



Analyse af en enkelt stikprøve: estimation og konfidensinterval

Anders Tolver
Institut for Matematiske Fag



I dag

Dagens emne: **Analyse af en enkelt stikprøve** (one sample).

Dagens forelæsninger dækkes primært af Kap. 4.2, 4.4 og 5.3.1-5.3.3 i lærebogen.

Formiddag:

- Intro/motivation (problemformulering)
- Egenskaber ved gennemsnit, CLT (matematik)
- Statistisk model, estimation og standard error (løsning)
- Konfidensinterval

Eftermiddag (video):

- Besvarelse af Quiz
- Analyse af transformeret stikprøve illustreret ved gæt på punktplot (opfølgning på HS.11 mm).



Intro/motivation: population vs. stikprøve



En enkelt stikprøve (one sample)

Data: y_1, \dots, y_n fra uafhængige individer som antages at være trukket tilfældigt fra den **samme population**.

Eksempel:

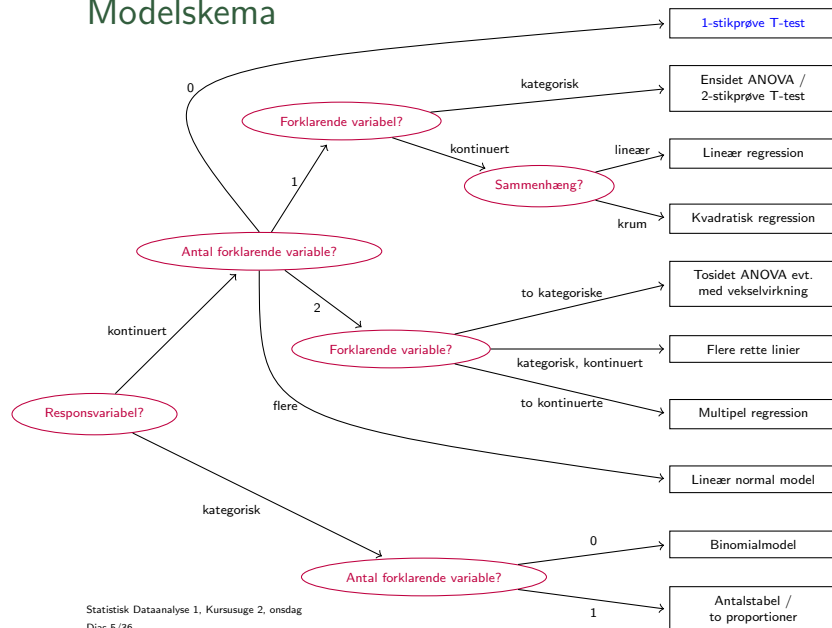
- Alle studerende på StatData1 2021 har forsøgt at afsætte to punkter med afstand 8 cm på en farvet seddel
- Datasættet består af målinger af afstanden for $n = 20$ tilfældigt udvalgte sedler

Ingen forklarende variable!

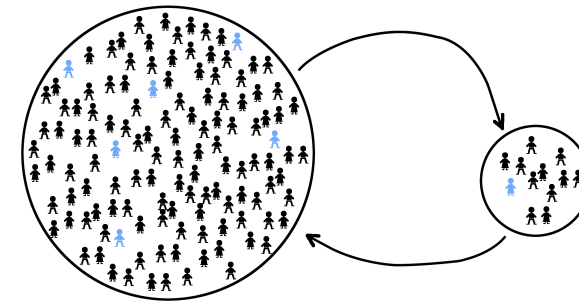
Analysen baseres på at data er normalfordelte: Vigtigt at kunne checke det. (Det lærte vi i mandags!)



Modelskema



Population vs stikprøve



- Vi er interesserede i populationen (alle studerende)
- Vi har kun målinger på en repræsentativ stikprøve ($n = 20$)
- Særligt interesseret i populationegennemsnittet μ (ukendt).

