Biostatistik, WS 2017/18

Wilcoxons Rangsummen-Test

Matthias Birkner

http://www.staff.uni-mainz.de/birkner/Biostatistik1718/

22.12.2017

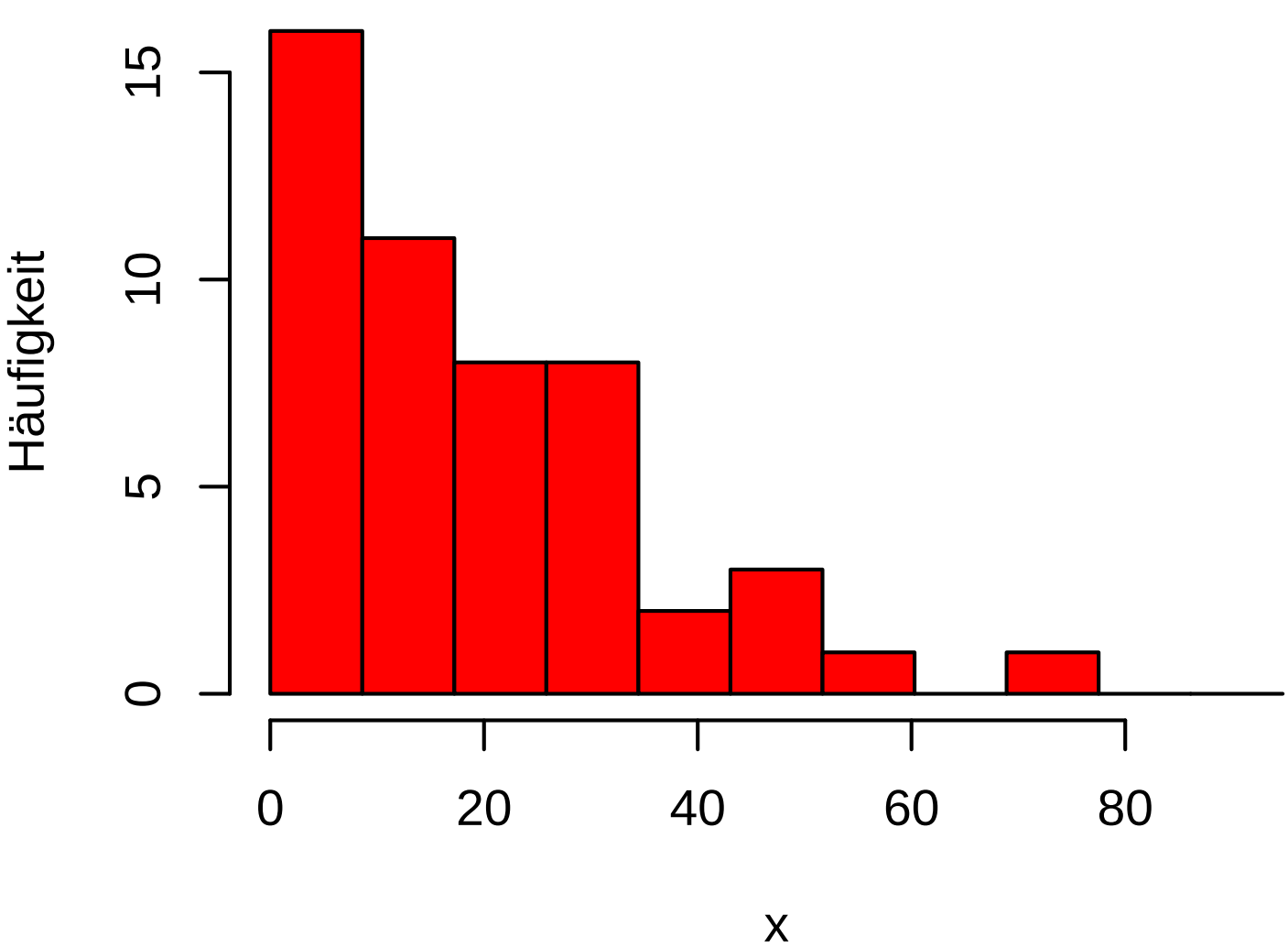
JOHANNES GUTENBERG UNIVERSITÄT MAINZ

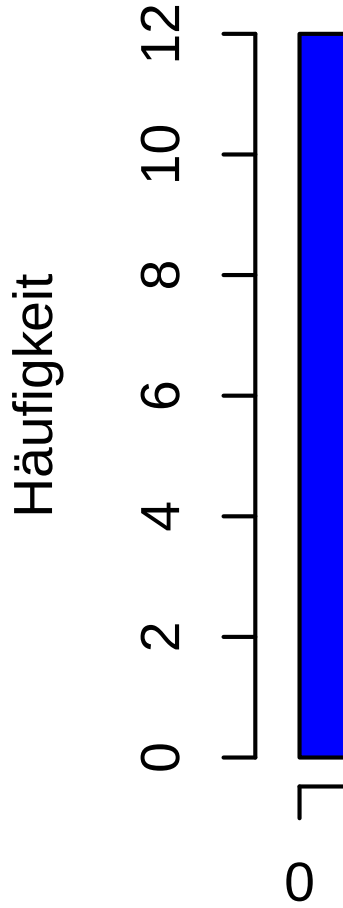
Bei (ungefähr) glockenförmigen und
symmetrisch verteilten Beobachtungen
oder wenn die Stichprobenumfänge genügend groß sind
können wir den t-Test benutzen,
um die Nullhypothese $\mu_1 = \mu_2$ zu testen:

Die t-Statistik ist (annährend) Student-verteilt.

Besonders bei sehr asymmetrischen und
langschwänzigen Verteilungen
kann das anders sein

Nehmen wir an, wir sollten folgende Verteilungen vergleichen:





Beispiele

- Wartezeiten
- Ausbreitungsentfernungen
- Zelltypenhäufigkeiten

Gesucht:

ein „verteilungsfreier“ Test,
mit dem man die Lage zweier Verteilungen
zueinander testen kann

Beobachtungen: Zwei Stichproben

$$X : x_1, x_2, \ldots, x_m$$

$$Y : y_1, y_2, \ldots, y_n$$

