

## مقایسهٔ آزمون بیزی و بسامدی برای پارامتر واریانس توزیع نرمال در حضور پارامتر مزاحم، در حالات دوطرفه و یک‌طرفه

بهزاد فلاحی‌فرد، رحیم چینی‌پرداز\*، سعید حبیب‌الهی تبار؛

دانشگاه شهید چمران اهواز، گروه آمار

پذیرش ۹۵/۴/۲

دریافت ۹۳/۱۱/۲۰

### چکیده

در این مقاله به بررسی آزمون واریانس جامعهٔ نرمال با میانگین مجهول، به دو روش معنی‌داری و بیزی می‌پردازیم. ابتدا تحت یک پیشین خاص، احتمال پسین فرضیه صفر آزمون دوطرفه، به‌دست‌آمده و با مقدار احتمال مقایسه می‌شود. سپس بزرگ‌ترین کران پایین احتمال پسین برای آزمون دوطرفه روی برخی رده‌هایی از توزیع‌های پیشین، با مقدار احتمال مقایسه می‌شود. در مرحلهٔ بعدی مقدار احتمال و احتمال پسین فرضیه صفر برای آزمون یک‌طرفه محاسبه شده است. در نهایت مشاهده می‌شود که در آزمون دوطرفه نتایج بیزی و معنی‌داری باهم سازگار نیستند درحالی‌که نوعی توافق بین این دو دیدگاه در آزمون یک‌طرفه دیده می‌شود.

**واژه‌های کلیدی:** مقدار احتمال، پارامتر مزاحم، کران پایین احتمال پسین.

### مقدمه

فرض می‌کنیم  $\mathbf{x} = (x_1, x_2, \dots, x_n)$  نمونه‌ای تصادفی مشاهده شده از جامعه‌ای با تابع چگالی  $f(x|\lambda)$ ،  $\lambda \in \Lambda \subseteq R$  باشد. برای آزمون  $H_0: \lambda \in \Lambda_0$  در مقابل  $H_1: \lambda \in \Lambda_1$  آماردانان بیزی از احتمال پسین<sup>۱</sup> درست بودن  $H_0$  یا عامل بیز<sup>۲</sup>، و آماردانان بسامدی<sup>۳</sup> معمولاً از معیار مقدار احتمال<sup>۴</sup> استفاده می‌کنند و برای برخی از توزیع‌ها نشان داده‌اند به‌ازای مقدار احتمال ثابت با افزایش تعداد نمونه، احتمال پسین درست بودن فرضیه  $H_0$ ، به سمت یک میل می‌کند (لیندلی<sup>۵</sup> ۱۹۵۷ و برگر و دلامپادی<sup>۶</sup> ۱۹۸۷).

لیندلی (۱۹۵۷) آزمون نقطه‌ای در مقابل دوطرفه را، برای میانگین توزیع نرمال، با در نظر گرفتن یک پیشین ناآگاهی بخش<sup>۷</sup> انجام داد و تعارض بین این دو روش را نشان داد. در تأیید کار لیندلی، جفریز<sup>۸</sup> (۱۹۶۱)، بر اساس یک توزیع پیشین مزدوج<sup>۹</sup> احتمال پسین برای میانگین را به‌دست آورد و نشان داد که احتمال پسین  $H_0$  همیشه از مقدار احتمال، بیش‌تر است. در قدم بعدی، آماردانان به مقایسه این دو روش برای تعداد نمونه ثابت و رده‌ای از توزیع‌های

\*نویسندهٔ مسنول chinipardaz\_r@scu.ac.ir

1. Posterior Probability
2. Bayes Factor
3. Frequentist
4. P-value
5. Lindley
6. Berger and Delampady
7. Non-informative Prior
8. Jeffreys
9. Conjugate Prior

پیشین پرداختند. سپس بزرگ‌ترین کران پایین احتمال پسین، تحت رده موردنظر از پیشین‌ها را با مقدار احتمال مقایسه کردند. ادوارد<sup>۱</sup> و دیگران (۱۹۶۳) با استفاده از رده همه توزیع‌های پیشین ممکن، برای آزمون دوطرفه میانگین توزیع نرمال، نشان دادند که هنوز کران پایین احتمال پسین از مقدار احتمال بزرگ‌تر است. به دنبال این نتایج تحقیقات دیگری با استفاده از رده‌های معقولی از توزیع‌های پیشین در آزمون‌های دوطرفه برای توزیع‌های دو جمله‌ای، نرمال، نمایی و پواسن به ترتیب برگر و دلامپادی (۱۹۸۷)، برگر و سلک<sup>۲</sup> (۱۹۸۷)، پیبل<sup>۳</sup> (۱۹۸۸)، چینی پرداز<sup>۴</sup> (۲۰۰۳) انجام دادند. هم‌چنین برخی تحقیقات نیز برای ایجاد توافق بین این دو شیوه انجام شده است، عمده این کارها در آزمون‌های یک‌طرفه صورت گرفته که می‌توان به کارهای برگر و کسلا<sup>۵</sup> (۱۹۸۷)، چینی پرداز و نوربلوچی<sup>۶</sup> (۲۰۰۳) اشاره کرد.

همه مواردی که از آن‌ها نام برده شد، مسئله وجود توافق یا تعارض بین آزمون‌های معنی‌داری و بی‌زی را، بدون در نظر گرفتن پارامتر مزاحم<sup>۷</sup> در مدل بررسی کرده‌اند. یین<sup>۸</sup> (۲۰۱۱) آزمون یک‌طرفه را در توزیع نمایی و چینی پرداز و مهری<sup>۹</sup> (۲۰۱۵) آزمون دوطرفه را در توزیع پارتو در حضور پارامتر مزاحم در نظر گرفته و به بررسی توافق یا تعارض بین این دو شیوه پرداخته‌اند. نتیجه این بررسی‌ها وجود تعارض بین دو شیوه بی‌زی و بسامدی در آزمون‌های دوطرفه بود. هدف این مقاله بررسی توافق یا تعارض برای آزمون دوطرفه و یک‌طرفه پارامتر واریانس توزیع نرمال در حضور پارامتر مزاحم (میانگین مجهول) به شیوه بسامدی و بی‌زی است.

بخش دوم شامل فرمول‌بندی مسئله است. بخش سوم به آزمون دوطرفه واریانس توزیع نرمال با در نظر گرفتن یک پیشین خاص برای آن می‌پردازد. در این بخش برای پارامتر مزاحم، توزیع پیشین نرمال در نظر گرفته شده است. از آنجا که در این بخش، همواره مقدار احتمال پسین از مقدار احتمال بیش‌تر است در مقابل این اندیشه که گرفتن یک توزیع پیشین خاص برای پارامتر مورد آزمون ممکن است یک‌جانبه‌نگری نسبت به فرضیه  $H_0$  محسوب شود، در بخش چهارم آزمون دوطرفه واریانس، وقتی که توزیع پیشین پارامتر آزمون عضو رده‌ای از توزیع‌های پیشین است در نظر گرفته می‌شود. بخش پنجم مقاله، به آزمون یک‌طرفه پارامتر واریانس در حضور پارامتر مزاحم به شیوه بسامدی و بی‌زی و مقایسه این دو می‌پردازد. در بخش ششم نیز به بحث و نتیجه‌گیری بر اساس نتایجی که به دست آمده است پرداخته می‌شود.

