

Kolmogorov-Smirnov proba

Josemari Sarasola



Kolmogorov-Smirnov proba

- Kolmogorov-Smirnov proba datu-multzo bat probabilitate-banaketa batekin bat etor daitekeen erabakitzeko proba estatistiko bat da.
- Horretarako probabilitate banaketaren **banaketa-funtzioa** datuei dagokien banaketa funtzioarekin alderatzen du, eta bi funtzioen arteko D_{max} distantzia maximoa kalkulatu.
- Distantzia maximoa handiegia bada, α **esangura-maila** baterako, kasualitatez ezin izan dela gertatu ondorioztatzen dugu, eta beraz datuak emandako probabilitate-banaketaekin bat ez datozela erabaki.
- α esangura-maila kasualitateaz ez fidatzeko aurrez ezartzen dugun probabilitatea edo portzentajea da, nolabait esateko aurrez finkatzen dugun mesfidantza-maila bat.

Kolmogorov-Smirnov proba

Banaketa-funtzio enpirikoa

Banaketa-funtzio enpirikoa datuei dagokien banaketa-funtzioa da, datuei dagozkien maiztasun erlatibo metatuak probabilitatetzat hartuz.

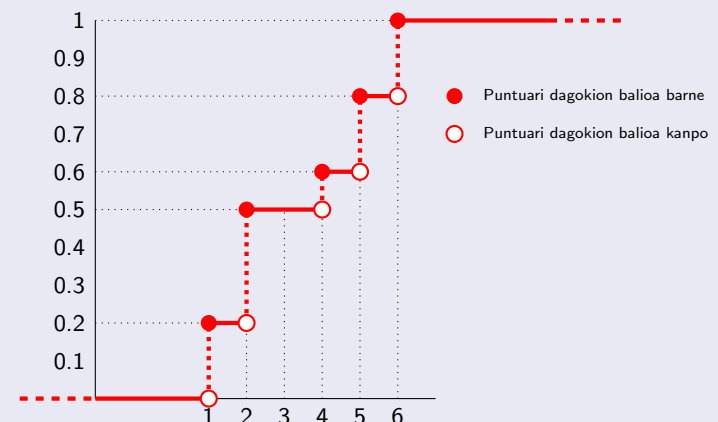
Adibidez, dado bat 10 aldiz bota eta 1-1-2-2-2-4-5-5-6-6 emaitzak lortu baditugu, hauek dira F maiztasun erlatibo metatuak, banaketa-funtzioaren balioztzat hartuko ditugunak:

x	1	2	3	4	5	6
$f(x)$	0.2	0.3	0	0.1	0.2	0.2
$\hat{F}(x)$	0.2	0.5	0.5	0.6	0.8	1

Kolmogorov-Smirnov proba

Banaketa-funtzio enpirikoa

Grafikoki, banaketa-funtzio enpirikoak eskailera moduan irudikatzen dira beti:



Kolmogorov-Smirnov proba

Banaketa-funtzio teorikoa

Banaketa-funtzio enpirikoa banaketa-funtzio teoriko batekin batera jarri behar dugu, biak alderatzeko. Dadoaren adibidean, dadoa ongi egina dagoen eta beraz alde guztietako probabilitateak 1 diren erabaki nahi dugu. beraz, banaketa teorikoa hau izango da:

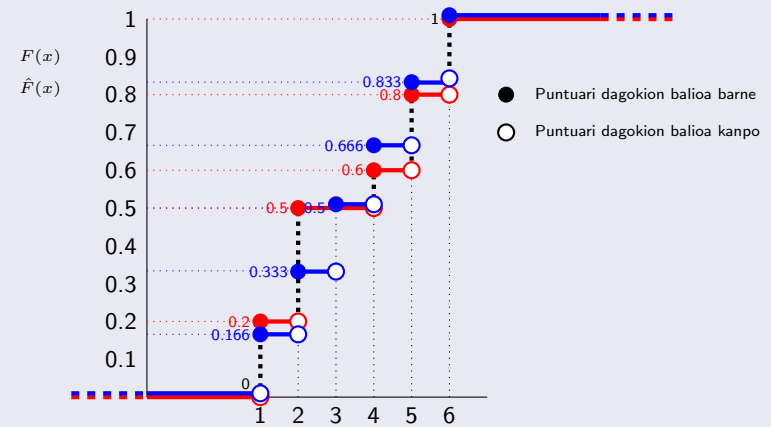
x	1	2	3	4	5	6
p(x)	1/6	1/6	1/6	1/6	1/6	1/6
F(x)	1/6	2/6	3/6	4/6	5/6	1

Banaketa-funtzio enpirikoa eta teorikoa behar bezala bereizteko, notazio hau erabiliko dugu hemendik aurrera: $F(x)$ banaketa-funtzio teorikoa izango da, eta $\hat{F}(x)$ banaketa-funtzio enpirikoa.

