

# Wahrscheinlichkeitsrechnung und Statistik für Biologen

## **Faktorielle Varianzanalyse**

Dirk Metzler & Martin Hutzenthaler

[http://evol.bio.lmu.de/\\_statgen](http://evol.bio.lmu.de/_statgen)

29. Juni 2011

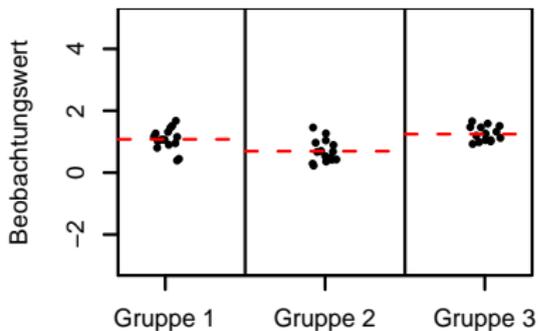
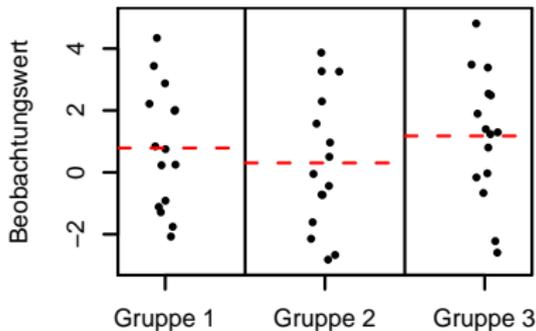
- 1 Die einfaktorielle Varianzanalyse und der  $F$ -Test
- 2 Paarweise Vergleiche und Exkurs über multiples Testen
- 3 Nichtparameterisch: Der Kruskal-Wallis-Test

# Inhalt

- 1 Die einfaktorielle Varianzanalyse und der  $F$ -Test
- 2 Paarweise Vergleiche und Exkurs über multiples Testen
- 3 Nichtparameterisch: Der Kruskal-Wallis-Test

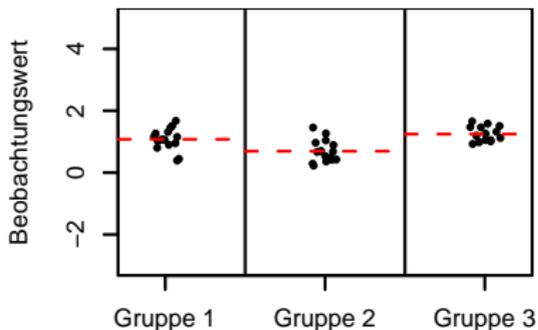
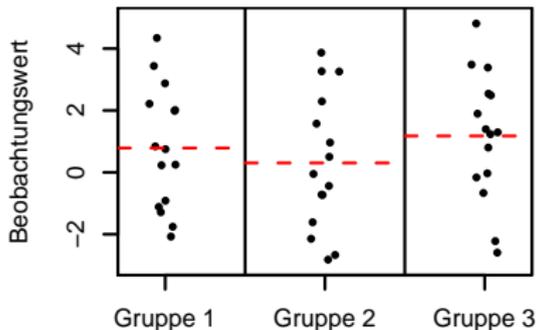
# Grundidee der Varianzanalyse

Wir beobachten unterschiedliche Gruppenmittelwerte:



# Grundidee der Varianzanalyse

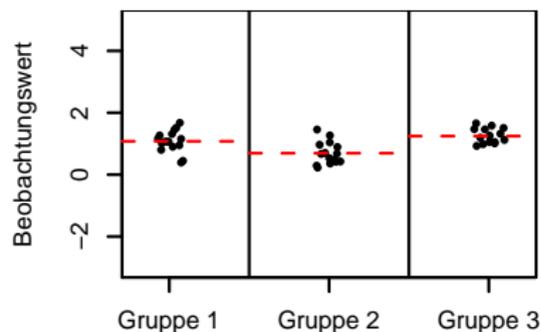
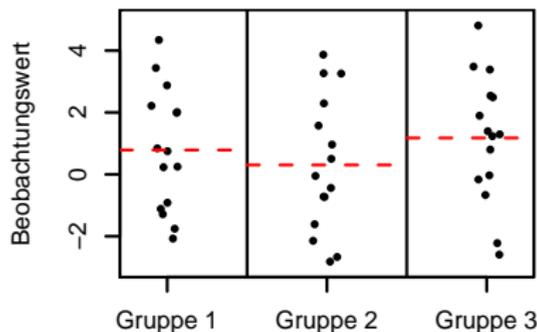
Wir beobachten unterschiedliche Gruppenmittelwerte:



Sind die beobachteten Unterschiede der Gruppenmittelwerte ernst zu nehmen — oder könnte das alles Zufall sein?

# Grundidee der Varianzanalyse

Wir beobachten unterschiedliche Gruppenmittelwerte:

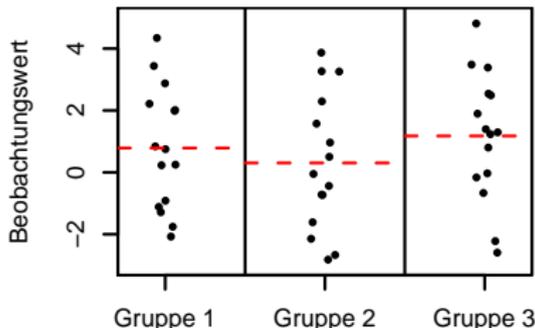


Sind die beobachteten Unterschiede der Gruppenmittelwerte ernst zu nehmen — oder könnte das alles Zufall sein?

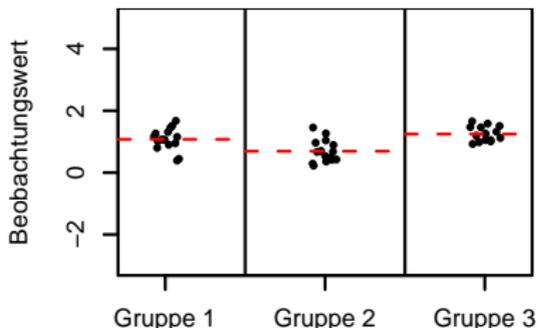
Das hängt vom Verhältnis der Variabilität der Gruppenmittelwerte und der Variabilität der Beobachtungen innerhalb der Gruppen ab:

# Grundidee der Varianzanalyse

Wir beobachten unterschiedliche Gruppenmittelwerte:



Variabilität innerhalb  
der Gruppen groß



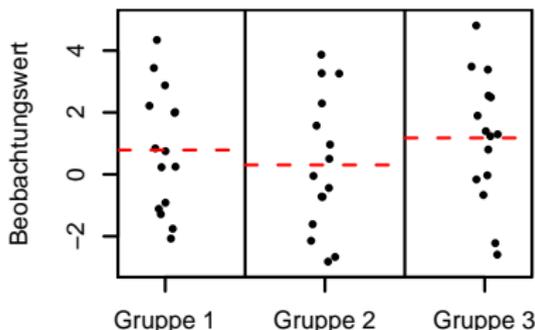
Variabilität innerhalb  
der Gruppen klein

Sind die beobachteten Unterschiede der Gruppenmittelwerte ernst zu nehmen — oder könnte das alles Zufall sein?

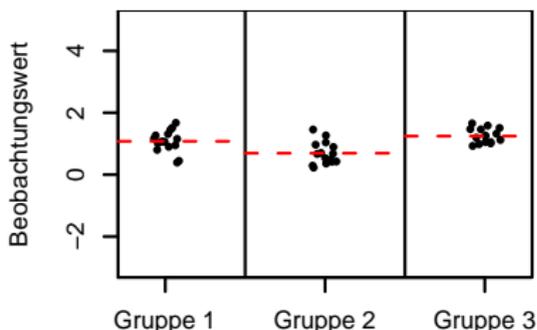
Das hängt vom Verhältnis der Variabilität der Gruppenmittelwerte und der Variabilität der Beobachtungen innerhalb der Gruppen ab:

# Grundidee der Varianzanalyse

Wir beobachten unterschiedliche Gruppenmittelwerte:



Variabilität innerhalb  
der Gruppen groß



Variabilität innerhalb  
der Gruppen klein

Sind die beobachteten Unterschiede der Gruppenmittelwerte ernst zu nehmen — oder könnte das alles Zufall sein?