Spørgsmål

Lad os kalde **populationsgennemsnittet** μ . Interesseret i at bruge data (stikprøven) til at sige noget begavet om μ :

- **Estimat** (punktestimat) for populationsgennemsnittet. Naturligt at bruge stikprøvegennemsnittet: $\hat{\mu} = \bar{y}$
- Usikkerhed på estimatet: **Standard error**
- Et interval af μ -værdier der passer med data: **konfidensinterval** (intervalestimat)

Ingredienser i analysen:

- Antager at data er **normalfordelte** \rightarrow skal checkes
- Estimat $\hat{\mu} = \bar{y} \rightarrow$ egenskaberne for **gennemsnittet** er vigtige

Husk at checke om data er normalfordelte

Hvis data y_1, \dots, y_n er normalfordelt, **så** vil...

- tæthed for $N(\bar{y}, s^2)$ være en god approks. til histogrammet
- punkterne i QQ-plottet ligge omkring den rette linie med skæring \bar{y} og hældning s

Systematiske afvigelser er tegn på at data **ikke** er normalfordelte.

- Jo mindre n , jo større afvigelser kan vi acceptere
- Histogrammet dur kun for n nogenlunde stor

Populations- og stikprøvestørrelser

Population	Stikprøve (data)
Pop.-gennemsnit μ	Stikprøvegennemsnit \bar{y}
Pop.-spredning σ	Stikprøvespredning s
Tæthed	Histogram
Ret linie	QQ-plot



Egenskaber ved gennemsnittet



Gennemsnit af normalfordelte variable

Infobox 4.3 Hvis Y_1, \dots, Y_n er uafhængige og alle $Y_i \sim N(\mu, \sigma^2)$, så er gennemsnittet \bar{Y} også normalfordelt:

$$\bar{Y} = \frac{1}{n}(Y_1 + \dots + Y_n) \sim N(\mu, \sigma^2/n)$$

Specielt gælder:

$$\text{sd}(\bar{Y}) = \frac{\sigma}{\sqrt{n}}$$

Lad os prøve at illustrere det...



Fordeling af gennemsnit

Vi forestiller os at vi ser **mange datasæt** der hver især består af n observationer. For hvert datasæt beregner vi gennemsnittet.

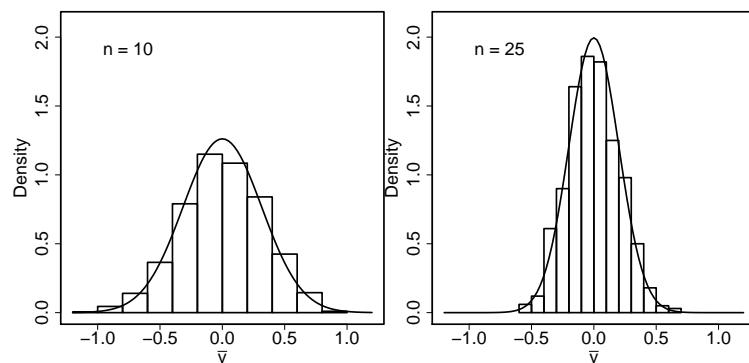
Stikprøve 1 (n observationer)	\rightarrow	\bar{y}_1
Stikprøve 2 (n observationer)	\rightarrow	\bar{y}_2
\vdots	\vdots	\vdots
Stikprøve 1000 (n observationer)	\rightarrow	\bar{y}_{1000}

Hvordan ser histogrammet for $\bar{y}_1, \dots, \bar{y}_{1000}$ ud?



Fordeling af gennemsnit

Histogrammer over 1000 gennemsnit af n stk. $N(0, 1)$ variable.



Ser faktisk ud til at være **normalfordelt** som Infobox 4.3 forudsagde. Passer middelværdi og spredning?



Model, estimation, standard error



Statistisk model

Data: y_1, \dots, y_n . Målinger på repræsentativ stikprøve.

Statistisk model: y_1, \dots, y_n er uafhængige og alle normalfordelte med samme middelværdi μ og samme spredning σ .

En statistisk model angiver de antagelser vi gør os om hvordan „de mekanismer“ der har genereret data.

Hvad betyder **uafhængighed**?

- Løst: Ingen information i én observation om nogle af de andre
- Eksempler på ikke-uafhængige data?