### فرمول‌بندی

فرض کنید  $X_1, X_2, \dots, X_n$  نمونه‌ای تصادفی از توزیع نرمال  $N(\theta, \lambda)$  است که در آن هر دو پارامتر  $\theta$  و  $\lambda$  مجهول‌اند، آزمون فرضیه‌های

$$\begin{aligned} H_0 : \lambda &= \lambda_0 \\ H_1 : \lambda &\neq \lambda_0 \end{aligned} \quad (1)$$

1. Edwards
2. Berger and Sellke
3. Pepple
4. Chinipardaz
5. Casella and Berger
6. Noorbaloohi
7. Nuisance Parameter
8. Yin
9. Chinipardaz and Mehri

را در نظر بگیرید. نسبت درست‌نمایی<sup>۱</sup> برای آزمون (۱) عبارت است:

$$\frac{f_{H_0}(\mathbf{x})}{f_{H_1}(\mathbf{x})} = \left( \frac{\sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2}{\sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2} \right)^{\frac{n}{2}} e^{\frac{-\sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2}{2\lambda}}$$

که با توجه به آن، فرضیه  $H_0$  رد می‌شود اگر  $\sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2 < k_1$  یا  $\sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2 > k_2$  ( $k_1 < k_2$ ) باشد. بنابراین دامنه سمت راست یا چپ  $T(\mathbf{X}) = \sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2$  علیه فرضیه  $H_0$  هستند. همچنین  $T(\mathbf{X})$  تابعی از آماره‌های بسنده<sup>۲</sup>  $(\sum_{i=1}^n X_i, \sum_{i=1}^n X_i^2)$  نیز است. بر این اساس  $T(\mathbf{X})$  آماره آزمون معنی‌داری است که مقادیر بزرگ و کوچک آن علیه  $H_0$  هستند. با توجه به این که  $\frac{T(\mathbf{X})}{\lambda_0}$  تحت  $H_0$  دارای توزیع  $\chi_{n-1}^2$  است، مقدار احتمال از رابطه (۲) به‌دست می‌آید:

$$P\text{-value} = 2 \min \left\{ P_{H_0} (T(\mathbf{X}) \leq t(\mathbf{x})), P_{H_0} (T(\mathbf{X}) \geq t(\mathbf{x})) \right\} \\ = 2 \min \left\{ P_{H_0} \left( \chi_{n-1}^2 \leq \frac{t(\mathbf{x})}{\lambda_0} \right), P_{H_0} \left( \chi_{n-1}^2 \geq \frac{t(\mathbf{x})}{\lambda_0} \right) \right\} \quad (2)$$

که در آن  $t(\mathbf{x})$  مقدار مشاهده شده  $T(\mathbf{X})$  است (ویلیامسون<sup>۳</sup> ۲۰۰۴).

برای انجام آزمون دوطرفه (۱) به روش بیزی، ابتدا فرض می‌شود که فرضیه‌های  $H_0$  و  $H_1$  به ترتیب دارای احتمال‌های پیشین<sup>۴</sup>  $\pi_0$  و  $1 - \pi_0$  باشند، با توجه به وجود پارامتر مزاحم، احتمال پسین  $H_0$  تابعی از پارامتر مزاحم مزاحم خواهد بود. برای رفع این مشکل، یک توزیع پیشین برای آن در نظر می‌گیرند. اگر  $\pi(\theta | H_0)$  و  $\pi(\theta | H_1)$  به ترتیب نشان‌دهنده توزیع پیشین پارامتر مزاحم تحت  $H_0$  و  $H_1$  باشد آن‌گاه احتمال پسین فرضیه  $H_0$  وقتی  $\mathbf{x}$  مشاهده شده است عبارت است از:

$$P(H_0 | \mathbf{x}) = P(H_0 | \bar{x}, t) = \left[ 1 + \frac{1 - \pi_0}{\pi_0} \times \frac{m(\bar{x}, t | H_1)}{m(\bar{x}, t | H_0)} \right]^{-1} \quad (3)$$

که  $(\bar{x}, t)$  مقدار مشاهده شده آماره  $(\bar{X}, T(\mathbf{X}))$  است که رابطه یک‌به‌یک با آماره بسنده  $(\sum_{i=1}^n X_i, \sum_{i=1}^n X_i^2)$  دارد، و

$$m(\bar{x}, t | H_0) = \int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \lambda | \bar{x}, t) \pi(\theta | H_0) d\theta \quad (4)$$

$$m(\bar{x}, t | H_1) = \int_0^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \lambda | \bar{x}, t) \pi(\theta | \lambda, H_1) \pi(\lambda | H_1) d\theta d\lambda \quad (5)$$

که  $L(\theta, \lambda | \bar{x}, t)$  نشان‌دهنده تابع درست‌نمایی بر اساس آماره بسنده  $(\bar{X}, T)$  است و  $\pi(\lambda | H_1)$  تابع چگالی تحت  $H_1$  است. چنان‌که گفته شد در دیدگاه بیزی احتمال‌های پیشین  $\pi_0$  و  $1 - \pi_0$  را به ترتیب به فرضیه‌های  $H_0$  و  $H_1$  نسبت می‌دهند. فرض می‌کنیم جرم احتمال  $1 - \pi_0$  روی فضای  $H_1$  مطابق با چگالی  $\pi(\lambda | H_1)$  پراکنده شده باشد؛ از این‌رو تابع چگالی  $\lambda$  روی کل فضا، بدین‌صورت است:

$$\pi(\lambda) = \pi_0 I_{\{\lambda\}}(\lambda) + (1 - \pi_0) \pi(\lambda | H_1) I_{\Lambda - \{\lambda\}}(\lambda)$$

1. Likelihood Ratio  
2. Sufficient Statistic  
3. Williamson  
4. Prior Probabilities

که  $I$  تابع نشان‌گر است.

اگر به جای آزمون (۱)، فرضیه‌های یک‌طرفه‌ی

$$\begin{aligned} H'_0 &: \lambda \leq \lambda_0 \\ H'_1 &: \lambda > \lambda_0 \end{aligned} \quad (۶)$$

آزمون شوند، در این صورت مقادیر سمت راست آماره  $T(\mathbf{X})$  علیه فرضیه  $H_0$  هستند، پس مقدار احتمال به صورت (۷) به دست می‌آید:

$$\begin{aligned} P\text{-value} &= P_{H_0}(T(\mathbf{X}) \geq t(\mathbf{x})) \\ &= P_{H_0}\left(\chi_{n-1}^2 \geq \frac{t(\mathbf{x})}{\lambda_0}\right) \end{aligned} \quad (۷)$$

برای انجام آزمون (۶) به شیوه بیزی فرض می‌شود که  $\lambda$  و  $\theta$  دارای توزیع پیشین توأم به به صورت (۸) باشند:

$$\pi(\theta, \lambda) = \pi(\theta | \lambda)\pi(\lambda) \quad (۸)$$

در این صورت:

$$\begin{aligned} P(H'_0 | \mathbf{x}) &= P(\lambda \leq \lambda_0 | \mathbf{x}) = \int_0^{\lambda_0} \pi(\lambda | \mathbf{x}) d\lambda \\ &= \int_0^{\lambda_0} \int_{-\infty}^{\infty} \pi(\theta, \lambda | \mathbf{x}) d\theta d\lambda \\ &= \frac{\int_0^{\lambda_0} \int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \lambda | \bar{x}, t) \pi(\theta | \lambda) \pi(\lambda) d\theta d\lambda}{\int_0^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \lambda | \bar{x}, t) \pi(\theta | \lambda) \pi(\lambda) d\theta d\lambda} \end{aligned} \quad (۹)$$

در دو بخش بعدی، آزمون (۱) به دو شیوه بیزی و معنی‌داری بررسی می‌شود.

## تعارض بین مقدار احتمال و احتمال پسین در آزمون دوطرفه وارینس، با استفاده از یک پیشین خاص

فرضیه‌های (۱) را در نظر می‌گیریم هرگاه  $\mathbf{x} = (x_1, x_2, \dots, x_n)$  مشاهده‌ای از  $N(\theta, \lambda)$  باشد، آن‌گاه

$$L(\theta, \lambda | \bar{x}, t) = f_{\bar{x}, T}(\bar{x}, t | \theta, \lambda) = \sqrt{\frac{n}{2\pi\lambda}} e^{-\frac{n}{2\lambda}(\bar{x}-\theta)^2} \times \left(\frac{t}{4\lambda}\right)^{\frac{n-1}{2}} \frac{e^{-\frac{t}{2\lambda}}}{t\Gamma\left(\frac{n-1}{2}\right)} \quad (۱۰)$$

برای آزمون دوطرفه (۱) به شیوه بیزی معمولاً فرض می‌شود که  $\lambda$  دارای توزیع گاما معکوس (پیشین مزدوج)، به طوری که  $E(\lambda | H_1) = \lambda_0$  (دگروت<sup>۱</sup> ۱۹۷۰) باشد.

$$\pi(\lambda | H_1) = \frac{1}{\beta^\alpha \Gamma(\alpha)} \lambda^{-(\alpha+1)} e^{-\frac{1}{\beta\lambda}}, \quad \alpha > 0, \beta > 0, \frac{1}{\beta(\alpha-1)} = \lambda. \quad (11)$$