Das hängt vom Verhältnis der Variabilität der Gruppenmittelwerte und der Variabilität der Beobachtungen innerhalb der Gruppen ab: die Varianzanalyse gibt eine (quantitative) Antwort.

# Beispiel: Blutgerinnungszeiten

Blutgerinnungszeit bei Ratten unter 4 versch. Behandlungen

Gruppe	Beobachtung							
1	62	60	63	59				
2	63	67	71	64	65	66		
3	68	66	71	67	68	68		
4	56	62	60	61	63	64	63	59

# Beispiel: Blutgerinnungszeiten

Blutgerinnungszeit bei Ratten unter 4 versch. Behandlungen

Gruppe	Beobachtung							
1	62	60	63	59				
2	63	67	71	64	65	66		
3	68	66	71	67	68	68		
4	56	62	60	61	63	64	63	59

Globalmittelwert  $\bar{x}_{..} = 64$ ,

Gruppenmittelwerte  $\bar{x}_{1.} = 61$ ,  $\bar{x}_{2.} = 66$ ,  $\bar{x}_{3.} = 68$ ,  $\bar{x}_{4.} = 61$ .

# Beispiel: Blutgerinnungszeiten

Blutgerinnungszeit bei Ratten unter 4 versch. Behandlungen

Gruppe	Beobachtung								
1	62	60	63	59					
2	63	67	71	64	65	66			
3	68	66	71	67	68	68			
4	56	62	60	61	63	64	63	59	

Globalmittelwert  $\bar{x}_{..} = 64$ ,

Gruppenmittelwerte  $\bar{x}_{1.} = 61$ ,  $\bar{x}_{2.} = 66$ ,  $\bar{x}_{3.} = 68$ ,  $\bar{x}_{4.} = 61$ .

**Vorsicht:** Der Globalmittelwert ist in diesem Beispiel auch der Mittelwert der Gruppenmittelwerte. Das muss aber nicht immer so sein!

# Beispiel

## Blutgerinnungszeit bei Ratten unter 4 versch. Behandlungen

Gr.	$\bar{x}_j$	Beobachtung							
1	61	62	60	63	59				
		$(62 - 61)^2$	$(60 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(59 - 61)^2$				
2	66	63	67	71	64	65	66		
		$(63 - 66)^2$	$(67 - 66)^2$	$(71 - 66)^2$	$(64 - 66)^2$	$(65 - 66)^2$	$(66 - 66)^2$		
3	68	68	66	71	67	68	68		
		$(68 - 68)^2$	$(66 - 68)^2$	$(71 - 68)^2$	$(67 - 68)^2$	$(68 - 68)^2$	$(68 - 68)^2$		
4	61	56	62	60	61	63	64	63	59
		$(56 - 61)^2$	$(62 - 61)^2$	$(60 - 61)^2$	$(61 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(64 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(59 - 61)^2$

Globalmittelwert  $\bar{x}_{..} = 64$ ,

Gruppenmittelwerte  $\bar{x}_1 = 61$ ,  $\bar{x}_2 = 66$ ,  $\bar{x}_3 = 68$ ,  $\bar{x}_4 = 61$ .

# Beispiel

## Blutgerinnungszeit bei Ratten unter 4 versch. Behandlungen

Gr.	$\bar{x}_j$	Beobachtung							
1	61	62	60	63	59				
		$(62 - 61)^2$	$(60 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(59 - 61)^2$				
2	66	63	67	71	64	65	66		
		$(63 - 66)^2$	$(67 - 66)^2$	$(71 - 66)^2$	$(64 - 66)^2$	$(65 - 66)^2$	$(66 - 66)^2$		
3	68	68	66	71	67	68	68		
		$(68 - 68)^2$	$(66 - 68)^2$	$(71 - 68)^2$	$(67 - 68)^2$	$(68 - 68)^2$	$(68 - 68)^2$		
4	61	56	62	60	61	63	64	63	59
		$(56 - 61)^2$	$(62 - 61)^2$	$(60 - 61)^2$	$(61 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(64 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(59 - 61)^2$

Globalmittelwert  $\bar{x}_{..} = 64$ ,

Gruppenmittelwerte  $\bar{x}_1 = 61$ ,  $\bar{x}_2 = 66$ ,  $\bar{x}_3 = 68$ ,  $\bar{x}_4 = 61$ .

Die roten Werte (ohne die Quadrate) heißen **Residuen**: die „Restvariabilität“ der Beobachtungen, die das Modell nicht erklärt.

# Beispiel

## Blutgerinnungszeit bei Ratten unter 4 versch. Behandlungen

Gr.	$\bar{x}_j$	Beobachtung							
1	61	62	60	63	59				
		$(62 - 61)^2$	$(60 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(59 - 61)^2$				
2	66	63	67	71	64	65	66		
		$(63 - 66)^2$	$(67 - 66)^2$	$(71 - 66)^2$	$(64 - 66)^2$	$(65 - 66)^2$	$(66 - 66)^2$		
3	68	68	66	71	67	68	68		
		$(68 - 68)^2$	$(66 - 68)^2$	$(71 - 68)^2$	$(67 - 68)^2$	$(68 - 68)^2$	$(68 - 68)^2$		
4	61	56	62	60	61	63	64	63	59
		$(56 - 61)^2$	$(62 - 61)^2$	$(60 - 61)^2$	$(61 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(64 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(59 - 61)^2$

Globalmittelwert  $\bar{x}_{..} = 64$ ,

Gruppenmittelwerte  $\bar{x}_1 = 61$ ,  $\bar{x}_2 = 66$ ,  $\bar{x}_3 = 68$ ,  $\bar{x}_4 = 61$ .

Die roten Werte (ohne die Quadrate) heißen Residuen: die „Restvariabilität“ der Beobachtungen, die das Modell nicht erklärt.

Quadratsumme innerhalb der Gruppen:

$$SS_{\text{innerh}} = 112,$$

# Beispiel

## Blutgerinnungszeit bei Ratten unter 4 versch. Behandlungen

Gr.	$\bar{x}_j$	Beobachtung							
1	61	62	60	63	59				
		$(62 - 61)^2$	$(60 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(59 - 61)^2$				
2	66	63	67	71	64	65	66		
		$(63 - 66)^2$	$(67 - 66)^2$	$(71 - 66)^2$	$(64 - 66)^2$	$(65 - 66)^2$	$(66 - 66)^2$		
3	68	68	66	71	67	68	68		
		$(68 - 68)^2$	$(66 - 68)^2$	$(71 - 68)^2$	$(67 - 68)^2$	$(68 - 68)^2$	$(68 - 68)^2$		
4	61	56	62	60	61	63	64	63	59
		$(56 - 61)^2$	$(62 - 61)^2$	$(60 - 61)^2$	$(61 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(64 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(59 - 61)^2$

Globalmittelwert  $\bar{x}_{..} = 64$ ,

Gruppenmittelwerte  $\bar{x}_1 = 61$ ,  $\bar{x}_2 = 66$ ,  $\bar{x}_3 = 68$ ,  $\bar{x}_4 = 61$ .

Die roten Werte (ohne die Quadrate) heißen Residuen: die „Restvariabilität“ der Beobachtungen, die das Modell nicht erklärt.

Quadratsumme innerhalb der Gruppen:

$ss_{\text{innerh}} = 112$ , 20 Freiheitsgrade

# Beispiel

## Blutgerinnungszeit bei Ratten unter 4 versch. Behandlungen

Gr.	$\bar{x}_j$	Beobachtung							
1	61	62	60	63	59				
		$(62 - 61)^2$	$(60 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(59 - 61)^2$				
2	66	63	67	71	64	65	66		
		$(63 - 66)^2$	$(67 - 66)^2$	$(71 - 66)^2$	$(64 - 66)^2$	$(65 - 66)^2$	$(66 - 66)^2$		
3	68	68	66	71	67	68	68		
		$(68 - 68)^2$	$(66 - 68)^2$	$(71 - 68)^2$	$(67 - 68)^2$	$(68 - 68)^2$	$(68 - 68)^2$		
4	61	56	62	60	61	63	64	63	59
		$(56 - 61)^2$	$(62 - 61)^2$	$(60 - 61)^2$	$(61 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(64 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(59 - 61)^2$

Globalmittelwert  $\bar{x}_{..} = 64$ ,

Gruppenmittelwerte  $\bar{x}_1 = 61$ ,  $\bar{x}_2 = 66$ ,  $\bar{x}_3 = 68$ ,  $\bar{x}_4 = 61$ .