To ukendte **parametre** i modellen: Populationsgennemsnittet μ og populationsspredningen σ .



Estimation

To ukendte **parametre** i modellen: Populationsgennemsnittet μ og populationsspredningen σ .

Vores bedste gæt på parametrene er de tilhørende stikprøvestørrelser.

Estimation:

$$\hat{\mu} = \bar{y}, \quad \hat{\sigma} = s$$

Husk at \bar{y} er normalford. med middelværdi μ og spredning σ/\sqrt{n} .



Standard error

\bar{y} normalfordelt med middelværdi μ og spredning σ/\sqrt{n}

Standard error for $\hat{\mu} = \bar{y}$ er den estimerede spredning:

$$SE(\hat{\mu}) = SE(\bar{y}) = \frac{s}{\sqrt{n}}$$

Vores gæt på spredningen af \bar{y} .

For data vedr. afstande ml. punkter:

$$\hat{\mu} = \bar{\mu} = 8.07, \quad SE(\hat{\mu}) = SE(\bar{y}) = \frac{2.101}{\sqrt{20}} = 0.47$$



Evt.: Mindste kvadraters metode

Husk at vi fandt „den bedste rette linie“ i lineær regression med mindste kvadraters metode.

Vi kan også bruge **mindste kvadraters metode** for en enkelt stikprøve: Vælg μ så residualkvadratsummen er så lille som mulig:

$$\text{Minimér} \quad \sum_{i=1}^n (y_i - \mu)^2$$

Residualkvadratsummen viser sig at være mindst for $\mu = \bar{y}$.

Skæg pointe: Minimeres istedet

$$\sum_{i=1}^N |y_i - m|,$$

så fås at m skal være *medianen* af y_i 'erne.



Konfidensinterval



Konfidensinterval

Har estimat \bar{y} — den værdi der ”passer bedst” med vores data. Kaldes sommetider et **punktestimat**.

Ønsker et **intervalestimat** — et interval af μ -værdier der er ”i overensstemmelse” med vores data. **Konfidensinterval**.

”Løsningen” viser sig at være

$$\hat{\mu} \pm \text{noget} \cdot SE(\hat{\mu})$$

Hvad er dette *noget*?



Konfidensinterval for μ

$\bar{y} \sim N(\mu, \sigma^2/n)$, så

$$P\left(\mu - 1.96 \frac{\sigma}{\sqrt{n}} < \bar{y} < \mu + 1.96 \frac{\sigma}{\sqrt{n}}\right) = 0.95$$

Eller — hvis vi omorganiserer så μ står i midten:

$$P\left(\bar{y} - 1.96 \frac{\sigma}{\sqrt{n}} < \mu < \bar{y} + 1.96 \frac{\sigma}{\sqrt{n}}\right) = 0.95$$

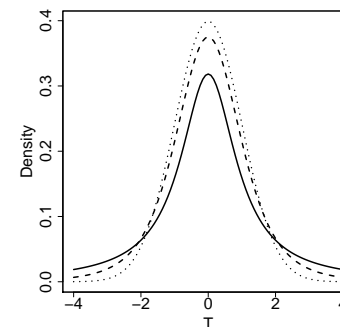
Hvis vi kendte populationsspredningen σ , så ville vi kunne beregne endepunkterne $\bar{y} \pm 1.96 \frac{\sigma}{\sqrt{n}}$.

Men: Vi kender ikke populationsspredningen σ . Oplagt at erstatte σ med s , men så skal 1.96 erstattes med et lidt større tal.



t -fordelingen

$df = 1, 4$ og $N(0, 1)$



Standardisering

$$Z = \frac{\sqrt{n}(\bar{y} - \mu)}{\sigma} \sim N(0, 1)$$

Fordelingen ændres hvis σ erstattes med s :

$$T = \frac{\sqrt{n}(\bar{y} - \mu)}{s} \sim t_{n-1}$$

t -fordelingen med $n - 1$ frihedsgrader ($df = n - 1$)

- Brede haler end $N(0, 1)$.
- Ligner $N(0, 1)$ mere og mere når df vokser.



