



Last updated May 23, 2016

Il Test di Ipotesi

Lezione 5

G. Bacaro

Statistica

CdL in Scienze e Tecnologie per l'Ambiente e la Natura

I anno, II semestre

Il test di ipotesi

Cuore della statistica inferenziale!

Fino a questo momento abbiamo solo descritto popolazioni o campioni

o
stimato parametri della popolazione usando campioni (e.g. intervalli di confidenza)



Ora siamo pronti per testare vere ipotesi sulle popolazioni!

Logica del processo inferenziale: i 5 passi

1. Costruire un'ipotesi (questione oggetto della ricerca)

E.g. Problema: gli studenti maschi hanno dei voti più alti delle femmine?

2. Scegliere l'analisi statistica

E.g. Analisi per testare differenze fra medie

3. Pianificare ed eseguire il campionamento

E.g. Selezionare un campione di M e F e raccogliere i dati

4. Eseguire il test

5. Rifiutare o accettare l'ipotesi di partenza

E.g. Maschi e femmine non sono diversi

Errore comune

Eseguire il campionamento prima di aver costruito l'ipotesi e aver scelto l'analisi

1. Costruire e testare un'ipotesi

Ipotesi: affermazione che ha come oggetto accadimenti nel mondo reale, che si presta ad essere confermata o smentita dai dati osservati sperimentalmente

Esempio: gli studenti maschi e femmine presentano gli stessi voti

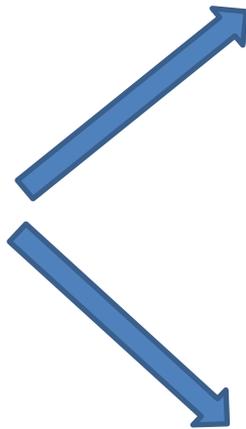
1. Costruire e testare un'ipotesi

Ipotesi nulla (H_0): è un'affermazione riguardo alla popolazione che si assume essere vera fino a che non ci sia una prova evidente del contrario (status quo, mancanza di effetto etc.)

Ipotesi alterantiva (H_a): è un'affermazione riguardo alla popolazione che è contraria all'ipotesi nulla e che viene accettata solo nel caso in cui ci sia una prova evidente in suo favore

1. Costruire e testare un'ipotesi

Test di ipotesi
consiste in una
decisione fra H_0 e H_a



1. Rifiutare H_0 (e quindi accettare H_a)

2. Accettare H_0 (e quindi rifiutare H_a)

1. Costruire e testare un'ipotesi

1. Rifiutare H_0



2. Accettare H_0

La statistica inferenziale ci permette di quantificare delle probabilità per decidere se accettare o rifiutare l'ipotesi nulla:
Quanto attendibile è H_0 ?

Testare un'ipotesi su una popolazione
con σ e μ note!

Testare un'ipotesi su una popolazione

H_0 : Il campione ha una media $= \mu$

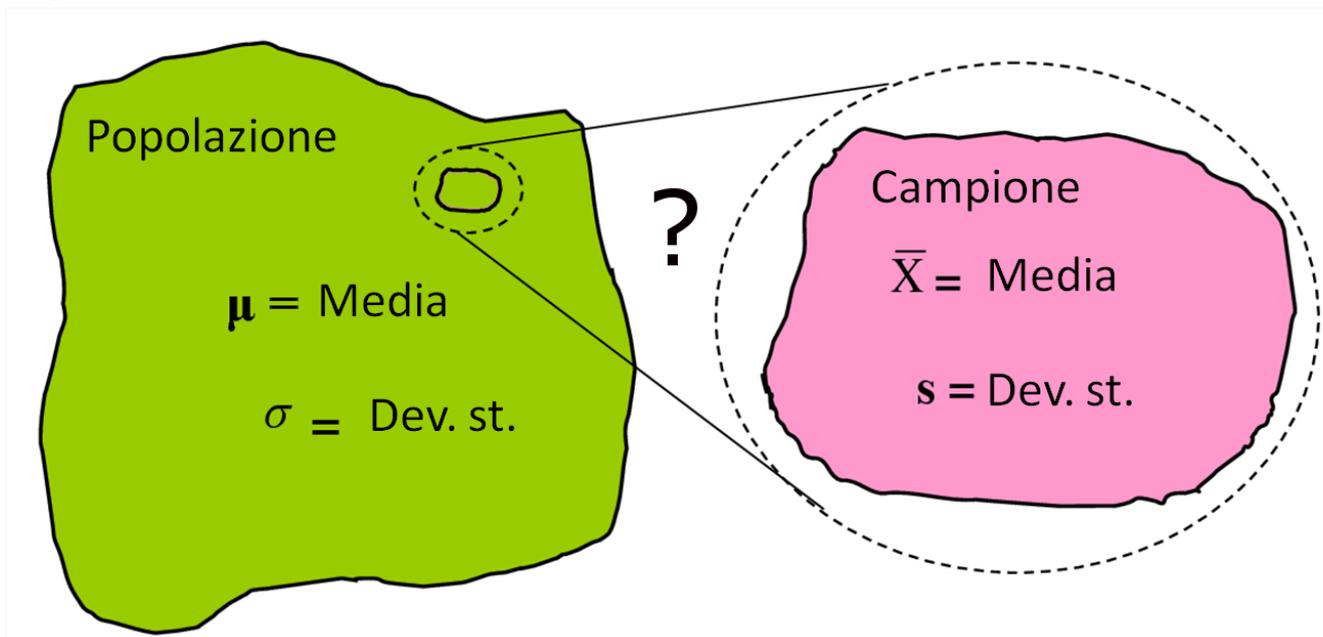
TRE IPOTESI ALTERNATIVE POSSIBILI:

H_a : Il campione ha una media $\neq \mu$

H_a : Il campione ha una media $> \mu$

H_a : Il campione ha una media $< \mu$

Come quantificare la probabilità per decidere se accettare o rifiutare l'ipotesi nulla?

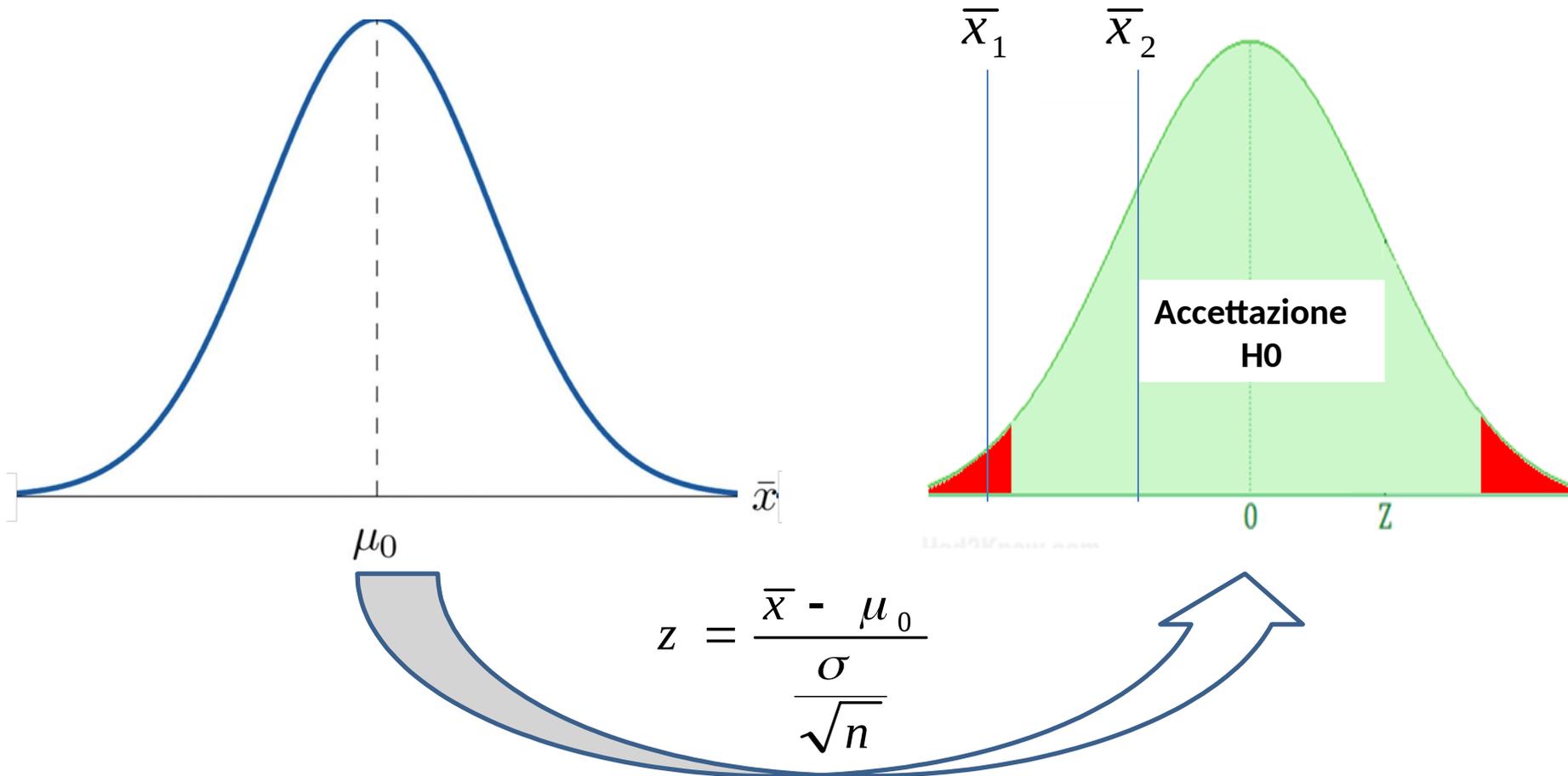


Testare un'ipotesi su una popolazione

Popolazione con media μ e deviazione standard σ nota:

H_0 : Il campione ha una media = μ

H_a : Il campione ha una media $\neq \mu$ (o $>\mu$ o $<\mu$)



Livello di significatività (alpha)

Devo definire a priori una probabilità (alpha) per rifiutare l'ipotesi nulla



Il livello di significatività di un test: probabilità di rifiutare H_0 , quando in realtà è vera (quanto confidenti siamo nelle nostre conclusioni?)