Wir möchten die Nullhypothese:
X und Y aus derselben Population
(X und Y haben diesselbe Verteilung)
testen

gegen die Alternative:
Die beiden Verteilungen sind gegeneinander verschoben.

Wir sind also in einer Situation, die wir schon beim t-Test getroffen haben: Die zwei Verteilungen sind möglicherweise gegeneinander verschoben (haben insbesondere möglicherweise unterschiedliche Mittelwerte), aber wir möchten *nicht* die implizite Annahme treffen, dass es sich dabei (wenigstens ungefähr) um Normalverteilungen handelt.

Idee

Beobachtungen:

$$X : x_1, x_2, \ldots, x_m$$

$$Y : y_1, y_2, \ldots, y_n$$

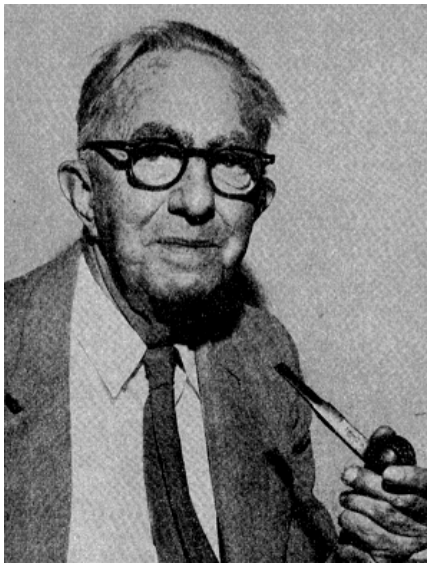
- Sortiere alle Beobachtungen der Größe nach.
- Bestimme die Ränge der m X-Werte unter allen $m + n$ Beobachtungen.
- Wenn die Nullhypothese zutrifft, sind die m X-Ränge eine rein zufällige Wahl aus $\{1, 2, \ldots, m + n\}$.
- Berechne die Summe der X-Ränge, prüfe, ob dieser Wert untypisch groß oder klein.

