Introduktion til Statistik

Forelæsning 4: Konfidensinterval for middelværdi (og varians)

Peder Bacher

DTU Compute, Dynamiske Systemer Bygning 303B, Rum 010 Danmarks Tekniske Universitet 2800 Lyngby – Danmark e-mail: pbac@dtu.dk

Forår 2021

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

Chapter 3: One sample confidence intervals

General concepts

- Population and a random sample
- Statistical model
- Estimation (e.g. $\hat{\mu}$ is estimate of μ)
- Significance level α
- Confidence intervals (Catches true value 1α times)
- Sampling distributions (sample mean (t) and sample valance (χ^2))
- Central Limit Theorem

Specific methods, one sample

- Confidence interval for the mean (t-distribution)
- Confidence interval for the variance (χ^2 -distribution)

Kapitel 3: Konfidensintervaller for én gruppe/stikprøve

Grundlæggende koncepter

- Population og tilfældig stikprøve
- Statistisk model
- Estimation (f.eks. μ̂ er estimat af μ)
- ullet Signifikansniveau lpha
- Konfidensintervaller (fanger rigtige prm. 1α af gangene)
- Stikprøvefordelinger (stikprøvegennemsnit (t) og empirisk varians (χ^2))
- Centrale grænseværdisætning

Specifikke metoder, én gruppe/stikprøve

- Konfidensinterval for middelværdi (t-fordeling)
- Konfidensinterval for varians (χ^2 -fordeling)

Forår 2021 uge 4

Oversigt

- Fordelingen for gennemsnittet
 - *t*-fordelingen
- \bigcirc Konfidensintervallet for μ
 - Eksempel
- 3 Den statistiske sprogbrug og formelle ramme
- Ikke-normale data, Central Grænseværdisætning (CLT)
- 5 Konfidensinterval for varians og standardafvigelse

DTU Compute Introduktion til Statistik Forår 2021 uge 4 DTU Compute Introduktion til Statistik Forår 2021 uge 4

Eksempel: Population og fordeling



DTU Compute

DTU Compute

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

Forår 2021 uge 4 7 / 60

Stikprøveeksperiment: Simulering af stikprøve og beregning af 95% konfidensinterval

```
## Middelværdien
mu <- 3
## Standardafvigelsen
sigma <- 1.8
## Stikprøvestørrelsen
n <- 10
## Simuler normalfordelte X_i
x <- rnorm(n=n, mean=mu, sd=sigma)
## Se værdierne i den simulerede stikprøve
## Empirisk tæthed
hist(x, prob=TRUE, col='blue')
## Beregn stikprøvegennemsnittet bar\{x\} (sample mean)
## Beregn stikprøvestandardafvigelsen s (sample standard deviation)
## Beregn 95% konfidensintervallet
mean(x) - 2.26 * sd(x)/sqrt(n)
mean(x) + 2.26 * sd(x)/sqrt(n)
```

Introduktion til Statistik

Stikprøveeksperiment 1

Eksperiment

Tag en stikprøve på n = 10 observationer fra populationen.

Kan det passe, at der er 95% sandsynlighed for at intervallet beregnet på stikprøven ved

$$\bar{X} \pm 2.26 \cdot \frac{S}{\sqrt{10}}$$

indeholder populationens gennemsnit μ (dvs. middelværdien)?

Altså at følgende er sandt

$$P\left(\bar{X} - 2.26 \cdot \frac{S}{\sqrt{10}} < \mu < \bar{X} + 2.26 \cdot \frac{S}{\sqrt{10}}\right) = 0.95$$

DTU Compute

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

6 / 60

Stikprøveeksperiment 1: 100 simuleringer



DTU Compute Introduktion til Statistik Forår 2021 uge 4 8/60

Theorem 3.2: Fordeling for gennemsnit af normalfordelinger

(Stikprøve-) fordelingen for \bar{X}

Assume that X_1, \ldots, X_n are independent and identically normally distributed random variables, $X_i \sim N(\mu, \sigma^2)$ and i = 1, ..., n, then:

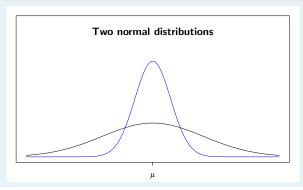
$$\bar{X} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^{n} X_i \quad \Rightarrow \quad \bar{X} \sim N\left(\mu, \frac{\sigma^2}{n}\right)$$

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4 10 / 60

Fordelingen for gennemsnittet

Spørgsmål om stikprøvegennemsnittet (socrative.com, room: PBAC)



Introduktion til Statistik

Den ene pdf hører til X_i og den anden til \bar{X} . Hvad kan konkluderes (for n > 1)?