Più piccola è alpha maggiore sarà la certezza nel rifiutare l'ipotesi nulla

Valori usuali sono 10%, 5%, 1%, 0.1%

I valori più comuni

Esempio

H_0 : Il campione ha una media = 175

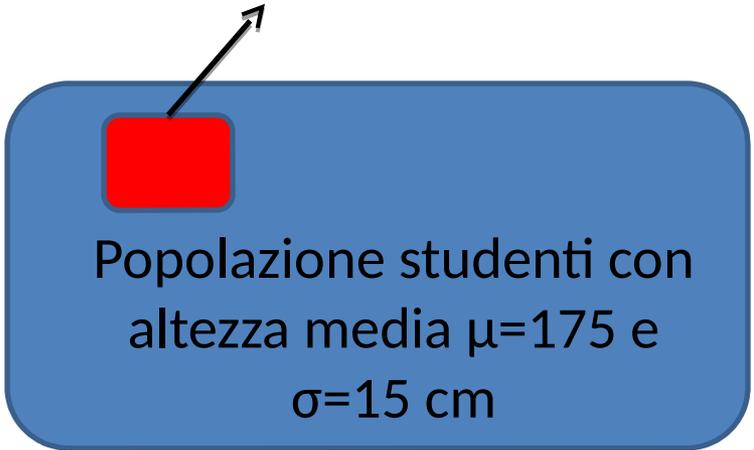
TRE IPOTESI ALTERNATIVE POSSIBILI:

H_a : Il campione ha una media \neq 175

H_a : Il campione ha una media $>$ 175

H_a : Il campione ha una media $<$ 175

Il campione ha una media di 172 (n=10)



Popolazione studenti con altezza media $\mu=175$ e $\sigma=15$ cm

$$z = \frac{\bar{x} - \mu_0}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}$$



Quale alpha volete?