از آن جاکه تابع درست‌نمایی، تابعی از پارامتر مجهول  $\theta$  است، به منظور پیدا کردن توزیع حاشیه‌ای  $(\bar{x}, t)$  با در نظر گرفتن توزیع‌های پیشین (۱۲) برای پارامتر  $\theta$ ، به تجمیع اثر پارامتر می‌پردازیم (روبرت، ۲۰۰۷).

$$\begin{aligned} \pi(\theta | H_0) &\equiv N(\mu, \lambda_0) \\ \pi(\theta | \lambda, H_1) &\equiv N(\mu, \lambda) \end{aligned} \quad (12)$$

که در آن  $\mu$  معلوم است. بر اساس روابط (۴) و (۵) داریم:

$$m(\bar{x}, t | H_0) = \sqrt{\frac{n}{2\pi\lambda_0(n+1)}} \left(\frac{t}{4\lambda_0}\right)^{\frac{n-1}{2}} \frac{1}{t} \exp\left\{-\frac{t}{2\lambda_0} - \frac{n(\bar{x}-\mu)^2}{n+1}\right\} \quad (13)$$

و

$$m(\bar{x}, t | H_1) = \frac{\sqrt{\frac{2n}{\pi(n+1)}} \left(\frac{\beta}{4}\right)^{\frac{n}{2}} t^{\frac{n-3}{2}}}{\text{Beta}\left(\frac{n-1}{2}, \alpha\right) \left(\frac{\beta}{2}t + \frac{\beta}{2} \frac{n}{n+1} (\bar{x}-\mu)^2 + 1\right)^{\alpha+\frac{n}{2}}}, \beta = \frac{1}{\lambda_0(\alpha-1)} \quad (14)$$

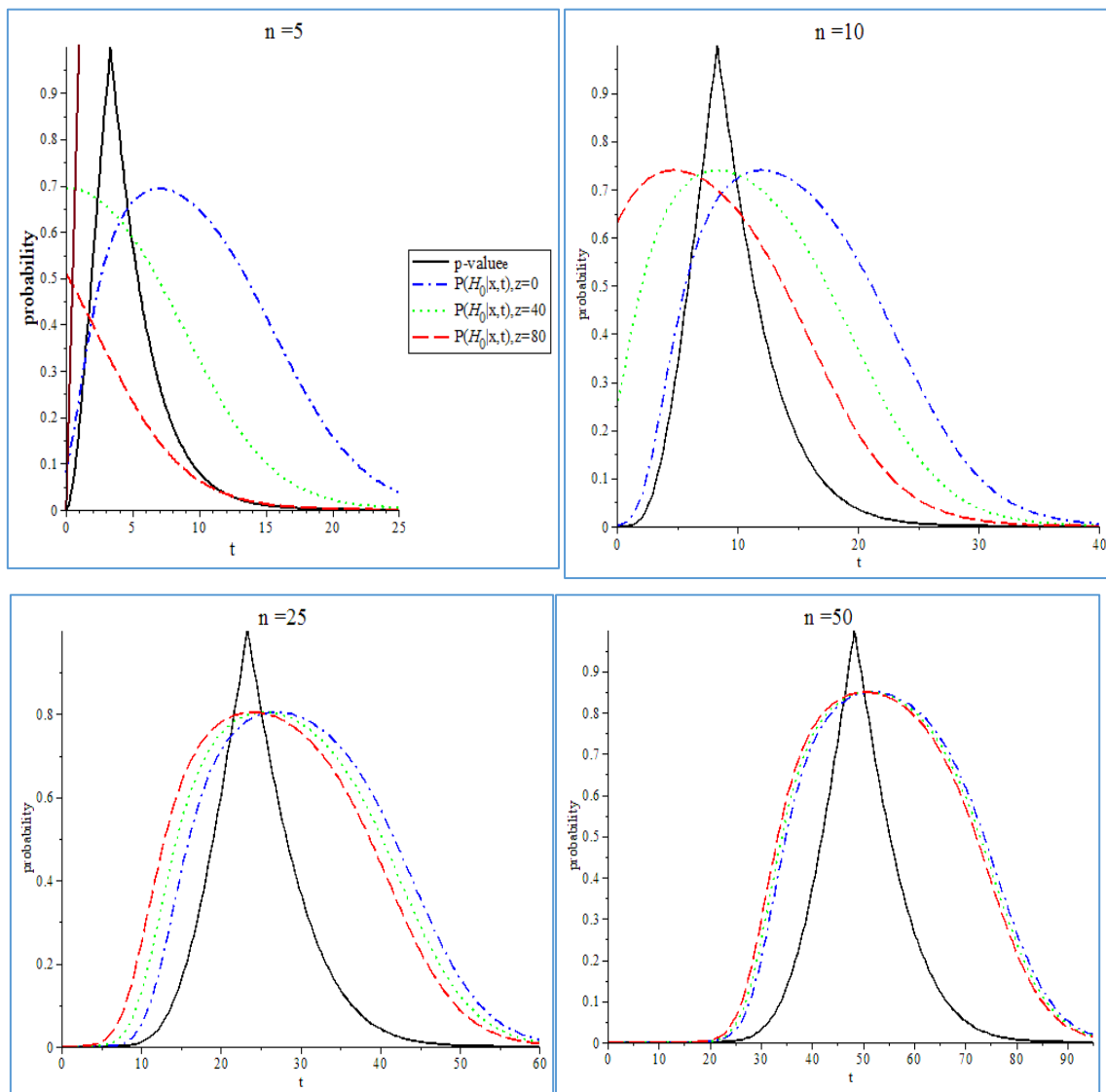
$$P(H_0 | \bar{x}, t) = \left[ 1 + \frac{1-\pi_0}{\pi_0} \frac{(\beta)^{\frac{n}{2}} \Gamma(\alpha + \frac{n}{2})}{\Gamma(\alpha)} \frac{e^{\frac{t}{2\lambda_0} + \frac{z}{2(n+1)}}}{\left(\frac{1}{\lambda_0} + \frac{\beta z}{2(n+1)} + \frac{\beta t}{2\lambda_0}\right)^{(\alpha+\frac{n}{2})}} \right], z = \frac{n(\bar{x}-\mu)}{\lambda_0}, \beta = \frac{1}{\lambda_0(\alpha-1)} \quad (15)$$

که در اینجا  $t$  مقدار مشاهده‌شده  $T(X)$  است.

شکل ۱ مقایسه بین مقدار احتمال و احتمال پسین فرضیه صفر را نشان می‌دهد از آن جاکه  $P(H_0 | \bar{x}, t)$  به دو مقدار  $Z$  و  $t$  وابسته است، نمودار  $P(H_0 | \bar{x}, t)$  برای مقادیر مختلف  $Z$  و  $t$  رسم شده است هرگاه  $n$  زیاد نباشد، به ازای  $P$ -value های کوچک- که دلیلی بر رد  $H_0$  به شیوه بسامدی (معنی‌داری) است-  $P(H_0 | \bar{x}, t)$  بزرگ‌تر از  $P$ -value است و با افزایش  $n$ ،  $P(H_0 | \bar{x}, t)$  از تمامی مقادیر  $P$ -value بزرگ‌تر خواهد بود. این نتیجه بیان‌گر این است که در مواقعی که معیار مقدار احتمال برای آزمون (۱) تمایل به رد فرضیه  $H_0$  دارد، معیار احتمال پسین دلیل کافی بر رد  $H_0$  ارائه نمی‌دهد و برای  $n$  های بزرگ در بعضی موارد حتی  $P(H_0 | \bar{x}, t)$  تمایل به پذیرش  $H_0$  دارد.