- A: Den sorte hører til X_i og den blå til \bar{X}
- B: Den sorte hører til \bar{X} og den blå til X_i
- C: Det kan ikke afgøres
- D: Ved ikke

DTU Compute

Svar A:

 $X_i \sim N(\mu, \sigma^2)$ og

 $\bar{X} \sim N(\mu, \frac{\sigma^2}{n})$ altså

Forår 2021 uge 4

 $\sigma_{\bar{X}} < \sigma_{X_i}$

Middelværdi og varians følger af regneregler

Theorem 2.40: Lineær funktion af normal distribuerede variable er også normalfordelt

Theorem 2.53: Middelværdien af \bar{X}

$$\mathsf{E}(\bar{X}) = \mathsf{E}\left(\frac{1}{n}\sum_{i=1}^{n}X_{i}\right) = \frac{1}{n}\sum_{i=1}^{n}\mathsf{E}(X_{i}) = \frac{1}{n}\sum_{i=1}^{n}\mu = \frac{1}{n}n\mu = \mu$$

Theorem 2.53: Variansen for \bar{X}

$$Var(\bar{X}) = \frac{1}{n^2} \sum_{i=1}^{n} Var(X_i) = \frac{1}{n^2} \sum_{i=1}^{n} \sigma^2 = \frac{1}{n^2} n \sigma^2 = \frac{\sigma^2}{n}$$

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

Fordelingen for gennemsnittet

Eksempel: Simuler middelværdi og standardafvigelse af stikprøvegennemsnit

```
## Stikprøvestørrelsen
x <- rnorm(n=n, mean=mu, sd=sigma)
## Se den simulerede stikprøve
## Empirisk tethed
hist(x, prob=TRUE, col='blue')
## Beregn stikprøvegennemsnittet (bar\{x\}: sample mean)
 ## Beregn stikprøvestandardafvigelsen (s: sample standard deviation)
## Gentag den simulerede stikprývetagning mange gange
mat <- replicate(100, rnorm(n=n, mean=mu, sd=sigma))
## Beregn genmemnittet for hver af dem
xbar <- apply(mat, 2, mean)
## Nu har vi mange realiseringer af stikprývegennemsnittet
xbar
## Se deres fordeling
hist(xbar, prob=TRUE, col='blue')
## og deres standardafvigelser
sd(xbar)
```

DTU Compute Forår 2021 uge 4 13 / 60 Introduktion til Statistik

Fordelingen for gennemsnittet

Standardiseret fejl vi begår, Corollary 3.3:

Når vi bruger \bar{X} som estimat for μ :

Så begår vi fejlen $\bar{X} - \mu$

Fordelingen for den standardiserede fejl vi begår:

Assume that $X_1, ..., X_n$ are independent and identically normally distributed random variables, $X_i \sim N(\mu, \sigma^2)$ where i = 1, ..., n, then:

$$Z = \frac{\bar{X} - \mu}{\sigma_{(\bar{X} - \mu)}} = \frac{\bar{X} - \mu}{\sigma / \sqrt{n}} \sim N(0, 1^2)$$

That is, the standardized sample mean Z follows a standard normal distribution.

