

Tests para igualdad de varianzas

En los problemas de comparaciones de dos o más tratamientos que hemos tratado hemos supuesto que, si existe una diferencia entre tratamientos, ésta se traduce en un corrimiento. Obviamente hay otras alternativas posibles, como por ejemplo que la diferencia entre tratamientos se traduzca en un cambio en la varianza. El primer test que veremos trabaja con los rangos tal como los definimos en el problema de posición.

Test de Mood para igualdad de varianzas: Sean X_1, \dots, X_n e Y_1, \dots, Y_m muestras aleatorias de distribuciones $F((x-\mu)/\sigma)$ y $F((x-\mu)/\tau)$ respectivamente, con μ común y conocida. Supongamos que la hipótesis nula de interés es $H_0: \sigma = \tau$.

Sea $R(Y_i)$ el rango de Y_i en la muestra agrupada de tamaño $N = n+m$, y definamos

$$M = \sum_{i=1}^m \left(R(Y_i) - \frac{N+1}{2} \right)^2$$

Valores grandes de M indicarían que $\tau > \sigma$ y valores pequeños de M indicarían que $\tau < \sigma$. Por lo tanto, se pueden construir tests para las diferentes alternativas basados en M .

Tablas exactas de la distribución de M bajo H_0 se hallan en Laubscher, Steffens y DeLange (1968). Si n y m son suficientemente grandes se puede usar la aproximación normal, basada en

$$E(M) = m \frac{N^2 - 1}{12}$$

$$Var(M) = nm \frac{(N+1)(N^2 - 4)}{180}$$

Hipótesis a testear y región de rechazo:

A. $H_0: \sigma = \tau$ vs $H_1: \sigma > \tau$

Rechazamos H_0 si $M < m \frac{N^2 - 1}{12} - z_{\alpha} \sqrt{Var(M)}$

B. $H_0: \sigma = \tau$ vs $H_1: \sigma < \tau$

Rechazamos H_0 si $M > m \frac{N^2 - 1}{12} + z_{\alpha} \sqrt{Var(M)}$

C. $H_0: \sigma = \tau$ vs $H_1: \sigma \neq \tau$

Rechazamos H_0 si $\left| M - m \frac{N^2 - 1}{12} \right| > z_{\alpha/2} \sqrt{Var(M)}$

Notar que se supone que los parámetros de posición de ambas muestras son conocidos e idénticos. Si no se puede suponer que son idénticos, debe realizarse previamente algún tipo de ajuste. Si los valores que se utilizan en ese ajuste son estimaciones alejadas de los verdaderos valores de los parámetros, es posible que el rechazo de H_0 no implique necesariamente que las varianzas son distintas.

Eficiencia: La eficiencia del test de Mood fue estudiada por Hollander (1863). Respecto del test F y en el caso Normal es 0.76.

Ejemplo: Se desea testear si el orden en que las preguntas son formuladas influye en los resultados en un examen multiple choice. 21 alumnos que tomaron un curso de Inferencia Estadística fueron divididos en dos grupos aleatoriamente y se les tomó un examen que constaba de 20 preguntas. A 11 alumnos (Grupo 1) las preguntas se les presentaron en el orden en que se habían desarrollado los temas en clase y al resto (Grupo 2) en un orden aleatorio. Los resultados (número de respuestas correctas) se presentan en la siguiente tabla, juntamente con los rangos:

| Grupo 1 (X) | Grupo 2 (Y) | Rango X | Rango Y |
|-------------|-------------|---------|---------|
| | 3 | | 1 |
| | 6 | | 2 |
| 7 | | 3 | |
| | 8 | | 4 |
| 9 | | 6 | |
| 9 | | 6 | |
| | 9 | | 6 |
| 10 | | 8 | |
| 11 | | 10.5 | |
| 11 | | 10.5 | |
| | 11 | | 10.5 |
| | 11 | | 10.5 |
| 12 | | 13 | |
| | 13 | | 15 |
| | 13 | | 15 |
| | 13 | | 15 |
| 14 | | 17 | |
| 15 | | 18.5 | |
| | 15 | | 18.5 |
| 17 | | 20 | |
| 19 | | 21 | |

Supongamos que se puede suponer que ambas poblaciones tienen el mismo centro y que se desea testear $H_0: \sigma = \tau$ vs $H_1: \sigma \neq \tau$

$E(M) = 366.67$ y $Var(M) = 5875.22$. El valor del estadístico $M = 359.75$ y por lo tanto el p-valor aproximado será

$$2 \left[\phi \left(\frac{359.75 - 366.67}{\sqrt{76.65}} \right) \right] = 0.93$$

y no se rechaza H_0 .