Kolmogorov-Smirnov proba

Banaketa-funtzio teorikoa

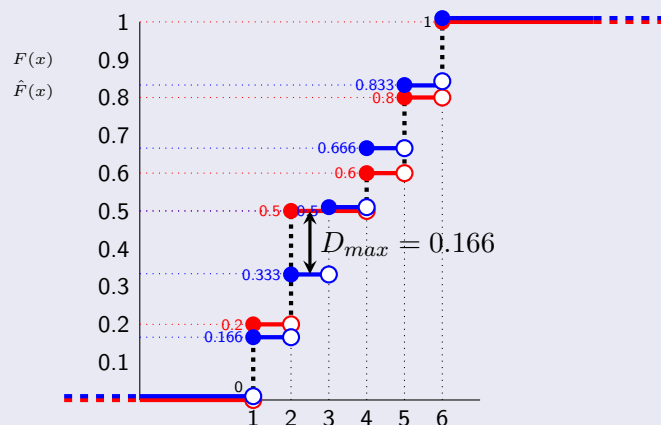
Banaketa-funtzio enpirikoarekin batera grafikatzten dugu:



Kolmogorov-Smirnov proba

Distantzia maximoa

Eta ondoren bi eskailera edo banaketa-funtzioen arteko balio maximoa bilatu eta kalkulatzten dugu:



Kolmogorov-Smirnov proba

Distantzia maximoa taula bidez

Arestekoa adibide sinplea izan arren, distantzia maximoa bilatzea ez da erraza, eta gainera eskuz egiteko, zehaztasun handia beharko genuke. Baina, (eskerrak!), kalkula daiteke taula bidez ere:

x	$\hat{F}(x)$	$F(x)$	$D = \hat{F}(x) - F(x) $
1^-	0	0	0
1	0.2	0.166	0.033
2^-	0.2	0.166	0.033
2	0.5	0.333	0.166
3^-	0.5	0.333	0.166
3	0.5	0.5	0
4^-	0.5	0.5	0
4	0.6	0.666	0.066
5^-	0.6	0.666	0.066
5	0.8	0.833	0.033
6^-	0.8	0.833	0.033
6	1	1	0

Esango duzu: zertarako kalkulatu beharra (-) puntuetan ere? Orain, badirudi ez dela beharrezkoa, baina banaketa teorikoa jarraitua denean, ikusiko duzu ezinbestekoa dela.

Kolmogorov-Smirnov proba

Azken erabakia: esangura maila

Orain, D_{max} distantzia banaketa teorikoa datu horietarako egokia ez dela baieztatzeko aski handia den erabaki behar dugu. Printzipioz (estatistikan, **hipotesi nulupean** diogu) sinesten dugu banaketa teorikoa egokia dela datuetarako, eta portzentaje txiki batez ez gara fidatzen horrekin. Banaketa teorikoarekiko mesfidantza-portzentaje horri α **esangura-maila edo adierazgarritasun-maila** deritzo, eta 0.2, 0.1, 0.5, 0.02 edo 0.01 izaten da. Ikertzaileak erabakitzen du maila hori aldeztuz aurretik: zenbat eta sinistuagoa izan banaketarekin, orduan eta α txikiagoa jarriko du.

Kolmogorov-Smirnov proba

Azken erabakia: taula eta distantzia kritikoa

α esangura-maila bakoitzeko (hobe litzateke agian mesfidantza-maila deitzea), distantzia *kritiko* desberdinak ditugu. Suertatu zaigun distantzia hori, taulak ematen duen **balio kritikoa** baino handiagoa bada, distantzia aski handia dela erabaki eta banaketa teorikoa baztertu egiten dugu, hots datuetarako egokia ez dela erabaki. Gurean, $n = 10$ eta $\alpha = \%5 = 0.05$ finkatzen badugu, distantzia kritikoa 0.409 da. 0.166 suertatu zaigu, ez da hartara balio kritikoraino iristen, eta beraz banaketa teorikoa datuetarako egokia dela erabakitzen dugu (dadao ongi eraturik dagoela alegia, probabilitate berdinekin).

n	$\alpha = 0.20$	$\alpha = 0.10$	$\alpha = 0.05$	$\alpha = 0.02$	$\alpha = 0.01$
9	0,339	0,387	0,43	0,48	0,513
10	0,323	0,369	0,409	0,457	0,489
11	0,308	0,352	0,391	0,437	0,468

Taula eskuragarri hemen: <https://gizapedia.hirusta.io/>

[pdf-printer-friendly-statistical-table-for-the-one-sample-kolmogorov-smirnov-test/](https://gizapedia.hirusta.io/pdf-printer-friendly-statistical-table-for-the-one-sample-kolmogorov-smirnov-test/).