DTU Compute

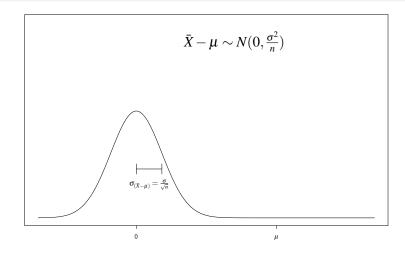
Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

14 / 60

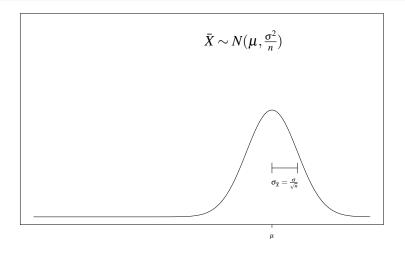
Fordelingen for gennemsnittet

Transformation til standard normalfordeling: Pdf for *fejlen vi begår* $\bar{X} - \mu$ når $X_i \sim N(\mu, \sigma^2)$



Fordelingen for gennemsnittet

Transformation til standard normalfordeling: Pdf for gennemsnittet \bar{X} når $X_i \sim N(\mu, \sigma^2)$



DTU Compute

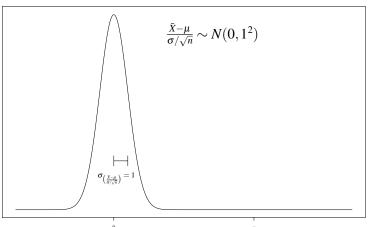
Introduktion til Statistik

Forår 2021 uga 4

15 / 6

Fordelingen for gennemsnittet

Transformation til standard normalfordeling: Pdf for *den standardiserede fejl* $\frac{\bar{X}-\mu}{\sigma/\sqrt{n}}$ når $X_i \sim N(\mu, \sigma^2)$



Standardiseret til *standard normalfordeling (noteres* $Z = \frac{\bar{X} - \mu}{\sigma / \sqrt{n}} \sim N(0, 1^2)$)

Compute

roduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4 17 / 60

Fordelingen for gennemsnittet

95% konfidensintervallet kan udledes således

95% konfidensinterval for μ :

$$P(z_{0.025} < Z < z_{0.975}) = 0.95$$

$$\Leftrightarrow$$

$$P\left(z_{0.025} < \frac{\bar{X} - \mu}{\sigma/\sqrt{n}} < z_{0.975}\right) = 0.95$$

$$\Leftrightarrow$$

$$P\left(z_{0.025}\frac{\sigma}{\sqrt{n}} < \bar{X} - \mu < z_{0.975}\frac{\sigma}{\sqrt{n}}\right) = 0.95$$

$$\Leftrightarrow$$

$$P\left(\bar{X} + z_{0.025} \frac{\sigma}{\sqrt{n}} < \mu < \bar{X} + z_{0.975} \frac{\sigma}{\sqrt{n}}\right) = 0.95$$

DTU Compute

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

18 / 60

DTU Compute

Introduktion til Statistik

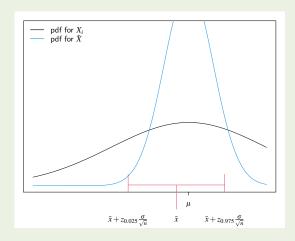
Forår 2021 uge 4

10 /6

Fordelingen for gennemsnittet

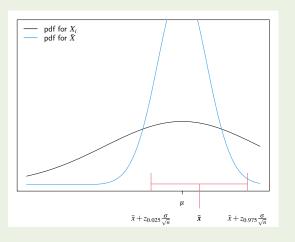
2. simulering: Beregning af 95% konfidensinterval

Konfidensintervallet er omkring \bar{x} og fanger her μ



1. simulering: Beregning af 95% konfidensinterval

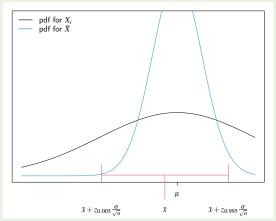
Konfidensintervallet er omkring \bar{x} og fanger her μ



Fordelingen for gennemsnittet

2. simulering: Beregning af 99% konfidensinterval

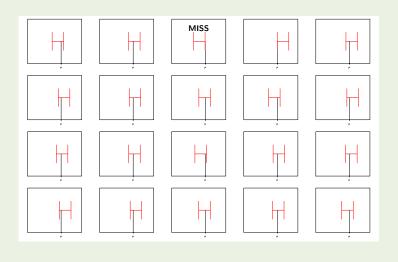
99% konfidensintervallet er breddere end 95% konfidensintervallet (det skal fange μ oftere)