A continuación se presentan los resultados obtenidos al procesar este ejemplo en R.

```
grupo1<-c(7,9,9,10,11,11,12,14,15,17,19)
grupo2<-c(3,6,8,9,11,11,13,13,13,15)
```

```
mood.test(grupo1,grupo2)
```

Mood two-sample test of scale

```
data: grupo1 and grupo2
Z = 0.021, p-value = 0.9833
alternative hypothesis: two.sided
```

Test de rangos al cuadrado (Conover): Sean X_1, \dots, X_n e Y_1, \dots, Y_m muestras aleatorias de distribuciones $F((x-\mu_1)/\sigma)$ y $F((x-\mu_2)/\tau)$ respectivamente. Supongamos que la hipótesis nula de interés es

$$H_0: \sigma = \tau$$

Transformamos los datos a desviaciones absolutas respecto de su media, es decir, definimos

$$U_i = |X_i - \mu_1|, \quad i = 1, \dots, n \quad \text{y} \quad V_j = |Y_j - \mu_2|, \quad j = 1, \dots, m$$

Sean $R(U_i)$ y $R(V_j)$ los rangos de U_i y V_j respectivamente en la muestra agrupada de tamaño $N=n+m$. Si no hay empates, el estadístico del test será

$$T = \sum_{i=1}^n [R(U_i)]^2$$

que, bajo H_0 , satisface

$$E(T) = n \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N i^2 = \frac{n}{N} \frac{N(N+1)(2N+1)}{6} = \frac{n(N+1)(2N+1)}{6}$$

$$Var(T) = \frac{nm}{(N-1)N} \left\{ \sum_{i=1}^N i^4 - N \frac{(N+1)^2 (2N+1)^2}{36} \right\} = \frac{nm(N+1)(2N+1)(8N+11)}{180}$$

Si hay empates, se utiliza el estadístico

$$T_1 = \frac{T - n \bar{R}_2}{\left[\frac{nm}{N(N-1)} \sum_{i=1}^N R_i^4 - \frac{nm}{N-1} (\bar{R}_2)^2 \right]^{1/2}}$$

donde $\bar{R}_2 = \frac{1}{N} \left\{ \sum_{i=1}^n [R(U_i)]^2 + \sum_{j=1}^m [R(V_j)]^2 \right\}$ es el promedio de los rangos al cuadrado de ambas muestras combinadas y $\sum_{i=1}^N R_i^4 = \sum_{i=1}^n [R(U_i)]^4 + \sum_{j=1}^m [R(V_j)]^4$.

Los cuantiles de la distribución exacta de T se encuentran tabulados (Tabla A9 de Conover) para $n \leq 10$, $m \leq 10$ y en el caso en que no hay empates. Para tamaños mayores de muestra o si hay empates se utiliza la aproximación Normal.

Supongamos que deseamos testear las hipótesis:

$$A. H_0: \sigma = \tau \quad \text{vs} \quad H_1: \sigma > \tau$$

Si n y m son menores o iguales que 10 y no hay empates, se rechaza H_0 si $T > w_{1-\alpha}$, siendo $w_{1-\alpha}$ el cuantil $1-\alpha$ de la distribución exacta.

Si n y m son grandes y no hay empates, se rechaza H_0 si $\frac{T - E(T)}{\sqrt{Var(T)}} > z_\alpha$.

Si hay empates, se rechaza H_0 si

$$T_1 = \frac{T - n \bar{R}_2}{\left[\frac{nm}{N(N-1)} \sum_{i=1}^N R_i^4 - \frac{nm}{N-1} (\bar{R}_2)^2 \right]^{1/2}} > z_\alpha$$

De manera análoga se aplica el test a las otras dos alternativas.