### مقایسه آزمون دوطرفه واریانس به شیوه بسامدی و بیزی در رده توزیع‌های پیشین

برای بسیاری از آماردانان استفاده از یک توزیع پیشین خاص برای پارامتر مورد آزمون، یک‌جانبه‌نگری نسبت به فرضیه  $H_0$  محسوب می‌شود. بنابراین برای مقایسه آزمون‌های معنی‌داری و بیزی، به جای استفاده از یک توزیع پیشین



شکل ۱. مقایسه بین مقدار احتمال و احتمال پسین فرضیه صفر با استفاده از توزیع‌های پیشین (۱۱) و (۱۲)

معین، رده‌هایی از توزیع‌های پیشین در نظر گرفته و سپس بزرگ‌ترین کران پایین احتمال پسین فرضیه  $H_1$ ، روی این رده با مقدار احتمال مقایسه می‌شود. هرگاه پارامتر مزاحم در مدل وجود داشته باشد این کران پایین تحت تأثیر پارامتر مزاحم است. راه‌حلی مناسب برای رفع این مشکل استفاده از یک توزیع پیشین برای پارامتر مزاحم  $(\theta)$  و رده‌ای از توزیع‌های پیشین برای پارامتر مورد آزمون  $(\lambda)$  است. یعنی اگر رابطه

$$\pi(\theta, \lambda | H_1) = \pi(\theta | \lambda, H_1)\pi(\lambda | H_1)$$

را برای توزیع پیشین  $(\theta, \lambda)$  تحت فرض  $H_1$  در نظر بگیریم؛ آن‌گاه  $\pi(\lambda | H_1) \in G$  را در نظر می‌گیریم، که  $G$  رده‌ای مناسب از توزیع‌های پیشین است. هم‌چنین باید یک توزیع پیشین خاص را به صورت  $\pi(\theta | \lambda, H_1)$  در نظر گرفت. از آن‌جاکه در حالت کلی اطلاعات خاصی در مورد  $\theta$  نداریم از توزیع پیشین ناآگاهی بخش (۱۶) که جرم را روی نواحی خاصی پراکنده نمی‌کند استفاده می‌کنیم.

$$\pi(\theta | H_0) = \pi(\theta | \lambda, H_1) = 1, \quad \theta \in \mathbb{R} \tag{۱۶}$$

$$P_G(H_0 | \bar{x}, t) = \inf_{\pi \in G} P(H_0 | \bar{x}, t) = \left[ 1 + \frac{1 - \pi_0 \sup_{\pi \in G} m(\bar{x}, t | H_1)}{\pi_0 m(\bar{x}, t | H_0)} \right]^{-1} \quad (17)$$

در این صورت

که  $m(\bar{x}, t | H_0)$  و  $m(\bar{x}, t | H_1)$  از روابط (۴) و (۵) به دست می آیند.

رده‌های گوناگونی برای توزیع پیشین  $\lambda$  می توان در نظر گرفت. این مقاله به چهار رده مناسب از این توزیع‌های پیشین پرداخته است:

$$\{ \text{رده تمام توزیع‌های پیشین ممکن} \} = G_A$$

$$\{ \text{رده توزیع‌های پیشین مزدوج با میانگین } \lambda \} = G_C$$

$$\{ \text{رده توزیع‌های پیشین با میانه } \lambda \} = G_{ME}$$

$$\{ \text{رده توزیع‌های پیشین تک‌نمایی و متقارن حول } \lambda \} = G_{US}$$

این رده‌ها با استفاده از بررسی‌های برگر و سلک (۱۹۸۷) و برگر و دلامپادی (۱۹۸۷) به دست آمده‌اند. آن‌ها این رده‌ها را برای آزمون کردن پارامتر، بدون حضور پارامتر مزاحم در مدل، در نظر گرفته‌اند.

### ۱. کران پایین برای $G_A$

قضیه ۱: برای آزمون فرضیه  $H_0: \lambda = \lambda_0$  در مقابل  $H_1: \lambda \neq \lambda_0$  اگر  $\pi(\lambda | H_1) \in G_A$  و توزیع پارامتر مزاحم - ناآگاهی بخش (۱۶) - باشد:

$$P_{G_A}(H_0 | \bar{x}, t) = \left[ 1 + \frac{1 - \pi_0 m(\bar{x}, t | \hat{\lambda}, H_1)}{\pi_0 m(\bar{x}, t | H_0)} \right]^{-1} \\ = \left[ 1 + \frac{1 - \pi_0 \left( \frac{\lambda_0 n}{t} \right)^{\frac{n-1}{2}} e^{\frac{t-n\lambda_0}{2\lambda_0}}}{\pi_0} \right]^{-1} \quad (18)$$

که با توجه به (۱۶) و (۴) داریم:

$$m(\bar{x}, t | H_0) = \left( \frac{t}{4\lambda_0} \right)^{\frac{n-1}{2}} \frac{e^{-\frac{t}{2\lambda_0}}}{t\Gamma\left(\frac{n-1}{2}\right)} \quad (19)$$

واضح است که  $m_\pi(\bar{x}, t | H_1)$  نسبت به  $\lambda$ ، به‌ازای برآورد ماکسیمم درست‌نمایی یعنی  $\hat{\lambda} = \frac{\sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2}{n}$  ماکسیمم می‌شود و از این رو  $\sup_{G_A} m(\bar{x}, t | H_1) = m(\bar{x}, t | H_1, \hat{\lambda}) = \int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \hat{\lambda}) d\theta$  در ستون اول جدول ۱ مقادیر  $P_G(H_0 | \bar{x}, t)$  به‌ازای مقادیر مختلف  $n$  به دست آورده شده است. با مقایسه این ستون و مقدار احتمال در این جدول مشخص می‌شود که مقادیر کران پایین احتمال پسین برای  $G_A$  بسیار بزرگ‌تر از مقدار احتمال هستند.

### ۲. کران پایین برای $G_{ME}$

قضیه ۲: برای آزمون  $H_0: \lambda = \lambda_0$  در مقابل  $H_1: \lambda \neq \lambda_0$  اگر  $\pi(\lambda | H_1) \in G_{ME}$  و توزیع پارامتر مزاحم ناآگاهی بخش و به صورت (۱۶) باشد، آن‌گاه:

$$P_{G_{Me}}(H_0 | \bar{x}, t) = \left[ 1 + \frac{1 - \pi_0}{\pi_0} \frac{1}{2} \left( \frac{\lambda_0 n}{t} \right)^{\frac{n-1}{2}} e^{\frac{t - n\lambda_0}{2\lambda_0}} \left( 1 + \left( \frac{t}{n\lambda_0} \right) e^{\frac{n\lambda_0 - t}{2\lambda_0}} \right) \right]^{-1} \quad (20)$$

برهان: این رده، توزیع‌های پیشینی را شامل می‌شود که نیمی از جرم توزیع پیشین پارامتر آزمون را به فضای کم‌تر از  $\lambda$  و نیمی دیگر را به فضای بزرگ‌تر از  $\lambda$  اختصاص می‌دهند، یعنی:

$$G_{Me} = \left\{ \pi : \int_0^\lambda \pi(\lambda | H_1) d\lambda = \int_{\lambda_0}^\infty \pi(\lambda | H_1) d\lambda = \frac{1}{2} \right\} \quad (21)$$

جدول ۱. کران پایین احتمال پسین برای کلاسی از توزیع‌های پیشین وقتی  $\pi_0 = \frac{1}{2}$ ،  $P - value = 0.05$  و  $\lambda_0 = 1$