DTU Compute Introduktion til Statistik Forår 2021 uge 4

Fordelingen for gennemsnittet

20 simuleringer: Beregning at 95% konfidensinterval



Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

Fordelingen for gennemsnittet

Spørgsmål om konfidensinterval (socrative.com, room: PBAC)

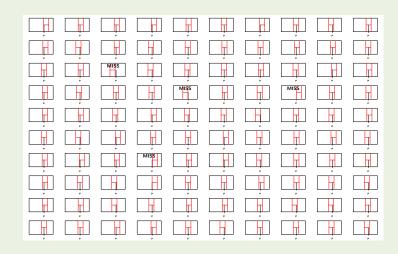
Hvis vi planlægger at beregne et 98% konfidensinterval for middelværdien, hvad er da sandsynligheden for at middelværdien ikke ligger inde i intervallet?

- A: 1%
- B: 2%
- C: 4%
- D: Den kender vi ikke
- E: Ved ikke

Svar B: Der er 2% for at vi ikke 'fanger' den rigtige middelværdi i 98% konfidensintervallet

Fordelingen for gennemsnittet

100 simuleringer: Beregning at 95% konfidensinterval



Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4 23 / 60

Fordelingen for gennemsnittet

Spørgsmål om konfidensinterval (socrative.com, room: PBAC)

Når vi så har udført eksperimentet og har stikprøven, ved vi da om middelværdien er indeholdt i det konfidensinterval vi har beregnet?

- A: Ja
- B: Nej
- C: Ved ikke

Svar B: Nej, vi ved ikke om vi har fanget den rigtige middelværdi, vi kender kun sandsynligheden for at fange den

DTU Compute Introduktion til Statistik Forår 2021 uge 4 24 / 60 DTU Compute Introduktion til Statistik Forår 2021 uge 4 25 / 60

Praktisk problem!!

Populationens standardafvigelse σ indgår i formlen og den kender vi ikke!!

Oplagt løsning:

Anvend stikprøvens standardafvigelse S som estimatet af σ i stedet for!

MEN MEN:

Så bryder den givne teori faktisk sammen!!

HELDIGVIS:

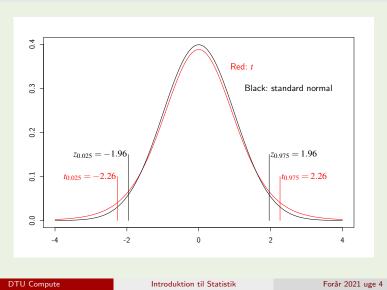
Der findes en heldigvis udvidet teori, der kan klare det!!

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

Fordelingen for gennemsnittet t-fordelingen

t-fordelingen med 9 frihedsgrader (n = 10) og standardnormalfordelingen



Theorem 3.4: More applicable extension of the same stuff: (kopi af Theorem 2.49)

t-fordelingen tager højde for usikkerheden i at bruge *s*:

Assume that X_1, \ldots, X_n are independent and identically normally distributed random variables, where $X_i \sim N(\mu, \sigma^2)$ and i = 1, ..., n, then

$$T = \frac{\bar{X} - \mu}{S / \sqrt{n}} \sim t$$

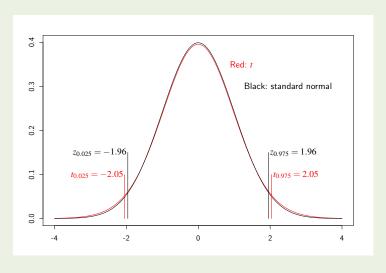
where t is the t-distribution with n-1 degrees of freedom.

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4 27 / 60

Fordelingen for gennemsnittet t-fordelingen

t-fordelingen med 29 frihedsgrader (n = 30) og standardnormalfordelingen



DTU Compute

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

Metodeboks 3.8: One-sample konfidensinterval for μ

Brug den rigtige *t*-fordeling til at lave konfidensintervallet:

For a sample x_1, \ldots, x_n the $100(1-\alpha)\%$ confidence interval is given by:

$$\bar{x} \pm t_{1-\alpha/2} \cdot \frac{s}{\sqrt{n}}$$

where $t_{1-\alpha/2}$ is the $100(1-\alpha)\%$ quantile from the *t*-distribution with n-1degrees of freedom.