Eficiencia: La eficiencia de este test respecto al test F es similar a la del test de Mood. Es $15/(2 \pi^2)=0.76$ en el caso Normal, 1 en el caso uniforme y 1.08 en el caso doble exponencial.

En caso de que las medias sean desconocidas, deben reemplazarse por estimaciones. En este caso la distribución exacta deja de ser válida y debe usarse la aproximación normal.

Extensión a más de dos muestras: Este test se puede extender fácilmente a más de dos muestras. Sean

$$X_{ij} \sim F \left(\frac{x - \mu_i}{\sigma_i} \right) \quad 1 \leq j \leq n_i, 1 \leq i \leq k$$

Si μ_i es conocido para todo i , se considera $U_{ij} = |X_{ij} - \mu_i|$. Si no se conoce, se estima y se considera $U_{ij} = |X_{ij} - \hat{\mu}_i|$.

Una vez construidos los U_{ij} se procede como en el test de Kruskal-Wallis, definiendo $R_{ij} = R(U_{ij}) =$ rango de U_{ij} en la muestra total ordenada de tamaño $N = \sum_{i=1}^k n_i$.

Sea $S_i = \sum_{j=1}^{n_i} (R_{ij})^2$ (en el caso $k=2$, $S_1 = T$)

Nos interesa testear

$H_0: \sigma_1 = \sigma_2 = \dots = \sigma_k$ vs $H_1: \text{existe al menos un par } i \neq j \text{ tal que } \sigma_i \neq \sigma_j$

Como en el test de Kruskal-Wallis, se construye un estadístico que, bajo H_0 tiene distribución asintótica χ_{k-1}^2 .

Si no hay empates, el estadístico es

$$T = \frac{180}{N(N+1)(2N+1)(8N+11)} \left[\sum_{i=1}^k \frac{S_i^2}{n_i} - \frac{N(N+1)^2(2N+1)^2}{6} \right]$$

Si hay empates, se debe corregir la esperanza y la varianza y se utiliza

$$T = \frac{1}{D^2} \sum_{i=1}^k \left(\frac{S_i^2}{n_i} - N \bar{S}^2 \right)$$

donde $\bar{S} = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^k S_i$ y $D^2 = \frac{1}{N-1} \left(\sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^{n_i} R_{ij}^4 - N \bar{S}^2 \right)$.

Se rechaza H_0 a nivel α si $T > \chi_{k-1, \alpha}^2$.

Comparaciones múltiples: Diremos que σ_i es significativamente distinta de σ_j si

$$\left| \frac{S_i}{n_i} - \frac{S_j}{n_j} \right| > t_{N-k, \alpha/2} \left(D^2 \frac{N-1-T}{N-k} \right)^{1/2} \left(\frac{1}{n_i} + \frac{1}{n_j} \right)^{1/2}$$

donde $t_{N-k, \alpha/2}$ es el valor crítico $\alpha/2$ de la distribución t con $N-k$ grados de libertad.

Test de Siegel-Tukey: Sean X_1, \dots, X_n e Y_1, \dots, Y_m muestras aleatorias de distribuciones $F((x-\mu)/\sigma)$ y $F((x-\mu)/\tau)$ respectivamente. Supongamos que las hipótesis de interés son

$$H_0: \sigma = \tau \quad \text{vs} \quad H_1: \sigma > \tau$$

Se asignan rangos de la siguiente manera:

- rango 1 a la menor observación en la muestra agrupada
- rango 2 a la mayor observación
- rango 3 a la segunda mayor observación
- rango 4 a la segunda menor observación y así sucesivamente.

Si la muestra X tiene mayor dispersión que la muestra Y, los rangos correspondientes a la muestra Y deberían ser mayores que los de la muestra X. Llamemos S_1, S_2, \dots, S_n a los rangos de la muestra Y en la muestra agrupada, el estadístico del test es

$$T_v = \sum_{i=1}^m S_i$$

y se rechazará H_0 a favor de H_1 si $T_v > c$. ¿Cómo se halla el valor c ?

