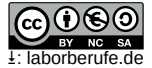


Anleitung zum F-Test: Prüfen, ob die Varianzen zweier Stichproben homogen sind



Gutes Lernvideo, das genau die Inhalte (9,5 min) dieser Anleitung wiedergibt: <https://youtu.be/betZ6r8z4XA>



Mit dem F-Test kann mit einer gewissen Konfidenz ($\hat{=}$ „Stichhaltigkeit“) entschieden werden, ob zwei Stichproben aus unterschiedlichen, normalverteilten Grundgesamtheiten sich hinsichtlich ihrer Varianzen ($s^2 = \text{Quadrate der Standardabweichungen}$, =**„Streuung“**) wesentlich unterscheiden. Nur wenn der F-Test als Ergebnis liefert, dass sich die Stichprobenstreuungen nicht wesentlich unterscheiden (= „homogene Varianzen“), liefert ein t-Test zum Stichprobenvergleich ein statistisch gültiges Ergebnis. Mit der Durchführung des F-Tests wird also geprüft, ob eine notwendige Vorbedingung des t-Tests erfüllt ist.

Beispiel: Bei zwei Farbstoffproben wurden mehrmals der Gehalt bestimmt. Mit den Stichprobenumfängen $n_A = 10$ und $n_B = 12$ resultieren folgende Ergebnisse (in mg/L):

												Mittelwert	Stichproben-Standardabweichung (s)
Probe A:	20,8	21,5	20,4	21,3	20,1	20,4	21,0	20,9	21,2	19,8		20,74	0,550151494287407
Probe B:	21,2	20,1	19,9	20,5	19,9	21,0	19,8	20,2	20,0	20,8	20,1	20,30	0,465149047471492

Es ist auf dem Signifikanzniveau von 95% (Irrtumswahrscheinlichkeit $\alpha = 5\% = 0,05$) zu prüfen, ob es die beiden Varianzen der Stichproben homogen sind.

Allgemeine Vorgehensweise	Konkretisierung für dieses Beispiel									
<p>1. Formulierung der Nullhypothese (H_0)</p> <p>Die Nullhypothese ist die Annahme, dass der Unterschied in den Varianzen der beiden Stichproben zufälliger Natur ist. Die beiden wahren Varianzen, die man erhalten würde, wenn man die Mittelwerte aus unendlich großen Stichprobenumfängen vergleichen würde, sind identisch. $s_A^2 = s_B^2$</p>	<p>1. Formulierung der Nullhypothese (H_0)</p> <p>Wir gehen davon aus, dass die wahren Varianzen bei unendlich großen Stichprobenumfängen in Wirklichkeit identisch sind. Der hier vorhandene Unterschied ist nur zufälliger Natur, da nur Stichproben mit geringem Umfang miteinander verglichen wurden. In Wirklichkeit ist $s_A^2 = s_B^2$.</p>									
<p>2. Berechnung der Prüfgröße, $F_{\text{Prüf}}$:</p> $F_{\text{Prüf}} = \frac{s_A^2}{s_B^2}$ <p>Varianzen so zuweisen, dass $s_A^2 > s_B^2$, d.h. für den Bruch kommt ein Ergebnis >1 heraus ($F_{\text{Prüf}} > 1$). Die Varianzen s_A^2 und s_B^2 sind die Quadrate der Stichproben-Standardabweichungen:</p> $s^2 = \frac{\sum (x_i - \bar{x})^2}{n - 1} \quad \text{oder} \quad s^2 = \frac{\sum x_i^2 - \frac{(\sum x_i)^2}{n}}{n - 1}$	<p>2. Berechnung der Teststatistik, $F_{\text{Prüf}}$:</p> <p>Da die Standardabweichungen s_A und s_B gegeben sind:</p> $s_A^2 = 0,550151494287407^2 = 0,3026666667$ $s_B^2 = 0,465149047471492^2 = 0,2163636364$ <p>Die größere der beiden Varianzen dient stets als Zähler.</p> $F_{\text{Prüf}} = \frac{0,3026666667}{0,2163636364} \approx 1,39888$									
<p>3. Vergleich mit Tabellenwert</p> <p>Der Freiheitsgrade der beiden Stichproben f_A und f_B betragen jeweils: $f = n - 1$.</p> <p>In der Tabelle mit der F-Verteilung in Abhängigkeit von f_A, f_B und α den Tabellenwert F_{Tabelle} ablesen. Wenn für das gegebene Signifikanzniveau gilt:</p> <ul style="list-style-type: none"> $F_{\text{Prüf}} > F_{\text{Tabelle}}$: Nullhypothese wird verworfen. $F_{\text{Prüf}} < F_{\text{Tabelle}}$: Nullhypothese wird akzeptiert. 	<p>3. Vergleich mit Tabellenwert</p> <p>Mit $f = 10 - 1 = 9$ und $f = 12 - 1 = 11$ resultiert aus der Tabelle mit der F-Verteilung:</p> <table border="1"> <tr> <td>0,72</td> <td>3,028</td> <td>2,9</td> </tr> <tr> <td>948</td> <td>2,896</td> <td>2,8</td> </tr> <tr> <td>849</td> <td>2,798</td> <td>2,7</td> </tr> </table> <p>Achtung: $f = 9$ gehört zur Datenreihe mit der größeren Varianz (s_A^2) \Rightarrow Legt die Spaltennummer fest. $F = 11$ legt die Zeilennummer fest. \Rightarrow nicht verwechseln.</p> <p>Da $F_{\text{Prüf}} < F_{\text{Tabelle}}$ ($1,39888 < 2,896$): Nullhypothese akzeptiert.</p>	0,72	3,028	2,9	948	2,896	2,8	849	2,798	2,7
0,72	3,028	2,9								
948	2,896	2,8								
849	2,798	2,7								
<p>4. Interpretation des Ergebnisses</p> <ul style="list-style-type: none"> Wenn Nullhypothese verworfen: Varianzen sind nicht homogen \Rightarrow t-Test nicht durchführbar. Die Fehlerwahrscheinlichkeit für irrtümliche Verwerfung beträgt α. Wenn Nullhypothese akzeptiert: Varianzen sind homogen \Rightarrow t-Test durchführbar. Wahrscheinlichkeit für eine irrtümliche Akzeptanz (β-Fehler) ist nicht bekannt. 	<p>4. Interpretation des Ergebnisses</p> <p>Die Varianzen sind auf dem Signifikanzniveau „95%“ ($\alpha = 0,05$) homogen, der t-Test deshalb durchführbar. Die Wahrscheinlichkeit für eine irrtümliche Akzeptanz der Nullhypothese (β-Fehler) ist nicht bekannt.</p>									

*: Es existiert ein modifizierter Test, der keine Gleichheit der Varianzen voraussetzt, der WELCH-Test.