Mest almindeligt med $\alpha = 0.05$:

The most commonly used is the 95%-confidence interval:

$$\bar{x} \pm t_{0.975} \cdot \frac{s}{\sqrt{n}}$$

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4 31 / 60

Konfidensintervallet for μ Eksempel

Højde-eksempel, 95% konfidensinterval (CI)

97.5% fraktilen af t-fordelingen for n=10: qt(p=0.975, df=9)

[1] 2.26

Indsat i formlen

$$178 \pm 2.26 \cdot \frac{12.21}{\sqrt{10}}$$

giver det

$$178 \pm 8.74 = [169.3; 186.7]$$

Eksempel - Højde af 10 studerende

Stikprøve, n = 10:

168 161 167 179 184 166 198 187 191 179

Sample mean og standard deviation:

$$\bar{x} = 178$$

s = 12.21

Estimer population mean og standard deviation:

$$\hat{\mu} = 178$$

$$\hat{\sigma} = 12.21$$

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4 32 / 60

Konfidensintervallet for μ Eksempel

Højde-eksempel, 99% Konfidensinterval (CI)

99.5% fraktilen af t-fordelingen for n=10: qt(p=0.995, df=9)

[1] 3.25

Indsat i formlen

$$178 \pm 3.25 \cdot \frac{12.21}{\sqrt{10}}$$

giver det

$$178 \pm 12.55 = [165.4; 190.6]$$

DTU Compute Introduktion til Statistik Forår 2021 uge 4 33 / 60 DTU Compute Introduktion til Statistik Forår 2021 uge 4 34 / 60 Konfidensintervallet for μ Eksempel

Der findes en R-funktion, der kan gøre det hele (med mere):

```
## Angiv data
x \leftarrow c(168, 161, 167, 179, 184, 166, 198, 187, 191, 179)
## Beregn 99% konfidensinterval
t.test(x, conf.level=0.99)
##
##
   One Sample t-test
## data: x
## t = 46, df = 9, p-value = 5e-12
## alternative hypothesis: true mean is not equal to 0
## 99 percent confidence interval:
## 165 191
## sample estimates:
## mean of x
         178
```

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

Den statistiske sprogbrug og formelle ramme

Den formelle ramme for statistisk inferens

Fra bogen, kapitel 1:

- An observational unit is the single entity/level about which information is sought (e.g. a person) (Observationsenhed)
- The statistical population consists of all possible "measurements" on each observational unit (**Population**)
- The sample from a statistical population is the actual set of data collected. (Stikprøve)

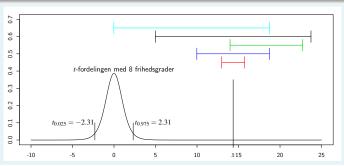
Sprogbrug og koncepter:

- μ og σ er parametre, som beskriver populationen
- \bar{x} er estimatet for μ (konkret udfald)
- \bar{X} er estimatoren for μ (nu set som stokastisk variabel)
- Begrebet 'statistic(s)' er en fællesbetegnelse for begge

Konfidensintervallet for μ Eksempel

Svar via socrative.com eller Socrative app. Room: PBAC

- Gennemsnit $\bar{x} = 14.4$, stikprøvens standardafvigelse s = 6, antal obs. er n = 9
- Formlen for konfidensintervallet er $\bar{x} \pm t_{0.975} \frac{s}{\sqrt{n}}$



Hvilket af intervallerne er det rigtige 95% konfidensinterval?

A: Turkise B: Sorte C: Grønne D: Blå E: Røde

Svar D: Blå. Fordi $t_{0.975} \frac{s}{\sqrt{n}} = 2.31 \frac{6}{\sqrt{9}} \approx 4.6$ så nedre grænse omkring 10.

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

Den statistiske sprogbrug og formelle ramme

Den formelle ramme for statistisk inferens - Eksempel

Fra bogen, kapitel 1, højdeeksempel

Vi måler højden for 10 tilfældige personer i Danmark

Stikprøven/The sample:

De 10 konkrete talværdier: x_1, \ldots, x_{10}

Populationen:

Højderne for alle mennesker i Danmark.