Testare un'ipotesi su una popolazione

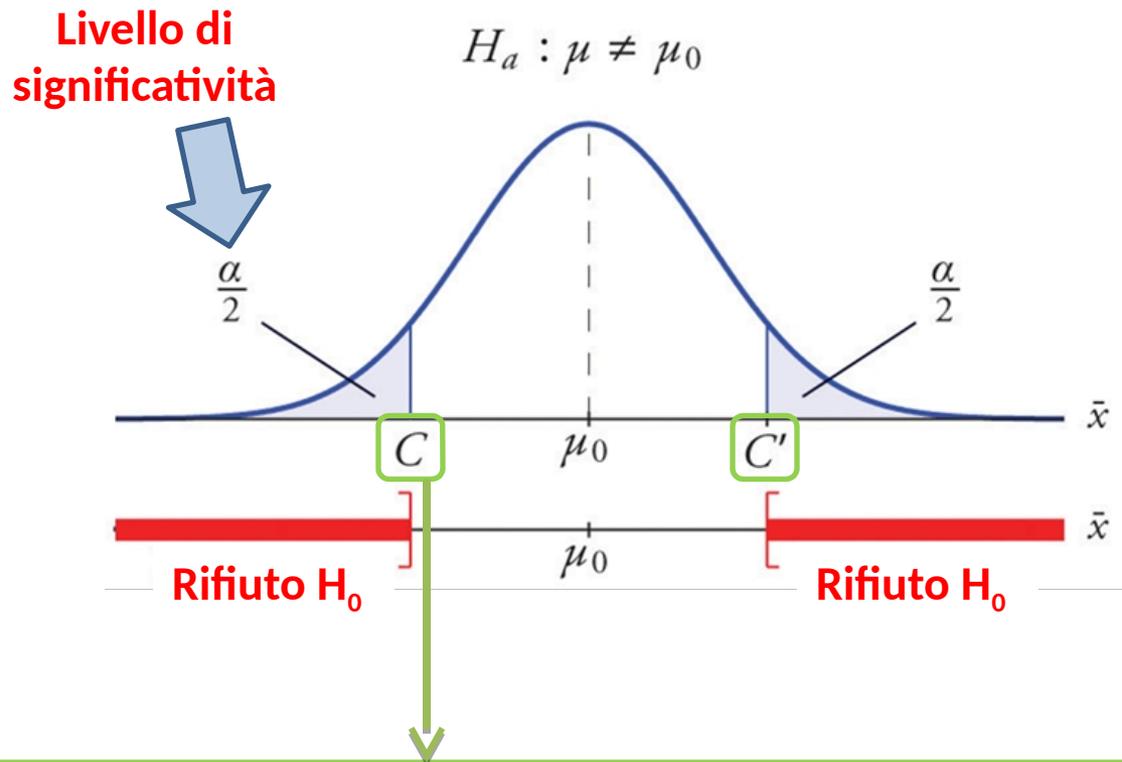
Passi:

1. Definisco alpha
2. Controllo il z-critico a seconda che sia una o due code dalla tavola
3. Calcolo il valore di z-calcolato

$$Z_{calcolato} = \frac{\bar{x} - \mu_0}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}$$

5. Se z-calcolato è più estremo del valore critico rifiuto H0

Regione di accettazione e rifiuto

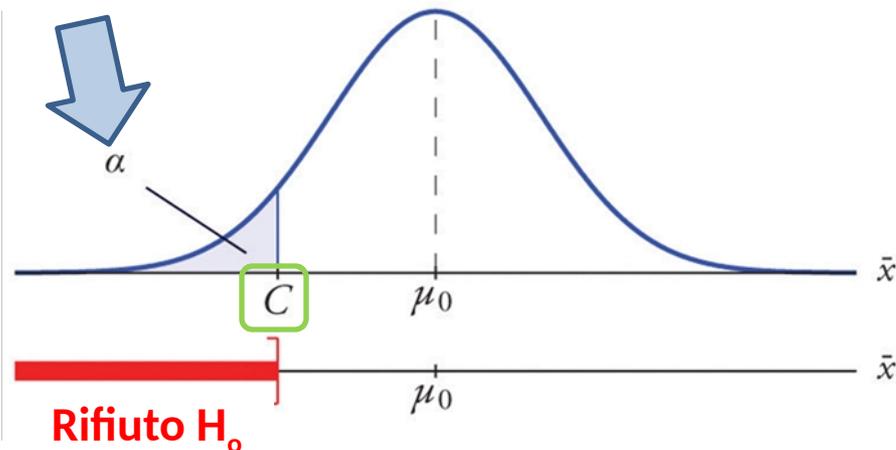


Definito il valore critico (C) della statistica possiamo individuare una zona di rifiuto e una zona di accettazione di H_0