Wilcoxons Rangsummenstatistik

Beobachtungen:

$X : x_1, x_2, \ldots, x_m$

$Y : y_1, y_2, \ldots, y_n$



Frank Wilcoxon,
1892–1965

$$U = \text{Summe der } X\text{-Ränge} - (1 + 2 + \cdots + m)$$

heißt

Wilcoxons Rangsummenstatistik

(Der minimal mögliche Wert ist 0, der maximal mögliche Wert ist $m \cdot n$.)

Wilcoxons Rangsummenstatistik

Bemerkung:

$$U = \text{Summe der } X\text{-Ränge} - (1 + 2 + \cdots + m)$$

Wir könnten auch die Summe der Y-Ränge benutzen, denn

$$\begin{aligned} &\text{Summe der } X\text{-Ränge} + \text{Summe der } Y\text{-Ränge} \\ = \;& \text{Summe aller Ränge} \\ = \;& 1 + 2 + \cdots + (m+n) = \frac{(m+n)(m+n+1)}{2} \end{aligned}$$

Bemerkung

Der Wilcoxon-Test heißt auch Mann-Whitney-Test.

In der Literatur sind verschiedene Zentrierungen der Rangsumme gebräuchlich, ggfs. prüfen, bevor Sie eine Formel aus einem Buch verwenden.

Ein kleines Beispiel

- Beobachtungen:

$$X : 1{,}5;\ 5{,}6;\ 35{,}2$$
$$Y : 7{,}9;\ 38{,}1;\ 41{,}0;\ 56{,}7;\ 112{,}1;\ 197{,}4;\ 381{,}8$$

- Lege Beobachtungen zusammen und sortiere:
  $1{,}5;\ 5{,}6;\ 7{,}9;\ 35{,}2;\ 38{,}1;\ 41{,}0;\ 56{,}7;\ 112{,}1;\ 197{,}4;\ 381{,}8$
- Bestimme Ränge:
  $1,\ 2,\ 3,\ 4,\ 5,\ 6,\ 7,\ 8,\ 9,\ 10$
- Rangsumme: $U = 1 + 2 + 4 - (1 + 2 + 3) = 1$

Interpretation von U

X-Population kleiner $\Longrightarrow$ U klein:

1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10 $U = 0$

1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10 $U = 1$

1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10 $U = 2$

1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10 $U = 2$

X-Population größer $\Longrightarrow$ U groß:

1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10 $U = 21$

1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10 $U = 20$

1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10 $U = 20$

1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10 $U = 19$

Signifikanz

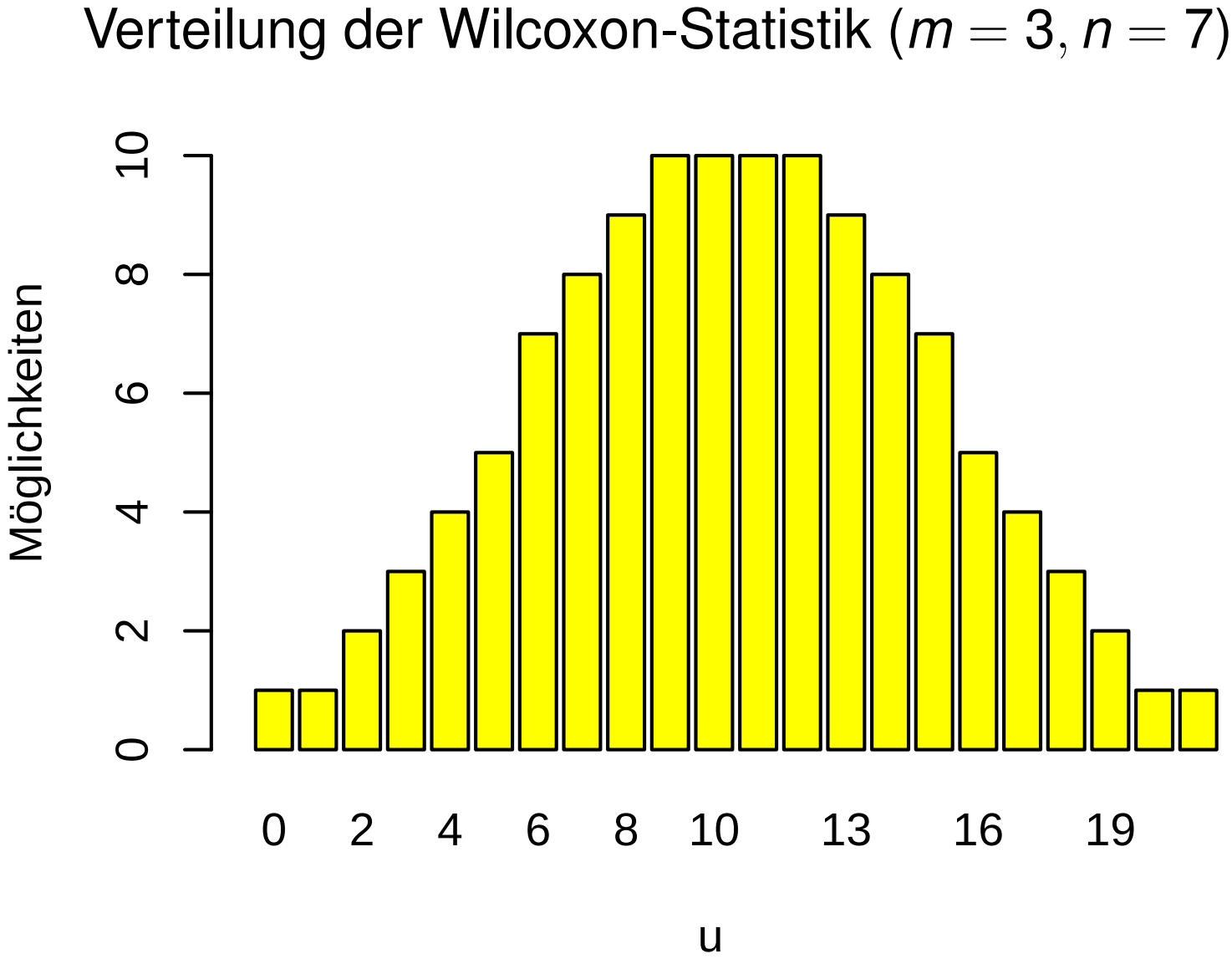
Nullhypothese:
X-Stichprobe und Y-Stichprobe
stammen aus
derselben Verteilung

Die 3 Ränge der X-Stichprobe
1 2 3 4 5 6 7 8 9 10

hätten genausogut irgendwelche 3 Ränge
1 2 3 4 5 6 7 8 9 10
sein können.

Es gibt $\frac{10 \cdot 9 \cdot 8}{3 \cdot 2 \cdot 1} = 120$ Möglichkeiten.

(Allgemein: $\frac{(m+n)(m+n-1)\cdots(n+1)}{m(m-1)\cdots 1}) = \frac{(m+n)!}{n!m!} = \binom{m+n}{m}$ Möglichkeiten)

