

Лекция 7  
(продолжение)

# Проверка статистических гипотез

# Критерий согласия хи-квадрат Пирсона

Разработан первоначально для **дискретных распределений**:

$X$	$x_1$	$\dots$	$x_L$
$P$	$p_1$	$\dots$	$p_L$

Статистический ряд:

$X$	$x_1$	$\dots$	$x_L$	$v_1 + \dots + v_L = N$
$v$	$v_1$	$\dots$	$v_L$	

**Нулевая гипотеза:** исследуемая случайная величина имеет заданный закон распределения.

Статистика критерия:

$$\chi^2 = \chi^2 (X_1, X_2, \dots, X_L) = \sum_{l=1}^L \frac{(v_l - Np_l)^2}{Np_l}$$

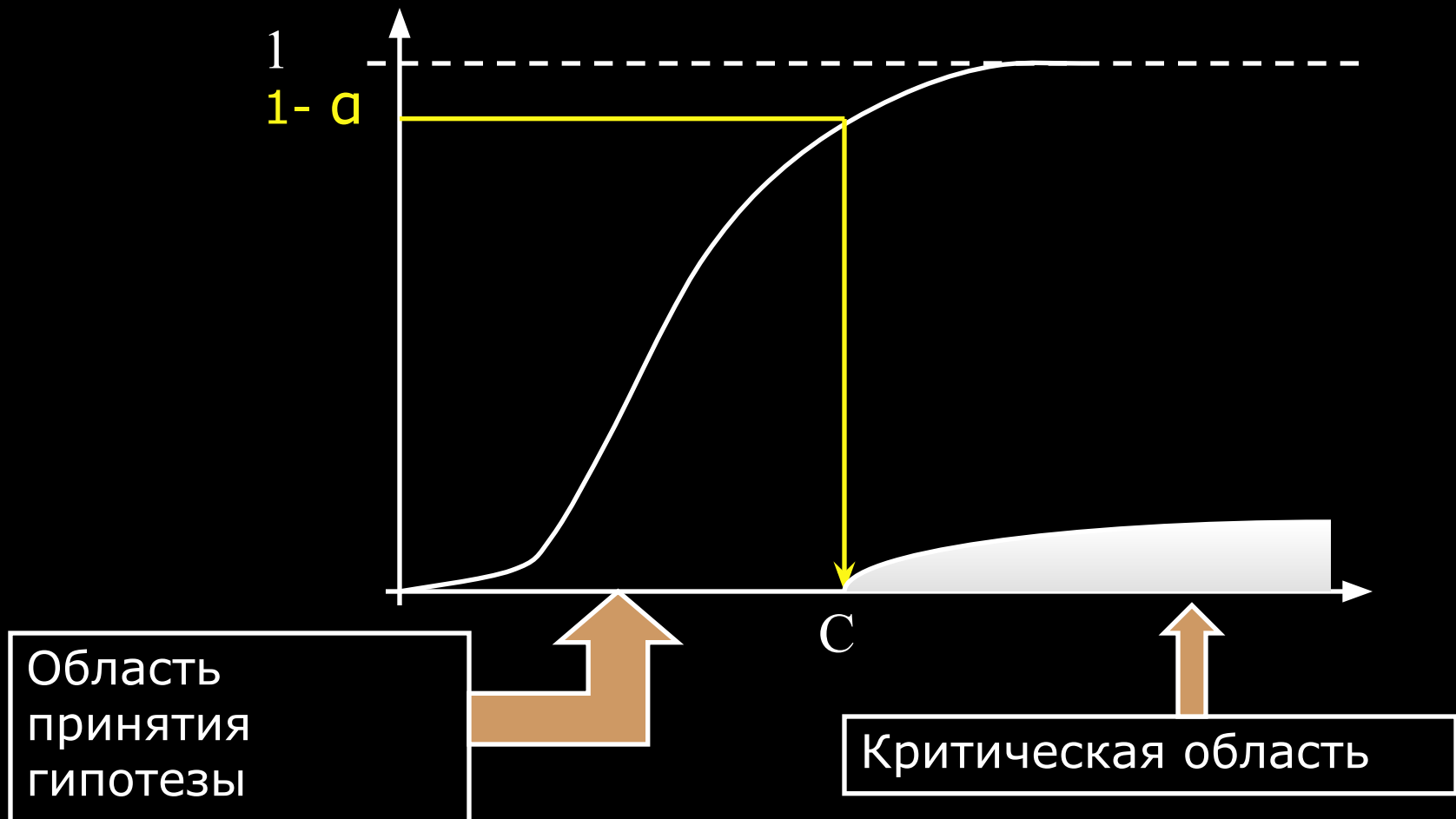
Является мерой близости теоретических вероятностей  $P_l$  и эмпирических (экспериментальных) частот  $v_l$

Имеет асимптотическое (при  $n \rightarrow \infty$ ) распределение хи-квадрат.

Число степеней свободы равно:

- $L-1$ , если распределение полностью задано.
- $L - 1 - r$ , если дополнительно оценивается  $r$  неизвестных параметров распределения.

Для нахождения критической области необходимо по заданной вероятности ошибки первого рода (уровню значимости критерия)  $\alpha$  найти квантиль хи-квадрат распределения на уровне  $1 - \alpha$ .



Подсчитываем значение статистики критерия и сравниваем его с критической точкой. Если

$$\chi^2 > C$$

То нулевая гипотеза отвергается.

В противном случае она принимается на уровне значимости  $\alpha$

Критерий легко приспособливается и для непрерывных распределений путем их *дискретизации*.

Проверку гипотезы удобно совмещать с построением гистограмм.

# Пять шагов проверки гипотезы

1. Сформулировать нулевую  $H_0$  и альтернативную  $H_1$  гипотезы.
2. Выбрать статистику критерия  $T(X)$  и уяснить её закон распределения.
3. Задать уровень значимости критерия. По таблицам квантилей распределения статистики найти критические точки и указать критическую область.
4. Подсчитать значение статистики критерия и проверить условие попадания в критическую область.
5. Сделать вывод о принятии нулевой или альтернативной гипотезы.

# Простейшие параметрические гипотезы

Гипотезы о среднем значении гауссовской случайной величины

Дано: Проведено две серии **независимых** испытаний одинакового объема, по результатам которых получены оценки математического ожидания  $a_0$  и  $a_1$ .

Проверить нулевую гипотезу:  $a_0 = a_1$ .

Случай 1. Дисперсия известна и равна  $\sigma^2$

Статистика критерия

$$a_1 = \overline{X}_1, > a_0 = \overline{X}_0 \quad T = \frac{a_1 - a_0}{\sqrt{D[a_1 - a_0]}} = \frac{a_1 - a_0}{\sqrt{2 \frac{\sigma^2}{n}}} = \frac{a_1 - a_0}{\sqrt{2}\sigma} \sqrt{n}$$

Имеет стандартное распределение



Выбор критической области зависит от вида альтернатив.

Альтернатива первая:

$$H_1 : a_0 \neq a_1$$

