

Statistik och Dataanalys I

Föreläsning 22 - Hypotestest och jämföra grupper

Mattias Villani



Statistiska institutionen
Stockholms universitet



mattiasvillani.com



@matvil



@matvil



mattiasvillani

- Mera hypotestest: fel av typ I och II
- Jämföra två populationer - oberoende stickprov
- Jämföra två populationer - parade data

Praktisk vs Statistisk signifikans

■ Teststatistiska

$$T = \frac{\bar{X} - \mu_0}{\frac{s}{\sqrt{n}}}$$

■ Stora stickprov: även små skillnader $\bar{X} - \mu_0$ blir **signifikanta**.

■ Det betyder inte alltid att de är **praktiskt betydelsefulla**.

■ Studie 1:

▶ $\bar{x} = 1, \mu_0 = 0, s = 2, n = 10$.

$$t_{\text{obs}} = \frac{1 - 0}{\frac{2}{\sqrt{10}}} = 1.58$$

■ Studie 2:

▶ $\bar{x} = 0.05, \mu_0 = 0, s = 2, n = 10000$.

$$t_{\text{obs}} = \frac{0.05 - 0}{\frac{2}{\sqrt{10000}}} = 2.5$$

Fel av typ I och II

■ Fel av typ I:

- ▶ $\alpha = P(\text{förkasta } H_0 \mid H_0 \text{ sann}).$
- ▶ Bestäms av kritiska värdet.

■ Fel av typ II:

- ▶ $\beta = P(\text{inte förkasta } H_0 \mid H_A \text{ sann}).$
- ▶ Beror på kritiska värdet och **värdet på μ under H_A .**

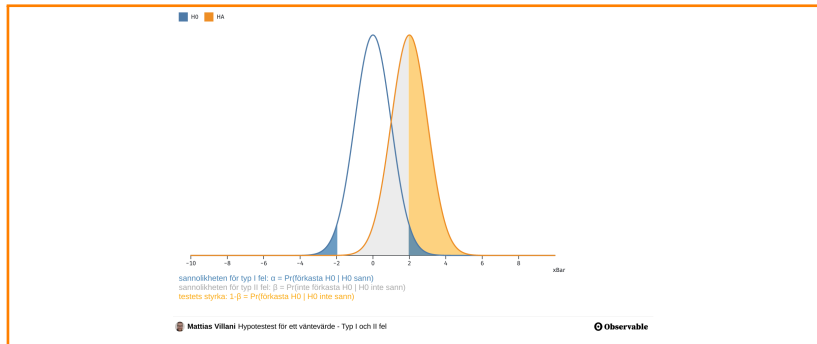
■ Testets styrka

- ▶ $1 - \beta = P(\text{förkasta } H_0 \mid H_A \text{ sann})$

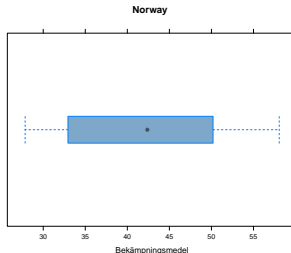
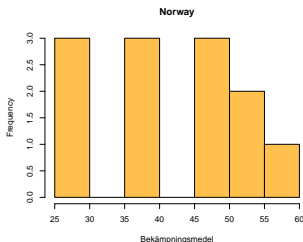
Fel av typ I och II

		Sanningen	
		H_0 sann	H_0 falsk
Beslut	ej förkasta H_0	OK	Typ II fel
	förkasta H_0	Typ I fel	OK

Fel av typ I och II - interaktivt



- Total.pestocide i 153 laxar vid 8 olika platser.
- Grupp 1: Eastern Canada med $n = 24$ laxar. $N(\mu_1, \sigma_1)$.
 - ▶ $\bar{x}_1 = 33.572$
 - ▶ $s_1 = 7.671$
- Grupp 2: Norge med $n = 12$ laxar. $N(\mu_2, \sigma_2)$.
 - ▶ $\bar{x}_2 = 41.763$
 - ▶ $s_2 = 10.373$
- Är $\mu_1 = \mu_2$?