Kolmogorov-Smirnov proba

Azken ohar bat α -ri buruz

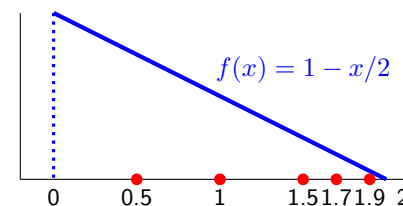
Ohartu α zenbat eta txikiagoa izan, orduan eta distantzia kritiko handiagoa dugula. Normala da: zenbat eta α txikiagoa izan, orduan eta konfiantza handiagoa dugu banaketa teorikoarekin, eta distantzia kritikoa handiago jarri behar da banaketa baztertzeko.

Kolmogorov-Smirnov proba

K-S proba banaketa teorikoa jarraitua denean

0.5-1-1.5-1.7-1.9 lagin datuetarako banaketa-funtzio teoriko gisa $F(x) = x - x^2/4; 0 \leq x \leq 2$ ezarri da. Banaketa teoriko egokia dela esan al daiteke? $\alpha = 0.10$.

K-S proba garatu aurretik, halako esplorazio bat egin dezakegu galdetzen duenari buruz, dentsitate-funtzioa datuekin batera irudikatuz:



Ikusten den bezala, erudian ezartzen da 2 inguruko balioak direla probabilitate txikienekoak, eta 0 ingurukoak handienekoak. Datuak, berriz, ugalduta egiten dira 2 baliora gerturatu ahala. Beraz, ez dirudi erudia oso egokia denik.

Kolmogorov-Smirnov proba

K-S proba banaketa teorikoa jarraitua denean

0.5-1-1.5-1.7-1.9 lagin datuetarako banaketa-funtzio teoriko gisa

$F(x) = x - x^2/4; 0 \leq x \leq 2$ ezarri da. Banaketa teoriko egokia dela esan al daiteke? $\alpha = 0.10$.

x	$\hat{F}(x)$	$F(x)$	$D = \hat{F}(x) - F(x) $
0.5^-	0	0.4375	0.4375
0.5	0.2	0.4375	0.2375
1^-	0.2	0.75	0.55
1	0.4	0.75	0.35
1.5^-	0.4	0.9375	0.5375
1.5	0.6	0.9375	0.3375
1.7^-	0.6	0.9775	0.3775
1.7	0.8	0.9775	0.1775
1.9^-	0.8	0.9975	0.1975
1.9	1	0.9975	0.0025

Banaketa teorikoaren eta enpirikoaren arteko distantzia maximoa $D_{max} = 0.5375$ da.

Kolmogorov-Smirnov proba

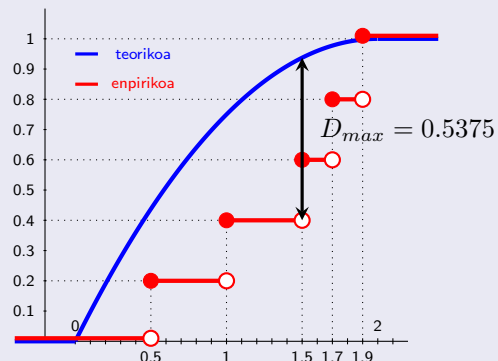
K-S proba, banaketa teorikoa jarraitua denean

$n = 5$ datuetarako eta $\alpha = \%10$ harturik, distantziaren balio kritikoa, hortik gora banaketa teorikoa baztertzera daramana, $D^* = 0.509$ da. $D_{max} = 0.5375 > 0.509$. Beraz, hipotesi nulua, banaketa teorikoa datuetarako egokia dela alegia, baztertu behar da.

Kolmogorov-Smirnov proba

K-S proba, banaketa teorikoa jarraitua denean: grafikoki

$F(x)$ (teorikoa), enuntziatuan ematen den $F(x)$ funtzioaren adierazpen grafikoa baino ez da, balio posibleen tartean, 0tik 2ra alegia.



Kolmogorov-Smirnov proba

Ariketa I

Ikasle batzuek suspenditutako irakasgai kopurua jaso da: 1-1-2-3-4. Eredu gisa, suspenditutako irakasgai kopurua 1, 2, 3 edo 4 izan daitekeela planteatu da, irakasgai bat gehiago suspenditzeko probabilitatea aurrekoa baino 0.1 txikiagoa delarik. Eredu egokia dela esan al daiteke? $\alpha = 0.05$. Grafikoki nahiz analitikoki ebatzi.

Ariketa II

Eguneko salmenta hauek jaso dira enpresa batean: 0.8-1.4-2.8-3.4.
Salmentetarako eredu hau ezarri da: $f(x) = 0.25; 0.5 < x < 4.5$.
Eredua egokia dela esan al daiteke? $\alpha = \%1$ Grafikoki nahiz analitikoki ebatzi.