Die roten Werte (ohne die Quadrate) heißen Residuen: die „Restvariabilität“ der Beobachtungen, die das Modell nicht erklärt.

Quadratsumme innerhalb der Gruppen:

$$ss_{\text{innerh}} = 112, 20 \text{ Freiheitsgrade}$$

Quadratsumme zwischen den Gruppen:

$$ss_{\text{zw}} = 4 \cdot (61 - 64)^2 + 6 \cdot (66 - 64)^2 + 6 \cdot (68 - 64)^2 + 8 \cdot (61 - 64)^2 = 228,$$

# Beispiel

## Blutgerinnungszeit bei Ratten unter 4 versch. Behandlungen

Gr.	$\bar{x}_j$	Beobachtung							
1	61	62	60	63	59				
		$(62 - 61)^2$	$(60 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(59 - 61)^2$				
2	66	63	67	71	64	65	66		
		$(63 - 66)^2$	$(67 - 66)^2$	$(71 - 66)^2$	$(64 - 66)^2$	$(65 - 66)^2$	$(66 - 66)^2$		
3	68	68	66	71	67	68	68		
		$(68 - 68)^2$	$(66 - 68)^2$	$(71 - 68)^2$	$(67 - 68)^2$	$(68 - 68)^2$	$(68 - 68)^2$		
4	61	56	62	60	61	63	64	63	59
		$(56 - 61)^2$	$(62 - 61)^2$	$(60 - 61)^2$	$(61 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(64 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(59 - 61)^2$

Globalmittelwert  $\bar{x}_{..} = 64$ ,

Gruppenmittelwerte  $\bar{x}_1 = 61$ ,  $\bar{x}_2 = 66$ ,  $\bar{x}_3 = 68$ ,  $\bar{x}_4 = 61$ .

Die roten Werte (ohne die Quadrate) heißen Residuen: die „Restvariabilität“ der Beobachtungen, die das Modell nicht erklärt.

Quadratsumme innerhalb der Gruppen:

$$ss_{\text{innerh}} = 112, 20 \text{ Freiheitsgrade}$$

Quadratsumme zwischen den Gruppen:

$$ss_{\text{zw}} = 4 \cdot (61 - 64)^2 + 6 \cdot (66 - 64)^2 + 6 \cdot (68 - 64)^2 + 8 \cdot (61 - 64)^2 = 228,$$

3 Freiheitsgrade

# Beispiel

## Blutgerinnungszeit bei Ratten unter 4 versch. Behandlungen

Gr.	$\bar{x}_j$	Beobachtung							
1	61	62	60	63	59				
		$(62 - 61)^2$	$(60 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(59 - 61)^2$				
2	66	63	67	71	64	65	66		
		$(63 - 66)^2$	$(67 - 66)^2$	$(71 - 66)^2$	$(64 - 66)^2$	$(65 - 66)^2$	$(66 - 66)^2$		
3	68	68	66	71	67	68	68		
		$(68 - 68)^2$	$(66 - 68)^2$	$(71 - 68)^2$	$(67 - 68)^2$	$(68 - 68)^2$	$(68 - 68)^2$		
4	61	56	62	60	61	63	64	63	59
		$(56 - 61)^2$	$(62 - 61)^2$	$(60 - 61)^2$	$(61 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(64 - 61)^2$	$(63 - 61)^2$	$(59 - 61)^2$

Globalmittelwert  $\bar{x}_{..} = 64$ ,

Gruppenmittelwerte  $\bar{x}_1 = 61$ ,  $\bar{x}_2 = 66$ ,  $\bar{x}_3 = 68$ ,  $\bar{x}_4 = 61$ .

Die roten Werte (ohne die Quadrate) heißen Residuen: die „Restvariabilität“ der Beobachtungen, die das Modell nicht erklärt.

Quadratsumme innerhalb der Gruppen:

$$ss_{\text{innerh}} = 112, 20 \text{ Freiheitsgrade}$$

Quadratsumme zwischen den Gruppen:

$$ss_{\text{zw}} = 4 \cdot (61 - 64)^2 + 6 \cdot (66 - 64)^2 + 6 \cdot (68 - 64)^2 + 8 \cdot (61 - 64)^2 = 228,$$

3 Freiheitsgrade

$$F = \frac{ss_{\text{zw}}/3}{ss_{\text{innerh}}/20} = \frac{76}{5,6} = 13,57$$

## Beispiel: Blutgerinnungszeit bei Ratten unter 4 versch. Behandlungen

## ANOVA-Tafel („ANalysis Of VAriance“)

	Freiheits- grade (DF)	Quadrat- summe (SS)	mittlere summe (SS/DF)	Quadrat- summe (SS/DF)	$F$ -Wert
Gruppe	3	228		76	13,57
Residuen	20	112		5,6	

## Beispiel: Blutgerinnungszeit bei Ratten unter 4 versch. Behandlungen

## ANOVA-Tafel („ANalysis Of VAriance“)

	Freiheits- grade (DF)	Quadrat- summe (SS)	mittlere Quadrat- summe (SS/DF)	$F$ -Wert
Gruppe	3	228	76	13,57
Residuen	20	112	5,6	

Unter der Hypothese  $H_0$  „die Gruppenmittelwerte sind gleich“  
(und einer Normalverteilungsannahme an die Beobachtungen)

ist  $F$  Fisher-verteilt mit 3 und 20 Freiheitsgraden,

$$p = \text{Fisher}_{3,20}([13,57, \infty)) \leq 5 \cdot 10^{-5}.$$

## Beispiel: Blutgerinnungszeit bei Ratten unter 4 versch. Behandlungen

## ANOVA-Tafel („ANalysis Of VAriance“)

	Freiheits- grade (DF)	Quadrat- summe (SS)	mittlere Quadrat- summe (SS/DF)	$F$ -Wert
Gruppe	3	228	76	13,57
Residuen	20	112	5,6	

Unter der Hypothese  $H_0$  „die Gruppenmittelwerte sind gleich“ (und einer Normalverteilungsannahme an die Beobachtungen)

ist  $F$  Fisher-verteilt mit 3 und 20 Freiheitsgraden,

$$p = \text{Fisher}_{3,20}([13,57, \infty)) \leq 5 \cdot 10^{-5}.$$

Wir lehnen demnach  $H_0$  ab.



Sir Ronald Aylmer Fisher,  
1890–1962

# $F$ -Test

$n = n_1 + n_2 + \dots + n_l$  Beobachtungen in  $l$  Gruppen,  
 $X_{ij} = j$ -te Beobachtung in der  $i$ -ten Gruppe,  $j = 1, \dots, n_i$ .

## $F$ -Test

$n = n_1 + n_2 + \dots + n_l$  Beobachtungen in  $l$  Gruppen,

$X_{ij} = j$ -te Beobachtung in der  $i$ -ten Gruppe,  $j = 1, \dots, n_i$ .

Modellannahme:  $X_{ij} = \mu_i + \varepsilon_{ij}$ ,

mit unabhängigen, normalverteilten  $\varepsilon_{ij}$ ,  $\mathbb{E}[\varepsilon_{ij}] = 0$ ,  $\text{Var}[\varepsilon_{ij}] = \sigma^2$

## $F$ -Test

$n = n_1 + n_2 + \dots + n_l$  Beobachtungen in  $l$  Gruppen,

$X_{ij} = j$ -te Beobachtung in der  $i$ -ten Gruppe,  $j = 1, \dots, n_i$ .

Modellannahme:  $X_{ij} = \mu_i + \varepsilon_{ij}$ ,

mit unabhängigen, normalverteilten  $\varepsilon_{ij}$ ,  $\mathbb{E}[\varepsilon_{ij}] = 0$ ,  $\text{Var}[\varepsilon_{ij}] = \sigma^2$

( $\mu_i$  ist der „wahre“ Mittelwert innerhalb der  $i$ -ten Gruppe.)

## $F$ -Test

$n = n_1 + n_2 + \dots + n_l$  Beobachtungen in  $l$  Gruppen,  
 $X_{ij}$  =  $j$ -te Beobachtung in der  $i$ -ten Gruppe,  $j = 1, \dots, n_i$ .

