ISTx1002 Usikkerhet og støy i målinger

Feilforplantning i målesysemer; Kalibrering

Stefanie Muff, Institutt for matematiske fag, NTNU Trondheim

Oktober 24 og 30, 2023

Plan for i dag (15:15-16:00) og mandag 15:15-16:00

- Tema 1: Feilforplantning i målesystemer
- Tema 2: Kalibrering

Pensum og læringsressurser

Husk lenken til den eksterne modulsiden:

https://wiki.math.ntnu.no/istx1002/2023h/start

Pensum del 2:

- **Korte videoer**: (by Charles H. A. Curry)
  - Målefunksjoner og kombinert standardavvik (7:08)
  - Kalibrering (5:06)
- Denne forelesningen
- **Disse slides** med alle notater og beregninger som er vist fram

Målesystemer

Et **målesystem** beskriver en sammenheng mellom én eller flere inngangsstørrelser og den størrelsen vi egentlig vi måle.

Eksempel:

- Vi skal måle volumet til en gjenstand som er en sylinder med høyde h og diameter d. Volumet er gitt ved

$$V(d,h) = \pi d^2 h \ .$$

- **Målefunksjonen** defineres som $V(d,h)$ og ses som funksjon av variablene d og h.

Feilforplantning i målesystemer

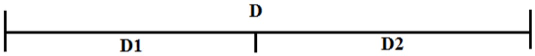
Vi har sett på standard usikkerhet i en eneste variabel. Nå skal vi gjøre ting litt mer kompliserte:

1) Usikkerhet i en lineær *målefunksjon* av flere variabler
2) Usikkerhet i en ikke-lineær *målefunksjon* av en variabel $f(X)$
3) Usikkerhet i en ikke-lineær *målefunksjon* av flere variabler $f(X, Y)$ for ukorrelerte X, Y
4) Usikkerhet i en ikke-lineær *målefunksjon* av flere variabler $f(X, Y)$ for korrelerte X, Y

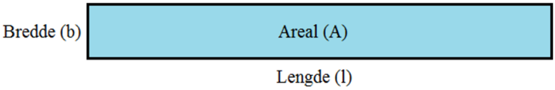
Kombinert standard usikkerhet (eller "feilforplantning")

Eksempler:

- Mål summen av flere deler (X_1, X_2,..), slik at du tar $X_1 + X_2 + ... + X_n$ (oppgave 3a og b i prosjektet).



- Mål lengde (l) og bredde (b) til en rektangel og beregn arealet $A = f(l, b) = l \cdot b$ (oppgave 3c-e i prosjektet).



- Mål en størrelse X, men så er du interessert i en transformert versjon, for eksempel X^2 (tenk at du vil måle arealeat til en firkant).
- Mål masse m og hastighet v av et objekt og beregn bevegelsesenergi $f(m, v) = \frac{1}{2}mv^2$.

Og alle størrelser vi måler har forskjelle grader av usikkerhet som “forplanter” seg videre til den endelige størrelsen vi egentlig vil måle.

1) Lineære kombinasjoner av variabler

Problemstilling: Vi har to variabler, X_1 og X_2, som måler steglengden til to forskjellige personer. Vi vet at de typiske steglengdene er $\mu_1 = 75$cm og $\mu_2 = 82$cm med standard usikkerhet $u(X_1) = 6$ og $u(X_2) = 9$cm. Vi antar steglengdene er uavhengige ($\mathrm{Cov}(X_1, X_2) = 0$).

a) Hva er forventningsverdien og standard usikkerheten i summen av 5 uavhengige steg gått av person 1?

b) Hva er standard usikkerheten i gjennomsnittig steglengde til de to personene?

Generell regel:

For en kombinert størrelse

$$Y = f(X_1, \dots, X_n) = a_1 X_1 + a_2 X_2 + \dots + a_n X_n$$

kan vi beregne variansen som

$$\begin{aligned}\mathrm{Var}(Y) =& a_1^2 \mathrm{Var}(X_1) + a_2^2 \mathrm{Var}(X_2) + \dots + a_n^2 \mathrm{Var}(X_n) \\ &+ 2 \sum_{i=1}^{n-1} \sum_{j=i+1}^{n} \mathrm{Cov}(X_i, X_j) \ .\end{aligned}$$

Husk: $\mathrm{Var}(X) = u^2(X)$, fordi standard usikkerheten er bare standardavviket av størrelsen.