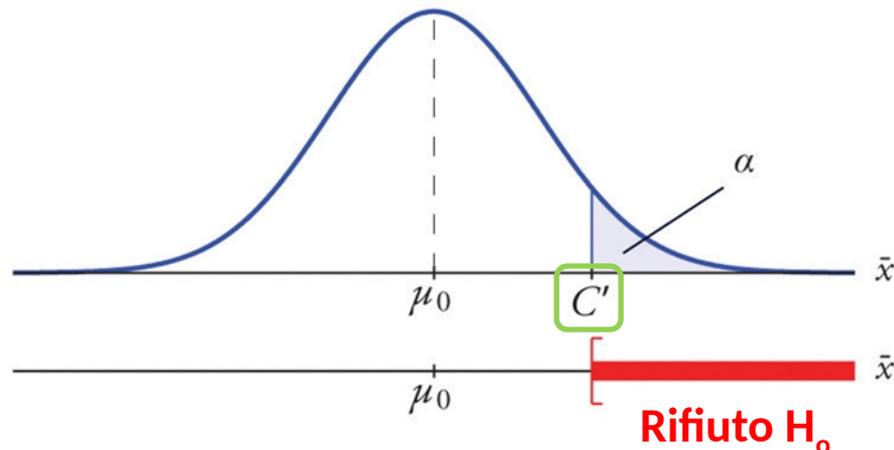
Regione di accettazione e rifiuto

Livello di
significatività

$H_a : \mu < \mu_0$



$H_a : \mu > \mu_0$



Definito il valore critico della statistica (C) possiamo individuare una zona di rifiuto e una zona di accettazione di H_0 .

Testare un'ipotesi su una popolazione
con μ nota ma σ incognita

Caso più comune!

Testare un'ipotesi su una popolazione

Se non conosciamo la deviazione standard devo usare la distribuzione di t!

H_0 : Il campione ha una media = μ

H_a : Il campione ha una media $\neq \mu$ (o $>\mu$ o $<\mu$)

$$t = \frac{\bar{x} - \mu}{\frac{S}{\sqrt{n}}}$$

t si distribuisce come una variabile casuale con n-1 gradi di libertà

Testare un'ipotesi su una popolazione

Passi:

1. Definisco alpha
2. Determino n-1 (d.g.)
3. Controllo il t-critico a seconda che sia una o due code dalla tavola
4. Calcolo il t-calcolato

$$t_{calcolato} = \frac{\bar{x} - \mu}{\frac{S}{\sqrt{n}}}$$

5. Se t-calcolato è più estremo del critico rifiuto H0

Tipi di errori nel test di ipotesi

Tutte le decisioni sono basate su probabilità

Esiste sempre un livello di incertezza sia nel rifiutare sia nell'acceptare l'ipotesi nulla

Il test di per se non prova nulla in modo assoluto!!!

Tipo di errori

Decisione statistica

	Rifiuto H_0	Accetto H_0
Realtà	<u>Corretta</u> Effetto visto	<u>Errore tipo II (β)</u> Effetto non visto, ma in realtà esiste
	<u>Errore tipo I (α)</u> Effetto visto, ma in realtà non esiste (valore di P)	<u>Corretta</u> Effetto non visto, Effetto non esiste (Power)

Potenza di un test

I fattori che incidono sulla potenza di un test per la verifica dell'ipotesi nulla sono 6:

- 1 - il livello di significatività (α);
- 2 - la dimensione della differenza, di cui si vuole verificare la significatività;
- 3 - la variabilità dei dati;
- 4 - la direzione dell'ipotesi (una o due code);
- 5 - la dimensione (n) del campione;
- 6 - le caratteristiche del test

Potenza di un test

1. Livello di significatività (Alpha):

Il timore di commettere errori di I tipo tende a far abbassare al ricercatore il livello di significatività α . Ma, riducendo il valore di α , egli diminuisce la probabilità di scoprire delle differenze, anche quando nella realtà esistono; in altri termini, aumenta la probabilità β di commettere errori di II tipo

Potenza di un test (Power)

2. La dimensione della differenza tra il valore osservato e il valore atteso nell'ipotesi nulla (di solito, la media)

La potenza di un test statistico è funzione crescente della differenza, considerata in valore assoluto

