Estymacja parametrów rozkładu cechy

Estymujemy parametr θ rozkładu cechy XPróba: X_1, X_2, \dots, X_n

Estymator (punktowy) jest funkcją próby

$$\hat{\theta} = \hat{\theta}(X_1, X_2, \dots, X_n)$$

przybliżającą wartość parametru θ

Przedział ufności (estymator przedziałowy) jest przedziałem o końcach zależnych od próby, który z pewnym z góry zadanym prawdopodobieństwem pokrywa nieznaną wartość parametru θ

$$P\{\theta \in (\underline{\theta}(X_1,\ldots,X_n), \ \overline{\theta}(X_1,\ldots,X_n))\} = 1 - \alpha$$

Poziom ufności: prawdopodobieństwo $1 - \alpha$

Co wpływa na długość d przedziału ufności?

- 1. Liczność próby $(n \nearrow \Longrightarrow d \searrow)$
- 2. Poziom ufności $(1 \alpha \nearrow \Longrightarrow d \nearrow)$
- 3. Wariancja cechy $(\sigma^2 \searrow \Longrightarrow d \searrow)$

Rozkład normalny Estymacja parametrów

Próba (prosta): X_1, X_2, \dots, X_n

Estymator średniej μ — średnia arytmetyczna

$$\bar{X} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^{n} X_i = \frac{X_1 + \dots + X_n}{n}$$

Estymator wariancji σ^2 — wariancja próbkowa

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

Suma kwadratów odchyleń od średniej

$$var X = \sum_{i=1}^{n} (X_i - \bar{X})^2 = \sum_{i=1}^{n} X_i^2 - n\bar{X}^2$$

Estymator odchylenia standardowego σ

$$S = \sqrt{S^2}$$

Szereg rozdzielczy (dane skumulowane)

Przedział klasowy	Liczebność
$x_0 - x_1$	n_1
$x_1 - x_2$	n_2
• •	• • •
$x_{k-1} - x_k$	n_k
	\overline{n}

Średnia z próby $(\dot{x}_i = (x_{i-1} + x_i)/2)$

$$\bar{X} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^{k} \dot{x}_i n_i$$

Suma kwadratów odchyleń od średniej

$$var X = \sum_{i=1}^{k} (\dot{x}_i - \bar{X})^2 n_i$$

Liczność próby

Jeżeli X_1, \ldots, X_n są niezależnymi zmiennymi losowymi takimi, że $X_i \sim N(\mu, \sigma^2), i = 1, \ldots, n$, to

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

Przykład.

Jakie jest prawdopodobieństwo, że średnia \bar{X} "trafi" bliżej μ niż 0.1σ ?

$$P\{|\bar{X} - \mu| < 0.1\sigma\} = P\{\bar{X} \in (\mu - 0.1\sigma, \mu + 0.1\sigma)\}$$

$$F\left(\frac{(\mu + 0.1\sigma) - \mu}{\sigma/\sqrt{n}}\right) - F\left(\frac{(\mu - 0.1\sigma) - \mu}{\sigma/\sqrt{n}}\right) =$$

$$F(0.1\sqrt{n}) - F(-0.1\sqrt{n}) = 2F(0.1\sqrt{n}) - 1$$

Przedział ufności dla średniej

Wariancja σ^2 jest nieznana

Poziom ufności: $1 - \alpha$

$$\left(\bar{X} - t(\alpha; n-1)\frac{S}{\sqrt{n}}, \bar{X} + t(\alpha; n-1)\frac{S}{\sqrt{n}}\right)$$

 $t(\alpha; n-1)$: wartość krytyczna rozkładu t (Studenta) z ν stopniami swobody

Długość przedziału:
$$d = 2t(\alpha; n-1)\frac{S}{\sqrt{n}}$$

Przedziały jednostronne

$$(-\infty, \quad \bar{X} + t(2\alpha; n-1)\frac{S}{\sqrt{n}})$$

$$(\bar{X} - t(2\alpha; n-1)\frac{S}{\sqrt{n}}, \quad \infty)$$

Na podstawie próby 1.1, 1.2, 0.8, 0.9, 1.2, 1.3, 1.0, 0.7, 0.8, 1.0 oszacować wartość średnią rozkładu obserwowanej cechy.