Konfidensinterval for μ

For kendt σ :

$$P\left(-1.96 < \frac{\sqrt{n}(\bar{y} - \mu)}{\sigma} < 1.96\right) = 0.95$$

Husk at 1.96 er 97.5% fraktilen i $N(0, 1)$.

Hvis vi i stedet indsætter estimatet s , så skal vi bruge 97.5% fraktilen i t fordelingen med $n - 1$ frihedsgrader:

$$P\left(-t_{0.975, n-1} < \frac{\sqrt{n}(\bar{y} - \mu)}{s} < t_{0.975, n-1}\right) = 0.95$$

Vi flytter rundt så μ står i midten:

$$P\left(\bar{y} - t_{0.975, n-1} \cdot \frac{s}{\sqrt{n}} < \mu < \bar{y} + t_{0.975, n-1} \cdot \frac{s}{\sqrt{n}}\right) = 0.95$$



Konfidensinterval for μ

Foregående slide:

$$P\left(\bar{y} - t_{0.975, n-1} \cdot \frac{s}{\sqrt{n}} < \mu < \bar{y} + t_{0.975, n-1} \cdot \frac{s}{\sqrt{n}}\right) = 0.95$$

Altså: Intervallet

$$\bar{y} \pm t_{0.975, n-1} \cdot \frac{s}{\sqrt{n}} \quad \text{eller} \quad \hat{\mu} \pm t_{0.975, n-1} \cdot \text{SE}(\hat{\mu})$$

indeholder populationsmiddelværdien med 95% sandsynlighed.

Intervallet kaldes et **95% konfidensinterval for μ** .



Konfidensinterval for gennemsnitshøjde

Indhold på de næste 5 slides er også grundigt gennemgået i R programmet!

95% KI for den populationsgennemsnittet for **kvinder**:

$$168.52 \pm 1.983 \cdot \frac{6.64}{\sqrt{104}} = 168.52 \pm 1.29 = (167.23, 169.82)$$

Værdier mellem 167.2 og 169.8 for populationsgennemsnittet er i overensstemmelse med data på 95% konfidensniveau.

95% KI for den populationsgennemsnittet for **mænd**:

$$182.70 \pm 2.010 \cdot \frac{5.54}{\sqrt{50}} = 182.70 \pm 1.57 = (181.13, 184.27)$$



R: Kommentarer

Flere metoder til bestemmelse af konfidensintervallet i situationen med en stikprøve:

- "Manuelt". Brug **qt** til at finde *t*-fraktilen
- Funktionen **t.test**
- Med **lm** og **confint**

Bemærk: **lm** og **summary** giver flere ting: \bar{y} , $SE(\bar{y})$, s mm.



R: "Manuelt"

Gennemsnit og stikprøvespredning

```
> mean(kData$hojde, na.rm=TRUE)
[1] 168.524
> sd(kData$hojde, na.rm=TRUE)
[1] 6.639972
```

Den relevante *t*-fraktil

```
> qt(0.975, df=103)
[1] 1.983264
```

Nedre grænse

```
> 168.524 - 1.9833 * 6.639972/sqrt(104)
[1] 167.2327
```

Øvre grænse

```
> 168.524 + 1.9833 * 6.639972/sqrt(104)
[1] 169.8153
```



R: t.test

```
> t.test(kData$hojde)
```

One Sample t-test

```
data: kData$hojde
t = 258.83, df = 103, p-value < 2.2e-16
alternative hypothesis: true mean is not equal to 0
95 percent confidence interval:
 167.2327 169.8153
sample estimates:
mean of x
 168.524
```



R: lm

```
> model <- lm(hojde ~ 1, data=kData)
> summary(model)
```

Coefficients:

```
      Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
(Intercept) 168.5240    0.6511   258.8  <2e-16 ***
---

```

```
Signif. codes:  0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
```

```
Residual standard error: 6.64 on 103 degrees of freedom
(1 observation deleted due to missingness)
```