Nå kan vi beregne løsningen for problemstillingen ovenfor:

2) Transformert versjon av en variabel

Problemstilling: Du måler lengden X til en firkant med 55cm (nøyaktigheten er bare 1cm), og så vil du beregne arealet til firkanten. Hva er standard usikkerheten i arealmålingen?

- 55cm med en standard usikkerhet (standardavvik) som er firkantfordelt, og derfor...

- Men hvordan bruker vi det når vi må gange X med seg selv...?

Usikkerheten i en transformert variabel $f(X)$

Generell regel:
Når vi har en variabel X som vi kan måle og vet usikkerheten $u(X)$, men vi er interessert i en transformert version $f(X)$ (for eksempel $f(X) = X^2$, $\log(X)$,...), kan vi bruke det følgende:

Trick: Taylor approximasjon
For en gitt måleverdi μ har vi omtrent

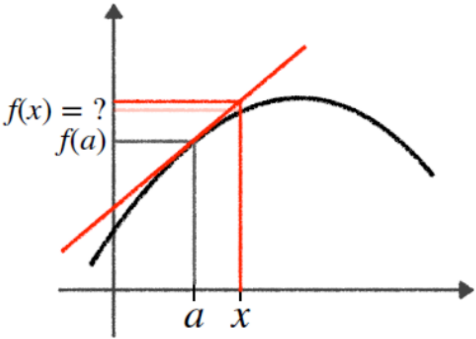
$$\begin{aligned} f(X) &\approx f(\mu) + f'(\mu)(X - \mu) \\ &= \underbrace{[f(\mu) - f'(\mu)\mu]}_{a} + \underbrace{f'(\mu)}_{b} \cdot X \end{aligned}$$

Derfor har vi omtrent

$$\mathrm{Var}(f(X)) = \underbrace{f'(\mu)^2}_{b^2} \cdot \underbrace{\mathrm{Var}(X)}_{u^2(X)} \ .$$

$$\text{Eller:} \quad u(f(X)) = \sqrt{f'(\mu)^2 \cdot u^2(X)} \ .$$

Visualisering: Taylor approximasjon i 1 dimension:



$$f(x) \approx f(a) + \boxed{f'(a)} \cdot (x - a)$$

$f'(a)$ heter følsomhet eller følsomhetsfaktor.

Nå kan vi beregne arealet og approximert usikkerhet til arealet for firkanten:

3) Ikke-lineær *kombinasjon* av flere variabler $f(X_1, X_2)$, med ukorrelerte X_1, X_2

Problemstilling: Vi vil beregne bevegelsesenergi til et objekt og måler

- masse $m_0 = 0.45, u(m) = 0.01 kg$
- hastighet $v_0 = 10.8, u(v) = 0.05 m/s$

Hva er usikkerheten i den beregnete begevelsesenergien?

$$f(m, x) = \frac{1}{2} m v^2$$

Hvordan går vi frem i flere dimensioner?

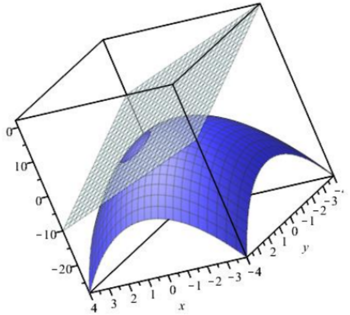
Generell regel:

Trick: Taylor approximasjon (igjen) for flere dimensioner

For gitte måleverdier μ_1 og μ_2 av en funksjon $f(X_1, X_2)$ har vi omtrent

$$\begin{aligned} f(X_1, X_2) \approx\, & f(\mu_1, \mu_2) \\ & + \underbrace{\frac{\partial f}{\partial X_1}(\mu_1, \mu_2)}_{a}(X_1 - \mu_1) + \underbrace{\frac{\partial f}{\partial X_2}(\mu_1, \mu_2)}_{b}(X_2 - \mu_2) \end{aligned}$$

Visualisering: Taylor approximasjon 2 dimensioner:



$$
\begin{aligned}
&f(x,y)\\
&\approx f(a,b) + \frac{\partial f}{\partial x}(a,b)\cdot(x-a)\\
&+\frac{\partial f}{\partial y}(a,b)\cdot(y-a)
\end{aligned}
$$

$\frac{\partial f}{\partial x}(a,b)$ og $\frac{\partial f}{\partial y}(a,b)$ heter følsomhet eller følsomhetsfaktorer.

