

การเปรียบเทียบตัวสถิติทดสอบความแตกต่างของค่าเฉลี่ยของประชากรหลายกลุ่ม

นางสาวกมลทิพย์ ปรัชญชรินทร์



สถาบันวิทยบริการ
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

วิทยานิพนธ์นี้เป็นส่วนหนึ่งของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญาวิทยาศาสตรมหาบัณฑิต

สาขาสถิติ ภาควิชาสถิติ

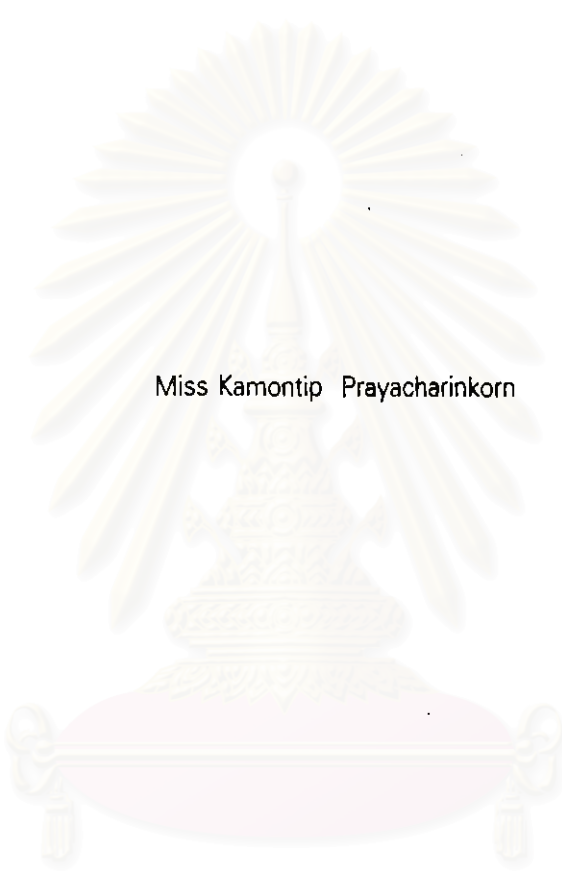
บัณฑิตวิทยาลัย จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

ปีการศึกษา 2541

ISBN 974-331-975-1

ลิขสิทธิ์ของบัณฑิตวิทยาลัย จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

A COMPARISON ON TEST STATISTICS FOR TESTING
THE DIFFERENT AMONG POPULATION MEANS



Miss Kamontip Prayacharinkorn

สถาบันวิทยบริการ

จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

A Thesis Submitted in Partial Fulfillment of the Requirements
for the Degree of Master of Science in Statistics

Department of Statistics

Graduate School

Chulalongkorn University

Academic Year 1998

ISBN 974-331-975-1

พิมพ์ต้นฉบับเพื่อจัดพิมพ์วิทยานิพนธ์ภายในกรอบสี่เหลี่ยมนี้เพียงอย่างเดียว

กมลทิพย์ ปรีชญชรินทร์ : การเปรียบเทียบตัวสถิติทดสอบความแตกต่างของค่าเฉลี่ยของประชากรหลายกลุ่ม (A COMPARISON ON TEST STATISTICS FOR TESTING THE DIFFERENT AMONG POPULATION MEANS) อ. ที่ปรึกษา : ผศ. ร.อ. มานพ วรภักดิ์, 214 หน้า. ISBN 974-331-975-1.

