

تذکری در باره کوتاهترین فاصله اطمینان برای میانگین یک جامعه نرمال

رابرت بارتوزینسکی

وای چن

ترجمه اعظم نجف کوچک*

۱ مقدمه

ما نمی‌توانیم جزئیات پاسخ دانشجویان را برملا کنیم. اما این سوال صرفاً جنبه کنجدکاوی ندارد. حتی آماردانان با تجربه نیز برای لحظاتی از این استدلال دکتر جونز سر در گم شده‌اند. نکته اساسی این است که گرچه احتمال $D(X) \leq tS/\sqrt{n-1}$ است اما احتمال شرطی $P(|X - \mu| \leq tS/\sqrt{n-1} | S = s)$ ثابت نیست. وقتی $\sqrt{n}/\sigma < 1.96$ است، احتمال شرطی ثابت نیست. وقتی $\sqrt{n}/\sigma > 1.96$ است، احتمال شرطی ثابت نیست.

در نظریه برآورده، کوتاهترین فاصله اطمینان ۹۵٪ برای میانگین یک توزیع نرمال با واریانس معلوم σ^2 به صورت زیر است:

$$(1) \quad \bar{X} \pm 1.96\sigma/\sqrt{n}$$

(متلاً نگاه کنید به لین [۱]). دکتر جونز^۱ از فارغ‌التحصیلان اخیر گروه آمار شکاکیون^۲، فاصله اطمینانی حتی کوتاهتر از فاصله (۱) به دست آورده است. ابتدا او فاصله (۱) را محاسبه می‌کند. سپس وانود می‌کند که σ مجھول است و فاصله اطمینان زیر را محاسبه می‌کند.

$$(2) \quad \bar{X} \pm tS/\sqrt{n-1}$$

که در آن $t = t_{0.975}^{(n-1)}$ و $nS^2 = \sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2$ صدک ۹۷.۵-ام توزیع t است. درجه آزادی ۱- n است. حال او از بین فاصله اطمینان‌های به دست آمده از رابطه‌های (۱) و (۲) آن فاصله‌ای را انتخاب می‌نماید که کوتاهتر است.

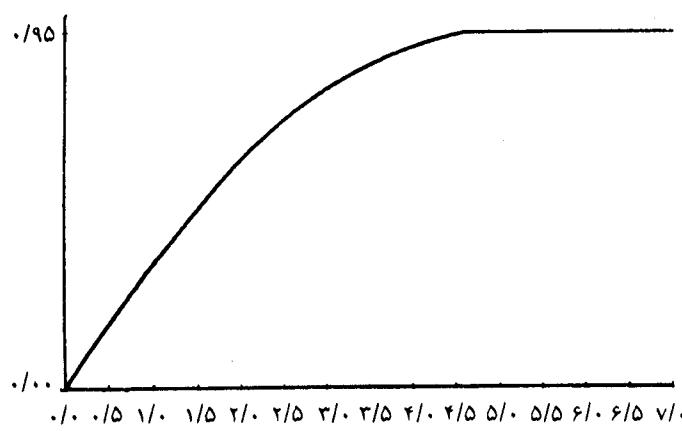
واضح است که طول فاصله اطمینان دکتر جونز کمتر از یا مساوی طول فاصله (۱) است. از طرف دیگر هر دو فاصله (۱) و (۲) احتمال پوشش ۹۵٪ دارند. بنابراین دکتر جونز ادعا می‌کند که همین حکم درباره فاصله اطمینان او نیز صادق است.

آیا دکتر جونز یک کشف آماری مهم کرده است؟

این سوال، به علاوه چند سوال دیگر که جنبه فنی بیشتری دارند جزو سوالات به اصطلاح امتحان استنباط پخش آمار دانشگاه ایالتی اوهايو در سال ۱۹۸۷ آمده بود.

