

일원배치 분산분석

정의

- 개요

1. 평균이 $\mu_1, \mu_2 \dots \mu_b$ 로 다르고, 공통분산이 σ^2 인 정규분포를 따르는 b개의 확률변수 X_1, \dots, X_b 를 정의하자.
 - 1) 각각의 확률변수에서 추출한 확률표본 X_{ab} 을 $N(\mu_i, \sigma^2)$ 을 따르는 iid라고 하자.
 - 2) 이 때, 관측값에 대한 어떤 모형
 - (1) $x_{ij} = \mu_j + e_{ij}$ 를 고려하자.
 - (2) 단, 이 때 $e_{ij} \sim N(0, \sigma^2)$ 를 따른다.
 - 3) 이제, 가설 $\langle H_0 : \mu_1 = \mu_2 = \dots = \mu_b \text{ VS } H_1 : \text{적어도 하나는 같지 않다} \rangle$ 를 검증한다.
 - (1) 총 모수공간 $\Omega = \{(\mu_1, \mu_2, \dots, \mu_b, \sigma^2) : -\infty < \mu_j < \infty, 0 < \sigma^2 < \infty\}$ 으로 놓고
 - (2) 가설공간 $w = \{(\mu_1, \mu_2, \dots, \mu_b, \sigma^2) : -\infty < \mu_1 = \mu_2 = \dots = \mu_b < \infty, 0 < \sigma^2 < \infty\}$

정의

- 개요

3) 우도비함수를 정의하면

$$(1) L(\Omega) = \left[\frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma} \right]^{\frac{ab}{2}} \exp \left(-\frac{\sum \sum (x_{ij} - \mu)^2}{2\sigma^2} \right)$$

$$(2) L(w) = \left[\frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma} \right]^{\frac{ab}{2}} \exp \left(-\frac{\sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2}{2\sigma^2} \right)$$

4) 우도비 검정을 정의하기 위해 MLE 추정량을 구하면

(1) $\log L(w)$

$$- \frac{\partial \log L(w)}{\partial \mu} = \frac{\partial \left(\frac{ab}{2} \log 2\pi\sigma + \left[-\frac{1}{2\sigma^2} \sum \sum (x_{ij} - \mu)^2 \right] \right)}{\partial \mu} = \frac{\sum \sum (x_{ij} - \mu)}{\sigma^2} = 0$$

$$\text{따라서 } \sum \sum x_{ij} - ab\mu = 0 \text{에서 } \hat{\mu} = \frac{\sum \sum x_{ij}}{ab}$$

정의

- 개요

4) 우도비 검정을 정의하기 위해 MLE 추정량을 구하면

(1) $\log L(w)$

$$- \frac{\partial \log L(w)}{\partial \sigma^2} = \frac{\partial \left(\frac{ab}{2} \log 2\pi\sigma + \left[-\frac{1}{2\sigma^2} \sum \sum (x_{ij} - \mu)^2 \right] \right)}{\partial \sigma^2} = -\frac{ab}{2\sigma^2} + \frac{1}{2\sigma^4} \sum \sum (x_{ij} - \mu)^2 = 0$$

$$\text{따라서 } -\frac{ab}{2\sigma^2} + \frac{1}{2\sigma^4} \sum \sum (x_{ij} - \mu)^2 = 0 \text{ 에서 } \widehat{\sigma^2} = \frac{\sum \sum (x_{ij} - \mu)^2}{ab}$$

$$(2) \text{ 따라서 } L(\widehat{w}) = \left[\frac{ab}{2\pi \sum \sum (x_{ij} - \mu)^2} \right]^{\frac{ab}{2}} \exp \left(-\frac{ab \sum \sum (x_{ij} - \mu)^2}{2 \sum \sum (x_{ij} - \mu)^2} \right) = \left[\frac{ab}{2\pi \sum \sum (x_{ij} - \mu)^2} \right]^{\frac{ab}{2}} \exp \left(-\frac{ab}{2} \right)$$

정의

- 개요

4) 우도비 검정을 정의하기 위해 MLE 추정량을 구하면

(3) $\log L(\Omega)$

$$- \frac{\partial \log L(\Omega)}{\partial \mu_j} = \frac{\partial \left(\frac{ab}{2} \log 2\pi\sigma^2 + \left[-\frac{1}{2\sigma^2} \sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2 \right] \right)}{\partial \mu_j} = \frac{\sum \sum (x_{ij} - \mu_j)}{\sigma^2} = 0$$

따라서 $\sum \sum x_{ij} - a\mu_j = 0$ 에서 $\widehat{\mu_j} = \frac{\sum \sum x_{ij}}{a}$ (단, $j = b$ 인 경우)

$$- \frac{\partial \log L(\Omega)}{\partial \sigma^2} = \frac{\partial \left(\frac{ab}{2} \log 2\pi\sigma^2 + \left[-\frac{1}{2\sigma^2} \sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2 \right] \right)}{\partial \sigma^2} = -\frac{ab}{2\sigma^2} + \frac{1}{2\sigma^4} \sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2 = 0$$

따라서 $-\frac{ab}{2\sigma^2} + \frac{1}{2\sigma^4} \sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2 = 0$ 에서 $\widehat{\sigma^2} = \frac{\sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2}{ab}$

$$(4) L(\hat{\Omega}) = \left[\frac{ab}{2\pi \sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2} \right]^{\frac{ab}{2}} \exp \left(-\frac{ab \sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2}{2 \sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2} \right) = \left[\frac{ab}{2\pi \sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2} \right]^{\frac{ab}{2}} \exp \left(-\frac{ab}{2} \right)$$

정의

- 개요

5) 정리해서 우도비를 정의하면

$$(1) \frac{L(\hat{\omega})}{L(\hat{\Omega})} = \frac{\left[\frac{ab}{2\pi \sum \sum (x_{ij} - \mu)^2} \right]^{\frac{ab}{2}} \exp\left(-\frac{ab}{2}\right)}{\left[\frac{ab}{2\pi \sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2} \right]^{\frac{ab}{2}} \exp\left(-\frac{ab}{2}\right)} = \left[\frac{\sum \sum (x_{ij} - \mu)^2}{\sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2} \right]^{\frac{ab}{2}}$$

(2) $\sum \sum (x_{ij} - \mu)^2$ 혹은 $\sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2$ 는 정규분포의 완비충분통계량 $Y = \sum \sum x_{ij}^2$ 의 함수이다.

정의

- 개요

6) 따라서 $g_1(Y) = \sum \sum (x_{ij} - \mu)^2$ 혹은 $g_2(Y) = \sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2$ 를 잘 알려진 어떤 분포로 변환하면

(1) $\frac{\sum \sum (x_{ij} - \mu)^2}{ab}$ 는 실2차형식 $\frac{Q}{ab}$ 와 같고

(2) $\frac{\sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2}{ab}$ 는 실2차형식 $\frac{Q_3}{ab}$ 와 같다.

$$7) \left[\frac{L(\hat{w})}{L(\hat{\Omega})} \right]^{\frac{ab}{2}} = \left[\frac{\frac{\sum \sum (x_{ij} - \mu)^2}{ab}}{\frac{\sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2}{ab}} \right]^{\frac{ab}{2}} = \left[\frac{\sum \sum (x_{ij} - \mu)^2}{\sum \sum (x_{ij} - \mu_j)^2} \right]^{\frac{ab}{2}} = \left[\frac{Q_3}{Q} \right]^{\frac{ab}{2}} = \Lambda$$

(1) 따라서 $[\Lambda]^{\frac{ab}{2}} = \frac{Q_3}{Q} = Y$ 이다.