Modellannahme:  $X_{ij} = \mu_i + \varepsilon_{ij}$ ,

mit unabhängigen, normalverteilten  $\varepsilon_{ij}$ ,  $\mathbb{E}[\varepsilon_{ij}] = 0$ ,  $\text{Var}[\varepsilon_{ij}] = \sigma^2$

( $\mu_i$  ist der „wahre“ Mittelwert innerhalb der  $i$ -ten Gruppe.)

$\bar{X}_{..} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^l \sum_{j=1}^{n_i} X_{ij}$  (empirisches) „Globalmittel“

$\bar{X}_{i.} = \frac{1}{n_i} \sum_{j=1}^{n_i} X_{ij}$  (empirischer) Mittelwert der  $i$ -ten Gruppe

## F-Test

$n = n_1 + n_2 + \dots + n_l$  Beobachtungen in  $l$  Gruppen,  
 $X_{ij}$  =  $j$ -te Beobachtung in der  $i$ -ten Gruppe,  $j = 1, \dots, n_i$ .

Modellannahme:  $X_{ij} = \mu_i + \varepsilon_{ij}$ ,  
 mit unabhängigen, normalverteilten  $\varepsilon_{ij}$ ,  $\mathbb{E}[\varepsilon_{ij}] = 0$ ,  $\text{Var}[\varepsilon_{ij}] = \sigma^2$   
 ( $\mu_i$  ist der „wahre“ Mittelwert innerhalb der  $i$ -ten Gruppe.)

$\bar{X}_{..} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^l \sum_{j=1}^{n_i} X_{ij}$  (empirisches) „Globalmittel“

$\bar{X}_{i.} = \frac{1}{n_i} \sum_{j=1}^{n_i} X_{ij}$  (empirischer) Mittelwert der  $i$ -ten Gruppe

$SS_{\text{innerh}} = \sum_{i=1}^l \sum_{j=1}^{n_i} (X_{ij} - \bar{X}_{i.})^2$  Quadratsumme innerhalb d. Gruppen,  
 $n - l$  Freiheitsgrade

$SS_{\text{zw}} = \sum_{i=1}^l n_i (\bar{X}_{i.} - \bar{X}_{..})^2$  Quadratsumme zwischen d. Gruppen,  
 $l - 1$  Freiheitsgrade

## F-Test

$n = n_1 + n_2 + \dots + n_l$  Beobachtungen in  $l$  Gruppen,  
 $X_{ij}$  =  $j$ -te Beobachtung in der  $i$ -ten Gruppe,  $j = 1, \dots, n_i$ .

Modellannahme:  $X_{ij} = \mu_i + \varepsilon_{ij}$ ,  
 mit unabhängigen, normalverteilten  $\varepsilon_{ij}$ ,  $\mathbb{E}[\varepsilon_{ij}] = 0$ ,  $\text{Var}[\varepsilon_{ij}] = \sigma^2$   
 ( $\mu_i$  ist der „wahre“ Mittelwert innerhalb der  $i$ -ten Gruppe.)

$\bar{X}_{..} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^l \sum_{j=1}^{n_i} X_{ij}$  (empirisches) „Globalmittel“

$\bar{X}_{i.} = \frac{1}{n_i} \sum_{j=1}^{n_i} X_{ij}$  (empirischer) Mittelwert der  $i$ -ten Gruppe

$SS_{\text{innerh}} = \sum_{i=1}^l \sum_{j=1}^{n_i} (X_{ij} - \bar{X}_{i.})^2$  Quadratsumme innerhalb d. Gruppen,  
 $n - l$  Freiheitsgrade

$SS_{\text{zw}} = \sum_{i=1}^l n_i (\bar{X}_{i.} - \bar{X}_{..})^2$  Quadratsumme zwischen d. Gruppen,  
 $l - 1$  Freiheitsgrade

$$F = \frac{SS_{\text{zw}} / (l - 1)}{SS_{\text{innerh}} / (n - l)}$$

# $F$ -Test

$X_{ij}$  =  $j$ -te Beobachtung in der  $i$ -ten Gruppe,  $j = 1, \dots, n_i$ ,

Modellannahme:  $X_{ij} = \mu_i + \varepsilon_{ij}$ .  $\mathbb{E}[\varepsilon_{ij}] = 0$ ,  $\text{Var}[\varepsilon_{ij}] = \sigma^2$

$SS_{\text{innerh}} = \sum_{i=1}^I \sum_{j=1}^{n_i} (X_{ij} - \bar{X}_{i\cdot})^2$  Quadratsumme innerhalb d. Gruppen,  
 $n - I$  Freiheitsgrade

$SS_{\text{zw}} = \sum_{i=1}^I n_i (\bar{X}_{i\cdot} - \bar{X}_{\cdot\cdot})^2$  Quadratsumme zwischen d. Gruppen,  
 $I - 1$  Freiheitsgrade

$$F = \frac{SS_{\text{zw}} / (I - 1)}{SS_{\text{innerh}} / (n - I)}$$

Unter der Hypothese  $H_0 : \mu_1 = \dots = \mu_I$  („alle  $\mu_i$  sind gleich“) ist  $F$  Fisher-verteilt mit  $I - 1$  und  $n - I$  Freiheitsgraden (unabhängig vom tatsächlichen gemeinsamen Wert der  $\mu_i$ ).

$F$ -Test: Wir lehnen  $H_0$  zum Signifikanzniveau  $\alpha$  ab, wenn  $F \geq q_\alpha$ , wobei  $q_\alpha$  das  $(1 - \alpha)$ -Quantil der Fisher-Verteilung mit  $I - 1$  und  $n - I$  Freiheitsgraden ist.

# Berechnung der Signifikanz mit R

Wie muss man  $q$  wählen, damit  $\Pr(F \leq q) = 0.95$  für Fisher(6,63)-verteiltes  $F$ ?

```
> qf(0.95,df1=6,df2=63)  
[1] 2.246408
```

# Berechnung der Signifikanz mit R

Wie muss man  $q$  wählen, damit  $\Pr(F \leq q) = 0.95$  für Fisher(6,63)-verteiltes  $F$ ?

```
> qf(0.95, df1=6, df2=63)
[1] 2.246408
```

p-Wert-Berechnung: Wie wahrscheinlich ist es, dass eine Fisher(3,20)-verteilte Zufallsgröße einen Wert  $\geq 13.57$  annimmt?

```
> pf(13.57, df1=3, df2=20, lower.tail=FALSE)
[1] 4.66169e-05
```

# Tabelle der 95%-Quantile der F-Verteilung

Die folgende Tabelle zeigt (auf 2 Nachkommastellen gerundet) das 95%-Quantil der Fisher-Verteilung mit  $k_1$  und  $k_2$  Freiheitsgraden ( $k_1$  Zähler- und  $k_2$  Nennerfreiheitsgrade)

$k_2 \backslash k_1$	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	20
1	161.45	199.5	215.71	224.58	230.16	233.99	236.77	238.88	240.54	241.88	243.80
2	18.51	19	19.16	19.25	19.3	19.33	19.35	19.37	19.38	19.4	19.42
3	10.13	9.55	9.28	9.12	9.01	8.94	8.89	8.85	8.81	8.79	8.77
4	7.71	6.94	6.59	6.39	6.26	6.16	6.09	6.04	6	5.96	5.94
5	6.61	5.79	5.41	5.19	5.05	4.95	4.88	4.82	4.77	4.74	4.72
6	5.99	5.14	4.76	4.53	4.39	4.28	4.21	4.15	4.1	4.06	4.04
7	5.59	4.74	4.35	4.12	3.97	3.87	3.79	3.73	3.68	3.64	3.62
8	5.32	4.46	4.07	3.84	3.69	3.58	3.5	3.44	3.39	3.35	3.33
9	5.12	4.26	3.86	3.63	3.48	3.37	3.29	3.23	3.18	3.14	3.12
10	4.96	4.1	3.71	3.48	3.33	3.22	3.14	3.07	3.02	2.98	2.96
11	4.84	3.98	3.59	3.36	3.2	3.09	3.01	2.95	2.9	2.85	2.83
12	4.75	3.89	3.49	3.26	3.11	3	2.91	2.85	2.8	2.75	2.73
13	4.67	3.81	3.41	3.18	3.03	2.92	2.83	2.77	2.71	2.67	2.65
14	4.6	3.74	3.34	3.11	2.96	2.85	2.76	2.7	2.65	2.6	2.58
15	4.54	3.68	3.29	3.06	2.9	2.79	2.71	2.64	2.59	2.54	2.52
16	4.49	3.63	3.24	3.01	2.85	2.74	2.66	2.59	2.54	2.49	2.47
17	4.45	3.59	3.2	2.96	2.81	2.7	2.61	2.55	2.49	2.45	2.43
18	4.41	3.55	3.16	2.93	2.77	2.66	2.58	2.51	2.46	2.41	2.39
19	4.38	3.52	3.13	2.9	2.74	2.63	2.54	2.48	2.42	2.38	2.36
20	4.35	3.49	3.1	2.87	2.71	2.6	2.51	2.45	2.39	2.35	2.33

# Varianzanalyse komplett in R

Die Text-Datei gerinnung.txt enthält eine Spalte "bgz" mit den Blutgerinnungszeiten und eine Spalte "beh" mit der Behandlung (A,B,C,D).