| n    | t       | $P_{G_A}(H.   \bar{x}, t)$ | $P_{G_{Me}}(H.   \bar{x}, t)$ | $P_{G_{Us}}(H.   \bar{x}, t)$ | $P_{G_C}(H.   \bar{x}, t)$ |
|------|---------|----------------------------|-------------------------------|-------------------------------|----------------------------|
| 2    | 5.03    | 0.258                      | 0.340                         | 0.410                         | 0.500                      |
|      |         |                            |                               |                               |                            |
| 3    | 7.38    | 0.215                      | 0.301                         | 0.326                         | 0.496                      |
|      | 0.05    | 0.067                      | 0.119                         | 0.197                         | 0.089                      |
| 4    | 9.35    | 0.197                      | 0.283                         | 0.364                         | 0.485                      |
|      | 0.21    | 0.074                      | 0.129                         | 0.208                         | 0.108                      |
| 5    | 11.15   | 0.186                      | 0.271                         | 0.352                         | 0.474                      |
|      | 0.48    | 0.081                      | 0.139                         | 0.218                         | 0.127                      |
| 10   | 19.02   | 0.165                      | 0.248                         | 0.335                         | 0.441                      |
|      | 2.7     | 0.096                      | 0.161                         | 0.244                         | 0.178                      |
| 15   | 26.1    | 0.158                      | 0.240                         | 0.324                         | 0.423                      |
|      | 5.63    | 0.102                      | 0.169                         | 0.252                         | 0.202                      |
| 20   | 32.85   | 0.153                      | 0.234                         | 0.322                         | 0.411                      |
|      | 8.90    | 0.105                      | 0.173                         | 0.259                         | 0.217                      |
| 50   | 70.22   | 0.143                      | 0.222                         | 0.311                         | 0.381                      |
|      | 31.55   | 0.113                      | 0.184                         | 0.272                         | 0.256                      |
| 100  | 128.42  | 0.138                      | 0.216                         | 0.306                         | 0.364                      |
|      | 73.36   | 0.117                      | 0.190                         | 0.278                         | 0.276                      |
| 400  | 456.24  | 0.132                      | 0.210                         | 0.299                         | 0.343                      |
|      | 345.56  | 0.122                      | 0.197                         | 0.286                         | 0.298                      |
| 1000 | 1088.48 | 0.131                      | 0.207                         | 0.297                         | 0.335                      |
|      | 913.28  | 0.124                      | 0.199                         | 0.290                         | 0.420                      |
| 2000 | 2124.8  | 0.130                      | 0.206                         | 0.300                         | 0.331                      |
|      | 1877    | 0.125                      | 0.200                         | 0.284                         | 0.311                      |

فرض کنید  $G_{Me}$  مجموعه‌ای از چگالی‌ها روی بازه  $(0, \infty)$  با میانه  $\lambda$  باشد، در این صورت:

$$\begin{aligned} \sup m(\bar{x}, t | H_1) &= \sup_{(g_1, g_2)} \int_0^{\lambda_0} \int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \lambda | \bar{x}, t) g_1(\lambda) d\theta d\lambda + \int_{\lambda_0}^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \lambda | \bar{x}, t) g_2(\lambda) d\theta d\lambda \\ &= \sup_{g_1} \int_0^{\lambda_0} \int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \lambda | \bar{x}, t) d\theta g_1(\lambda) d\lambda + \sup_{g_2} \int_{\lambda_0}^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \lambda | \bar{x}, t) d\theta g_2(\lambda) d\lambda \quad (22) \end{aligned}$$

که در آن  $g_1$  و  $g_2$  به ترتیب روی  $(0, \lambda_0)$  و  $(\lambda_0, \infty)$  نامنفی هستند. فرض کنید در حالت اول

$$> \lambda_0 \frac{t}{n} = \hat{\lambda} (= \frac{\sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2}{n})$$



با توجه به رابطه (۲۱) داریم :

$$\begin{aligned} \sup_{g_1} \int_0^{\lambda} \left( \int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \lambda | \bar{x}, t) d\theta \right) g_1(\lambda) d\lambda &= \int_0^{\lambda} \left( \int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \lambda_0 | \bar{x}, t) d\theta \right) g_1(\lambda) d\lambda \\ &= \int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \lambda_0 | \bar{x}, t) d\theta \int_0^{\lambda} g_1(\lambda) d\lambda \\ &= \frac{1}{2} \int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \lambda_0 | \bar{x}, t) d\theta \quad (23) \\ &= \frac{C}{2} \left( \frac{1}{\lambda_0} \right)^{\frac{n-1}{2}} e^{-\frac{t}{2\lambda_0}} \end{aligned}$$

که

$$C = \left( \frac{1}{4} \right)^{\frac{n-1}{2}} \frac{n-1}{\Gamma\left(\frac{n-1}{2}\right)} \left( \frac{t}{\lambda_0} \right)^{\frac{n-1}{2}-1} \quad (24)$$

در روابط بالا  $\int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \lambda | \bar{x}, t) d\theta$  تابعی صعودی از  $\lambda$  بر بازه  $(0, \lambda_0)$  است و به ازای  $\lambda = \lambda_0$  ماکسیمم می شود. از طرفی چون  $\int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \lambda | \bar{x}, t) d\theta$  ماکسیمم خود را در  $\lambda = \hat{\lambda}$  اختیار می کند خواهیم داشت:

$$\begin{aligned} \sup_{g_2} \int_{\lambda_0}^{\infty} \left( \int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \lambda | \bar{x}, t) d\theta \right) g_2(\lambda) d\lambda &= \left[ \int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \hat{\lambda} | \bar{x}, t) d\theta \right] \int_{\lambda_0}^{\infty} g_2(\lambda) d\lambda \\ &= \frac{C}{2} \left( \frac{n}{t} \right)^{\frac{n-1}{2}} e^{-\frac{n}{2t}} \quad (25) \end{aligned}$$

با جای گذاری (۲۵) و (۲۳) در (۲۲) و سپس (۲۲) و (۱۹) در (۱۷)، (۲۰) را به دست می آوریم.

برای حالت دوم، یعنی  $\hat{\lambda} < \lambda_0$  نیز، به طریق مشابه رابطه (۲۰) به دست می آید.

با توجه به ستون دوم جدول ۱ اختلاف بین مقدار احتمال و  $P_{G_{Me}}(H_0 | \bar{x}, t)$  به وضوح مشخص است. چون

$G_{Me} \subseteq G_A$ ، پس  $P_{G_{Me}}(H_0 | \bar{x}, t) \geq P_{G_A}(H_0 | \bar{x}, t)$  و این امر تعارض بیشتری بین مقدار احتمال و احتمال

پسین را نشان می دهد.

### ۳. کران پایین برای $G_{US}$

از آن جاکه توزیع نرمال حول  $\lambda = \lambda_0$  متقارن نیست برای محاسبه بزرگترین کران پایین روی  $G_{US}$  باید تبدیلی مناسب

روی  $\lambda$  صورت گیرد. با پیروی از پیل (۱۹۸۸) و چینی پرداز و مهری (۲۰۱۵) که برای توزیع های نامتقارن تبدیلی را

پیشنهاد کرده اند، تبدیل مناسب در این جا  $u(\lambda) = \ln\left(\frac{\lambda}{\lambda_0}\right)$  با برد  $\mathbb{R}$  انتخاب می شود. فرض کنید  $h$  یک تابع چگالی

متقارن از  $u$  باشد به طوری که:

$$\int_{-\infty}^0 h(u) du = \frac{1}{2} = \int_0^{\infty} h(u) du$$

بنابراین توزیع پیشین  $\lambda$  به صورت (۲۶) است:

$$\pi(\lambda | H_1) = h(u(\lambda)) \frac{d(u(\lambda))}{d\lambda} \quad (26)$$

هم‌چنین  $\lambda_0$  میانه  $\pi(\lambda | H_1)$  است زیرا:

$$\int_0^\lambda \pi(\lambda | H_1) d\lambda = \int_0^\lambda h(u(\lambda)) \frac{d(u(\lambda))}{d\lambda} d\lambda = \int_{-\infty}^0 h(u) du = \frac{1}{2} \quad (27)$$

حال قضیه ۳ را داریم:

قضیه ۳: برای آزمون  $H_0: \lambda = \lambda_0$  در مقابل  $H_1: \lambda \neq \lambda_0$  اگر  $\pi(\lambda | H_1) \in G_{US}$  آن‌گاه کران پایین احتمال پسین  $H_0$  عبارت است از:

$$\underline{P}_{G_{US}}(H_0 | \bar{x}, t) = \left[ 1 + \frac{1 - \pi_0}{\pi_0} \sup_{k > 0} \frac{1}{2k} \int_{-k}^k \exp\left(-\frac{n-1}{2}u + (1 - e^{-u}) \frac{t}{2\lambda_0}\right) du \right]^{-1} \quad (28)$$

برهان: اگر  $h$  یک تابع چگالی تک‌نمایی و متقارن حول صفر و  $H$  رده‌ای از این تابع‌های چگالی باشد، با در نظر گرفتن توزیع پیشین  $\lambda$  به صورت (۲۶) و با توجه به رابطه (۲۷) داریم:

$$\begin{aligned} \sup_{\pi \in G_{US}} m(\bar{x}, t | H_1) &= \sup_{\pi \in G_{US}} \int_0^\infty \int_{-\infty}^\infty L(\theta, \lambda | \bar{x}, t) \pi(\theta | \lambda, H_1) \pi(\lambda | H_1) d\theta d\lambda \\ &= C \times \sup_{h \in H} \int_{-\infty}^\infty \left(\frac{1}{\lambda_0}\right)^{\frac{n-1}{2}} \exp\left(-\frac{n-1}{2}u - \frac{t}{2}e^{-u}\right) h(u) du \end{aligned} \quad (29)$$

