

8. Kalibrierung und Validierung

Erinnerung an Abschn.1

- Modelle erstellt,
 - um Experimente mit realen (Objekt-) Systemen zu vermeiden
 - um Aussagen über (potentielle) Objekt-Systeme zu erhalten, die (noch) nicht existieren
 - um **Vorhersagen** machen zu können
- Folgerungen aus Modellanalysen (hier: Simulations-Experimenten) sollten (da als relevant für Realität verwendet) weitestgehend gleich sein zu Folgerungen, die aus entsprechenden (potentiell, irgendwann möglichen) Objekt-Analysen / Objekt-Experimenten gewonnen
- Gleiche Beurteilungs-, Folgerungs- Schemata vorausgesetzt, sind Folgerungen (zumindest) dann identisch, wenn unmittelbare Resultate / Beobachtungen von Simulations- und Objekt- Experimenten identisch

Identität Resultate zu erwarten ??

Sicher nicht immer, nicht allgemein, nicht in jedem Detail !!

Objekt- und Modell-System nicht identisch, Verhaltensunterschiede zu erwarten

Simulation be/ja/2(2) Kalibrierung/Validierung 8 - 3

Uneinheitliche Terminologie, hier strikt unterschieden:

- **Verifikation:**
Bestätigung aller Modell-Eingangsgrößen / -Annahmen incl. struktureller Annahmen, ... , Programmverifikation, Parameterwerten
- **Validierung:**
Bestätigung der Modell-Resultate

(zu feineren Unterscheidungen vgl. LaKe91, KnAr93 incl. "confidence assessment methodology")

Sicher (hoffentlich) größte Mühe gelegt auf "gute" Wahl Eingangsgrößen (Hypothesen,...,Parameter)

"Hoffnung" auf gültiges Modell damit zweifellos steigend, "Garantie" für gültiges Modell aber nicht gegeben ("positivistischer" Blick sogar: Ergebnisse ok, alles ok)

Wenn Verhaltensunterschiede Modell / Realität entdeckt, Versuch natürlich (und legitim), Modell zu ändern, um Verhaltensunterschiede (Hoffnung:) zu beseitigen, zu reduzieren:

Reduktion "Verhaltensunterschiede" ist Reduktion eines $D(V_R, V_S)$

Vorgang "ausgelöst von (zu) großem D Modell ändern mit Ziel D-Reduktion" heißt **Kalibrierung**

Simulation Kalibrierung/Validierung

vernünftige Definition von **Realitätstreue Gültigkeit validity**

- müßte aufbauen auf Maß Verhaltensunterschiede $D(V_R, V_S)$ R: real, S: simuliert
- müßte Realitätstreue bejahen, falls Abweichungsmaß unter bestimmtem, festzulegendem, (problemabhängigem, Fragestellung-abhängigem) Grenzwert liegt
- müßte Grenzwert so festlegen, daß (unvermeidlich existierende) Verhaltensunterschiede die zu treffenden Folgerungen nicht beeinträchtigen (nicht zu unterschiedlichen Folgerungen führen)

Ursachen für Verhaltensunterschiede:

- strukturelle Unterschiede
 - Abstraktion, Aggregation (beabsichtigt!)
 - Ungenauigkeiten (bugs), Fehler (faults) (unbeabsichtigt!)
- Parameterwerte
 - deterministische Werte + Abhängigkeiten
 - Verteilungsfunktionen
 - ...