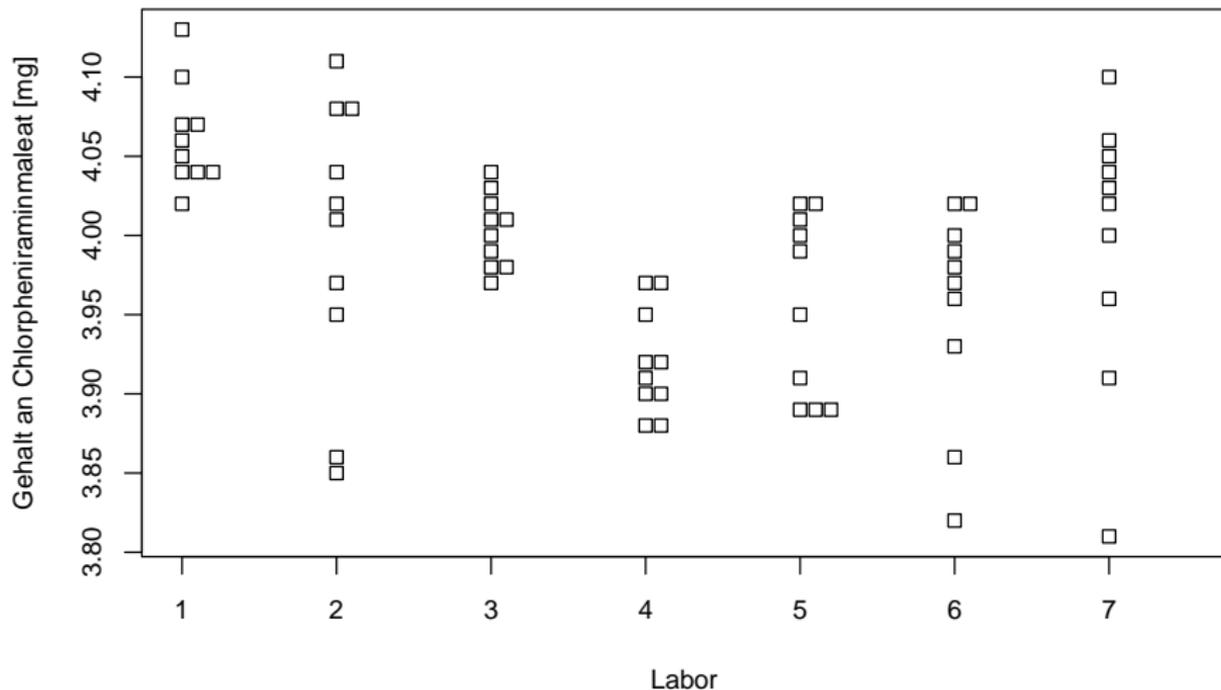
```
> rat<-read.table("gerinnung.txt",header=TRUE)
> rat.aov <- aov(bgz~beh,data=rat)
> summary(rat.aov)
```

	Df	Sum Sq	Mean Sq	F value	Pr(>F)
beh	3	228	76.0	13.571	4.658e-05 ***
Residuals	20	112	5.6		

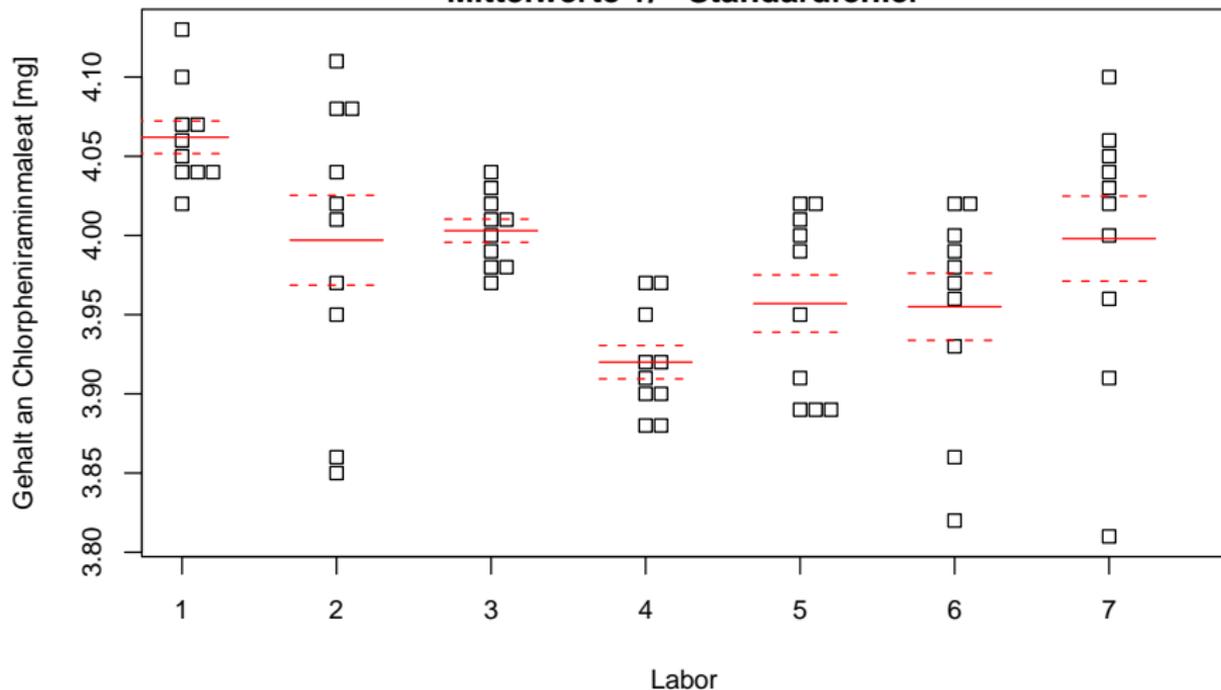
---

```
Signif. codes:  0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
```

## 7 verschiedene Labors haben jeweils 10 Messungen des Chlorpheniraminmaleat-Gehalts von Medikamentenproben vorgenommen:



**7 verschiedene Labors haben jeweils 10 Messungen  
des Chlorpheniraminmaleat-Gehalts von  
Medikamentenproben vorgenommen:  
Mittelwerte  $\pm$  Standardfehler**



Beachte: Die Labore sind mit Zahlen nummeriert. Damit R das nicht als numerische Werte sondern als Nummern der Labore auffasst, müssen wir die Variable "Labor" in einen sog. Factor umwandeln:

```
> chlor <- read.table("chlorpheniraminmaleat.txt")
> str(chlor)
'data.frame': 70 obs. of 2 variables:
 $ Gehalt: num 4.13 4.07 4.04 4.07 4.05 4.04 4.02 4.06 4
 $ Labor : int 1 1 1 1 1 1 1 1 1 ...
> chlor$Labor <- as.factor(chlor$Labor)
> str(chlor)
'data.frame': 70 obs. of 2 variables:
 $ Gehalt: num 4.13 4.07 4.04 4.07 4.05 4.04 4.02 4.06 4
 $ Labor : Factor w/ 7 levels "1","2","3","4",...: 1 1 1 1
```

Nun können wir die Varianzanalyse durchführen:

```
> chlor.aov <- aov(Gehalt~Labor,data=chlor)
> summary(chlor.aov)
```

	Df	Sum Sq	Mean Sq	F value	Pr(>F)	
Labor	6	0.12474	0.020789	5.6601	9.453e-05	***
Residuals	63	0.23140	0.003673			

---

Signif. codes: 0 '\*\*\*' 0.001 '\*\*' 0.01 '\*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1

# Inhalt

- 1 Die einfaktorielle Varianzanalyse und der  $F$ -Test
- 2 Paarweise Vergleiche und Exkurs über multiples Testen**
- 3 Nichtparameterisch: Der Kruskal-Wallis-Test

Die Varianzanalyse zeigte, dass es signifikante Unterschiede zwischen den Laboren gibt.