การวิจัยครั้งนี้มีวัตถุประสงค์ที่จะศึกษาเปรียบเทียบอำนาจของการทดสอบ (power of the test) ของตัวสถิติทดสอบความแตกต่างของค่าเฉลี่ยของประชากร 3 และ 5 กลุ่ม ได้แก่ ตัวสถิติทดสอบเอฟ (F) ตัวสถิติทดสอบครัสคัล-วัลลิส (KW) ตัวสถิติทดสอบนอร์มอลสกออร์ (NS) และตัวสถิติทดสอบแบบดัดแปลงอย่างต่อเนื่อง (CA) เมื่อสุ่มตัวอย่างมาจากประชากรที่มีการแจกแจงเหมือนกัน ได้แก่ การแจกแจงแลมดาของดูเกียร์ การแจกแจงปกติ การแจกแจงแกมมา และการแจกแจงลอกนอร์มอล ขนาดของตัวอย่างที่กำหนดเท่ากับ เท่ากับ 5, 10, 20, 30, 40 และ 50 ระดับนัยสำคัญเท่ากับ 0.01, 0.05 และ 0.10 ในการวิจัยครั้งนี้ ใช้เทคนิคการจำลองแบบมอนติคาร์โล กระทำซ้ำ 1,000 ครั้ง ในแต่ละกรณี

ผลการวิจัยสรุปได้ดังนี้

อำนาจการทดสอบพิจารณา 2 กรณี คือ กรณีแรก ประชากรมีการแจกแจงปกติ พบว่าที่ระดับนัยสำคัญ 0.01 และ 0.05 ตัวสถิติทดสอบเอฟมีอำนาจการทดสอบสูงสุด และที่ระดับนัยสำคัญ 0.10 ตัวสถิติทดสอบนอร์มอลสกออร์มีอำนาจการทดสอบสูงสุด

กรณีที่สอง การแจกแจงของประชากรไม่ใช่แบบปกติ โดยทั่วไป ตัวสถิติทดสอบครัสคัล-วัลลิสมีอำนาจการทดสอบสูงสุด ยกเว้น กรณีความเบ้อยู่ระหว่าง 0.0-0.5 และความโด่งอยู่ในระดับต่ำและปานกลาง พบว่า ตัวสถิติทดสอบเอฟมีอำนาจการทดสอบสูงกว่า เมื่อ $n \leq 10$ และตัวสถิติทดสอบนอร์มอลสกออร์มีอำนาจการทดสอบสูงกว่า เมื่อ $n > 10$

ค่าอำนาจการทดสอบจะแปรผันตามความเบ้ ความโด่ง จำนวนกลุ่มตัวอย่าง ขนาดตัวอย่างและระดับนัยสำคัญ โดยเรียงลำดับจากมากไปน้อย

ภาควิชา สถิติ

สาขาวิชา สถิติ

ปีการศึกษา 2541

ลายมือชื่อนิติ กมลทิพย์ ปรีชญชรินทร์

ลายมือชื่ออาจารย์ที่ปรึกษา 

ลายมือชื่ออาจารย์ที่ปรึกษารวม

3970017926 : MAJOR STATISTICS

KEY WORD: DIFFERENT MEANS/POWER OF THE TEST/ NORMAL SCORE TEST STATISTIC/
CONTINUOUSLY ADAPTIVE TEST STATISTIC

KAMONTIP PRAYACHARINKORN : A COMPARISON ON TEST STATISTICS FOR TESTING
DIFFERENT AMONG POPULATION MEANS. THESIS ADVISOR : ASSIST. PROF. CAPT.
MANOP VARAPHAKE, 214 pp. ISBN 974-331-975-1.

The purpose of this research is to compare the power of the test of F test (F), Kruskal-Wallis test (KW), Normal Score test (NS), and Continuously Adaptive test (CA) in testing population means of 3 and 5 groups. The population distribution are Lamda's Tukey Distribution, Normal Distribution, Gamma Distribution, and Lognormal Distribution. All groups have the sample sizes which are 5, 10, 20, 30, 40, and 50. The levels of significance are 0.01, 0.05, and 0.10. The Monte Carlo simulation method was used in this research.

Results of the study are as follows :

Under the normal population, F test has the highest power at $\alpha = 0.01$ and 0.05, and Normal Score test has the highest power at $\alpha = 0.10$.

Under the non-normal population, Kruskal-Wallis test has the highest power in all situations, except the skewness is in range 0.0 to 0.5 and the kurtosis is platykurtic or moderate, the F test will have the more power for $n \leq 10$ and the Normal Score test will have more power for $n > 10$.