* عضو هیأت علمی گروه آمار، دانشگاه شهید چمران اهواز

1) Jones 2) Department of Dubious Statistics



در شکل ۱ نمودار احتمال پوشش فاصله اطمینان دکتر جونز را به عنوان تابعی از n برای $n = 21$ و $\sigma = 25$ رسم کردہ‌ایم. بنابراین با اینکه امید ریاضی طول فاصله اطمینان دکتر جونز کمتر از $1.96\sigma/\sqrt{n} = 1.96\sigma/5$ است، احتمال پوشش کمتر از ۹۵٪ است. مختصرًا محاسبات مربوط به امید ریاضی طول و احتمال پوشش فاصله اطمینان دکتر جونز را شرح می‌دهیم.

حال با شرطی کردن روی متغیر S و با استفاده از این حقیقت که X و S از یکدیگر مستقل‌اند، داریم:

$$\begin{aligned} P(\text{پوشش}) &= \\ &= \int_{\{(1,16\sigma)^t/n \leq t^s s^t / (n-1)\}} P(|\bar{X} - \mu| \leq 1,16\sigma / \sqrt{n} | S = s) f_{n-1}\left(\frac{ns^t}{\sigma^t}\right) d\left(\frac{ns^t}{\sigma^t}\right) \quad (7) \\ &+ \int_{\{(1,16\sigma)^t/n > t^s s^t / (n-1)\}} P(|\bar{X} - \mu| \leq \frac{ts}{\sqrt{n-1}} | S = s) f_{n-1}\left(\frac{ns^t}{\sigma^t}\right) d\left(\frac{ns^t}{\sigma^t}\right) \quad (8) \\ &= 0,95 P(ns^t / \sigma^t \geq (n-1)(1,16/t)^t) \\ &+ \int_{\{ns^t / \sigma^t < (n-1)(1,16/t)^t\}} P(|\bar{X} - \mu| \leq ts / \sqrt{n-1} | S = s) f_{n-1}\left(\frac{ns^t}{\sigma^t}\right) d\left(\frac{ns^t}{\sigma^t}\right) \end{aligned}$$

اولین جمله رابطه (8) برابر است با $(1,16/t)^t$. دومین جمله (8)، پس از تغییر متغیر، به صورت زیر درمی‌آید:

$$\begin{aligned} &\int_{y=0}^d P(|\bar{X} - \mu| \leq t\sigma\sqrt{y/(n^t - n)}) f_{n-1}(y) dy \\ &= \int_{y=0}^d (2\Phi(t\sqrt{y/(n-1)}) - 1) f_{n-1}(y) dy, \end{aligned}$$

که در آن Φ تابع توزیع تجمعی توزیع نرمال استاندارد است. بنابراین رابطه (8) را به صورت زیر می‌توان نوشت:

$$\begin{aligned} P(\text{پوشش}) &= \\ &= 0,95 - 1,16 P(\mathcal{X}_{n-1}^t \leq d) + 2 \int_{y=0}^d [\Phi(t\sqrt{y/(n-1)})] f_{n-1}(y) dy \quad (9) \end{aligned}$$

که می‌توان آن را به صورت عددی محاسبه کرد. برای $n = 21$ و $\sigma^t = 25$ احتمال پوشش $0,9358$ است. توجه کنید که هر زمان $y < d = (n-1)(1,16/t)^t$ آنگاه $\Phi(t\sqrt{y/(n-1)}) < \Phi(1,16) = 0,975$ می‌آوریم:

$$\begin{aligned} P(\text{پوشش}) &< 0,95 - 1,16 P(\mathcal{X}_{n-1}^t \leq d) + 2 \int_{y=0}^d 0,975 f_{n-1}(y) dy \\ &= 0,95 - 1,16 P(\mathcal{X}_{n-1}^t \leq d) + 2(0,975) P(\mathcal{X}_{n-1}^t \leq d) \\ &= 0,95 \quad (10) \end{aligned}$$

و بنابراین احتمال پوشش فاصله اطمینان دکتر جونز همان طور که گفته شد، کمتر از $0,95$ است.