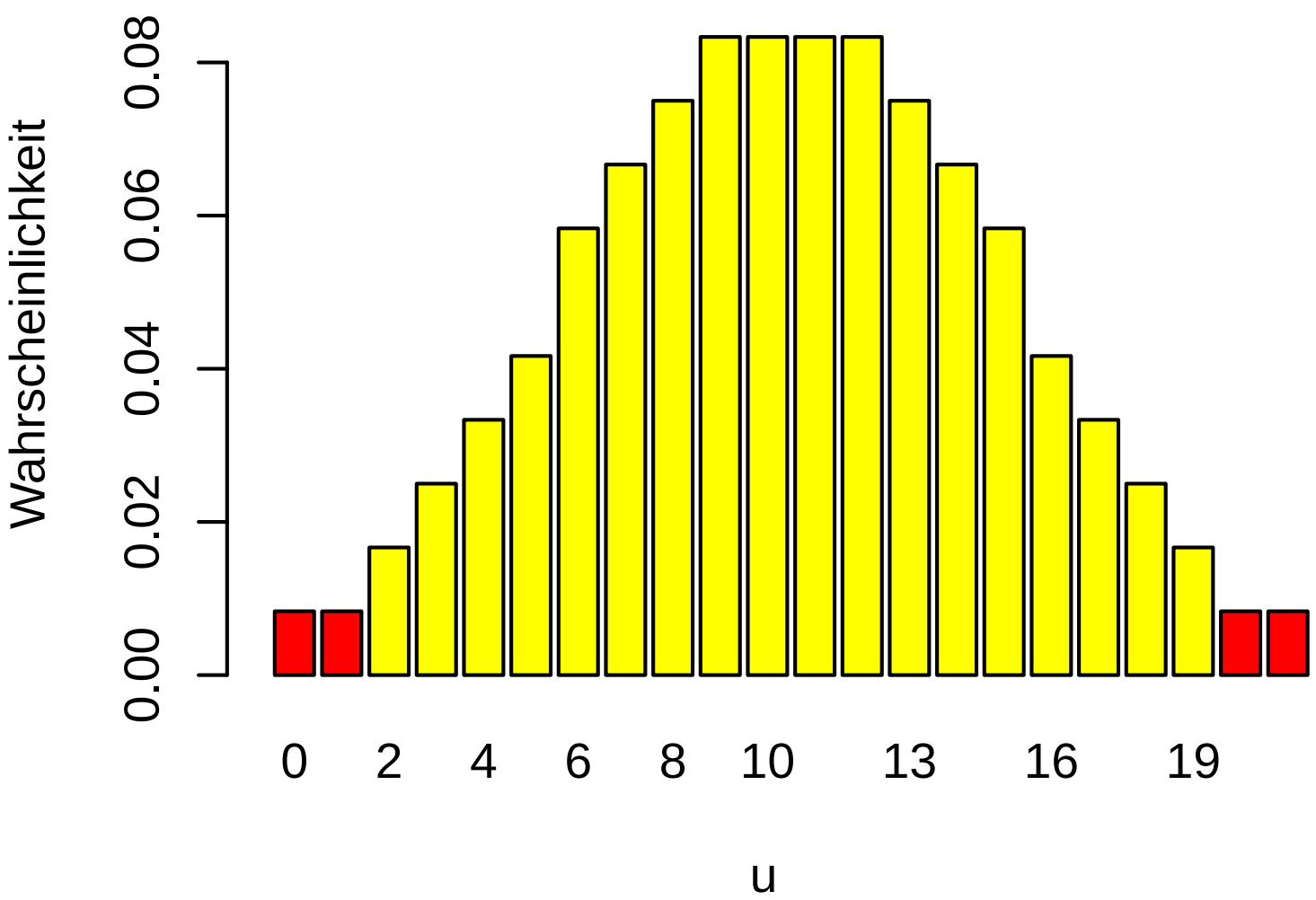

Verteilung der Wilcoxon-Statistik ($m = 3, n = 7$)
Möglichkeiten
0
2
4
6
8
10
0
2
4
6
8
10
13
16
19
u

Unter der Nullhypothese sind alle Rangbelegungen gleich wahrscheinlich, also

$$\mathbb{P}(U = u) = \frac{\text{Anz. Möglichkeiten mit Rangsummenstatistik } u}{120}$$

Wir beobachten in unserem Beispiel:
1,5, 5,6; 7,9; 35,2; 38,1; 41,0; 56,7; 112,1; 197,4; 381,8
somit $U = 1$

$$\mathbb{P}(U \leq 1) + \mathbb{P}(U \geq 20)$$
$$= \mathbb{P}(U = 0) + \mathbb{P}(U = 1) + \mathbb{P}(U = 20) + \mathbb{P}(U = 21)$$
$$= \tfrac{1+1+1+1}{120} \doteq 0{,}033$$


Verteilung der Wilcoxon-Statistik ($m = 3, n = 7$)
Wahrscheinlichkeit
0.00
0.02
0.04
0.06
0.08
0
2
4
6
8
10
13
16
19
u

Für unser Beispiel ($U = 1$) also:

$$p\text{-Wert} = \mathbb{P}(\text{ein so extremes } U) = 4/120 = 0{,}033$$

Wir lehnen die Nullhypothese,
dass die Verteilungen
von X und Y
identisch sind,
auf dem 5%-Niveau ab.