Jämföra grupper - konfidensintervall för $\mu_1 - \mu_2$

- Grupp 1: n_1 observationer från populationen $N(\mu_1, \sigma_1)$.
 - ▶ Medelvärde \bar{x}_1 och standardavvikelse s_1 .
- Grupp 2: n_2 observationer från populationen $N(\mu_2, \sigma_2)$.
 - ▶ Medelvärde \bar{x}_2 och standardavvikelse s_2 .
- **Oberoende** observationer **inom och mellan** grupperna.

$$E(\bar{X}_1 - \bar{X}_2) = E(\bar{X}_1) - E(\bar{X}_2) = \mu_1 - \mu_2$$

$$\text{Var}(\bar{X}_1 - \bar{X}_2) = \text{Var}(\bar{X}_1) + \text{Var}(\bar{X}_2) = \frac{\sigma_1^2}{n_1} + \frac{\sigma_2^2}{n_2}$$

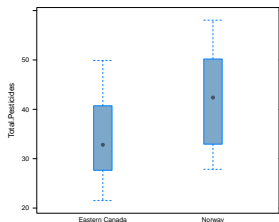
■ Standardfel

$$SE(\bar{x}_1 - \bar{x}_2) = \sqrt{\frac{s_1^2}{n_1} + \frac{s_2^2}{n_2}}$$

■ Konfidensintervall för differensen $\mu_1 - \mu_2$

$$(\bar{x}_1 - \bar{x}_2) \pm t_{0.025, df} \cdot SE(\bar{x}_1 - \bar{x}_2)$$

- Frihetsgraderna df har en komplicerad formel. Använder R.



```
> # Using the t.test function to compute C.I. and do test H0:  $\mu_1 = \mu_2$   
> t.test(Total.Pesticides ~ Location, data = salmonTwoPop)
```

Welch Two Sample t-test

data: Total.Pesticides by Location

t = -2.424, df = 17.223, p-value = 0.02663

alternative hypothesis: true difference in means between group Eastern Canada and g

95 percent confidence interval:

-15.314121 -1.068879

sample estimates:

mean in group Eastern Canada

33.57167

mean in group Norway

41.76317

Jämföra grupper - test för $\mu_1 = \mu_2$

- Hypotestest för skillnaden mellan två gruppers väntevärden:

$$H_0 : \mu_1 = \mu_2$$

$$H_0 : \mu_1 - \mu_2 = d_0$$

$$H_A : \mu_1 \neq \mu_2$$

$$H_A : \mu_1 - \mu_2 \neq d_0$$

- Recall: Allmän formel teststatistika

$$\frac{\text{Estimat} - \text{parameter under } H_0}{\text{Standardfel estimator under } H_0}$$

- **Teststatistika**

$$T = \frac{(\bar{X}_1 - \bar{X}_2) - 0}{SE(\bar{X}_1 - \bar{X}_2)} = \frac{(\bar{X}_1 - \bar{X}_2) - 0}{\sqrt{\frac{s_1^2}{n_1} + \frac{s_2^2}{n_2}}} \sim t_{df} \text{ under } H_0$$

- Förkastar H_0 om $|t_{obs}| > t_{crit}$.

- p -värde från t_{df} .

Jämföra parade grupper

- **Parade data.** Ex **mäter samma n personer** vid två tillfällen:
- Mätningar vid tidpunkt 1: $N(\mu_1, \sigma_1)$.
- Mätningar vid tidpunkt 2: $N(\mu_2, \sigma_2)$.
- **Beroende** stickprov, med lika många observationer.
- Skapa **differenser** av mätningarna: $d_i = x_{1i} - x_{2i}$.
- **Differenserna ska vara oberoende** mellan personer.
- **Standardfel**

$$SE(\bar{d}) = \frac{s_d}{\sqrt{n}}$$

- **95%-igt konfidensintervall**

$$\bar{d} \pm t_{0.025} \cdot \frac{s_d}{\sqrt{n}}$$

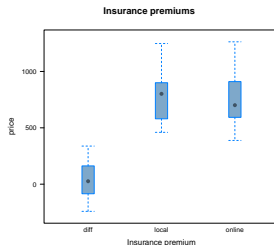
- **Hypotestest**

$$H_0 : \mu_1 = \mu_2$$

$$H_A : \mu_1 \neq \mu_2$$

$$T = \frac{\bar{d} - 0}{\frac{s_d}{\sqrt{n}}} \sim t_{n-1}$$

Person	Local	Online	PriceDiff
1	550	388	162
2	856	593	263
3	460	497	-37
4	1248	910	338
5	580	665	-85
6	1022	1263	-241
7	773	703	70
8	830	789	41
9	900	1001	-101
10	710	699	11
medelvärde	792.900	750.800	42.100
standardavv.	235.431	254.956	174.964



```
> t.test(price ~ place, data = df, paired = TRUE)
```

Paired t-test

```
data: price by place
t = 0.76091, df = 9, p-value = 0.4662
alternative hypothesis: true mean difference is not equal to 0
95 percent confidence interval:
-83.06154 167.26154
sample estimates:
mean difference
42.1
```