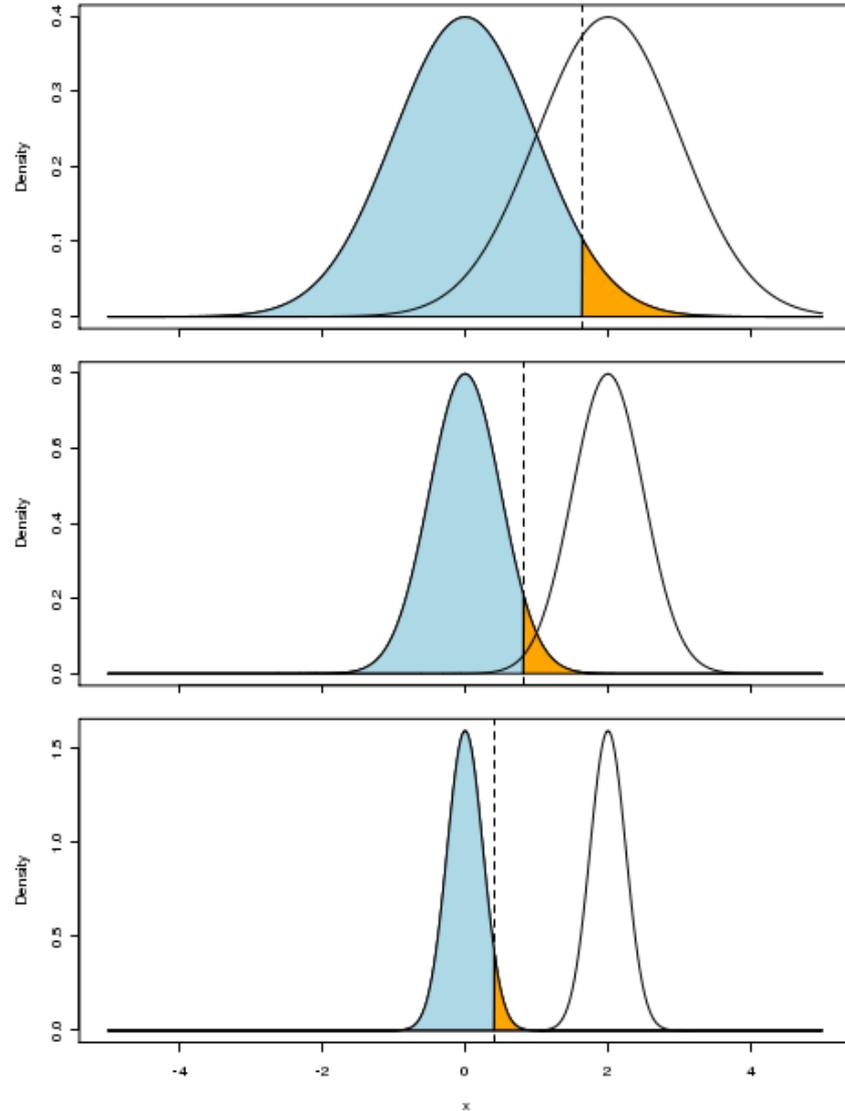
$$z = \frac{\bar{x} - \mu}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}$$

Esempio test z

Potenza di un test (Power)

3. Variabilità

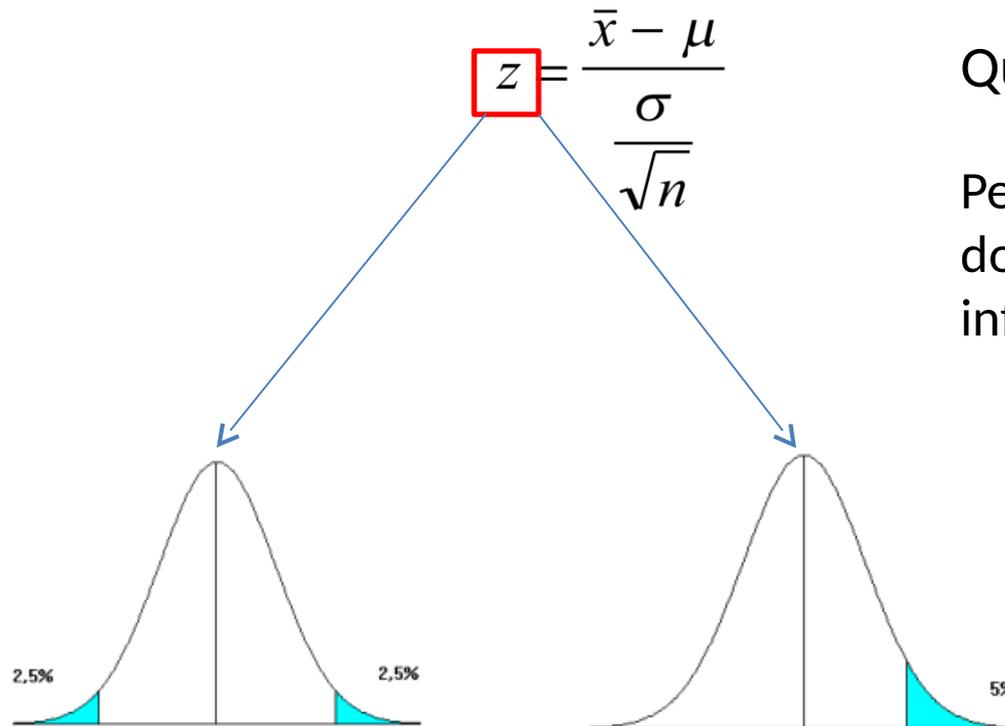
$$z = \frac{\bar{x} - \mu}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}$$