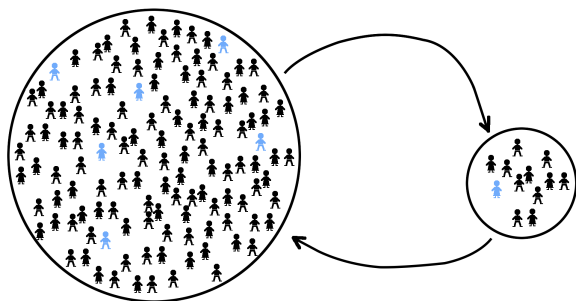
```
> confint(model)
      2.5 %    97.5 %
(Intercept) 167.2327 169.8153
```



Analyse af en enkelt stikprøve: når data ikke er normalfordelte



Population vs stikprøve



- Vi er interesserede i populationen
- Vi har kun målinger på en repræsentativ stikprøve (n)
- Særligt interesseret i populationegennemsnittet μ (ukendt).
- Men vi tror ikke på, at data er normalfordelte!



Spørgsmål

Brug stikprøven til at sige noget om **pop.-gennemsnittet** μ :

- **Estimat** (punkttestimat) for populationsgennemsnittet.
Naturligt at bruge stikprøvegennemsnittet: $\hat{\mu} = \bar{y}$
- Usikkerhed på estimatet: **Standard error**
- Et interval af μ -værdier der passer med data:
konfidensinterval (intervalestimat)

Problemer forhold til tidligere analyse:

- Desværre ser data **ikke normalfordelte** ud
- Estimat $\hat{\mu} = \bar{y} \rightarrow$ egenskaberne for **gennemsnittet** er vigtige, men vi kan ikke bruge Infobox 4.3

To løsninger:

- Find transformation så data bliver normalfordelte (R program, øvelser, video)
- Træk på **Den centrale Grænseværdisætning** (CLT)



Den centrale grænseværdisætning (CLT)

I dagens R-program simuleres og beregnes gennemsnit fra population, som ikke er normalfordelt (transporttid til studie).

Overraskende: Gennemsnittet så ud til være normalfordelt uanset om „basisfordelingen“ var en normalfordeling eller ej.

Det er præcis det **den centrale grænseværdisætning** (CLT) siger:

- **Hvis:** y_1, \dots, y_n er uafhængige og har den **samme fordeling**, med middelværdi μ og spredning σ
- **Så:** \bar{y} approksimativt normalfordelt med middelværdi μ og spredning σ/\sqrt{n}

Gælder (næsten) uanset hvordan den bagvedliggende fordeling ser ud.



Konsekvenser af CLT

- For **store stikprøver** vil statistiske metoder baseret på normalfordelingsmodeller give fornuftige resultater
- Gælder også selvom data ikke er normalfordelte
- Gælder ikke kun for analyser af en enkelt stikprøve men også for fx. ensidet ANOVA og lineær regression
- **Udfordring:** Svært at afgøre, hvornår stikprøven er stor nok til at retfærdiggøre brug af normalfordelingsmodeller.



Opsummering - eget brug (en enkelt stikprøve)

Modelfiguren: Kontinuert respons, ingen forklarende variable.

Data: y_1, \dots, y_n

Statistisk model: y_1, \dots, y_n er uafhængige og alle normalfordelte med samme middelværdi μ og samme spredning σ .

Estimation: $\hat{\mu} = \bar{y}$ og $\hat{\sigma} = s$

Standard error for $\hat{\mu}$: $SE(\hat{\mu}) = \frac{s}{\sqrt{n}}$

95% konfidensinterval for μ : $\bar{y} \pm t_{0.975, n-1} \cdot \frac{s}{\sqrt{n}}$. De værdier af μ der er i overensstemmelse med data.

Bemærk struktur af KI:

$$\text{estimat} \pm t\text{-fraktil} \cdot SE(\text{estimat}).$$



Opsummering — til eget brug

- Hvad er antagelserne i den statistiske model for en enkelt stikprøve?
- Hvordan estimeres populationsparametrene?
- Hvad er formelen for $SE(\bar{y})$?
- Hvad er formelen for 95% konfidensintervallet for μ ?
- Hvad er fortolkningen af konfidensintervallet?
- Kan du indlæse data fra en Excel og/eller tekstfil?