Observationsenheden:

En person

DTU Compute Introduktion til Statistik Forår 2021 uge 4 DTU Compute Introduktion til Statistik Forår 2021 uge 4 39 / 60 Den statistiske sprogbrug og formelle ramme

Statistisk inferens = Learning from data

Learning from data is learning about parameters of distributions that describe populations

Vigtigt i den forbindelse:

Stikprøven skal på meningsfuld vis være repræsentativ for en eller anden veldefineret population

Hvordan sikrer man det

Ved at sikre at stikprøven er fuldstændig tilfældig udtaget

DTU Comput

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

0 / 60

Ikke-normale data, Central Grænseværdisætning (CLT)

Theorem 3.13: The Central Limit Theorem

Gennemsnittet af en tilfældig stikprøve følger altid en normalfordeling hvis n er stor nok:

Let \bar{X} be the mean of a random sample of size n taken from a population with mean μ and variance σ^2 , then

$$Z = \frac{\bar{X} - \mu}{\sigma / \sqrt{n}}$$

is a random variable whose distribution function approaches that of the standard normal distribution, $N(0,1^2)$, as $n\to\infty$

Dvs., hvis n er stor nok, kan vi (tilnærmelsesvist) antage:

 $rac{ar{x}-\mu}{\sigma/\sqrt{n}}\sim N(0,1^2)$ og $rac{ar{x}-\mu}{S/\sqrt{n}}\sim t$ ved *t*-fordelingen med n-1 frihedsgrader

Den statistiske sprogbrug og formelle ramme

Tilfældig stikprøveudtagning

Definition 3.11:

- A random sample from an (infinite) population: A set of observations $X_1, X_2, ..., X_n$ constitutes a random sample of size n from the infinite population f(x) if:
 - **1** Each X_i is a random variable whose distribution is given by f(x)
 - \bigcirc These n random variables are independent

Hvad betyder det????

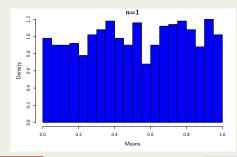
- 4 Alle observationer skal komme fra den samme population
- ② De må IKKE dele information med hinanden (f.eks. hvis man havde udtaget hele familier i stedet for enkeltindivider)

TU Compute Introduktion til Statistik Forår 2021 uge 4 41/

Ikke-normale data, Central Grænseværdisætning (CLT)

CLT in action - gennemsnit af Uniform fordelte observationer

```
## Stikprøvestørrelse
n <- 1
## Antal gentagelser
k <- 1000
## Simuler værdier og sæt i k x n
u <- matrix(runif(n=k*n, min=0, max=1), ncol=n)
## Se empirisk tæthed
hist(apply(u,1,mean), col='blue', main='n=1', xlab='Means', nclass=15, prob=TRUE, xlim=c(0)</pre>
```



DTU Compute

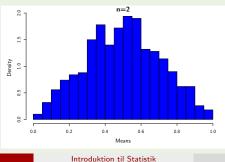
Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4 44 / 60

Ikke-normale data, Central Grænseværdisætning (CLT)

CLT in action - gennemsnit af Uniform fordelte observationer

```
## Stikprøvestørrelse
n <- 2
## Antal gentagelser
k <- 1000
## Simuler
u <- matrix(runif(n=k*n, min=0, max=1),ncol=n)</pre>
## Se empirisk tæthed
hist(apply(u,1,mean), col='blue', main='n=2', xlab='Means', nclass=15, prob=TRUE, xlim=c(0,1))
```



DTU Compute

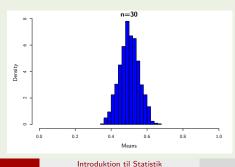
Forår 2021 uge 4 45 / 60

Forår 2021 uge 4 47 / 60

Ikke-normale data, Central Grænseværdisætning (CLT)

CLT in action - gennemsnit af Uniform fordelte observationer

```
## Stikprøvestørrelse
n <- 30
## Antal gentagelser
k <- 1000
## Simuler
u <- matrix(runif(n=k*n, min=0, max=1),ncol=n)</pre>
## Se empirisk tæthed
hist(apply(u,1,mean), col='blue', main='n=30', xlab='Means', nclass=15, prob=TRUE, xlim=c(0,1))
```