Og derfor er

$$\mathrm{Var}(f(X_1, X_2)) \approx \underbrace{\left(\frac{\partial f}{\partial X_1}(\mu_1, \mu_2)\right)^2}_{a^2} \mathrm{Var}(X_1) + \underbrace{\left(\frac{\partial f}{\partial X_2}(\mu_1, \mu_2)\right)^2}_{b^2} \mathrm{Var}(X_2)$$

$$\Rightarrow u(f(X_1, X_2)) \approx \sqrt{a^2 \mathrm{Var}(X_1) + b^2 \mathrm{Var}(X_2)}$$

Nå kan vi beregne bevegelsesenergien og approximert usikkerhet:

4) Ikke-lineær *kombinasjon* av flere variabler $f(X,Y)$, med korrelerte X, Y

Generell regel:

$$\begin{aligned}\mathrm{Var}(f(X_1,X_2)) \approx & \left(\frac{\partial f}{\partial X_1}(\mu_1,\mu_2)\right)^2 \mathrm{Var}(X_1) \\ & + \left(\frac{\partial f}{\partial X_2}(\mu_1,\mu_2)\right)^2 \mathrm{Var}(X_2) \\ & + 2\cdot\frac{\partial f}{\partial X_1}\frac{\partial f}{\partial X_2} u(X_1,X_2)\ ,\end{aligned}$$

hvor $u(X_1,X_2) = u(X_1)u(X_2)\mathrm{Cor}(X_1,X_2)$.

Det må dere ikke lære utenat.

Men husk: sterkere korrelasjoner mellom X_1 og X_2 betyr større avvik fra tilfelle 3) hvor vi hadde uavhengige variabler.

Kalibrering – grunnlegende idé

- Prosessen hvor vi presiserer forhold mellom målte og ekte verdier (eller nominell og ekte verdi).

- Retting av **systematisk feil**, for eksempel i et måleinstrument.

- For å kalibrere, sammenligner vi resultatene av målinger fra et instrument med verdier fra en annen kilde som vi vet er mer nøyaktig (3-5 ganger nøyaktigere).

- Eksempler: Mål en kjent kilde på 100V, en kjent lengde på 10m eller en kjent vekt på 1kg.

Kalibrering eksempel: Voltmeter

Vi måler en kjent kilde på 100V med to voltmetere, 10 ganger hver:

	A	B
1	100,5	90,0
2	95,5	92,0
3	101,5	91,5
4	104,0	90,5
5	100,5	89,5
6	103,0	90,0
7	99,5	91,0
8	101,0	89,5
9	98,5	88,5
10	103,0	92,0
gjennomsnitt	100,7	90,45
standardavvik	2,49	1,17

- Hva vet vi nå om de to voltmetere? Hva ville du gjort hvis du må bruke en av disse to voltmetere?

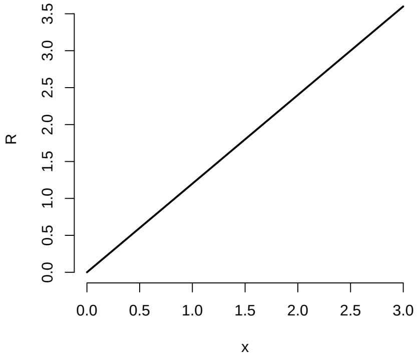
- Hva er *usikkerheten* i de to estimatene av systematisk feil?

- Hvilket voltmeter vil du heller bruke, og hvorfor?

- Hvordan går du frem hvis du egentlig vil måle en spenning på omtrent 200V eller 25V med en av de to voltmetere?

Kalibreringskurver

- Det er mulig at samme voltmeter som underestimerer når den skulle måle 100V, er mye nærmere den ekte verdien når den skulle måle 200V.
- Mer generelt måler vi en størrelse R som har en lineær sammenheng med en størrelse x vi er interessert i.