$$\bar{x} = \frac{1.1 + 1.2 + \dots + 1.0}{10} = 1.0$$

$$\text{var}X = (1.1 - 1.0)^2 + \dots + (1.0 - 1.0)^2 = 0.36$$

$$s^2 = \frac{0.36}{10 - 1} = 0.04, \qquad s = \sqrt{s^2} = 0.2$$

Poziom ufności $1 - \alpha = 0.95$, czyli $\alpha = 0.05$.

$$t(0.05; 9) = 2.2622$$

$$t(0.05; 9) \frac{s}{\sqrt{n}} = 2.2622 \frac{0.2}{\sqrt{10}} = 0.14$$

$$(1 - 0.14, 1 + 0.14) = (0.86, 1.14)$$

Wniosek. Średnia wartość cechy jest jakąś liczbą z przedziału (0.86, 1.14). Zaufanie do tego wniosku wynosi 95%.

Oszacować przeciętną ilość punktów uzyskiwanych na klasówce.

$$n = 300$$
 $\sum x_i = 176.566$ $\sum x_i^2 = 107.845302$

Populacja:

Słuchacze podstawowego kursu statystyki

Cecha X:

ilość punktów zdobytych na klasówce

Założenie:

cecha X ma rozkład normalny $N(\mu, \sigma^2)$

Zadanie: oszacować parametr μ

Technika statystyczna:

przedział ufności dla średniej poziom ufności $1-\alpha=0.95$

$$\bar{x} = \frac{1}{n} \sum x_i = \frac{176.566}{300} = 0.589$$

$$\text{var} X = \sum x_i^2 - \frac{1}{n} \left(\sum x_i\right)^2$$

$$= 107.845302 - \frac{176.566^2}{300} = 3.92679$$

$$s^2 = \frac{3.92679}{300 - 1} = 0.01313, \qquad s = \sqrt{s^2} = 0.11460$$

$$t(0.05; 299) \approx 1.96$$

$$t(0.05; 299) \frac{s}{\sqrt{n}} = 1.96 \frac{0.11460}{\sqrt{300}} = 0.01297$$

$$(0.589 - 0.013, 0.589 + 0.013) = (0.576, 0.602)$$

Odpowiedź: $\mu \in (0.576, 0.602)$

Wniosek. Przeciętna liczba punktów zdobywana na klasówce jest liczbą z przedziału (0.576, 0.602). Zaufanie do tego wniosku wynosi 95%.

Przedział ufności dla wariancji

Średnia μ jest nieznana

Poziom ufności: $1 - \alpha$

$$\left(\frac{\operatorname{var}X}{\chi^2\left(\frac{\alpha}{2};n-1\right)}, \frac{\operatorname{var}X}{\chi^2\left(1-\frac{\alpha}{2};n-1\right)}\right)$$

 $\chi^2\left(\alpha;n-1\right)$ jest stablicowaną wartością krytyczną rozkładu chi–kwadrat z ν stopniami swobody.

Przedziały jednostronne

$$\left(0, \frac{\operatorname{var} X}{\chi^{2}(\alpha; n-1)}\right)$$

$$\left(\frac{\operatorname{var} X}{\chi^{2}(1-\alpha; n-1)}, \infty\right)$$

Na podstawie próby 1.1, 1.2, 0.8, 0.9, 1.2, 1.3, 1.0, 0.7, 0.8, 1.0 oszacować zróżnicowanie rozkładu obserwowanej cechy.

$$\bar{x} = \frac{1.1 + 1.2 + \dots + 1.0}{10} = 1.0$$

$$var X = (1.1 - 1.0)^2 + \dots + (1.0 - 1.0)^2 = 0.36$$

$$s^2 = \frac{0.36}{10 - 1} = 0.04, \qquad s = \sqrt{s^2} = 0.2$$

Poziom ufności $1 - \alpha = 0.95$, czyli $\alpha = 0.05$.

$$\chi^{2}\left(\frac{\alpha}{2}; n-1\right) = \chi^{2}\left(0.025; 9\right) = 19.0228$$

$$\chi^{2}\left(1 - \frac{\alpha}{2}; n-1\right) = \chi^{2}\left(0.975; 9\right) = 2.7004$$

$$\left(\frac{0.36}{19.0228}, \frac{0.36}{2.7004}\right) = (0.019, 0.133)$$

Wniosek. Wariancja cechy jest jakąś liczbą z przedziału (0.019, 0.133). Zaufanie do tego wniosku wynosi 95%.