Simulation be/ja/2(5) Kalibrierung/Validierung 8 - 4

Kalibrierung schließt also (zwangsläufig) ein:

- Identifikation Ursachen Verhaltensunterschiede
- entsprechende, gezielte Änderungen Modell
 - Struktur: "Code"-Änderung
 - Parameter / statische Attribute: "Werte"-Änderung

Bei stochastischen Modellen resultieren zwei spezifische statistische Problem-Typen:

- Auswahl eines aus mehreren alternativen Modellen (S_1, S_2, \dots, S_k) auf Basis zugehöriger $(D(V_R, V_{S_i}); i=1, 2, \dots, k)$ wo D (wie gewohnt) Zufallsvariable oder gar stochastischer Prozeß und Unterschiede der D's müssen (folglich) "das normale Maß der Schwankung" übersteigen, Unterschiede müssen **signifikant** sein

Aufgabe: **Tests auf Signifikanz**

- "tuning" durch Parameter(wert)veränderungen, Suche nach Parametervektor p_{opt} derart, daß

$$\min_p D(V_R, V_S(p))$$

erreicht

Aufgabe: **stochastische Optimierung**

Simulation Kalibrierung/Validierung

Methodisch gesehen, ist
 - Kalibrieren stochastischen Simulators

identisches Problem wie
 - Experimentieren mit stochastischem Simulator
 (bzw.: stochastischem System)

Für gegebenes Realsystem mit Verhaltensgüte V_R
 wird (über Experimente) versucht,
 System mit Verhaltensgüte V_E zu finden derart, daß

$$D^*(V_R, V_E)$$

maximal (Veränderung hin zu "bester" Alternative);
 als Möglichkeiten dafür erneut
 - Ausprobieren struktureller Alternativen
 - tuning von System-Parametern

Bei Suche nach Methoden, Hilfsmitteln für Kalibrieren,
 sollte man demnach fündig werden
 bei Methoden, Hilfsmitteln des
 qualitativen und quantitativen Experimentierens
 mit stochastischen Systemen / Modellen

Zunächst aber:
 weitere prinzipielle Klärung "Kalibrieren"

- angenommen, mittels Kalibrierung sei unmittelbares Ziel erreicht:
 D ist unter (erträgliches) D_{err} gesunken
- ist damit auch inhaltliches Ziel erreicht:
 Folgerungen aus Objekt- und Modell-Experimenten sind gleich

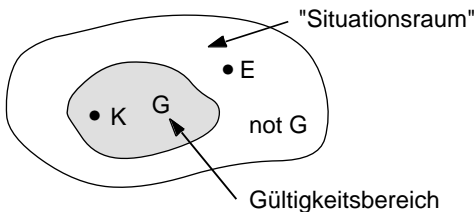
??

Simulation
 be/ja/2

Kalibrierung/Validierung
 8 - 7

- wenn Verhaltensunterschiede existieren, dann ("höchstwahrscheinlich") unterschiedlich, je nach Situation
- zu erwarten
 - Bereich mit hinreichend kleinen Unterschieden **Gültigkeitsbereich G**
 - Bereich mit zu großen Unterschieden **Bereich not G**

Prinzipiskizze:



und Frage damit:

gilt für (Experiment-Situation) E, daß
 $\begin{matrix} E & G \\ \text{oder} & \text{not G} \end{matrix}$??

nur beantwortbar (prinzipiell!), falls
 - von Verhaltensunterschieden für gewisse Situation(en)
 - auf Verhaltensunterschieden für andere Situation(en)
 geschlossen werden könnte

also sicher **nicht allgemein beantwortbar**

Simulation

Kalibrierung/Validierung

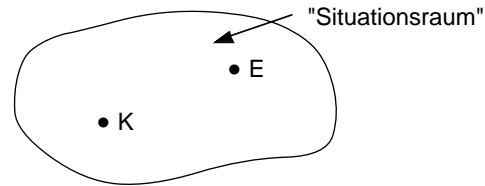
Was, genau, wurde getan?

Simulator-Verhalten wurde (mittels Änderungen)
 einem Objektsystem-Verhalten "hinreichend" angepaßt
 für **einen** Zustand der Umwelt (Last)
 für **einen** Zustand des Systems (Konfiguration,
 Systemparameter)

d.h. für **eine Situation**

Als "Zweck" des Simulators letztlich angepeilt:
 Experimentieren / Analysieren für **andere** Situationen;
 über **diese** (beim Kalibrierungsvorgang eingesetzte)
 Situation besteht ja Klarheit !