Power of the test varies directly to skewness, kurtosis, number of sample groups, sample size and level of significance, most to least, respectively.

ภาควิชา..... สถิติ

สาขาวิชา..... สถิติ

ปีการศึกษา..... 2541

ลายมือชื่อนิสิต..... กมลทิพย์ . ปัจจุบัน

ลายมือชื่ออาจารย์ที่ปรึกษา.....

ลายมือชื่ออาจารย์ที่ปรึกษาร่วม.....



กิตติกรรมประกาศ

วิทยานิพนธ์ฉบับนี้ สำเร็จลุล่วงได้ด้วยความกรุณาและความช่วยเหลืออย่างดียิ่ง จากผู้ช่วยศาสตราจารย์ ร้อยเอกมานพ วรภักดิ์ อาจารย์ที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ ที่กรุณาให้คำแนะนำปรึกษา และข้อคิดเห็นต่างๆ ตลอดจนช่วยเหลือแก้ไขข้อบกพร่องต่างๆ เป็นอย่างดีมาโดยตลอด จนทำให้วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สำเร็จลุล่วงไปด้วยดี ผู้วิจัยใคร่ขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูง ในความกรุณาของท่านไว้ ณ ที่นี้

ขอกราบขอบพระคุณรองศาสตราจารย์ มัลลิกา นูนาค ในฐานะประธานกรรมการและคณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์ทุกท่าน ที่ได้กรุณาให้คำแนะนำอันเป็นประโยชน์ในการแก้ไขวิทยานิพนธ์ให้สมบูรณ์มากยิ่งขึ้น และขอกราบขอบพระคุณ ครู-อาจารย์ ทุกท่านที่ได้ประสิทธิ์ประสาทความรู้แก่ผู้วิจัยมาโดยตลอด

คุณค่าและความดีของวิทยานิพนธ์ฉบับนี้ ขอน้อมรำลึกและบูชาพระคุณของคุณพ่อ-คุณแม่ ที่ได้ส่งเสริมและสนับสนุนการเรียน และเป็นกำลังใจเสมอมาจนสำเร็จการศึกษา อีกทั้งขอขอบพระคุณพี่สาว น้องชาย รวมทั้งเพื่อนๆ ทุกคนที่เป็นกำลังใจให้แก่ผู้วิจัยมาตลอด

กมลทิพย์ ปรัชญชรินทร์

สถาบันวิทยบริการ
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

สารบัญ

	หน้า
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	จ
กิตติกรรมประกาศ	ฉ
สารบัญ	ช
สารบัญตาราง	ฅ
สารบัญรูป	ณ
บทที่ 1 บทนำ	1
1.1 ความเป็นมาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการวิจัย	3
1.3 ขอบตกลงเบื้องต้น	3
1.4 ขอบเขตของการวิจัย	4
1.5 สมมติฐานของการวิจัย	5
1.6 เกณฑ์การตัดสินใจ	6
1.7 คำจำกัดความที่ใช้ในการวิจัย	6
1.8 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ	6
บทที่ 2 ตัวสถิติทดสอบและคุณสมบัติของการแจกแจง	7
2.1 ตัวสถิติทดสอบที่ใช้ในการวิจัย	7
2.2 คุณสมบัติและลักษณะการแจกแจงของประชากรที่ศึกษา	13
บทที่ 3 วิธีดำเนินการวิจัย	19
3.1 แผนการทดลอง	19
3.2 วิธีดำเนินการทดลอง	21
3.3 ขั้นตอนการทำงานของโปรแกรม	30
บทที่ 4 ผลการวิจัย	33
4.1 ความน่าจะเป็นของความคลาดเคลื่อนประเภทที่ 1	34
4.2 อำนาจของการทดสอบ	52

สารบัญ (ต่อ)