R kennt den Wilcoxon-Test mittels `wilcox.test`:

```
> x <- c(1.5,  5.6, 35.2)
> y <- c(7.9,  38.1,  41.0,  56.7, 112.1, 197.4, 381.8)

> wilcox.test(x,y)

Wilcoxon rank sum test

data:  x and y
W = 1, p-value = 0.03333
alternative hypothesis: true location shift is
not equal to 0
```

Wilcoxon-Test: allgemeine Theorie

Gegeben zwei Stichproben $x_1, x_2, \ldots, x_m$ (m x-Werte) und $y_1, \ldots, y_n$ (n y-Werte)

bilde (normierte) Rangsumme

$$U = \text{Summe aller } x\text{-Ränge} - (1 + 2 + \cdots + m)$$
$$= \sum_{i=1}^{m} \#\{j \leq n : x_i > y_j\} =: \sum_{i=1}^{m} U_i$$

(mit möglichen Werten in $0, 1, \ldots, m \cdot n$).

Unter H_0 : die x-Werte und die y-Werte sind unabhängige Stichproben aus derselben Verteilung

hängt die Verteilung von U nicht von der tatsächlichen Verteilung ab.

(Strenggenommen: Sofern die Verteilung „stetig“ ist, also kein Wert mehrmals vorkommen kann)

Wilcoxon-Test: allgemeine Theorie, 2

normierte Rangsumme $U = U_{m,n} = \sum_{i=1}^{m} \#\{j \leq n : x_i > y_j\}$

H_0 : x-Werte und y-Werte stammen aus derselben Verteilung

Die Verteilung von $U_{m,n}$ unter H_0 ist (prinzipiell) ein rein kombinatorisches Problem:

$$\mathbb{P}_{H_0}(U_{m,n} = u) = \frac{\#\begin{pmatrix}\text{Zuordnungen von } m \text{ Rängen an } x\text{-Werte,} \\ \text{die Rangsumme } u \text{ ergeben}\end{pmatrix}}{\binom{m+n}{m}}$$

Für sehr kleine Stichproben kann man dies durch Auszählen bestimmen (wie vorhin), für größere Stichproben verwendet man eine Rekursionsformel (in R implementiert) oder eine Normalapproximation.

Wilcoxon-Test: allgemeine Theorie, 3

$$\mathbb{P}_{H_0}(U_{m,n} = u) = \frac{\#\begin{pmatrix}\text{Zuordnungen von } m \text{ Rängen an } x\text{-Werte,} \\ \text{die Rangsumme } u \text{ ergeben}\end{pmatrix}}{\binom{m+n}{m}}$$

(in `R`: `dwilcox(u,m,n)`, z.B. `dwilcox(1,3,7)=0.00833`, `R` kennt auch die Verteilungsfunktion `pwilcox` und die Quantilfunktion `qwilcox`.)

Quantile $u_{m,n,\alpha}$ mit

$$\mathbb{P}_{H_0}(U_{m,n} \leq u_{m,n,\alpha}) = \alpha$$

für $\alpha \in (0, 1)$ findet man in Tabellen

(oder mit `R`: `qwilcox(`α`,m,n)`)

Zweiseitiger Wilcoxon-Rangsummen-Test

Gegeben m x-Werte $x_1, \ldots, x_m$, n y-Werte $y_1, \ldots, y_m$, Signifikanzniveau $\alpha \in (0, 1)$.

Bestimme (normierte) Rangsumme $U = \sum_{i=1}^{m} \#\{j \leq n : x_i > y_j\}$, $u_{m,n,1-\alpha/2}$ mit $\mathbb{P}_{H_0}(U_{m,n} \leq u_{m,n,1-\alpha/2}) = 1 - \alpha/2$ (aus Tabelle oder mit R)

Lehne H_0: die x-Werte und die y-Werte sind unabhängige Stichproben aus derselben Verteilung

ab zugunsten von

H_1: die Verteilung der x-Werte ist verschoben im Vergleich zu der der y-Werte

ab, falls

$$U > u_{m,n,1-\alpha/2} \quad \text{oder} \quad U < m \cdot n - u_{m,n,1-\alpha/2}$$

Einseitiger Wilcoxon-Rangsummen-Test

Gegeben m x-Werte $x_1, \ldots, x_m$, n y-Werte $y_1, \ldots, y_m$, Signifikanzniveau $\alpha \in (0, 1)$.