Die Varianzanalyse zeigte, dass es signifikante Unterschiede zwischen den Laboren gibt.

Aber welche Labore unterscheiden sich signifikant?

Die Varianzanalyse zeigte, dass es signifikante Unterschiede zwischen den Laboren gibt.

Aber welche Labore unterscheiden sich signifikant?

$p$ -Werte aus paarweisen Vergleichen mittels  $t$ -Tests:

	Lab2	Lab3	Lab4	Lab5	Lab6	Lab7
Lab1	0.05357	0.00025	0.00000	0.00017	0.00055	0.04657
Lab2		0.84173	0.02654	0.25251	0.25224	0.97985
Lab3			0.00001	0.03633	0.05532	0.86076
Lab4				0.09808	0.16280	0.01944
Lab5					0.94358	0.22336
Lab6						0.22543

Wir haben 21 paarweise Vergleiche; auf dem 5%-Niveau zeigen einige davon Signifikanz an.

Wir haben 21 paarweise Vergleiche; auf dem 5%-Niveau zeigen einige davon Signifikanz an.

Problem des Multiplen Testens: Wenn die Nullhypothese (“alles nur Zufallsschwankungen”) stimmt, verwirft man im Schnitt bei 5% der Tests die Nullhypothese zu Unrecht.

Wir haben 21 paarweise Vergleiche; auf dem 5%-Niveau zeigen einige davon Signifikanz an.

Problem des Multiplen Testens: Wenn die Nullhypothese (“alles nur Zufallsschwankungen”) stimmt, verwirft man im Schnitt bei 5% der Tests die Nullhypothese zu Unrecht. Testet man mehr als 20 mal und gelten jeweils die Nullhypothesen, wird man im Schnitt mehr als eine Nullhypothese zu Unrecht verwerfen.

Wir haben 21 paarweise Vergleiche; auf dem 5%-Niveau zeigen einige davon Signifikanz an.

Problem des Multiplen Testens: Wenn die Nullhypothese (“alles nur Zufallsschwankungen”) stimmt, verwirft man im Schnitt bei 5% der Tests die Nullhypothese zu Unrecht. Testet man mehr als 20 mal und gelten jeweils die Nullhypothesen, wird man im Schnitt mehr als eine Nullhypothese zu Unrecht verwerfen.

Daher sollte man bei multiplen Tests mit korrigierten  $p$ -Werten arbeiten.

Wir haben 21 paarweise Vergleiche; auf dem 5%-Niveau zeigen einige davon Signifikanz an.

Problem des Multiplen Testens: Wenn die Nullhypothese (“alles nur Zufallsschwankungen”) stimmt, verwirft man im Schnitt bei 5% der Tests die Nullhypothese zu Unrecht. Testet man mehr als 20 mal und gelten jeweils die Nullhypothesen, wird man im Schnitt mehr als eine Nullhypothese zu Unrecht verwerfen. Daher sollte man bei multiplen Tests mit korrigierten  $p$ -Werten arbeiten.

Eine Möglichkeit bei Varianzanalysen: Tukey’s Honest Significant Differences (HSD).

```
> TukeyHSD(chlor.aov)
```

```
Tukey multiple comparisons of means
 95% family-wise confidence level
```

```
Fit: aov(formula = Gehalt ~ Labor, data = chlor)
```

```
$Labor
```

	diff	lwr	upr	p adj
2-1	-0.065	-0.147546752	0.017546752	0.2165897
3-1	-0.059	-0.141546752	0.023546752	0.3226101
4-1	-0.142	-0.224546752	-0.059453248	0.0000396
5-1	-0.105	-0.187546752	-0.022453248	0.0045796
6-1	-0.107	-0.189546752	-0.024453248	0.0036211
7-1	-0.064	-0.146546752	0.018546752	0.2323813
3-2	0.006	-0.076546752	0.088546752	0.9999894
4-2	-0.077	-0.159546752	0.005546752	0.0830664
5-2	-0.040	-0.122546752	0.042546752	0.7578129
6-2	-0.042	-0.124546752	0.040546752	0.7140108
7-2	0.001	-0.081546752	0.083546752	1.0000000
4-3	-0.083	-0.165546752	-0.000453248	0.0478900
5-3	-0.046	-0.128546752	0.036546752	0.6204148
6-3	-0.048	-0.130546752	0.034546752	0.5720976
7-3	-0.005	-0.087546752	0.077546752	0.9999964
5-4	0.037	-0.045546752	0.119546752	0.8178759
6-4	0.035	-0.047546752	0.117546752	0.8533629
7-4	0.078	-0.004546752	0.160546752	0.0760155
6-5	-0.002	-0.084546752	0.080546752	1.0000000
7-5	0.041	-0.041546752	0.123546752	0.7362355

```
> TukeyHSD(chlor.aov)
```

```
Tukey multiple comparisons of means
 95% family-wise confidence level
```

```
Fit: aov(formula = Gehalt ~ Labor, data = chlor)
```

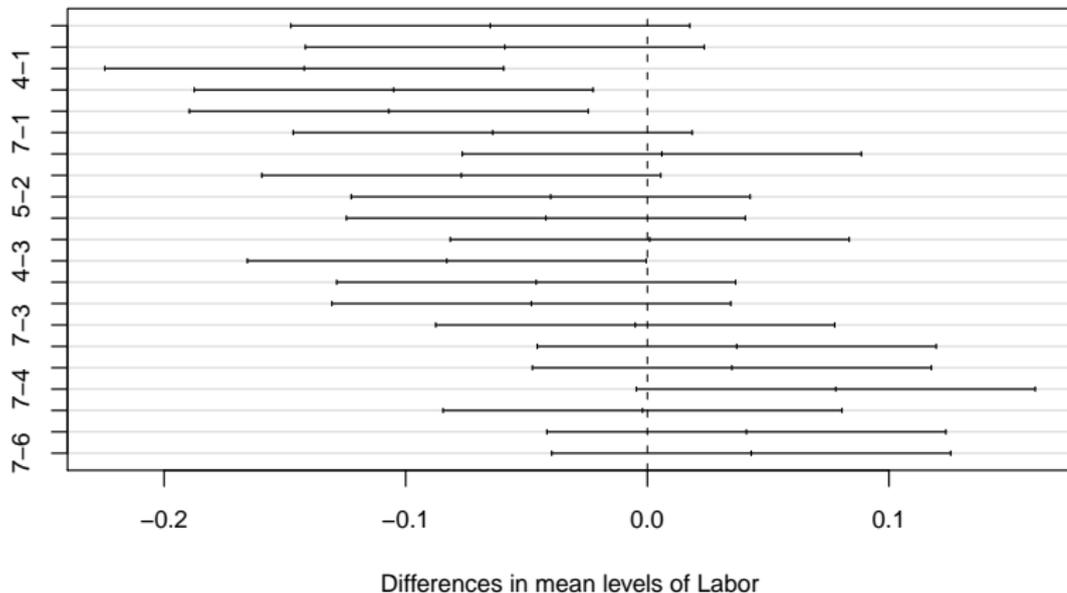
```
$Labor
```

	diff	lwr	upr	p adj
2-1	-0.065	-0.147546752	0.017546752	0.2165897
3-1	-0.059	-0.141546752	0.023546752	0.3226101
4-1	-0.142	-0.224546752	-0.059453248	0.0000396
5-1	-0.105	-0.187546752	-0.022453248	0.0045796
6-1	-0.107	-0.189546752	-0.024453248	0.0036211
7-1	-0.064	-0.146546752	0.018546752	0.2323813
3-2	0.006	-0.076546752	0.088546752	0.9999894
4-2	-0.077	-0.159546752	0.005546752	0.0830664
5-2	-0.040	-0.122546752	0.042546752	0.7578129
6-2	-0.042	-0.124546752	0.040546752	0.7140108
7-2	0.001	-0.081546752	0.083546752	1.0000000
4-3	-0.083	-0.165546752	-0.000453248	0.0478900
5-3	-0.046	-0.128546752	0.036546752	0.6204148
6-3	-0.048	-0.130546752	0.034546752	0.5720976
7-3	-0.005	-0.087546752	0.077546752	0.9999964
5-4	0.037	-0.045546752	0.119546752	0.8178759
6-4	0.035	-0.047546752	0.117546752	0.8533629
7-4	0.078	-0.004546752	0.160546752	0.0760155
6-5	-0.002	-0.084546752	0.080546752	1.0000000
7-5	0.041	-0.041546752	0.123546752	0.7362355

Wir erhalten Konfidenzintervalle  $[lwr, upr]$  für die Unterschiede zwischen den Labormittelwerte und  $p$ -Werte für die Nullhypothese, dass diese Unterschiede 0 sind; alles bereits korrigiert für multiples Testen.