	หน้า
บทที่ 5 สรุปผลการวิจัยและข้อเสนอแนะ	183
5.1 สรุปผลการวิจัย	183
5.2 ข้อเสนอแนะ	185
รายการอ้างอิง	190
ภาคผนวก	
ภาคผนวก ก	191
ภาคผนวก ข	207
ภาคผนวก ค	209
ประวัติผู้วิจัย	214

สถาบันวิทยบริการ
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

สารบัญตาราง (ต่อ)

ตารางที่		หน้า
4.43	แสดงค่าอำนาจการทดสอบ ภายใต้การแจกแจงแกมมา เมื่อกำหนดอัตราส่วนค่าเฉลี่ยแตกต่างกันเป็น (1:1:1.5) และ (1:1:1:1:1.5)	166
4.44	แสดงค่าอำนาจการทดสอบ ภายใต้การแจกแจงแกมมา เมื่อกำหนดอัตราส่วนค่าเฉลี่ยแตกต่างกันเป็น (1:2:1) และ (1:1:1:2:1)	167
4.45	แสดงค่าอำนาจการทดสอบ ภายใต้การแจกแจงลอกนอร์มอล เมื่อกำหนดอัตราส่วนค่าเฉลี่ยแตกต่างกันเป็น (1:1:1.5) และ (1:1:1:1:1.5)	174
4.46	แสดงค่าอำนาจการทดสอบ ภายใต้การแจกแจงลอกนอร์มอล เมื่อกำหนดอัตราส่วนค่าเฉลี่ยแตกต่างกันเป็น (1:2:1) และ (1:1:1:2:1)	175

สถาบันวิทยบริการ
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

สารบัญรูป

รูปที่	หน้า
2.1 แสดงฟังก์ชันความหนาแน่นของการแจกแจงแลมดาของตุกกีร์ ที่มีความเบ้เป็น 0 ความโด่งเท่ากับ 3,5,9	14
2.2 แสดงฟังก์ชันความหนาแน่นของการแจกแจงแลมดาของตุกกีร์ ที่มีความเบ้เป็น 1 ความโด่งเท่ากับ 4,6,9	15
2.3 แสดงฟังก์ชันความหนาแน่นของการแจกแจงแลมดาของตุกกีร์ ที่มีความเบ้เท่ากับ 0.0, 0.5, 1.0, ความโด่งเป็น 4	15
2.4 แสดงฟังก์ชันความหนาแน่นของการแจกแจงปกติมาตรฐาน	16
2.5 แสดงฟังก์ชันความหนาแน่นของการแจกแจงแกมมา	17
2.6 แสดงฟังก์ชันความหนาแน่นของการแจกแจงลอกนอนอร์มอล	18
3.1 แสดงโปรแกรมย่อยที่ใช้ในการผลิตเลขสุ่ม $U(0,1)$	22
3.2 แสดงโปรแกรมย่อยที่ใช้ในการผลิตตัวแปรสุ่มแบบแลมดาของตุกกีร์	23
3.3 แสดงโปรแกรมย่อยที่ใช้ในการผลิตตัวแปรสุ่มแบบปกติมาตรฐาน	25
3.4 แสดงโปรแกรมย่อยที่ใช้ในการผลิตตัวแปรสุ่มแบบแกมมา	27
3.5 แสดงโปรแกรมย่อยที่ใช้ในการผลิตตัวแปรสุ่มแบบลอกนอนอร์มอล	28
3.6 แสดงขั้นตอนทั่วไปในการคำนวณความน่าจะเป็นของความคลาดเคลื่อนประเภทที่ 1 และค่าอำนาจการทดสอบ	32
4.1 กราฟแสดงค่าอำนาจการทดสอบภายใต้การแจกแจงแลมดาของตุกกีร์ เมื่ออัตราส่วนค่าเฉลี่ยเป็น (1:1:1.5) $k=3$ $n=5$ ความโด่งต่ำ ที่ $\alpha=0.01$	69
4.2 กราฟแสดงค่าอำนาจการทดสอบภายใต้การแจกแจงแลมดาของตุกกีร์ เมื่ออัตราส่วนค่าเฉลี่ยเป็น (1:1:1.5) $k=3$ $n=5$ ความโด่งปานกลาง ที่ $\alpha=0.01$	69
4.3 กราฟแสดงค่าอำนาจการทดสอบภายใต้การแจกแจงแลมดาของตุกกีร์ เมื่ออัตราส่วนค่าเฉลี่ยเป็น (1:1:1.5) $k=3$ $n=5$ ความโด่งสูง ที่ $\alpha=0.01$	69
4.4 กราฟแสดงค่าอำนาจการทดสอบภายใต้การแจกแจงแลมดาของตุกกีร์ เมื่ออัตราส่วนค่าเฉลี่ยเป็น (1:1:1.5) $k=3$ $n=5$ ความโด่งต่ำ ที่ $\alpha=0.05$	70
4.5 กราฟแสดงค่าอำนาจการทดสอบภายใต้การแจกแจงแลมดาของตุกกีร์ เมื่ออัตราส่วนค่าเฉลี่ยเป็น (1:1:1.5) $k=3$ $n=5$ ความโด่งปานกลาง ที่ $\alpha=0.05$	70
4.6 กราฟแสดงค่าอำนาจการทดสอบภายใต้การแจกแจงแลมดาของตุกกีร์ เมื่ออัตราส่วนค่าเฉลี่ยเป็น (1:1:1.5) $k=3$ $n=5$ ความโด่งสูง ที่ $\alpha=0.05$	70