Se puede probar que T_v tiene la misma distribución que el estadístico del test de Mann-Whitney, y por lo tanto si no hay empates y los tamaños de muestra son menores o iguales que 20, se puede utilizar la Tabla A7 de Conover. Si n y m son grandes se rechaza H_0 si

$$T_v > m(N+1) + z_\alpha \sqrt{\frac{mn(N+1)}{12}}$$

Este test se basa en el supuesto de que las medias de ambas muestras son iguales. Si ésto no ocurriese, podrían reemplazarse las medias por valores estimados y trabajar con $X_i - \hat{\mu}_X$ y $Y_j - \hat{\mu}_Y$. En este caso, debe usarse la distribución aproximada.

Eficiencia: Este test tiene menor eficiencia que los tests anteriores. Su eficiencia respecto al test F bajo normalidad es $6/\pi^2 = 0.608$ y bajo la distribución doble exponencial es 0.94. Otro problema adicional de este test es su falta de simetría, es decir que si se invierte el orden de ranqueo, el p-valor obtenido no será el mismo.

Ejemplo Este test aplicado a los datos del ejemplo usado previamente da por resultado

SIEGEL-TUKEY TEST

[Sum of scores from population < 1 >]

| Min | Max | Mean | Std-dev | Observed | Standardized |
|-------|-------|-------|---------|----------|--------------|
| 57.33 | 162.3 | 110.0 | 13.95 | 109.3 | -0.04778 |

Asymptotic Inference:

One-sided p-value: $\Pr \{ \text{Test Statistic} \leq \text{Observed} \} = 0.4809$
 Two-sided p-value: $2 * \text{One-sided} = 0.9619$

Test de Klotz: Es un test basado en scores normales, con alta eficiencia si la distribución es simétrica. Bajo normalidad su eficiencia respecto al test F es 1. Sean X_1, \dots, X_n e Y_1, \dots, Y_m muestras aleatorias de distribuciones $F((x-\mu)/\sigma)$ y $F((x-\mu)/\tau)$.

El estadístico del test de Klotz es

$$K = \sum_{i=1}^m \left[\Phi^{-1} \left(\frac{R(Y_i)}{N+1} \right) \right]^2$$

Klotz (1962) calculó la distribución exacta, pero si los tamaños de muestra son grandes puede utilizarse la aproximación Normal y

$$E(K) = \frac{m}{N} \sum_{i=1}^N \left[\Phi^{-1} \left(\frac{i}{N+1} \right) \right]^2$$

$$\text{Var}(K) = \frac{nm}{N(N-1)} \sum_{i=1}^N \left[\Phi^{-1} \left(\frac{i}{N+1} \right) \right]^4 - \frac{[E(K)]^2 n}{m(N-1)}$$

El test de Klotz aplicado a los datos del ejemplo anterior, da por resultado

KLOTZ TEST

[Sum of scores from population < 1 >]

| Min | Max | Mean | Std-dev | Observed | Standardized |
|-------|-------|-------|---------|----------|--------------|
| 1.347 | 14.28 | 7.624 | 2.022 | 7.613 | -0.005233 |

Asymptotic Inference:

One-sided p-value: $\Pr \{ \text{Test Statistic} \leq \text{Observed} \} = 0.4979$
 Two-sided p-value: $2 * \text{One-sided} = 0.9958$

Correlación de rangos y asociación

Introduciremos nociones de correlación basadas en rangos. Consideraremos el caso en que las observaciones consisten en pares $(X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)$ y supondremos que $(X_i, Y_i) \sim F(x, y)$ con F absolutamente continua con marginales F_X y F_Y en Ω_0 .

Antes de proponer métodos basados en rangos recordemos que el coeficiente de correlación lineal, o coeficiente de Pearson, se define como

$$r = \frac{\sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})(Y_i - \bar{Y})}{\left[\sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2 \sum_{i=1}^n (Y_i - \bar{Y})^2 \right]^{1/2}}$$

que es el cociente entre la covarianza muestral entre X e Y y el producto de sus desvíos standard muestrales. Este coeficiente es una v.a. que mide la asociación lineal entre X e Y y su función de distribución depende de la distribución de (X, Y) .

Presentaremos algunas medidas de correlación basadas en rangos cuya distribución no depende de la distribución de (X, Y) si ésta es absolutamente continua.

