

Intervallo di Probabilità e di Confidenza

Intervallo di probabilità

Grazie al teorema del limite centrale, se la v.c. X ha $E(x)=\mu$ e $\text{Var}=\sigma^2$ si ha (per $n \rightarrow \infty$) che:

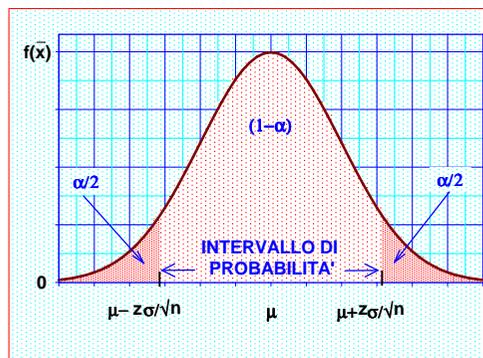
$$\bar{x} \sim N\left(\mu, \frac{\sigma^2}{n}\right)$$



Possiamo calcolare la probabilità che una data media campionaria ha di appartenere ad un certo intorno della **media vera μ** della variabile casuale x

Intervallo di probabilità

Consideriamo l'intervallo $\mu \pm z_{\alpha/2} \sigma / \sqrt{n}$ simmetrico attorno alla media vera μ



Intervallo di probabilità

In base alla distribuzione campionaria di \bar{x} la probabilità di ottenere una media campionaria appartenente a tale intervallo è $(1-\alpha)$, ovvero

$$p \{ \mu - z_{\alpha/2} \sigma / \sqrt{n} < \bar{x} < \mu + z_{\alpha/2} \sigma / \sqrt{n} \} = 1 - \alpha$$

e tale intervallo è detto

**INTERVALLO DI PROBABILITÀ
PER LA MEDIA CAMPIONARIA**

- Intervallo di ampiezza nota $= 2\Delta = 2z_{\alpha/2} \sigma / \sqrt{n}$
- Centrato sull'ignoto parametro μ

Intervallo di confidenza

Con semplici passaggi algebrici sulle due equazioni, possiamo esprimere l'intervallo in termini del valore osservato \bar{x} :

$$p \{ \bar{x} - z_{\alpha/2} \sigma / \sqrt{n} < \mu < \bar{x} + z_{\alpha/2} \sigma / \sqrt{n} \} = 1 - \alpha$$

- Intervallo di ampiezza nota $= 2\Delta = 2z_{\alpha/2} \sigma / \sqrt{n}$
- Centrato sulla media campionaria nota \bar{x}

Tale intervallo è detto

INTERVALLO DI CONFIDENZA PER IL PARAMETRO μ

Intervallo di confidenza

Poiché dipende dalla variabile \bar{X} :

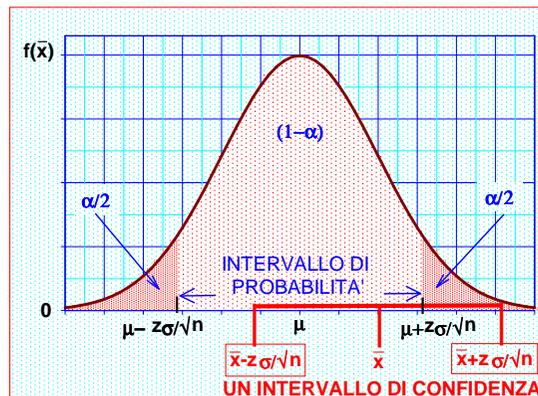
- Varia casualmente attorno al parametro μ
- Ha probabilità pari a $(1 - \alpha)$ di includere il parametro μ della variabile \mathbf{X}

Si noti che:

È **impossibile risalire** da una stima campionaria **al vero valore del parametro μ** di un universo, ma ...

... è possibile determinare in base a tale stima un **intervallo** che abbia una **prefissata probabilità** $(1 - \alpha)$ **di includere il parametro μ**

Intervallo di probabilità e di confidenza



Intervallo di confidenza

L'**ampiezza** ($2\Delta = 2z_{\alpha/2} \sigma / \sqrt{n}$) dell'IC :

esprime l'**indeterminazione** con cui è noto il valore di μ .

L'ampiezza **non dipende** dal valore di μ .

A parità del livello di confidenza $1 - \alpha$:

- maggiore è l'ampiezza dell'IC, minore è la precisione della stima campionaria di μ ,
- l'ampiezza dipende dall'**errore standard** (σ / \sqrt{n}), che a sua volta dipende dalla **dimensione** (n) del **campione** e quindi
- diminuisce al crescere di n , ovvero, al crescere di n la precisione aumenta

All'aumentare del grado di confidenza (es 99% invece di 95%) l'ampiezza dell'IC aumenta e la precisione diminuisce

Dimensione del campione

Data σ



è possibile calcolare la

dimensione del campione

necessaria per ottenere

un intervallo di confidenza **(1- α)** e ampiezza **2 Δ**

$$\Delta = z_{\alpha/2} \sigma / \sqrt{n}$$



$$n = (z_{\alpha/2} \sigma / \Delta)^2$$

1) Calcolare la numerosità campionaria necessaria per soddisfare le condizioni richieste

$$n = (z_{\alpha/2} \sigma / \Delta)^2$$

$$n = (1.96 * 1.1 / 0.35)^2 = 37.9 \approx 40 \text{ soggetti}$$

Servono almeno 40 soggetti per ottenere una stima con la precisione prescelta

Esempio

- Si vuole stimare il valore medio μ dell'uricemia in una popolazione maschile: è noto che in tale popolazione la dispersione dell'uricemia è $\sigma = 1.1$ mg/dl. Si richiede che la **confidenza** sia **del 95%** e che l'**indeterminazione Δ** non ecceda **0.35 mg/dl**.

2) Si supponga di aver estratto un campione casuale di 40 soggetti dalla popolazione e di aver determinato il valore di uricemia di ognuno dei 40 soggetti. La media di tali valori risulta $\bar{x} = 5.55$ mg/dl).

Si ricavi l'intervallo di confidenza della media al 95%

$$\text{I.C.}_{95\%} = \bar{x} \pm z_{\alpha/2} \sigma / \sqrt{n}$$

$$\text{I.C.}_{95\%} = 5.55 \pm 1.96 \times \frac{1.1}{\sqrt{40}} = 5.55 \pm 0.34 = (5.21, 5.89)$$

3) Sullo stesso campione, con $\bar{x} = 5.55$ mg/dl, di ricavi l'IC al 90%

$$I.C._{90\%} = \bar{x} \pm z_{\alpha/2} \sigma / \sqrt{n}$$

$$I.C._{90\%} = 5.55 \pm 1.64 \times \frac{1.1}{\sqrt{40}} = 5.55 \pm 0.29 = (5.26, 5.84)$$

L'intervallo di confidenza ha **minor ampiezza** ma siamo **meno certi** di prima che questo intervallo "catturi" il valor vero

Conclusioni

1. Possiamo dire, con una buona confidenza (del 95%) che **l'ignoto parametro μ è compreso tra 5.21 e 5.89 mg/dl**
2. Si noti che: μ (il valor vero) è compreso oppure no nell'intervallo non ci sono altre possibilità!
Ciò che noi diciamo è che **siamo abbastanza certi** che **questo intervallo "catturi"** il valor vero
3. **L'affermazione che l'intervallo contiene il valor vero potrebbe anche essere falsa**, ma con probabilità del 5%, quindi piuttosto bassa