Przedział ufności dla odchylenia standardowego

Średnia μ jest nieznana

Poziom ufności: $1 - \alpha$

$$\left(\sqrt{\frac{\operatorname{var}X}{\chi^2(\frac{\alpha}{2};n-1)}}, \sqrt{\frac{\operatorname{var}X}{\chi^2(1-\frac{\alpha}{2};n-1)}}\right)$$

Przedziały jednostronne

$$\left(0, \sqrt{\frac{\mathrm{var}X}{\chi^2\left(\alpha; n-1\right)}}\right)$$

$$\left(\sqrt{\frac{\mathrm{var}X}{\chi^2\left(1-\alpha;n-1\right)}},\infty\right)$$

Przykład (cd).

Przedział ufności dla odchylenia standardowego:

$$(\sqrt{0.019}, \sqrt{0.133}) = (0.136, 0.365)$$

Oszacować zróżnicowanie ilości punktów uzyskiwanych na klasówce.

$$n = 300$$
 $\sum x_i = 176.566$ $\sum x_i^2 = 107.845302$

Populacja:

Słuchacze podstawowego kursu statystyki

Cecha X:

ilość punktów zdobytych na klasówce

Założenie:

cecha X ma rozkład normalny $N(\mu, \sigma^2)$

Zadanie: oszacować parametr σ

Technika statystyczna:

przedział ufności dla odchylenia standardowego poziom ufności 0.95

$$\bar{x} = 0.589 \quad \text{var} X = 3.92679$$

$$\chi^2 \left(\frac{\alpha}{2}; n - 1\right) = \chi^2 \left(0.025; 299\right) = 348.79420$$

$$\chi^2 \left(1 - \frac{\alpha}{2}; n - 1\right) = \chi^2 \left(0.975; 299\right) = 252.99251$$

$$\left(\sqrt{\frac{3.92679}{348.79420}}, \sqrt{\frac{3.92679}{252.99251}}\right) = (0.10610, 0.12458)$$

Odpowiedź: $\sigma \in (0.10610, 0.12458)$

Wniosek. Odchylenie standardowe liczby punktów zdobywanych na klasówce jest liczbą z przedziału (0.106, 0.125). Zaufanie do tego wniosku wynosi 95%.

Rozkład dwupunktowy Estymacja parametru

p — frakcja, wskaźnik struktury

Próba:
$$X_1, \ldots, X_n \ (X_i = 0 \text{ lub } = 1)$$

$$k = \sum_{i=1}^{n} X_i$$
 — ilość jedynek (sukcesów)

Estymator punktowy:

$$\hat{p} = \frac{k}{n}$$

Przedział ufności na poziomie ufności $1 - \alpha$

$$\left(p_1\left(1-\frac{\alpha}{2};k,n-k\right),\quad 1-p_1\left(1-\frac{\alpha}{2};n-k,k\right)\right)$$

Jednostronne przedziały ufności

$$(p_1(1-\alpha;k,n-k),1)$$

$$(0, 1 - p_1 (1 - \alpha; n - k, k))$$

Wśród 20 zbadanych detali znaleziono dwa braki. Ocenić na tej podstawie wadliwość produkcji.

Cecha X — jakość detalu (dobry, zły). Sukces — detal wybrakowany Pytanie: p = ?

$$n = 20, \ k = 2 \Longrightarrow \hat{p} = 2/20 = 0.1$$

Poziom ufności $1 - \alpha = 0.9$, czyli $\alpha = 0.1$

$$p_1\left(1 - \frac{\alpha}{2}; k, n - k\right) = p_1(0.95; 2, 18) = 0.0123$$
$$p_1\left(1 - \frac{\alpha}{2}; n - k, k\right) = p_1(0.95; 18, 2) = 0.6830$$
$$(0.0123, 1 - 0.6830) = (0.0123, 0.3170)$$

Wniosek. Wadliwość produkcji wyraża się liczbą z przedziału (1.23%, 31.70%). Zaufanie do wniosku wynosi 90%.