که  $C$  در (۲۴) داده شده است، با توجه به این‌که توزیع تک‌نمایی و متقارن حول صفر، آمیخته‌ای از توزیع‌های یک‌نواخت حول صفر است کران پایین احتمال پسین تحت رده  $G_{US}$  برابر کران پایین احتمال پسین تحت رده توزیع‌های پیشین یک‌نواخت  $U(-k, k)$  خواهد بود (گوش و همکاران ۲۰۰۶) یعنی:

$$\inf_{G_{US}} P(H_0 | \bar{x}, t) = \inf_{U(-k, k)} P(H_0 | \bar{x}, t)$$

که در آن  $U(-k, k)$  بیان‌گر خانواده توزیع‌های یک‌نواخت در فاصله  $(-k, k)$ ،  $k > 0$  است. پس (۲۶) را می‌توان به صورت (۳۰) نوشت:

$$\sup_{\pi \in G_{US}} m(\bar{x}, t | H_1) = \left(\frac{1}{4}\right)^{\frac{n-1}{2}} \frac{1}{\Gamma\left(\frac{n-1}{2}\right)} \left(\frac{t}{\lambda_0}\right)^{\frac{n-1}{2}-1} \times \sup_{k > 0} \int_{-k}^k \left(\frac{1}{\lambda_0}\right)^{\frac{n-1}{2}} \exp\left(-\frac{n-1}{2}u - \frac{t}{2\lambda_0}e^{-u}\right) \frac{1}{2k} du \quad (30)$$

با جای‌گذاری رابطه (۳۰) و (۱۹) در رابطه (۱۷) اثبات کامل می‌شود. ستون سوم جدول ۱ مقادیر بزرگ‌ترین کران را نشان می‌دهد. در این رده نیز اختلاف بین دو روش آزمون، به‌وضوح  $G_{US}$  را روی رده  $H_0$  پایین احتمال پسین دیده می‌شود.

#### ۴. کران پایین برای $G_C$

چنان‌که در بخش سوم بیان شد برای پارامتر  $\lambda$  می‌توان از توزیع پیشین مزدوج استفاده کرد تا کران پایین احتمال پسین به صورت فرم بسته به دست آید. از آن‌جاکه لازم است مقدار احتمال با کران پایین احتمال پسین مقایسه شود برای حداقل کردن مقدار پارامترهای توزیع پیشین لازم است به صورت مناسبی انتخاب شود.

مقایسه آزمون بیزی و بسامدی برای پارامتر واریانس توزیع نرمال در حضور پارامتر مزاحم، در حالات دوطرفه و یکطرفه

$G_C = \left\{ \pi : \pi(\lambda | H_1) \equiv IG\left(\alpha, \frac{1}{\beta}\right) \right\}$  باشد که در آن تابع چگالی گاما معکوس،  $IG\left(\alpha, \frac{1}{\beta}\right)$  در بخش ۳ آمده است. قضیه زیر محاسبه کران پایین احتمال پسین را نشان می‌دهد.

قضیه ۴: برای آزمون  $H_0: \lambda = \lambda_0$  در مقابل  $H_1: \lambda \neq \lambda_0$  اگر  $\pi(\lambda | H_1) \in G_C$ ، کران پایین احتمال پسین  $H_0$  عبارت است از:

$$P_{G_C}(H_0 | \bar{x}, t) = \left[ 1 + \frac{1 - \pi_0}{\pi_0} \sup_{\alpha > 1} \frac{\Gamma\left(\frac{n-1}{2} + \alpha\right) (\lambda\beta)^{\frac{n-1}{2}} e^{\frac{t}{2\lambda}}}{\Gamma(\alpha) \left(\frac{t\beta}{2} + 1\right)^{\frac{n-1}{2} + \alpha}} \right]^{-1}, \beta = \frac{1}{\lambda(\alpha - 1)} \quad (31)$$

برهان: با توجه به (۴) و (۵) داریم:

$$m(\bar{x}, t | H_1) = \frac{1}{\text{Beta}\left(\frac{n-1}{2}, \alpha\right)} \frac{(t\beta/4)^{\frac{n-1}{2}}}{t(t\beta/2 + 1)^{\frac{n-1}{2} + \alpha}}, \frac{1}{\beta(\alpha - 1)} = \lambda_0 \quad (32)$$

با قرار دادن (۳۲) و (۱۹) در (۱۷) داریم:

$$P(H_0 | \bar{x}, t) = \left[ 1 + \frac{1 - \pi_0}{\pi_0} \frac{\Gamma\left(\frac{n-1}{2} + \alpha\right) (\lambda\beta)^{\frac{n-1}{2}} e^{\frac{t}{2\lambda}}}{\Gamma(\alpha) \left(\frac{t\beta}{2} + 1\right)^{\frac{n-1}{2} + \alpha}} \right]^{-1}, \beta = \frac{1}{\lambda_0(\alpha - 1)} \quad (33)$$

بنابراین کران پایین احتمال پسین (۳۳) برابر (۳۱) است.

ستون چهارم از جدول ۱ مقادیر بزرگ‌ترین کران پایین احتمال پسین فرضیه صفر را روی  $G_C$  نشان می‌دهد. این مقادیر بیش‌ترین اختلاف را با مقدار احتمال نسبت به سایر رده‌ها نشان می‌دهند. با توجه به این‌که در چهار رده توزیع‌های پیشین  $G_C$  از بقیه رده‌ها کوچک‌تر است، تفاوت بیش‌تر آن با مقدار احتمال، قابل‌انتظار است.

## وجود توافق بین مقدار احتمال و احتمال پسین در آزمون یک‌طرفه واریانس

### ۱. آزمون یک‌طرفه واریانس در حضور پارامتر واریانس

فرض شود که  $X_1, X_2, \dots, X_n$  نمونه‌ای تصادفی از  $N(\theta, \lambda)$  با  $\theta$  مجهول است و می‌خواهیم آزمون‌های (۳۴) را انجام دهیم:

$$\begin{aligned} H_0: \lambda &\leq \lambda_0 \\ H_1: \lambda &> \lambda_0 \end{aligned} \quad (34)$$

### ۱-۱. آزمون معنی‌داری

برای آزمون فرضیات (۳۴) به‌شیوه معنی‌داری، واضح است که مقادیر بزرگ (دامنه سمت راست)  $T(X) = \sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2$  علیه فرضیه  $H_0$  است بنابراین

$$P\text{-value} = \sup_{\lambda \leq \lambda_0} P(T(X) \geq t(\mathbf{x})) = P_{\lambda_0}(T(X) \geq t(\mathbf{x}))$$

$$= P_{\lambda_0}(\chi_{n-1}^2 \geq \frac{t(\mathbf{x})}{\lambda_0}) = \int_{\frac{t}{\lambda_0}}^{\infty} \left(\frac{1}{2}\right)^{n-1} \frac{1}{\Gamma(\frac{n-1}{2})} u^{\frac{n-1}{2}-1} e^{-\frac{u}{2}} du$$

با تغییر متغیره  $v = \frac{t}{u}$  داریم:

$$P\text{-value} = \left(\frac{t}{2}\right)^{\frac{n-1}{2}} \frac{1}{\Gamma(\frac{n-1}{2})} \int_0^{\lambda_0} \left(\frac{1}{v}\right)^{\frac{n-1}{2}+1} e^{-\frac{t}{2v}} dv$$