Mit `plot(TukeyHSD(chlor.aov))` bekommt man die Konfidenzintervalle für die Unterschiede auch visualisiert:

**95% family-wise confidence level**



Einschränkung: Tukeys HSD-Methode ist streng genommen nur für *balancierten Versuchsplänen* (engl. *balanced design*) anwendbar, d.h. wenn in jeder Gruppe die selbe Anzahl von Messungen vorliegt. (Außer geht HSD wie die ANOVA selbst von gleichen Varianzen in allen Gruppen aus.)

Einschränkung: Tukeys HSD-Methode ist streng genommen nur für *balancierten Versuchsplänen* (engl. *balanced design*) anwendbar, d.h. wenn in jeder Gruppe die selbe Anzahl von Messungen vorliegt. (Außer geht HSD wie die ANOVA selbst von gleichen Varianzen in allen Gruppen aus.) Das ist bei dem Laborvergleich der Fall, da jedes Labor 10 Messungen durchgeführt hat.

Einschränkung: Tukeys HSD-Methode ist streng genommen nur für *balancierten Versuchsplänen* (engl. *balanced design*) anwendbar, d.h. wenn in jeder Gruppe die selbe Anzahl von Messungen vorliegt. (Außer geht HSD wie die ANOVA selbst von gleichen Varianzen in allen Gruppen aus.) Das ist bei dem Laborvergleich der Fall, da jedes Labor 10 Messungen durchgeführt hat. Die Blutgerinnungsdaten sind jedoch nicht balanciert, da Behandlung 1 an vier Ratten und Behandlung 2 an 8 Ratten erprobt wurde.

Was können wir verwenden, wenn die Bedingungen für Tukeys HSD nicht erfüllt sind?

Was können wir verwenden, wenn die Bedingungen für Tukeys HSD nicht erfüllt sind?

Eine ganz allgemeine Korrektur für multiples Testen ist die **Bonferroni-Methode**: Multipliziere jeden  $p$ -Wert mit der Anzahl  $n$  der durchgeführten Tests.

Beispiel: Paarweise Vergleiche (mittels  $t$ -Test) für die Blutgerinnungszeiten bei vier verschiedenen Behandlungen, zunächst ohne Korrektur für multiples Testen:

	B	C	D
A	0.00941	0.00078	1.00000
B		0.17383	0.00663
C			0.00006

Beispiel: Paarweise Vergleiche (mittels  $t$ -Test) für die Blutgerinnungszeiten bei vier verschiedenen Behandlungen, zunächst ohne Korrektur für multiples Testen:

	B	C	D
A	0.00941	0.00078	1.00000
B		0.17383	0.00663
C			0.00006

Nun mit Bonferroni-Korrektur (alle Werte mit 6 multiplizieren):

	B	C	D
A	0.05646	0.00468	6.00000
B		1.04298	0.03978
C			0.00036

Beispiel: Paarweise Vergleiche (mittels  $t$ -Test) für die Blutgerinnungszeiten bei vier verschiedenen Behandlungen, zunächst ohne Korrektur für multiples Testen:

	B	C	D
A	0.00941	0.00078	1.00000
B		0.17383	0.00663
C			0.00006

Nun mit Bonferroni-Korrektur (alle Werte mit 6 multiplizieren):

	B	C	D
A	0.05646	0.00468	6.00000
B		1.04298	0.03978
C			0.00036

Nach Bonferroni-Korrektur führen folgende Paare von Behandlungen zu jeweils signifikant unterschiedlichen Ergebnissen: A/C, B/D sowie C/D.

Beispiel: Paarweise Vergleiche (mittels  $t$ -Test) für die Blutgerinnungszeiten bei vier verschiedenen Behandlungen, zunächst ohne Korrektur für multiples Testen:

	B	C	D
A	0.00941	0.00078	1.00000
B		0.17383	0.00663
C			0.00006

Nun mit Bonferroni-Korrektur (alle Werte mit 6 multiplizieren):

	B	C	D
A	0.05646	0.00468	6.00000
B		1.04298	0.03978
C			0.00036

Nach Bonferroni-Korrektur führen folgende Paare von Behandlungen zu jeweils signifikant unterschiedlichen Ergebnissen: A/C, B/D sowie C/D. (Der Bonferroni-korrigierte  $p$ -Wert von 6.0 für den Vergleich der Behandlungen A und D ist natürlich nicht als echter  $p$ -Wert zu interpretieren.)

Die Bonferroni-Methode ist sehr *konservativ*, d.h. um auf der sicheren Seite zu sein, lässt man sich lieber die eine oder andere Signifikanz entgehen.

Die Bonferroni-Methode ist sehr *konservativ*, d.h. um auf der sicheren Seite zu sein, lässt man sich lieber die eine oder andere Signifikanz entgehen.

Eine Verbesserung der Bonferroni-Methode ist die **Bonferroni-Holm-Methode**: Ist  $k$  die Anzahl der Tests, so multipliziere den kleinsten  $p$ -Wert mit  $k$ , den zweitkleinsten mit  $k - 1$ , den drittkleinsten mit  $k - 2$  usw.

Die Bonferroni-Methode ist sehr *konservativ*, d.h. um auf der sicheren Seite zu sein, lässt man sich lieber die eine oder andere Signifikanz entgehen.

Eine Verbesserung der Bonferroni-Methode ist die

**Bonferroni-Holm-Methode:** Ist  $k$  die Anzahl der Tests, so multipliziere den kleinsten  $p$ -Wert mit  $k$ , den zweitkleinsten mit  $k - 1$ , den drittkleinsten mit  $k - 2$  usw.

In R gibt es den Befehl `p.adjust`, der  $p$ -Werte für multiples Testen korrigiert und dabei defaultmäßig Bonferroni-Holm verwendet:

```
> pv <- c(0.00941, 0.00078, 1.00000, 0.17383,
+         0.00663, 0.00006)
> p.adjust(pv)
[1] 0.02823 0.00390 1.00000 0.34766 0.02652 0.00036
> p.adjust(pv, method="bonferroni")
[1] 0.05646 0.00468 1.00000 1.00000 0.03978 0.00036
```

Für paarweise  $t$ -Tests gibt es ebenfalls eine R-Funktion, die per default die Bonferroni-Holm-Korrektur verwendet:

```
> pairwise.t.test(rat$bgz, rat$beh, pool.sd=FALSE)
```

Pairwise comparisons using t tests with non-pooled SD

data: rat\$bgz and rat\$beh

	A	B	C
B	0.02823	-	-
C	0.00391	0.34766	-
D	1.00000	0.02654	0.00035

P value adjustment method: holm

# Inhalt

- 1 Die einfaktorielle Varianzanalyse und der  $F$ -Test
- 2 Paarweise Vergleiche und Exkurs über multiples Testen
- 3 Nichtparameterisch: Der Kruskal-Wallis-Test**

Die einfaktorielle Varianzanalyse basiert auf der Annahme, dass die gemessenen Werte unabhängig und normalverteilt sind. Die Mittelwerte  $\mu_1, \mu_2, \dots, \mu_m$  können verschieden sein (das herauszufinden ist Ziel des Tests), aber die Varianzen innerhalb der verschiedenen Gruppen müssen gleich sein.