Przybliżony przedział ufności

$$\left(\hat{p} - u_{1-\alpha/2}\sqrt{\frac{\hat{p}(1-\hat{p})}{n}}, \ \hat{p} + u_{1-\alpha/2}\sqrt{\frac{\hat{p}(1-\hat{p})}{n}}\right)$$

 u_{α} jest kwantylem rzędu α rozkładu N(0,1).

Przykład. (cd)

$$n = 200, \ k = 20 \Longrightarrow \hat{p} = 20/200 = 0.1$$

Poziom ufności $1 - \alpha = 0.9$, czyli $\alpha = 0.1$

$$u_{1-\alpha/2} = u_{0.95} = 1.6449$$

$$0.1 - 1.6449\sqrt{\frac{0.1(1 - 0.1)}{200}} = 0.0651$$

$$0.1 + 1.6449\sqrt{\frac{0.1(1-0.1)}{200}} = 0.1349$$

Wniosek. Wadliwość produkcji wyraża się liczbą z przedziału (6.51%, 13.49%). Zaufanie do wniosku wynosi 90%.

Oszacować odsetek ocen dostatecznych otrzymywanych na klasówce.

$$n = 300$$
 $k = 88$

Populacja:

Słuchacze podstawowego kursu statystyki

Cecha X:

ocena dostateczna z klasówki

Założenie:

cecha X ma rozkład D(p)

Zadanie: oszacować parametr p

Technika statystyczna:

przybliżony przedział ufności dla prawdopodobieństwa

poziom ufności 0.95

$$\widehat{p} = \frac{88}{300} = 0.29$$

$$u_{1-\alpha/2} = u_{0.975} = 1.96$$

$$0.29 - 1.96\sqrt{\frac{0.29(1 - 0.29)}{300}} = 0.2387$$

$$0.29 + 1.96\sqrt{\frac{0.29(1 - 0.29)}{300}} = 0.3413$$

Odpowiedź: $p \in (0.2387, 0.3413)$

Wniosek.

Odsetek ocen dostatecznych zdobywanych na klasówce jest liczbą z przedziału (23.87%, 34.13%). Zaufanie do tego wniosku wynosi 95%.

Porównanie dwóch rozkładów normalnych

Założenia:

- 1. $X_1 \sim N(\mu_1, \sigma_1^2), X_2 \sim N(\mu_2, \sigma_2^2)$
- 2. X_1, X_2 są niezależne

Ocena $\mu_1 - \mu_2$ oraz σ_1^2/σ_2^2 .

Próby: $X_{11}, \ldots, X_{1n_1}; X_{21}, \ldots, X_{2n_2}$

$$\bar{X}_1$$
, $\operatorname{var} X_1$, $s_1^2 = \frac{\operatorname{var} X_1}{n_1 - 1}$

$$\bar{X}_2$$
, $\operatorname{var} X_2$, $s_2^2 = \frac{\operatorname{var} X_2}{n_2 - 1}$

Ocena różnicy między średnimi $\mu_1 - \mu_2$

Ocena punktowa: $\bar{X}_1 - \bar{X}_2$

Przedział ufności (poziom ufności $1-\alpha$)

1. Założenie $\sigma_1^2 = \sigma_2^2$

$$(\bar{X}_1 - \bar{X}_2 - t(\alpha; n_1 + n_2 - 2)s_r, \bar{X}_1 - \bar{X}_2 + t(\alpha; n_1 + n_2 - 2)s_r)$$

$$s_e^2 = \frac{\text{var}X_1 + \text{var}X_2}{n_1 + n_2 - 2}, \quad s_r^2 = s_e^2 \left(\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}\right)$$

2. Bez założenia $\sigma_1^2 = \sigma_2^2$

$$(\bar{X}_1 - \bar{X}_2 - V(\alpha; n_1 - 1, n_2 - 1, c)s_r, \bar{X}_1 - \bar{X}_2 + V(\alpha; n_1 - 1, n_2 - 1, c)s_r)$$

$$s_r^2 = \left(\frac{s_1^2}{n_1} + \frac{s_2^2}{n_2}\right)$$
 $c = \frac{s_1^2/n_1}{s_1^2/n_1 + s_2^2/n_2}$

 $V(\alpha; n_1 - 1, n_2 - 1, c)$ — wartość krytyczna testu Behrensa–Fishera

Przykład. Ocenić różnicę między średnimi wynikami klasówki pań i panów.