### ۲-۱. آزمون بی‌زی

فرض شود که  $\pi(\theta, \lambda) = \frac{1}{\lambda}$ ,  $\theta \in \mathbb{R}$ ,  $\lambda \in \mathbb{R}^+$  یا به عبارت دیگر  $\pi(\theta | \lambda) = 1$ ,  $\theta \in \mathbb{R}$ ,  $\pi(\lambda) = \frac{1}{\lambda}$

$$\pi(\theta | \mathbf{x}) \propto \int_{-\infty}^{\infty} L(\theta, \lambda | \bar{x}, t) \frac{1}{\lambda} d\theta = c \left(\frac{1}{w}\right)^{\frac{n}{2}+1} e^{-\frac{t}{2w}} \int_{-\infty}^{\infty} e^{-\frac{n}{2\lambda}(\theta - \bar{x})^2} d\theta \quad (35)$$

بر اساس (۹) خواهیم داشت:

$$P(H_0 | \mathbf{x}) = P(\lambda \leq \lambda_0 | \mathbf{x})$$

$$\begin{aligned} &= \frac{\int_0^{\lambda_0} \int_{-\infty}^{\infty} \left(\frac{1}{\lambda}\right)^{\frac{n}{2}+1} e^{-\frac{t}{2\lambda}} e^{-\frac{n}{2\lambda}(\theta - \bar{x})^2} d\theta d\lambda}{\int_0^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} \left(\frac{1}{\lambda}\right)^{\frac{n}{2}+1} e^{-\frac{t}{2\lambda}} e^{-\frac{n}{2\lambda}(\theta - \bar{x})^2} d\theta d\lambda} \quad (36) \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} &= \frac{\sqrt{\frac{2\pi}{n}} \int_0^{\lambda_0} \left(\frac{1}{\lambda}\right)^{\frac{n-1}{2}+1} e^{-\frac{t}{2\lambda}} d\lambda}{\sqrt{\frac{2\pi}{n}} \Gamma\left(\frac{n-1}{2}\right) \left(\frac{2}{t}\right)^{\frac{n-1}{2}}} \\ &= \left(\frac{t}{2}\right)^{\frac{n-1}{2}} \frac{1}{\Gamma\left(\frac{n-1}{2}\right)} \int_0^{\lambda_0} \left(\frac{1}{w}\right)^{\frac{n-1}{2}+1} e^{-\frac{t}{2w}} d\lambda \end{aligned}$$

$$= P\text{-value}$$

پس می‌توان نتیجه گرفت که برخلاف آزمون دوطرفه برای پارامتر واریانس که اختلاف بین آزمون معنی‌داری و بی‌زی وجود داشت، در آزمون یک‌طرفه پارامتر واریانس، می‌توان پیشینی را یافت که بر اساس آن مقدار احتمال و احتمال پسین فرضیه  $H_0$  برابر باشند. بر این اساس، می‌توان گفت که در حضور پارامتر مزاحم، بین آزمون معنی‌داری و بی‌زی، مشابه حالتی که پارامتر مزاحم وجود ندارد، می‌توان به توافق رسید.

### ۳. مقایسه یک‌طرفه واریانس‌های دو جامعه نرمال

این توافق حتی در مقایسه یک‌طرفه واریانس‌های دو جامعه نرمال مستقل نیز دیده می‌شود که فرضیه «وجود توافق بین شیوه بی‌زی و بسامدی در آزمون‌های یک‌طرفه» را قوی‌تر می‌کند. برای نشان دادن آن فرض کنید که

همگی مجهول‌اند. آزمون یکطرفه (۳۷) را در نظر می‌گیریم

$$\begin{aligned} H_0 : \frac{\lambda_1}{\lambda_2} &\leq c_0 \\ H_1 : \frac{\lambda_1}{\lambda_2} &> c_0 \end{aligned}, (c_0 \geq 1) \quad (37)$$

#### ۴. آزمون معنی‌داری مقایسه واریانس دو جامعه

مطابق با روش معنی‌داری آماره‌ای مناسب برای آزمون (۳۷)، به صورت شهودی عبارت است از

$$S(\mathbf{X}, \mathbf{Y}) = \frac{n-1 \sum_{i=1}^m (X_i - \bar{X})^2}{m-1 \sum_{j=1}^n (Y_j - \bar{Y})^2} = \frac{n-1}{m-1} \frac{T_1}{T_2}$$

آماره تابعی از آماره بسنده  $(\sum_{i=1}^m X_i, \sum_{i=1}^m X_i^2, \sum_{j=1}^n Y_j, \sum_{j=1}^n Y_j^2)$  نیز نیست؛ بنابراین:

$$\begin{aligned} P\text{-Value} &= \sup_{\frac{\lambda_1}{\lambda_2} \leq c_0} P(S(\mathbf{X}, \mathbf{Y}) \geq S(\mathbf{x}, \mathbf{y})) = \sup_{\frac{\lambda_2 \leq 1}{\lambda_1 \leq c_0}} P\left(F_{m-1, n-1} \geq \frac{\lambda_2}{\lambda_1} S(\mathbf{x}, \mathbf{y})\right) \\ &= P_{\frac{\lambda_2 = 1}{\lambda_1 = c_0}} \left(F_{m-1, n-1} \geq \frac{S(\mathbf{x}, \mathbf{y})}{c_0}\right) \\ &= P\left(F_{n-1, m-1} \leq \frac{c_0}{S(\mathbf{x}, \mathbf{y})}\right) \end{aligned}$$

اما

$$= P\left(F_{n-1, m-1} \leq \frac{c_0}{s}\right) = \int_0^{\frac{c_0}{s}} \frac{\Gamma\left(\frac{m+n}{2}-1\right)}{\Gamma\left(\frac{m-1}{2}\right)\Gamma\left(\frac{n-1}{2}\right)} \left(\frac{n-1}{m-1}\right)^{\frac{n-1}{2}} \frac{u^{\frac{n-1}{2}}}{\left(1 + \frac{n-1}{m-1}u\right)^{\frac{m+n-2}{2}}} du$$

با تغییر متغیر  $v = \frac{u}{1 + \frac{n-1}{m-1}u}$  و با توجه به این که  $s = \frac{n-1}{m-1} \frac{t_1}{t_2}$  داریم:

$$= \frac{\Gamma\left(\frac{m+n-2}{2}\right)}{\Gamma\left(\frac{m-1}{2}\right)\Gamma\left(\frac{n-1}{2}\right)} \left(\frac{t_2}{t_1}\right)^{\frac{n-1}{2}} \int_0^{\frac{c_0}{s}} \frac{v^{\frac{n-1}{2}-1}}{\left(1 + \frac{t_2}{t_1}v\right)^{\frac{m+n-2}{2}}} dv \quad (38)$$

به روش بیزی فرض می‌کنیم که:

$$\begin{aligned} \pi(\theta_1, \theta_2 | \lambda_1, \lambda_2) &= 1, (\theta_1, \theta_2) \in \mathbb{R}^2 \\ \pi(\lambda_1, \lambda_2) &= \frac{1}{\lambda_1 \lambda_2}, (\lambda_1, \lambda_2) \in \mathbb{R}^+ \times \mathbb{R}^+ \end{aligned}$$

از این رو:

$$\begin{aligned} \pi(\lambda_1, \lambda_2 | \mathbf{x}, \mathbf{y}) &= \pi(\lambda_1 | \mathbf{x})\pi(\lambda_2 | \mathbf{y}) \\ &= \frac{\int_{-\infty}^{\infty} L(\theta_1, \lambda_1 | \bar{x}, t_1) \frac{1}{\lambda_1} d\theta_1}{m(\mathbf{x})} \cdot \frac{\int_{-\infty}^{\infty} L(\theta_2, \lambda_2 | \bar{y}, t_2) \frac{1}{\lambda_2} d\theta_2}{m(\mathbf{y})} \\ &= C.K. \frac{\sqrt{\frac{2\pi}{m}} \left(\frac{1}{\lambda_1}\right)^{\frac{m-1}{2}+1}}{m(\mathbf{x})} e^{-\frac{t_1}{2\lambda_1}} \frac{\sqrt{\frac{2\pi}{n}} \left(\frac{1}{\lambda_2}\right)^{\frac{n-1}{2}+1}}{m(\mathbf{y})} e^{-\frac{t_2}{2\lambda_2}} \end{aligned} \quad (39)$$