۲ امید ریاضی طول

طول فاصله اطمینان جدید تابعی از S و بنابراین یک متغیر تصادفی است. برای محاسبه امید ریاضی طول فرض کنید f_{n-1} تابع چگالی یک متغیر تصادفی خی دو با $n-1$ درجه آزادی باشد. در این صورت

$$\begin{aligned} E(\text{فاصله اطمینان دکتر جونز}) &= \\ &= \int_{\{t^s s^t / (n-1) \geq (1,16\sigma)^t / n\}} 2 \times 1,16\sigma / \sqrt{n} \times f_{n-1}\left(\frac{ns^t}{\sigma^t}\right) d\left(\frac{ns^t}{\sigma^t}\right) \\ &+ \int_{\{t^s s^t / (n-1) < (1,16\sigma)^t / n\}} 2 \times \frac{ts}{\sqrt{n-1}} \times f_{n-1}\left(\frac{ns^t}{\sigma^t}\right) d\left(\frac{ns^t}{\sigma^t}\right) \quad (11) \\ &= 2 \times 1,16\sigma / \sqrt{n} \times P(ns^t / \sigma^t \geq (n-1)(1,16/t)^t) \\ &+ 2 \frac{1}{\sqrt{n-1}} \int_{\{\frac{ns^t}{\sigma^t} < (n-1)(1,16/t)^t\}} s \times f_{n-1}\left(\frac{ns^t}{\sigma^t}\right) d\left(\frac{ns^t}{\sigma^t}\right) \quad (12) \end{aligned}$$

جمله اول رابطه (12) عبارت است از

$$(2 \times 1,16\sigma / \sqrt{n}) P(\mathcal{X}_{n-1}^t \geq (n-1)(\frac{1,16}{t})^t). \quad (13)$$

با تغییر متغیر، جمله دوم (12) به صورت زیر درمی‌آید:

$$\begin{aligned} \frac{2t}{\sqrt{n(n-1)}} \int_{y=0}^{(n-1)(1,16/t)^t} \sigma \sqrt{y} f_{n-1}(y) dy &= 2t\sigma \sqrt{\frac{2}{n(n-1)}} \\ &\times \frac{\Gamma(n/2)}{\Gamma((n-1)/2)} \times P(\mathcal{X}_n^t \leq (n-1)(1,16/t)^t). \quad (14) \end{aligned}$$

بنابراین برای محاسبه امید ریاضی طول فاصله اطمینان دکتر جونز تنها به جدول خی دو نیاز خواهیم داشت. برای مثال اگر $n = 21$ و $\sigma^t = 25$ با استفاده از رابطه‌های (13) و (14) داریم:

$$E(\text{فاصله اطمینان دکتر جونز}) = 2,61 + 1,46 = 4,09$$

در حالی که طول فاصله اطمینان استاندارد (1) در این حالت عبارت است از $4,28$.

۳ احتمال پوشش

احتمال پوشش عبارت است از

$$\begin{aligned} P(\text{پوشش}) &= \\ &P(|\bar{X} - \mu| \leq 1,16\sigma / \sqrt{n}; 1,16\sigma / \sqrt{n} \leq tS / \sqrt{(n-1)}) \\ &+ P(|\bar{X} - \mu| \leq \frac{tS}{\sqrt{(n-1)}}; 1,16\sigma / \sqrt{n} > tS / \sqrt{(n-1)}) \end{aligned}$$

مراجع

اصل این مقاله با عنوان

- [1] E. L. Lehmann, *Testing Statistical Hypotheses*, Wiley, New York, 1959.

A Remark on the Shortest Interval of a Normal Mean

Robert Bartoszyński and Wai Chan

نوشتة

The American Mathematical Monthly, May, 1990

چاپ شده است.