Panowie:

$$n_1 = 138$$
, $\sum x_{1i} = 82.833$, $\text{var}x_1 = 1.65841$

Panie:

$$n_2 = 162$$
, $\sum x_{2i} = 93.733$, $var x_2 = 2.23348$

Populacja 1:

Słuchacze podstawowego kursu statystyki

Populacja 2:

Słuchaczki podstawowego kursu statystyki

Cecha X: ilość punktów zdobytych na klasówce

Założenie:

cecha X ma w populacji 1 rozkład $N(\mu_1, \sigma_1^2)$ cecha X ma w populacji 2 rozkład $N(\mu_2, \sigma_2^2)$ $\sigma_1^2 = \sigma_2^2$

Zadanie: oszacować różnicę $\mu_1 - \mu_2$

Technika statystyczna:

przedział ufności t dla różnicy średnich poziom ufności 0.95

$$\bar{x}_1 = 0.60024, \quad \bar{x}_2 = 0.57860,$$

$$s_r^2 = \frac{1.65841 + 2.23348}{138 + 162 - 2} \left(\frac{1}{138} + \frac{1}{162}\right)$$
$$= 0.000175255$$

$$t(0.05; 298) \approx 1.96; \quad t(0.05; 298)s_r = 0.02595$$

$$(0.60024 - 0.57860 \pm 0.00034) = (-0.00431, 0.04759)$$

Odpowiedź: $\mu_1 - \mu_2 \in (-0.00431, 0.04759)$

Wniosek.

Różnica średnich ilości punktów zdobywanych na klasówce przez panie i panów jest liczbą z przedziału (-0.00431, 0.04759). Zaufanie do tego wniosku wynosi 95%.

Sugestia. Ponieważ przedział "obejmuje" zero, więc można uznać, że $\mu_1 = \mu_2$.

Ocena ilorazu wariancji σ_1^2/σ_2^2

Ocena punktowa: S_1^2/S_2^2

Przedział ufności (poziom ufności $1-\alpha$)

$$\left(\frac{S_1^2}{S_2^2} \cdot F\left(1 - \frac{\alpha}{2}; n_1 - 1, n_2 - 1\right), \frac{S_1^2}{S_2^2} \cdot F\left(\frac{\alpha}{2}; n_1 - 1, n_2 - 1\right)\right)$$

 $F\left(\alpha;u,v\right)$ jest stablicowaną wartością krytyczną rozkładu F--Snedecora (Fishera–Snedecora)

$$F(1 - \alpha; u, v) = \frac{1}{F(\alpha; v, u)}$$

Przykład. Porównać zróżnicowanie ocen wyników klasówek pań i panów.

Panowie:

$$n_1 = 138$$
, $\sum x_{1i} = 82.833$, $\text{var} x_1 = 1.65841$

Panie:

$$n_2 = 162, \quad \sum x_{2i} = 93.733, \quad \text{var} x_2 = 2.23348$$

Populacja 1:

Słuchacze podstawowego kursu statystyki

Populacja 2:

Słuchaczki podstawowego kursu statystyki

Cecha X: ilość punktów zdobytych na klasówce

Założenie:

cecha X ma w populacji 1 rozkład $N(\mu_1, \sigma_1^2)$ cecha X ma w populacji 2 rozkład $N(\mu_2, \sigma_2^2)$