Potenza di un test (Power)

4. Direzione del test (una o due code)

Lo stesso valore di Z può essere associato a due probabilità a seconda dell'ipotesi alternativa



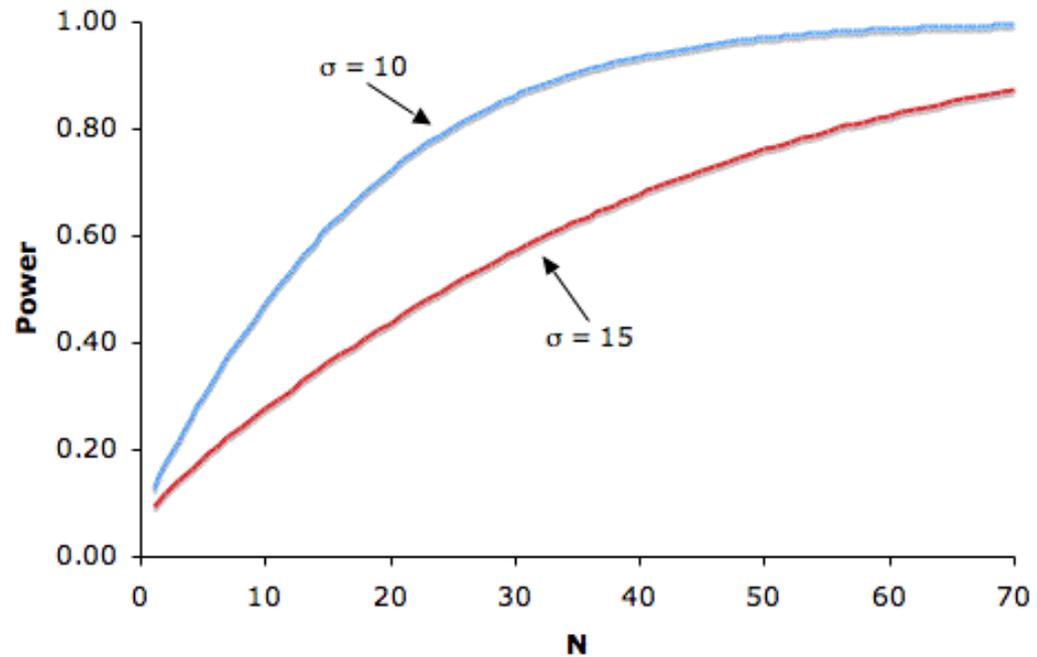
Qual è più potente?

Per eseguire un test a una coda dobbiamo avere delle informazioni a priori

Potenza di un test (Power)

5. La dimensione del campione (n)

$$z = \frac{\bar{x} - \mu}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}}$$



Potenza di un test (Power)

6. La scelta del test

A partire dagli stessi dati, non tutti i test hanno la stessa capacità di rifiutare l'ipotesi nulla quando è falsa

E' quindi molto importante scegliere il test più adatto!