- Kalibreringskurven kan beskrives som

$$R = k \cdot x \ ,$$

hvor k skal estimeres, eller

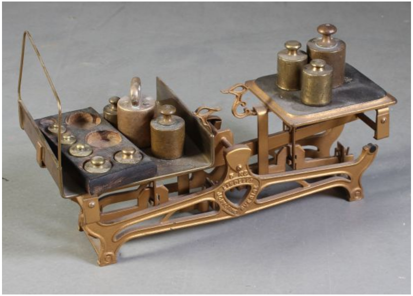
$$R = a + k \cdot x$$

hvis response ikke kan antas a være lik når $x = 0$.

- Når vi kan anta at R er normalfordelt, kan vi bruke minste kvadratsumme (lineær regresjon) for å finne k.

Eksempel 1: Kalibrering av et lodd

Her regner vi eksempelet for kalibrering av et lodd:



Et lodd med ukjent masse M_x på ca 10g skal kalibreres mot et 10g referanselodd.

1. Referanseloddet hadde ved siste kalibreringen massen $M_r = 10.005g$ og er antatt normalfordelt med standardavvik av $22.5mg$.
2. Mulig drift i referanseloddets masse siden kalibreringen: $\delta M_r = 0$ med maksimal $\pm 15.5mg$.
3. Målt differanse: Ukjent lodd - referanselodd: Ved 20 gjennomtatte målinger er gjennomsnitt $M_{diff} = 20mg$ med standardavvik $S = 64.6mg$, og derfor er standardavviket for middelverdien $S/\sqrt{20} = 14.4mg$.

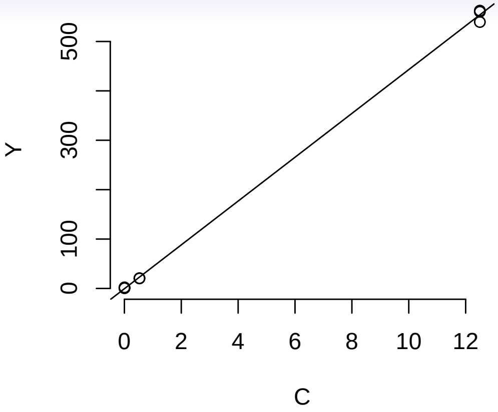
Oppgave: Angi et godt estimat for verdien av det ukjente loddet og standard usikkerheten til den verdien.

Løsning:

Eksempel 2: Kalibreringskurve

Vi er interessert i konsentrasjonen C av en radioaktiv stoff i en bergart. Siden det er vanskelig å måle den direkte, kan vi måle radon (en radioaktiv gass) som dannes av stoffen i bergarten. For å finne ut på relasjonen mellom konsentrasjon i steinen (C) og radon i luften (Y), måler vi åtte ganger strålingsintensiteten i tre kjente konsentrasjoner av uran:

prøve	Y_i	C_i
1	0.64	0.0036
2	0.67	0.0036
3	2.19	0.0036
4	20.35	0.53
5	20.80	0.53
6	539.4	12.5
7	560.2	12.5
8	562.4	12.5



Vi kan tilpasse en lineær regresjonslinje:

$$Y = k \cdot C$$

med estimert $\hat{k} = 44.36$ og $sd(\hat{k}) = u(\hat{k}) = 0.45$.

Anta vi har målt en spesifisk stråleintensitet $y = 120$ i luften. Så vil vi vite to ting:

1) Hva er den estimerte konsentrasjonen i bergarten?
2) Hva er standard usikkerheten i estimatet?

Løsning:

1)

$$\hat{c} = \frac{y}{\hat{k}} = \frac{120}{44.36} = 2.71$$

2) Usikkerheten er litt mer vanskelig å bestemme, og det finnes mer teoretiske og mer empiriske måter. Her gjør vi det empirisk og beregner forskjellen mellom de estimerte C_i verdiene med de observerte (det er et slags "residual", men for x-variablen istendenfor y)

$$W_i = \frac{Y_i}{\hat{k}} - C_i \ ,$$

og så tar vi standardavviket av alle W_i, $s = \sqrt{\frac{(W_i - \overline{W})^2}{n-1}} = 0.16$