สารบัญรูป (ต่อ)

รูปที่	หน้า
4.245 กราฟแสดงค่าอำนาจการทดสอบภายใต้การแจกแจงลอกนอร์มอล เมื่ออัตราส่วนค่าเฉลี่ยเป็น (1:2:1) $k=3$ ที่ระดับนัยสำคัญ 0.05	178
4.246 กราฟแสดงค่าอำนาจการทดสอบภายใต้การแจกแจงลอกนอร์มอล เมื่ออัตราส่วนค่าเฉลี่ยแตกต่างกัน (1:2:1) $k=3$ ที่ระดับนัยสำคัญ 0.10	178
4.247 กราฟแสดงค่าอำนาจการทดสอบภายใต้การแจกแจงลอกนอร์มอล เมื่ออัตราส่วนค่าเฉลี่ยแตกต่างกัน (1:1:1:1:1.5) $k=5$ ที่ระดับนัยสำคัญ 0.01	179
4.248 กราฟแสดงค่าอำนาจการทดสอบภายใต้การแจกแจงลอกนอร์มอล เมื่ออัตราส่วนค่าเฉลี่ยแตกต่างกัน (1:1:1:1:1.5) $k=5$ ที่ระดับนัยสำคัญ 0.05	179
4.249 กราฟแสดงค่าอำนาจการทดสอบภายใต้การแจกแจงลอกนอร์มอล เมื่ออัตราส่วนค่าเฉลี่ยแตกต่างกัน (1:1:1:1:1.5) $k=5$ ที่ระดับนัยสำคัญ 0.10	179
4.250 กราฟแสดงค่าอำนาจการทดสอบภายใต้การแจกแจงลอกนอร์มอล เมื่ออัตราส่วนค่าเฉลี่ยแตกต่างกัน (1:1:1:2:1) $k=5$ ที่ระดับนัยสำคัญ 0.01	180
4.251 กราฟแสดงค่าอำนาจการทดสอบภายใต้การแจกแจงลอกนอร์มอล เมื่ออัตราส่วนค่าเฉลี่ยแตกต่างกัน (1:1:1:2:1) $k=5$ ที่ระดับนัยสำคัญ 0.05	180
4.252 กราฟแสดงค่าอำนาจการทดสอบภายใต้การแจกแจงลอกนอร์มอล เมื่ออัตราส่วนค่าเฉลี่ยแตกต่างกัน (1:1:1:2:1) $k=5$ ที่ระดับนัยสำคัญ 0.10	180