Prinzipiskizze:



und Frage damit:

ist Unterschied D bei E ("eigentlich" interessierend)
 wie Unterschied D bei K (kraft Kalibrierung gesichert)

??

u.U. sehr fraglich

Simulation
 be/ja/2

Kalibrierung/Validierung
 8 - 8

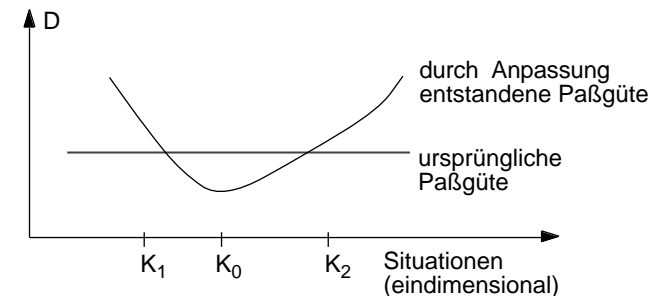
Und damit (leider !) häufig
 Übergang notwendig
 von "Beweis der Gültigkeit"
 nach "Zuversicht in Gültigkeit"
 bei jedem "vorhersagenden Modellieren" (LaKe91, KnAr93)

Schlimmer noch:
 Kalibrierungsvorgang kann durchaus Problem

Experimentsituation(en) gültig wiedergegeben ?

durch "Überanpassung" an spezielle Kalibriersituation
 verschärfen

Prinzipiskizze:



Reduktion der Gefahr einer Überanpassung
 durch Verwendung mehrerer
 Kalibriersituationen (Systemversion, Umweltversion)
 zu erwarten

Dennoch sollte (formaler) gezeigt werden,
 daß Kalibrierung nicht zu Überanpassung geführt hat

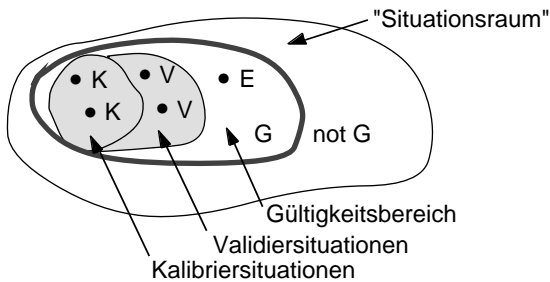
Simulation

Kalibrierung/Validierung

Wie ??

- Spezielle (unabhängige) **Validierungsläufe** für Situationen, die nicht zu Kalibrierung benutzt;
- Prüfung, ob Verhaltensunterschiede für diese (Validier-)Situationen "so etwa" wie für bekannte (Kalibrier-)Situationen

Prinzipskizze:



Allerdings:

Ob eine Experiment-Situation E im (unbekannten) Gültigkeitsbereich G liegt oder nicht ist nach wie vor unbeweisbar (in irgendeinem strengen Sinn) (bzw. nur retrospektiv beweisbar - dann aber "uninteressant" für "Vorhersagen")

Dennoch:

"Vertrauen" wächst durch erfolgreiche Validierungen (auch durch erfolgreiche retrospektive Validierungen)

Unterschiede auch

bzgl. "Interpolation / Extrapolation" von E-Gültigkeit; Vorsicht bei Extrapolation "weit weg" von K-/V-Bereichen !

Simulation

be/ja/2(4)

Kalibrierung/Validierung

8 - 11

(a) zielt auf Festlegung "erwünschtes Simulatorverhalten"

- Verhalten eines realen Objekt-Systems wäre ideale Basis

Idee realisierbar, falls

- System existiert und beobachtbar / meßbar ist
- Beobachtungen seines Verhaltens bei verschiedenen Umgebungssituationen, verschiedenen Struktursituationen (System-Versionen) angestellt werden können

Dann Vorgehen:

Man betreibe Realsystem und Modell (in verschiedenen, jeweils entsprechenden Versionen) in identischer Umgebung ("Last") (in verschiedenen, jeweils entsprechenden Umgebungen) und vergleiche Verhalten