Coficiente Rho de Spearman: Es el coeficiente de Pearson aplicado a los rangos. Sean $R(X_i)$ el rango de X_i entre las X 's y $R(Y_i)$ el rango de Y_i entre las Y 's, entonces el coeficiente de correlación de Spearman (1904) se define como

$$\rho = \frac{\sum_{i=1}^n R(X_i)R(Y_i) - n\left(\frac{n+1}{2}\right)^2}{\left(\sum_{i=1}^n [R(X_i)]^2 - n\left(\frac{n+1}{2}\right)^2 \right)^{1/2} \left(\sum_{i=1}^n [R(Y_i)]^2 - n\left(\frac{n+1}{2}\right)^2 \right)^{1/2}}$$

Si no hay empates, se reduce a

$$\rho = 1 - \frac{6 \sum_{i=1}^n [R(X_i) - R(Y_i)]^2}{n(n^2 - 1)}$$

Si suponemos, sin pérdida de generalidad que $X_1 < X_2 < \dots < X_n$, entonces el coeficiente de correlación de Spearman puede expresarse como

$$\rho = \frac{\sum_{i=1}^n \left(i - \frac{n+1}{2} \right) \left(R(Y_i) - \frac{n+1}{2} \right)}{\left(\sum_{i=1}^n \left(i - \frac{n+1}{2} \right)^2 \right)^{1/2} \left(\sum_{i=1}^n \left(R(Y_i) - \frac{n+1}{2} \right)^2 \right)^{1/2}}$$

Muchas veces el coeficiente de Spearman se utiliza para testear independencia de variables aleatorias (la hipótesis nula es la independencia de X e Y). En rigor, se debería decir que se utiliza para testear correlación entre variables aleatorias. Bajo la hipótesis nula de independencia, los rangos de Y se distribuyen uniformemente sobre los primeros n enteros y

$$E(\rho) = 0 \qquad V(\rho) = \frac{1}{n-1}$$

A su vez, la distribución asintótica es:

$$\sqrt{n-1} \rho \xrightarrow{d} N(0,1)$$

La distribución exacta de ρ se ha tabulado para $n \leq 30$ (Tabla A10 de Conover) y para valores mayores de n, el cuantil p se aproxima mediante:

$$w_p \cong \frac{z_p}{\sqrt{n-1}}$$

donde z_p es el cuantil p de la distribución Normal standard. Los cuantiles inferiores se obtienen a partir de la relación $w_p = -w_{1-p}$.

Supongamos que se desea testear, por ejemplo, las hipótesis

H_0 : X e Y son no correlacionadas

H_1 : valores grandes de X tienden a estar apareados con valores grandes de Y y valores pequeños de X tienden a estar apareados con valores pequeños de Y.

Se rechazará H_0 si $\rho > w_{1-\alpha}$, siendo $w_{1-\alpha}$ el percentil $1-\alpha$ de la distribución exacta (Tabla A10 de Conover) o el percentil aproximado. El p-valor aproximado se obtiene en la forma

$$\text{p-valor} \cong P(Z > \rho\sqrt{n-1}) = 1 - \Phi(\rho\sqrt{n-1})$$

Ejemplo: Para estudiar la relación entre los scores obtenidos en los exámenes de ingreso a un Master y el promedio general obtenido al finalizar los estudios, se analizaron los datos correspondientes a 12 graduados del Master. En la siguiente tabla se presentan los datos y sus correspondientes rangos:

| Graduado | Ingreso (X) | Promedio (Y) | R(X) | R(Y) |
|----------|-------------|--------------|------|------|
| 1 | 710 | 4.0 | 12 | 11.5 |
| 2 | 610 | 4.0 | 9.5 | 11.5 |
| 3 | 640 | 3.9 | 11 | 10 |
| 4 | 580 | 3.8 | 8 | 9 |
| 5 | 545 | 3.7 | 3 | 8 |
| 6 | 560 | 3.6 | 5 | 7 |
| 7 | 610 | 3.5 | 9.5 | 5 |
| 8 | 530 | 3.5 | 1 | 5 |
| 9 | 560 | 3.5 | 5 | 5 |
| 10 | 540 | 3.3 | 2 | 3 |
| 11 | 570 | 3.2 | 7 | 1.5 |
| 12 | 560 | 3.2 | 5 | 1.5 |

El valor del coeficiente de Spearman ρ es 0.59.