Ikke-normale data, Central Grænseværdisætning (CLT)

CLT in action - gennemsnit af Uniform fordelte observationer

```
## Stikprøvestørrelse
n <- 6
## Antal gentagelser
k <- 1000
## Simuler
u <- matrix(runif(n=k*n, min=0, max=1),ncol=n)</pre>
## Se empirisk tæthed
hist(apply(u,1,mean), col='blue', main='n=6', xlab='Means', nclass=15, prob=TRUE, xlim=c(0
```

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4 46 / 60

Ikke-normale data, Central Grænseværdisætning (CLT)

Konsekvens af CLT:

Vores CI-metode virker OGSÅ for ikke-normale data:

Vi kan bruge konfidens-interval baseret på *t*-fordelingen i stort set alle situationer, blot *n* er "stor nok"

Hvad er "stor nok"?

Faktisk svært at svare præcist på, MEN:

- Tommelfingerregel: $n \ge 30$
- Selv for mindre n kan formlen være (næsten) gyldig for ikke-normale data.

DTU Compute Introduktion til Statistik Forår 2021 uge 4

Svar via socrative.com eller Socrative app. Room: PBAC

Er lydniveauet behageligt?

- A: Fino
- B: Nope, tal højere
- C: Nope, tal lavere
- D: Nope, der er bare dårlig lyd herinde

DTU Compute

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

n

Ikke-normale data, Central Grænseværdisætning (CLT)

Statistisk model

Statistisk model, se Remark 3.2

Der tages en stikprøve, som består af de stokastiske variable X_i hvor $i=1,\dots,n$. Der opstilles følgende model

$$X_i \sim N(\mu, \sigma^2)$$
 and i.i.d., where $i = 1, ..., n$

Dvs.

- ullet n observationer fra en normalfordelt population med parametre μ og σ
- observationerne er i.i.d.:
 - independent: de gøres uafhængigt af hinanden
 - identically distributed: de har samme fordeling

Ikke-normale data, Central Grænseværdisætning (CLT)

Svar via socrative.com eller Socrative app. Room: PBAC

Bør Peder klæde sig mere nydeligt?

- A: Ja, for den da! Det er grimt det tøj
- B: Nej, han ser faktisk rigtig checket ud
- C: Nej, det kan være lige meget med tøjet, han skal barbere sig og rede sit hår først
- D: Ved ikke, jeg har simpelthen været for optaget af statistikken til at lægge mærke til hans påklædning

DTU Compute

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

EO / 6

Konfidensinterval for varians og standardafvigelse

Stikprøvefordelingen for varians-estimatet (Theorem 2.56)

Variansestimater opfører sig som en χ^2 -fordeling:

Let

$$S^{2} = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^{n} (X_{i} - \bar{X})^{2}$$

then:

$$\chi^2 = \frac{(n-1)S^2}{\sigma^2}$$

is a random variable following the χ^2 -distribution with v=n-1 degrees of freedom.

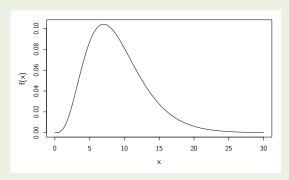
DTU Compute Introduktion til Statistik Forår 2021 uge 4

DTU Compute Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

χ^2 -fordelingen med v = 9 frihedsgrader

```
## Plot chi^2 txthedsfunktion med 9 frihedsgrader
## En sekvens af x vxrdier
x <- seq(0, 30, by = 0.1)
## Plot chi^2 txthedsfunktion
plot(x, dchisq(x, df = 9), type = 'l', ylab="f(x)")</pre>
```



DTU Compute

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

54 / 60

Konfidensinterval for varians og standardafvigelse

Eksempel

Produktion af tabletter

Vi producerer pulverblanding og tabletter deraf, så koncentrationen af det aktive stof i tabletterne skal være 1~mg/g med den mindst mulige spredning. En tilfældig stikprøve udtages, hvor vi måler mængden af aktivt stof.