Da "Betreiben und Beobachten Realsystem in verschiedenen Versionen / in verschiedenen Umgebungen"

(zu) aufwendig (bis: undenkbar) sein kann, ist Verfügbarkeit von ("historischen") Aufzeichnungen für versch. Versionen/Umgeb'gen erwünschte "Fundgrube"

In diesem Kontext liefert "trace-driven simulation"

(Betreiben mit konkret aufgezeichneter, nicht stochastisch modellierter Last)

gute Vergleichsbasis (z.B. Bankschalter: Liste Ankunftszeiten, Aufträge)

Simulation

Kalibrierung/Validierung

8.1 Zur Messung von Verhaltensunterschieden

Bestimmung des Ausmaßes von Verhaltensunterschieden Objekt / Modell war wesentlich bei

- **Kalibrierung:** Realitätstreue Modell zu verbessern durch Reduktion v. Verhaltensunterschieden
- **Validierung:** Realitätstreue Modell zu bestätigen durch Überprüfung v. Verhaltensunterschieden in (von Kalibrierung) unabh. Situationen

Kalibrierung und Validierung soll / muß Vertrauen in hinreichende Realitätstreue unterstützen, denn Modell erstellt für

- **Experimentieren:** System "güte" zu erhöhen durch Vergrößerung Verhaltensunterschiede "jetzt" -> "später", bzw. Plan 0 -> Plan 1 -> ...

Bei Durchführung "Messen Verhaltensunterschiede" auftretende Fragen:

- mit Verhalten welchen Systems soll Verhalten Simulator verglichen werden ?
- welche Verhaltens- Aspekte / -Beschreibungen sollen für Vergleich gewählt werden ?
- welche Vergleichs- Methoden / -Techniken sollen eingesetzt werden ?

Simulation

be/ja/2(6)

Kalibrierung/Validierung

8 - 12

Im Hinblick auf "retrospektive" (historische) Validierung: Nicht alle (Aufzeichnungen über) verfügbaren Situationen für Kalibrierung "aufbrauchen" !

- Verhalten analytischer Modelle ist Widerspruch ? (Simulation nur wenn's gar nicht anders geht !)

nicht notwendig: analytisches Modell stellt "Marginal"-Situation dar, für die analytisches Modell "lösbar", gleiche Situation sollte aber auch von Simulator behandelbar sein

- weitere Möglichkeiten deutlich "unterentwickelt", sehr informell: "Turing's Test", "Delphi-Verfahren", "face validity" benutzen Expertenmeinung (Befragung Experten aber sicherlich sehr sinnvoll: Zuversicht / Vertrauen !)

(b) Verhaltens -Aspekte / -Beschreibungen

Ziel ist, System auf Basis bestimmten (bewußt gewählten) Leistungskriteriums zu beurteilen, zu verbessern

Daher offensichtlich Realitätstreue hinsichtlich dieses Leistungskriteriums (+ zugeordneten Maßes) am wesentlichsten

Demnach ratsam: Einsatz dieses entscheidenden Leistungsmaßes auch für Kalibrierung / Validierung ("andere" nur zur Unterstützung)

Simulation

Kalibrierung/Validierung

(c) Vergleichs -Methoden / -Techniken

Fallunterscheidung

- reales Objektsystem / Simulator
 Problemtyp: Vergleich zweier Stichproben
 Entscheidung, ob zwei Stichproben
 "hinreichend ähnlich / unähnlich"

zunächst sicher:
 Vergleich einfacher Charakteristika
 der Verteilungen (z.B. Mittelwerte),

weiterhin: Vergleich anderer Charakteristika
 (immer auf Basis von Schätzern)
 denkbar, möglich

- analytisches Modell / Simulator
 Problemtyp: Vergleich analytische Verteilung
 mit einer Stichprobe
 Entscheidung, ob Stichprobe
 "hinreichend ähnlich / unähnlich"

wir kennen dazu bereits (Abschn. 5.3):
 χ^2 -Test,
 K-S-Test

Im Folgenden also:
 Vergleich Stichproben

Simulation

be/ja/2(6)