Die einfaktorielle Varianzanalyse basiert auf der Annahme, dass die gemessenen Werte unabhängig und normalverteilt sind. Die Mittelwerte  $\mu_1, \mu_2, \dots, \mu_m$  können verschieden sein (das herauszufinden ist Ziel des Tests), aber die Varianzen innerhalb der verschiedenen Gruppen müssen gleich sein.

In Formeln: Ist  $Y_{ij}$  die  $j$ -te Messung in der  $i$ -ten Gruppe, so muss gelten

$$Y_{ij} = \mu_i + \varepsilon_{ij},$$

wobei alle  $\varepsilon_{ij}$  unabhängig  $\mathcal{N}(0, \sigma^2)$ -verteilt sind, mit demselben  $\sigma^2$  für alle Gruppen!

Die einfaktorielle Varianzanalyse basiert auf der Annahme, dass die gemessenen Werte unabhängig und normalverteilt sind. Die Mittelwerte  $\mu_1, \mu_2, \dots, \mu_m$  können verschieden sein (das herauszufinden ist Ziel des Tests), aber die Varianzen innerhalb der verschiedenen Gruppen müssen gleich sein.

In Formeln: Ist  $Y_{ij}$  die  $j$ -te Messung in der  $i$ -ten Gruppe, so muss gelten

$$Y_{ij} = \mu_i + \varepsilon_{ij},$$

wobei alle  $\varepsilon_{ij}$  unabhängig  $\mathcal{N}(0, \sigma^2)$ -verteilt sind, mit demselben  $\sigma^2$  für alle Gruppen!

Die zu testende Nullhypothese ist  $\mu_1 = \mu_2 = \dots = \mu_m$ .

Nicht jede Abweichung von der Normalverteilung stellt ein Problem dar.

Nicht jede Abweichung von der Normalverteilung stellt ein Problem dar.

Die Anova ist aber nicht robust gegenüber Ausreißern bzw. Verteilungen, die seltene extrem große Werte liefern.

Nicht jede Abweichung von der Normalverteilung stellt ein Problem dar.

Die Anova ist aber nicht robust gegenüber Ausreißern bzw. Verteilungen, die seltene extrem große Werte liefern.

In diesem Fall kann man den **Kruskal-Wallis-Test** verwenden, der wie der Wilcoxon-Test die *Ränge* statt der tatsächlichen Werte verwendet. Es handelt sich also um einen *nicht-parameterischen Test*, d.h. es wird keine bestimmte Wahrscheinlichkeitsverteilung vorausgesetzt.

Nicht jede Abweichung von der Normalverteilung stellt ein Problem dar.

Die Anova ist aber nicht robust gegenüber Ausreißern bzw. Verteilungen, die seltene extrem große Werte liefern.

In diesem Fall kann man den **Kruskal-Wallis-Test** verwenden, der wie der Wilcoxon-Test die *Ränge* statt der tatsächlichen Werte verwendet. Es handelt sich also um einen *nicht-parameterischen Test*, d.h. es wird keine bestimmte Wahrscheinlichkeitsverteilung vorausgesetzt.

Nullhypothese des Kruskal-Wallis-Tests: alle Werte  $Y_{ij}$  kommen aus derselben Verteilung, unabhängig von der Gruppe.

Nicht jede Abweichung von der Normalverteilung stellt ein Problem dar.

Die Anova ist aber nicht robust gegenüber Ausreißern bzw. Verteilungen, die seltene extrem große Werte liefern.

In diesem Fall kann man den **Kruskal-Wallis-Test** verwenden, der wie der Wilcoxon-Test die *Ränge* statt der tatsächlichen Werte verwendet. Es handelt sich also um einen *nicht-parameterischen Test*, d.h. es wird keine bestimmte Wahrscheinlichkeitsverteilung vorausgesetzt.

Nullhypothese des Kruskal-Wallis-Tests: alle Werte  $Y_{ij}$  kommen aus derselben Verteilung, unabhängig von der Gruppe.

Grundvoraussetzung ist auch beim Kruskal-Wallis-Test, dass die Werte unabhängig voneinander sind.

- Sei  $R_{ij}$  der Rang von  $Y_{ij}$  innerhalb der Gesamtstichprobe.

- Sei  $R_{ij}$  der Rang von  $Y_{ij}$  innerhalb der Gesamtstichprobe.
- Sei

$$\bar{R}_i = \frac{1}{J_i} \sum_{j=1}^{J_i} R_{ij}$$

der durchschnittliche Rang in Gruppe  $i$ , wobei  $J_i$  die Anzahl der Messungen in Gruppe  $i$  ist.

- Sei  $R_{ij}$  der Rang von  $Y_{ij}$  innerhalb der Gesamtstichprobe.
- Sei

$$\bar{R}_i = \frac{1}{J_i} \sum_{j=1}^{J_i} R_{ij}$$

der durchschnittliche Rang in Gruppe  $i$ , wobei  $J_i$  die Anzahl der Messungen in Gruppe  $i$  ist.

- Der mittlere Rang der Gesamtstichprobe ist

$$\bar{R}_{..} = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^I \sum_{j=1}^{J_i} R_{ij} = \frac{N+1}{2},$$

wobei  $I$  die Anzahl der Gruppen ist und  $N$  der Umfang der Gesamtstichprobe.

- Sei  $R_{ij}$  der Rang von  $Y_{ij}$  innerhalb der Gesamtstichprobe.
- Sei

$$\bar{R}_i = \frac{1}{J_i} \sum_{j=1}^{J_i} R_{ij}$$

der durchschnittliche Rang in Gruppe  $i$ , wobei  $J_i$  die Anzahl der Messungen in Gruppe  $i$  ist.

- Der mittlere Rang der Gesamtstichprobe ist

$$\bar{R}_{..} = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^I \sum_{j=1}^{J_i} R_{ij} = \frac{N+1}{2},$$

wobei  $I$  die Anzahl der Gruppen ist und  $N$  der Umfang der Gesamtstichprobe.

- Unter der Nullhypothese haben die mittleren Ränge der Gruppen denselben Erwartungswert  $\bar{R}_{..}$ .

- Die Abweichung von dieser Erwartung kann man messen mit der Teststatistik

$$S = \sum_{i=1}^I J_i \cdot (\bar{R}_i - \bar{R}_{..})^2.$$

- Die Abweichung von dieser Erwartung kann man messen mit der Teststatistik

$$S = \sum_{i=1}^I J_i \cdot (\bar{R}_i - \bar{R}_{..})^2.$$

- Um aus  $S$  einen  $p$ -Wert zu erhalten, muss man die Verteilung von  $S$  unter der Nullhypothese kennen. Diese kann man für verschiedene  $I$  und  $J_i$  in Tabellen finden.

- Die Abweichung von dieser Erwartung kann man messen mit der Teststatistik

$$S = \sum_{i=1}^I J_i \cdot (\bar{R}_i - \bar{R}_{..})^2.$$

- Um aus  $S$  einen  $p$ -Wert zu erhalten, muss man die Verteilung von  $S$  unter der Nullhypothese kennen. Diese kann man für verschiedene  $I$  und  $J_i$  in Tabellen finden.
- Für  $I \geq 3$  und  $J_i \geq 5$  sowie  $I > 3$  und  $J_i \geq 4$  kann man ausnutzen, dass die folgende Skalierung  $K$  von  $S$  approximativ  $\chi^2$ -verteilt ist mit  $I - 1$  Freiheitsgraden:

$$K = \frac{12}{N \cdot (N + 1)} S = \frac{12}{N \cdot (N + 1)} \cdot \left( \sum_{i=1}^I J_i \cdot \bar{R}_i^2 \right) - 3 \cdot (N + 1)$$

# Kruskal-Wallis-Test mit R

```
> kruskal.test(bgz~beh,data=rat)
```

```
Kruskal-Wallis rank sum test
```

```
data:  bgz by beh
```

```
Kruskal-Wallis chi-squared = 17.0154, df = 3,  
p-value = 0.0007016
```

```
> kruskal.test(Gehalt~Labor,data=chlor)
```

```
Kruskal-Wallis rank sum test
```

```
data:  Gehalt by Labor
```

```
Kruskal-Wallis chi-squared = 29.606, df = 6,  
p-value = 4.67e-05
```