（以下、2サンプルの場合で説明します）、

<非正規分布ではあるけれど、等分散となっている場合>

中心極限定理により、平均値の差は近似的に正規分布に従うことが知られています。また、t値を求める際に利用する標準偏差が正確に計算できるため、t値はほとんど正規分布で近似できます。そのため、t検定が使えます。

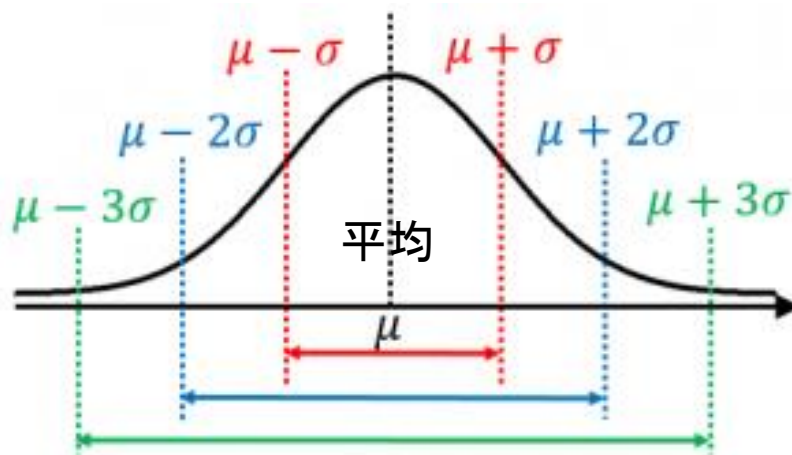
<非正規分布で、かつ等分散となっていない場合>

極端なケースではt検定を使えません。ただ、サンプル数が非常に多くあり、その標本分散から母分散をほぼ正確に推定できるのであれば、t検定が使えます。

ということで、t検定は多くの場面で使えることになります。これをt検定の頑健性(ロバストネス)といいます。

結論:t検定でたいいの場合は通用する

正規分布と1 σ 、2 σ 、3 σ



1 σ 区間とは、 $\mu - \sigma$ から $\mu + \sigma$ までの区間です。
2 σ 区間とは、 $\mu - 2\sigma$ から $\mu + 2\sigma$ までの区間です。
3 σ 区間とは、 $\mu - 3\sigma$ から $\mu + 3\sigma$ までの区間です。

1 σ 区間におさまる確率→ 約 68.27%
2 σ 区間におさまる確率→ 約 95.45%
3 σ 区間におさまる確率→ 約 99.73%