Kalibrierung/Validierung

8 - 15

Test-Algorithmus

Schätze durch

$$\mu_R \quad \tilde{\mu}_R = \frac{1}{n} \sum_i V_{Ri}$$

$$\mu_S \quad \tilde{\mu}_S = \frac{1}{n} \sum_i V_{Si}$$

$$\sigma_R^2 \quad \tilde{\sigma}_R^2 = \frac{1}{n-1} \left(\sum_i V_{Ri}^2 - n \tilde{\mu}_R^2 \right)$$

$$\sigma_S^2 \quad \tilde{\sigma}_S^2 = \frac{1}{n-1} \left(\sum_i V_{Si}^2 - n \tilde{\mu}_S^2 \right)$$

$$\sigma^2 \quad \tilde{\sigma}^2 = \frac{1}{2} \left(\tilde{\sigma}_R^2 + \tilde{\sigma}_S^2 \right)$$

Bei zutreffenden Annahmen und zutreffender Hypothese ist

$$D := \tilde{\mu}_R - \tilde{\mu}_S$$

normalverteilt mit
 Erwartungswert 0
 Varianz $(\sigma_R^2 + \sigma_S^2)/n = 2 \sigma^2/n$

und ist (demnach)

$$D/\sqrt{2 \sigma^2/n}$$

N(0,1)-verteilt

sowie (Resultat aus der Statistik):

$$T := D/\sqrt{2 \tilde{\sigma}^2/n}$$

t-verteilt mit 2n-2 Freiheitsgraden

Simulation

Kalibrierung/Validierung

8.2 Der zwei-Stichproben-t-Test

(zur Prüfung der Gleichheit

zweier Stichprobenmittelwerte)

Viel verwendeter Test
 (oft ohne die Voraussetzungen einzuhalten !)

Sei "Verhalten" beschrieben durch Zufallsvariable V
 (z.B. Verweilzeit Kunden im Bankschalter-System,
 in dessen stationärer Phase)

Mögen vorliegen zwei Stichproben

$$\underline{v}_R := (v_{R1}, v_{R2}, \dots, v_{Rn})$$

$$\underline{v}_S := (v_{S1}, v_{S2}, \dots, v_{Sn})$$

(z.B. "R" aus Beobachtung Realsystem, "S" aus Simulator)

Annahmen

- \underline{v}_R und \underline{v}_S sind unabhängige Stichproben
 und wechselseitig unabhängig
 (alle Stichprobenvariablen V_{Ri} identisch unabh. verteilt,
 alle Stichprobenvariablen V_{Si} identisch unabh. verteilt,
 paarweise Unabhängigkeit aller V_{Ri}, V_{Si})
- beide Stichproben sind normalverteilt,
 mit identischer Streuung $\sigma_R = \sigma_S (= \sigma)$

Test-Hypothese

Stichproben besitzen identische Erwartungswerte:

$$\mu_R = \mu_S$$

Alternativ-Hypothese(n)

entweder "zweiseitig": $\mu_R \neq \mu_S$
 oder "einseitig": $\mu_R > \mu_S$ bzw. $\mu_R < \mu_S$

Simulation

be/ja/2(4)

Kalibrierung/Validierung

8 - 16

falls (aus Stichproben errechneter) T-Wert
 "zu groß" oder "zu klein" (zweiseitig),
 "zu groß" bzw. "zu klein" (einseitig),

ist Testhypothese "gleiche Mittelwerte" zu verwerfen
 zugunsten Alternativhypothese (bzw. $>$, $<$)

kurz:
 prüfe, ob

$$\frac{|\tilde{\mu}_R - \tilde{\mu}_S|}{\sqrt{2 \tilde{\sigma}^2/n}}$$

aus t_{2n-2} -Tafelwerten (bzgl. Niveau α) "herausfällt"

Insgesamt kritisch für Anwendung sind die Annahmen:

- Normalverteilung
 ("parametrischer Test": Verteilungen als Annahme),
- Unabhängigkeit (ggf. höchstens: Unkorreliertheit),
- identische Streuung
 (ähnlicher Test existiert für ungleiche Streuungen),
- gleicher Stichprobenumfang
 (ähnlicher Test existiert für ungleiche Umfänge)

vgl. auch (breitere Diskussion): HaEK82

Simulation

Kalibrierung/Validierung

Simulation

Kalibrierung/Validierung

8.3 Der Mann-Whitney U-Test

(zur Prüfung der Gleichheit zweier Stichprobenverteilungen)

"nichtparametrischer" Test
 (ohne Verteilungsvoraussetzungen)
 zu nichtpar. Tests
 vgl. Sieg56, BüTr78, HaEK82
 in verschiedenen Varianten (hier i.w. "Siegel")

Sei "Verhalten" beschrieben durch Zufallsvariable V
 (z.B. Verweilzeit Kunden im stationären Bankschalter)

Mögen vorliegen zwei Stichproben
 $v_I := (v_{I1}, v_{I2}, \dots, v_{In})$
 $v_J := (v_{J1}, v_{J2}, \dots, v_{Jm})$
 (z.B. I=R aus Beobachtung Realsystem, J=S aus Simulator)

Annahmen

- Wertemengen der Stichproben unterliegen "zumindest" "Ordinalskala" (strenge Ordnungsrelation existiert)
- v_I und v_J voneinander unabhängige Stichproben, (nicht notwendig in sich unkorreliert !)
- im Vergleich: keine Annahmen über Verteilungstyp, Stichprobenumfänge

Test-Hypothese

Stichproben stammen aus identischer Verteilung;
 formalisiert zu: $P[v_{I*} > v_{J*}] = 1/2$

Alternativ-Hypothese(n)

entweder "zweiseitig": $P[v_{I*} > v_{J*}] = 1/2$
 oder "einseitig": $P[v_{I*} > v_{J*}] > 1/2$ (bzw. $< 1/2$)
 Normalfall, eine Stichprobe "stochastisch größer":
 v "Wertemenge von V": $P[v_{I*} < v] < P[v_{J*} < v]$

Simulation

Kalibrierung/Validierung

be/ja/2

8 - 19

Beispiel:

$n_1 :=$ Umfang kleinere Stichprobe = 3
 $n_2 :=$ Umfang größere Stichprobe = 4

aus Tafel " $n_2=4$ " für sehr kleine Stichproben:
 $P[U_3 (=u^*)] = 0.2$
 \Rightarrow kein Anlaß, Testhypothese zu verwerfen
 (falls nicht Typ1-Fehlerwahrsch. 0.2 toleriert)

- (Hinweis: falls Testwert u^* nicht in Tafel zu finden, wurde Alternativhypothese falsch gestellt; Prüfung von $u' := n_1 n_2 - u^*$ testet entgegengesetzte -einseitige- Alternativhypothese)

- Tafeln sehr kleine Stichproben: 3 n_2 8

Tafeln kleine Stichproben: 9 n_2 20
 (ein Beispiel: $n_1=6, n_2=13, u^*=19$
 führt gemäß Tafel zu Verwerfen zum Niveau 0.05)

Für größere Stichproben ($n_2 > 20$) ist U in guter Näherung normalverteilt mit

$$\mu_u = \frac{n_1 n_2}{2}$$

$$\sigma_u^2 = \frac{n_1 n_2 (n_1 + n_2 + 1)}{12}$$

und ("wie gehabt") Größe

$$g^* := (u^* - \mu_u) / \sigma_u$$

kann mit N(0,1)-Tafel einseitig/zweiseitig getestet werden

Simulation

Kalibrierung/Validierung

Test-Algorithmus

- vereinige Werte aus beiden Stichproben, sortiere gesamte Menge von Werten aufsteigend, notiere aber Stichprobenherkunft der Werte

Beispiel:

v_I : 9 11 15
 v_J : 6 8 10 13
 Anschein: "I" ist größer
 daher Alternativhypothese: $P[v_{I*} > v_{J*}] > 1/2$

sortierte gesamte Menge der Werte:

