

Критерий Колмогорова — Смирнова

Критерии согласия

Критерий согласия Колмогорова — Смирнова

Критерий согласия Колмогорова — Смирнова — это непараметрический критерий согласия, который основан на разнице между теоретической функцией распределения и эмпирической функцией распределения.

Статистика критерия согласия Колмогорова — Смирнова

$$D_n = \sup_{|x| < \infty} |F_n(x) - F(x, \theta)|$$

$F_n(x)$ — эмпирическая функция распределения

$F(x, \theta)$ — теоретическая функция распределения

Критерий согласия Колмогорова — Смирнова

Критерий Лиллиефорса — это статистический критерий, который представляет собой модификацию критерия Колмогорова — Смирнова. Используется для проверки нулевой гипотезы о том, что выборка распределена по нормальному закону для случая, когда параметры нормального распределения (математическое ожидание и дисперсия) априори неизвестны.