که  $m(\mathbf{x})$  و  $m(\mathbf{y})$  به ترتیب توزیع‌های حاشیه‌ای  $\mathbf{x}$  و  $\mathbf{y}$  هستند و

$$C = \sqrt{\frac{m}{2\pi}} \left(\frac{m-1}{4}\right)^{\frac{m-1}{2}} \frac{1}{\Gamma\left(\frac{m-1}{2}\right)} \left(\frac{t_1}{m-1}\right)^{\left(\frac{m-1}{2}-1\right)}, \quad K = \sqrt{\frac{n}{2\pi}} \left(\frac{n-1}{4}\right)^{\frac{n-1}{2}} \frac{1}{\Gamma\left(\frac{n-1}{2}\right)} \left(\frac{t_2}{n-1}\right)^{\left(\frac{n-1}{2}-1\right)}$$

$$t_2 = \sum_{j=1}^n (y_j - \bar{y})^2, \quad t_1 = \sum_{i=1}^m (x_i - \bar{x})^2$$

پس اگر تعریف کنیم  $\gamma = \frac{\lambda_1}{\lambda_2}$  آن‌گاه:

$$\begin{aligned} \pi(\gamma) &= \int_0^{\infty} \lambda_2 |\pi_{\lambda_1, \lambda_2}(\gamma \lambda_2, \lambda_2 | \mathbf{x}, \mathbf{y})| d\lambda_2 \\ &= \frac{C.K}{m(\mathbf{x})m(\mathbf{y})} \sqrt{\frac{2\pi}{mn}} \Gamma\left(\frac{m+n}{2}-1\right) \left(\frac{2}{t_1}\right)^{\left(\frac{m+n}{2}-1\right)} \frac{\gamma^{\frac{n-1}{2}-1}}{\left(1+\frac{t_2}{t_1}\right)^{\frac{m+n}{2}-1}} \\ &= \frac{\Gamma\left(\frac{m+n}{2}-1\right)}{\Gamma\left(\frac{m-1}{2}\right)\Gamma\left(\frac{n-1}{2}\right)} \left(\frac{t_2}{t_1}\right)^{\frac{n-1}{2}} \frac{\gamma^{\frac{n-1}{2}-1}}{\left(1+\frac{t_2}{t_1}\gamma\right)^{\frac{m+n}{2}-1}} \end{aligned} \quad (40)$$

پس:

$$\begin{aligned} P(H_0 | \mathbf{x}, \mathbf{y}) &= P\left(\frac{\lambda_1}{\lambda_2} \leq c_0 | \mathbf{x}, \mathbf{y}\right) \\ &= \frac{\Gamma\left(\frac{m+n}{2}-1\right)}{\Gamma\left(\frac{m-1}{2}\right)\Gamma\left(\frac{n-1}{2}\right)} \left(\frac{t_2}{t_1}\right)^{\frac{n-1}{2}} \int_0^{c_0} \frac{\gamma^{\frac{n-1}{2}-1}}{\left(1+\frac{t_2}{t_1}\gamma\right)^{\frac{m+n}{2}-1}} d\gamma \end{aligned} \quad (41)$$

بنابراین با توجه به (۳۸):

$$P\text{-value} = P(H_0 | \mathbf{x}, \mathbf{y})$$

برای حالت  $c_0 < 1$  با وارون کردن فرضیات،  $\frac{1}{c_0} \geq 1$  خواهد بود و واضح است که به نتیجه‌ای مشابه می‌رسیم.

## بحث و نتیجه‌گیری

در این مقاله به شیوه بیزی و بسامدی، آزمون دوطرفه و یکطرفه پارامتر واریانس توزیع نرمال انجام شده است و میانگین توزیع نقش پارامتر مزاحم را دارد. در مرحله نخست آزمون دوطرفه انجام شده است بدین ترتیب که با در نظر گرفتن یک پیشین خاص با افزایش تعداد نمونه احتمال پسین فرضیه صفر، به‌ازای مقدار احتمال ثابت و کوچک - که دلیل بر رد  $H_0$  به شیوه بسامدی (معنی‌داری) است - افزایش می‌یابد و از فرضیه  $H_0$  حمایت می‌کند. در گام بعدی، تحت تعداد نمونه ثابت و مقدار احتمال ثابت و کوچک، کران پایین احتمال پسین فرضیه صفر را، وقتی توزیع پیشین پارامتر مورد آزمون عضو رده‌ای از توزیع‌های پیشین است؛ به‌دست‌آمده و از مقدار احتمال بزرگ‌تر است. این امر در آزمون‌های دوطرفه اختلاف بین شیوه بیزی و بسامدی را آشکارتر می‌کند. در سومین مرحله برای آزمون یکطرفه پارامتر واریانس، یک پیشین خاص برای آزمون بیزی پیشنهاد شده است و نشان داده شده است که احتمال پسین و مقدار احتمال برابر هستند؛ یعنی در این حالت نوعی توافق بین دو شیوه مشاهده می‌شود. به‌طور کلی می‌توان این نتیجه را گرفت که برای آزمون دوطرفه، در رد کردن فرضیه  $H_0$  به شیوه معنی‌داری باید احتیاط بیش‌تری کرد و بنا بر توصیه برگر و سلک (۱۹۸۷) وقتی به شیوه معنی‌داری تمایل به رد  $H_0$  داریم، بهتر است روش‌های دیگری نیز بررسی شوند. در آزمون‌های یکطرفه چنانچه فرضیه  $H_0$  رد شود می‌توان امیدوار بود که این فرضیه به شیوه بیزی نیز حمایت نمی‌شود.

## منابع

1. O.Berger J., "Statistical Decision Theory and Bayesian Analysis", 2nd ed. Berlin: Springer (1985).
2. Berger J.O., Delampady M., "Testing precise hypotheses", (with discussion) Stat. Sci. 2 (1987) 317-352.
3. Berger J. O., Sellke T., "Testing a point null hypotheses: the irreconcilability of P value and evidence", J. Am. Stat. Assoc. 82 (1987) 112-122.
4. Casella G., Berger R. L., "Reconciling Bayesian and Frequentist Evidence in the One-Sided testing problem", (with discussion). J.Amer. Statist. Assoc., Vol., 82 (1987) 106-135.
5. Chinipardaz R., Noorbaloochi S., "Reconcilability of P-Values and Posterior Probability in Nonregular Distributions", Far East J. Theo.Stat. Vol. 10 (2) (2003) 111-122.
6. Chinipardaz R., "The Discrepancy of P-values and Posterior Probability in Poisson Distribution", Pak. J. Stat., 19 (2003) 301-313.
7. Chinipardaz R., Mehri K., "Irreconcilability of P-value and Bayesian Measure in two-sided Hypotheses: Pareto Distribution with the Presence of Nuisance Parameter", Communication in Statistics- Theory and Method (in press 2015).
8. DeGroot M. H., "Lindley's paradox: Comment, J. Am. Stat. Assoc., 378 (1982) 336-339.

9. Delampady M. , "Lower bounds on bayes factors for interval null hypotheses", J. Am. Stat. Assoc., 84 (1989) 120-124.
10. Edwards W., Lindman H., Savage L. J., "Bayesian statistical inference for psychological research, Psycholo. Rv., 70 (1963) 193-242.
11. Ghosh J. K., Delampady M., Samanta T., "An Introduction to Bayesian Analysis", New York: Springer (2006).
12. Ghosh J. K., Purkayastha S., Samanta T., "Role of P-values and Other Measures of Evidence in Bayesian Analysis", In: Dey, D.K and Rao, C.R. (eds) Handbook of Statistics 25, Bayesian Thinking: Modeling and Computation, (2005) 151-170.
13. Jeffreys H., "Theory of probability", 3rd ed. London: Oxford University Press (1961).
14. Lindley D. V., "A statistical paradox", Biometrika, 44 (1957) 187-192.
15. Pepple P. A., "Bayesian testing of an exponential point null hypothesis", Communications in Statistics-Theory and Methods, 17 (10) (1988) 3483-3503 .
16. Robert P. C., "The Bayesian Choice From Decision-Theoretic Foundations to Computational Implementation", New York: Springer (2007).
17. Williamson P. P., "Comparison of Testing Proc edures Utilizing p-values and Bayes Fa ctors in Some Common Situations, Journal of Statistical Computation and Simulation", 74 (2004) 833-850.
18. Yin Y., "Generalized P-values and Bayesian evidence in the One-sided testing problems under exponential distributions", Stat. Neerlandica, 65 (2011) 319-336.