Bestimme (normierte) Rangsumme $U = \sum_{i=1}^{m} \#\{j \leq n : x_i > y_j\}$,

$u_{m,n,1-\alpha}$ mit $\mathbb{P}_{H_0}(U_{m,n} \leq u_{m,n,1-\alpha}) = 1 - \alpha$ (aus Tabelle oder mit R)

Lehne H_0 ab zugunsten von

H_1: die Verteilung der x-Werte hat mehr Gewicht auf größen Werten im Vergleich zu der der y-Werte

ab, falls

$$U > u_{m,n,1-\alpha}$$

(analog für H_1 : „Verteilung der x-Werte nach links verschoben im Vgl. zu y-Werten“, falls $U < m \cdot n - u_{m,n,1-\alpha}$, oder vertausche Rollen von x und y.)

Wilcoxon-Test: Normalapproximation

Unter H_0 : x-Werte und y-Werte stammen aus derselben Verteilung

ist

$$\frac{U_{m,n} - \frac{m \cdot n}{2}}{\sqrt{\frac{mn(m+n+1)}{12}}} \approx \text{Standard-normalverteilt}$$

Damit lautet der (approximative) zweiseitige Test zum Signifikanzniveau α bei beobachter Rangsumme U:

$$\text{lehne } H_0 \text{ ab, wenn } \left| U - \frac{m \cdot n}{2} \right| > z_{1-\alpha/2} \sqrt{\frac{mn(m+n+1)}{12}}$$

wobei $z_{1-\alpha/2} = (1-\alpha/2)$-Quantil der Standard-Normalverteilung

Analog einseitig (H_1 = „Verteilung der x-Werte nach rechts verschoben im Vgl. zu y-Werten“):

Lehne H_0 ab, falls $U > \frac{m \cdot n}{2} + z_{1-\alpha} \sqrt{\frac{mn(m+n+1)}{12}}$.

Wilcoxon-Test, Fall mit Bindungen

Bei diskreten Verteilungen (und in der Praxis!) kann es vorkommen, dass einzelne Werte in den Daten x_i und y_j mehrfach vorkommen. Dies nennt man Bindungen. In diesem Fall wird der Rang von x_i in den $y_1, \ldots, y_n$ berechnet als

$$U_i = \text{Anzahl der } j \text{ mit } y_j < x_i + \frac{1}{2}\text{Anzahl der } j \text{ mit } y_j = x_i$$

und die Rangsumme als

$$U = \sum_{i=1}^{m} U_i.$$

In diesem Fall hält der Wilcoxon-Test das geforderte Niveau nicht exakt ein, meistens aber doch recht gut. `R` gibt dann eine Warnmeldung.

Beachte:

Wenn der Wilcoxon-Test Signifikanz anzeigt,
so kann das daran liegen, dass die zugrunde
liegenden Verteilungen verschiedene Formen haben.

Der Wilcoxon-Test kann beispielsweise Signifikanz anzeigen,
selbst wenn die Stichproben-Mittelwerte übereinstimmen!

Vergleich von *t*-Test und Wilcoxon-Test

Beachte:

Sowohl der *t*-Test als auch
der Wilcoxon-Test können verwendet werden,
um eine vermutete Verschiebung der Verteilung zu stützen.

Der *t*-Test testet „nur“ auf Gleichheit der Erwartungswerte.
Der Wilcoxon-Test dagegen testet auf Gleichheit
der gesamten Verteilungen.

In den meisten Fällen liefern beide Tests dasselbe Ergebnis.
Im Allgemeinen empfehlen wir den *t*-Test, da er robuster ist.