Data:

En tilfældig stikprøve med n=20 tabletter er udtaget og fra denne får man:

$$\hat{\mu} = \bar{x} = 1.01, \ \hat{\sigma}^2 = s^2 = 0.07^2$$

95%-konfidensinterval for variansen - vi skal bruge χ^2 -fraktilerne:

$$\chi^2_{0.025} = 8.9065, \ \chi^2_{0.975} = 32.8523$$

2.5% og 97.5% fraktilerne i chi^2 fordelingen for n=20 qchisq(c(0.025, 0.975), df = 19)

Konfidensinterval for varians og standardafvigelse

Metode 3.18: Konfidensinterval for stikprøvevarians og stikprøvestandardafvigelse

Variansen:

A $100(1-\alpha)\%$ confidence interval for the variance σ^2 is:

$$\left[\frac{(n-1)s^2}{\chi^2_{1-\alpha/2}};\;\frac{(n-1)s^2}{\chi^2_{\alpha/2}}\right]$$

where the quantiles come from a χ^2 -distribution with $\nu=n-1$ degrees of freedom.

Standardafvigelsen:

A $100(1-\alpha)\%$ confidence interval for the sample standard deviation $\hat{\sigma}$ is:

$$\left[\sqrt{\frac{(n-1)s^2}{\chi_{1-\alpha/2}^2}}; \sqrt{\frac{(n-1)s^2}{\chi_{\alpha/2}^2}}\right]$$

DTU Compute

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

Konfidensinterval for varians og standardafvigelse

Eksempel

Så konfidensintervallet for variansen σ^2 bliver:

$$\left[\frac{19 \cdot 0.7^2}{32.85}; \ \frac{19 \cdot 0.7^2}{8.907}\right] = [0.002834; \ 0.01045]$$

Og konfidensintervallet for standardafvigelsen σ bliver:

$$\left\lceil \sqrt{0.002834}; \ \sqrt{0.01045} \right\rceil = \left[0.053; \ 0.102 \right]$$

DTU Compute Introduktion til Statistik Forår 2021 uge 4 56/60 DTU Compute Introduktion til Statistik Forår 2021 uge 4 57/60

Konfidensinterval for varians og standardafvigelse

Højdeeksempel

Vi skal bruge χ^2 -fraktilerne med v = 9 frihedsgrader:

$$\chi_{0.025}^2 = 2.700389, \, \chi_{0.975}^2 = 19.022768$$

2.5% og 97.5% fraktilerne i chi^2 fordelingen for n=10
qchisq(c(0.025, 0.975), df = 9)

[1] 2.7 19.0

Så konfidensintervallet for højdens standardafvigelse σ bliver:

$$\left[\sqrt{\frac{9\cdot 12.21^2}{19.022768}}; \sqrt{\frac{9\cdot 12.21^2}{2.700389}}\right] = [8.4; 22.3]$$

DTU Comput

Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

Konfidensinterval for varians og standardafvigelse

Svar via socrative.com eller Socrative app. Room: PBAC

Hvilket af følgende udsagn er korrekt?

- A: Statistik er virkelig skod, jeg tror ikke det kan bruges til noget
- B: Statistik er altså øv, man skal bare sidde og sætte en masse tal ind i nogle dumme formler
- C: Jeg burde ligge under min dyne og blive frisk til at feste igennem i aften
- D: Statistik er virkelig fedt, det er fascinerende, at man ikke bare kan regne et estimat ud, men man kan også regne ud hvor præcist det er

Svar D

DTU Compute Introduktion til Statistik

Forår 2021 uge 4

0 / 60

Konfidensinterval for varians og standardafvigelse

Eksempel - Højde af 10 studerende - recap:

Stikprøve, n = 10:

168 161 167 179 184 166 198 187 191 179

Sample mean og standard deviation:

$$\bar{x} = 178$$

$$s = 12.21$$

Estimer population mean og standard deviation:

$$\hat{\mu} = 178$$

$$\hat{\sigma} = 12.21$$

NYT:**Konfidensinterval**, μ :

$$178 \pm 2.26 \cdot \frac{12.21}{\sqrt{10}} \Leftrightarrow [169.3; 186.7]$$

NYT:**Konfidensinterval**, σ :

U Compute Introduktion til Statistik Forår 2021 uge 4 59