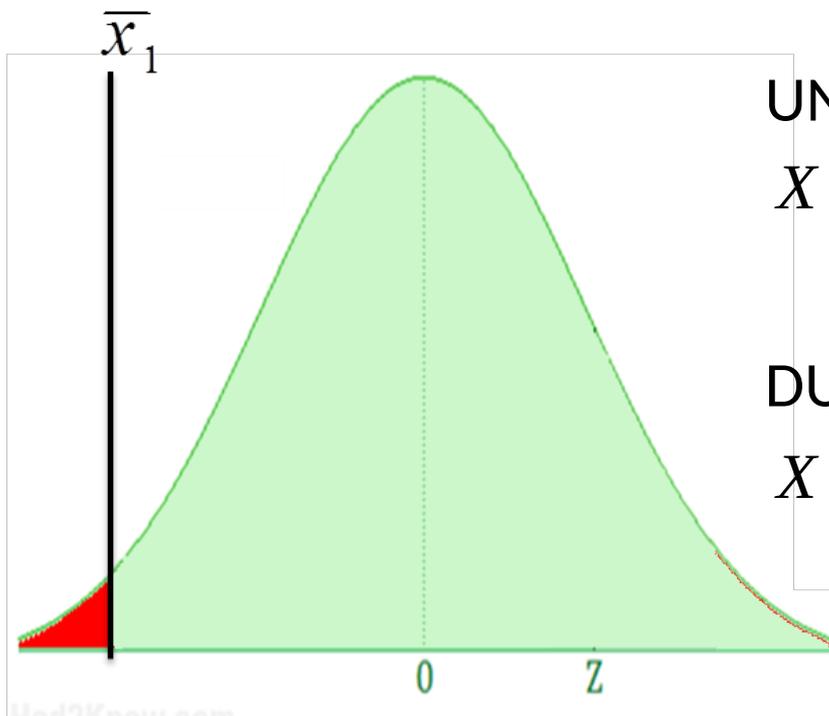
Test diversi hanno condizioni di validità differenti e sono più o meno robusti (sopportano in modo differente l'allontanamento dalle condizioni di validità)

Aspettiamo le prossime lezioni...

Il valore di P

Il **valore p** indica la probabilità di ottenere un risultato pari o più estremo di quello osservato, **supposta vera l'ipotesi nulla**

Talvolta viene anche chiamato **livello di significatività osservato**



UNA CODA

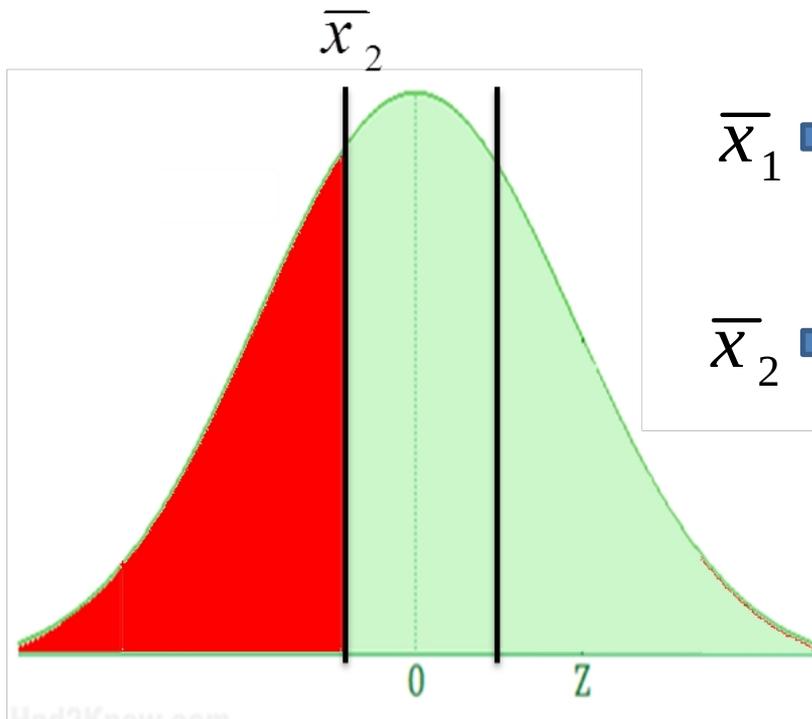
$$X_1 \rightarrow Z_{\text{calcolato}} \rightarrow P = 0.045$$

DUE CODE

$$X_1 \rightarrow Z_{\text{calcolato}} \rightarrow P = ?$$

Il valore di P

Il calcolo del P dipende dall'ipotesi alternativa!



$$\bar{x}_1 \rightarrow Z_1 \rightarrow P = 0.40$$

$$\bar{x}_2 \rightarrow Z_2 \rightarrow P = ?$$