In besonderen Fällen

- Verteilungen sind asymmetrisch
- Stichprobenlänge ist klein

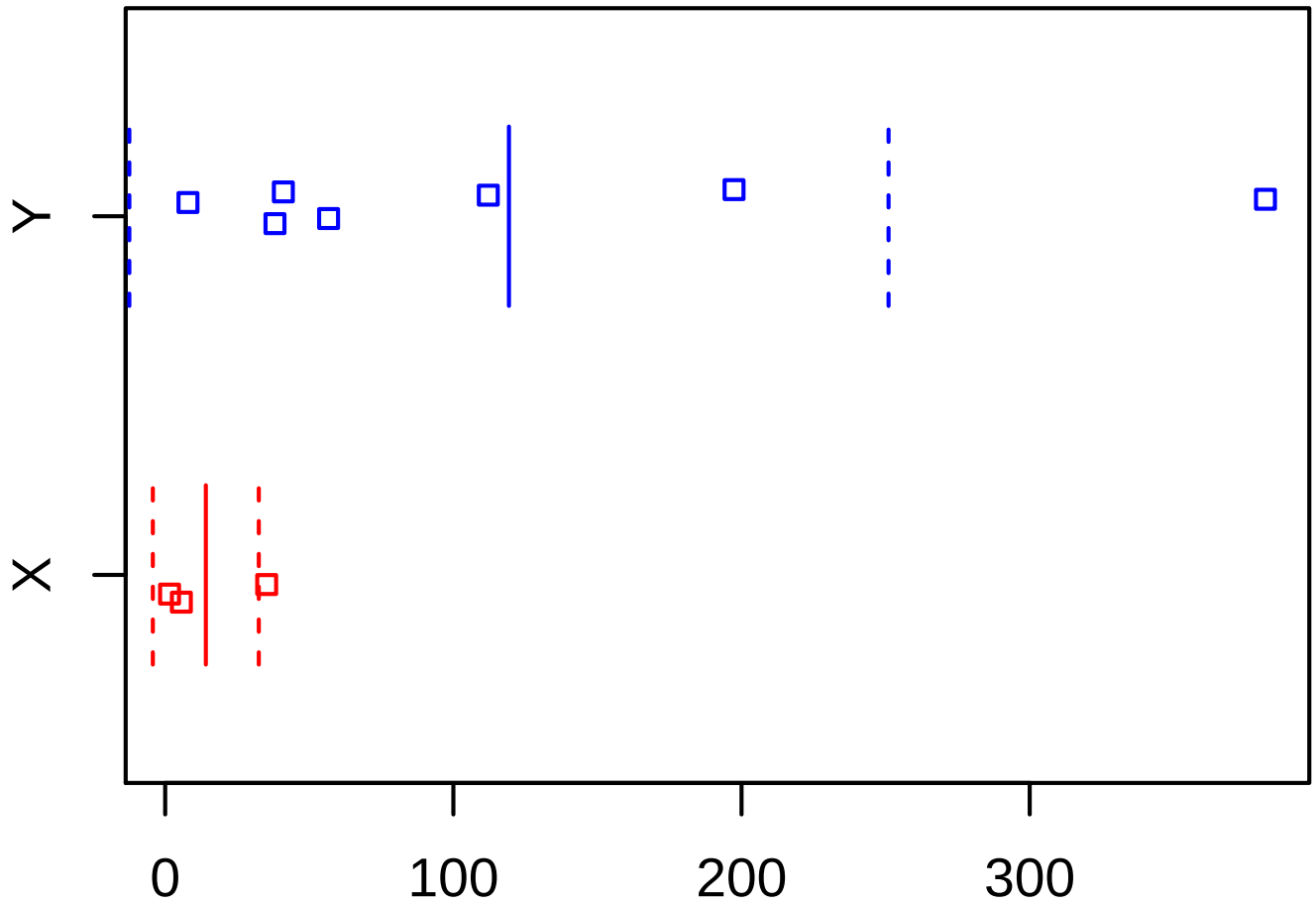
hat der Wilcoxon-Test eine höhere Testpower.

Vergleichen wir (spaßeshalber) mit dem *t*-Test:

```
> x
[1]  1.5  5.6 35.2
> y
[1]   7.9  38.1  41.0  56.7 112.1 197.4 381.8
> t.test(x,y)

Welch Two Sample t-test

data:  x and y
t = -2.0662, df = 6.518, p-value = 0.08061
alternative hypothesis: true difference in means is not e
95 percent confidence interval:
 -227.39182   17.02039
sample estimates:
mean of x mean of y
  14.1000  119.2857
```


Y
X
0
100
200
300