Cálculo del coeficiente usando R:

```
ingreso<-c(710,610,640,580,545,560,610,530,560,540,570,560)
promedio<-c(4,4,3.9,3.8,3.7,3.6,3.5,3.5,3.5,3.3,3.2,3.2)
cor(rank(promedio),rank(ingreso))
```

0.5900188

Coeficiente Tau de Kendall (1938): Se basa en la definición de concordancia. Dadas dos observaciones bivariadas (X_1, Y_1) y (X_2, Y_2) diremos que son concordantes si

$$(X_1 > X_2 \wedge Y_1 > Y_2) \quad \text{ó} \quad (X_1 < X_2 \wedge Y_1 < Y_2)$$

o sea, si $sg(X_2 - X_1) sg(Y_2 - Y_1) = 1$. Análogamente, diremos que son discordantes si $sg(X_2 - X_1) sg(Y_2 - Y_1) = -1$.

Sea N_c el número de pares concordantes entre los $\binom{n}{2}$ pares posibles y N_d el número de pares discordantes. Por ahora suponemos que no hay empates.

El exceso de concordancia sobre discordancia será

$$N_c - N_d = \sum_{i < j} sg(X_j - X_i) sg(Y_j - Y_i)$$

Observemos que esta diferencia toma valores entre $-\frac{n(n-1)}{2}$ y $\frac{n(n-1)}{2}$. El coeficiente de Kendall se define como

$$\tau = \frac{N_c - N_d}{\max(N_c - N_d)} = \frac{2(N_c - N_d)}{n(n-1)}$$

De esta manera, si todos los pares son concordantes $\tau = 1$ y si todos los pares son discordantes $\tau = -1$. Bajo independencia $E(\tau) = 0$ pues $E(\text{sg}(X_j - X_i) \text{sg}(Y_j - Y_i)) = 0$

¿Cómo se procede si hay empates? Sólo se comparan los pares con $X_i \neq X_j$, es decir se descartan los empates en X, y se utiliza la siguiente forma del coeficiente:

$$\tau = \frac{N_c - N_d}{N_c + N_d}$$

donde los empates en Y se cuentan como $\frac{1}{2}$ en N_c y $\frac{1}{2}$ en N_d . Es decir:

- si $X_i = X_j$, se excluye ese par
- si $\text{sg}(X_j - X_i) \text{sg}(Y_j - Y_i) = 1$, se suma 1 a N_c
- si $\text{sg}(X_j - X_i) \text{sg}(Y_j - Y_i) = -1$, se suma 1 a N_d
- si $\text{sg}(X_j - X_i) \text{sg}(Y_j - Y_i) = 0$, se suma $1/2$ a N_c y $1/2$ a N_d

Goodman y Kruskal (1963) propusieron esta modificación del coeficiente de Kendall y algunos autores la denominan coeficiente gamma.

Ejemplo: En el ejemplo anterior, los números de pares concordantes y discordantes son $N_c = 44.5$ y $N_d = 17.5$, por lo cual

$$\tau = \frac{N_c - N_d}{N_c + N_d} = \frac{44.5 - 17.5}{44.5 + 17.5} = 0.4355$$

También el coeficiente tau de Kendall puede ser utilizado para testear la hipótesis de independencia (o mejor expresado "no correlación") entre X e Y. Se utiliza como estadístico del test, si no hay empates

$$T = N_c - N_d$$

y si hay empates el coeficiente τ . La distribución exacta bajo H_0 (independencia) de T y τ está tabulada para $n \leq 60$ (Tabla A11 de Conover). Para valores mayores de n o en presencia de empates, se aproxima el cuantil de τ mediante:

$$w_p = z_p \frac{\sqrt{2(2n+5)}}{3\sqrt{n(n-1)}}$$

y el cuantil de T mediante:

$$w_p = z_p \sqrt{n(n-1)(2n+5)/18}$$