Zadanie: oszacować iloraz σ_1^2/σ_2^2

Technika statystyczna:

przedział ufności dla ilorazu wariancji poziom ufności 0.90

$$s_1^2 = \frac{1.65841}{138 - 1} = 0.01211, \quad s_2^2 = \frac{2.23348}{162 - 1} = 0.01387,$$

$$F(0.05; 137, 161) = 1.30936$$

$$F(0.95; 137, 161) = \frac{1}{F(0.05; 161, 137)}$$

$$= \frac{1}{1.31386} = 0.76111$$

$$\left(\frac{0.01211}{0.01387} \cdot 0.76111, \frac{0.01211}{0.0138} \cdot 1.30936\right)$$

$$= (0.66415, 1.14255)$$

Odpowiedź: $\sigma_1^2/\sigma_2^2 \in (0.66415, 1.14255)$

Wniosek.

Iloraz wariancji ilości punktów zdobywanych na klasówce jest liczbą z przedziału (0.66415, 1.14255). Zaufanie do tego wniosku wynosi 90%.

Sugestia. Ponieważ przedział "obejmuje" jedynkę, więc można uznać, że $\sigma_1^2 = \sigma_2^2$.

Porównanie dwóch rozkładów dwupunktowych

Założenia:

1. $X_1 \sim D(p_1), X_2 \sim D(p_2)$

2. X_1, X_2 są niezależne

Ocena $p_1 - p_2$.

Próby: $X_{11}, \dots, X_{1n_1}; X_{21}, \dots, X_{2n_2} (X_{ij} = 0 \text{ lub } 1)$

$$k_1 = \sum_{i=1}^{n_1} X_{1i}$$
 $k_2 = \sum_{i=1}^{n_2} X_{12}$

$$\hat{p}_1 = k_1/n_1$$
 $\hat{p}_2 = k_2/n_2$ $\hat{p} = (k_1 + k_2)/(n_1 + n_2)$

Przedział ufności (poziom ufności $1-\alpha$)

$$\left(\hat{p}_1 - \hat{p}_2 - u_{1-\frac{\alpha}{2}}\sqrt{\hat{p}(1-\hat{p})\left(\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}\right)},\right)$$

$$\hat{p}_1 - \hat{p}_2 + u_{1-\frac{\alpha}{2}} \sqrt{\hat{p}(1-\hat{p})\left(\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}\right)}$$

Oszacować różnicę między "niezaliczalnością" klasówki ze statystyki przez panie i panów. Na podstawie dotychczasowych danych wiadomo, że na 162 pań nie zaliczyło klasówki 46 pań oraz na 138 panów 30 uzyskało ocenę negatywną.

Populacja 1:

Słuchacze podstawowego kursu statystyki

Populacja 2:

Słuchaczki podstawowego kursu statystyki

Cecha X: uzyskanie z klasówki oceny negatywnej

Założenie:

cecha X ma w populacji 1 rozkład $D(p_1)$ cecha X ma w populacji 2 rozkład $D(p_2)$

Zadanie: oszacować różnicę $p_1 - p_2$

Technika statystyczna:

przybliżony przedział ufności dla różnicy prawdopodobieństw

poziom ufności 0.95: $u_{0.975} = 1.96$

$$n_1 = 162 \quad k_1 = 46 \qquad n_2 = 138 \quad k_2 = 30$$

$$\hat{p}_1 = \frac{k_1}{n_1} = \frac{46}{162} = 0.2840 \quad \hat{p}_2 = \frac{k_2}{n_2} = \frac{30}{138} = 0.2174$$

$$\hat{p} = \frac{(k_1 + k_2)}{(n_1 + n_2)} = \frac{(46 + 30)}{(162 + 138)} = 0.2533$$

$$1.96 \cdot \sqrt{\frac{0.2533(1 - 0.2533)}{300}} \left(\frac{1}{162} + \frac{1}{138}\right) = 0.0987$$

$$(0.2840 - 0.2174 - 0.0987, 0.2840 - 0.2174 + 0.0987)$$
 $(-0.0321, 0.1653)$

Wniosek. Różnica prawdopodobieństw jest liczbą z przedziału $(-0.0321,\ 0.1653)$.

Sugestia. Ponieważ przedział "obejmuje" zero, więc odsetki pań i panów niezaliczających klasówki można traktować jako porównywalne.