6 8 9 10 11 13 15
 Herkunft: J J I J I J I

- zähle, für jeden J-Wert, Anzahl vorausgehender I-Werte und addiere Anzahlen zu Summe =: u^*
 (Realisierung einer Test-ZV U)

Beispiel:

Zählung: 0 0 1 2
 Summe: $u^* = 3$

- Testgröße U sollte kleinen Wert u^* aufweisen, falls "I" wirklich größer ist
 Wahrscheinlichkeiten, mit denen U "wert" (= u^*)

ausfällt, sind vertafelt
 (verschiedene Tafeln für "sehr kleine", "kleine", "verbleibende" Stichprobenumfänge)

Simulation

Kalibrierung/Validierung

be/ja/2

8 - 20

- rechnerisch effizientere Methode zur Berechnung von u^* mittels Zuweisung von "Rängen" (ranking) zu den kombinierten Wertemengen beider Stichproben und nachfolgende Addition der Ränge je Stichprobe

im Beispiel:

		Stichproben-	Rang-
		umfang	summen
v_I :	9 11 15	$n_I = 3$	
Rang	3 5 7		$r_I = 15$
v_J :	6 8 10 13	$n_J = 4$	
Rang	1 2 4 6		$r_J = 13$

zu errechnender Testgrößenwert ergibt sich zu

$$u^* = n_I n_J + \frac{n_I (n_I + 1)}{2} - r_I \quad (= 3)$$

bzw. bei umgekehrter Alternativhypothese zu

$$u' = n_I n_J + \frac{n_J (n_J + 1)}{2} - r_J \quad (= 9)$$

(einfach: kleineres der Ergebnisse verwenden)

Simulation

Kalibrierung/Validierung

8.4 Der Wilcoxon Matched-Pairs Signed-Rank Test (zur Prüfung der Gleichheit der Verteilungen zweier "gepaarter" Stichproben)

Sei "Verhalten" beschrieben durch Zufallsvariable V
(z.B. Verweilzeit Kunden im stationären Bankschalter)

Mögen vorliegen zwei "gepaarte" Stichproben

$v_I := (v_{I1}, v_{I2}, \dots, v_{In})$
 $v_J := (v_{J1}, v_{J2}, \dots, v_{Jn})$
 (z.B. "trace-driven" Simulation,
 gleicher Kundenstrom für Modellvarianten I und J;
 natürliche Paarung: "i-ter Kunde bei Behandl'gen I, J")

Annahmen

- Wertemengen der Differenzen gepaarter Werte unterliegen zumindest Ordinalskala
- "je nach Literaturstelle" auch:
 (v_I und v_J unabhängige Stichproben, symmetrische Verteilungen, Verteilungsunterschiede nur in "Lokation")
- im Vergleich: keine Annahmen über Verteilungstyp

Test-Hypothese

Stichproben stammen aus identischer Verteilung;
 formalisiert zu: $P[v_{I*} > v_{J*}] = 1/2$

Alternativ-Hypothese

generell "einseitig": $P[v_{I*} > v_{J*}] > 1/2$ (bzw. $< 1/2$)
 zweiseitig aber möglich!

Test-Algorithmus

- bilde Differenzen d_i der gepaarten Werte, sortiere Differenzbeträge, ordne den Differenzen Ränge zu, ordne den Rangzahlen Vorzeichen der Differenzen zu, summiere positive Rangwerte zu s^+ , negative zu s^-

Beispiel:

v_I	v_J	d	Rang	samt	
			Absolutwerte	Vorzeichen	
82	63	19	7	7	
69	42	27	8	8	
73	74	-1	1		-1
43	37	6	4	4	
58	51	7	5	5	
56	43	13	6	6	
76	80	-4	3		-3
65	62	3	2	2	
			Summen	32	-4

- Testgrößen S^+ , $|S^-|$ sollten bei zutreffender Testhypothese "annähernd gleiche" Werte aufweisen

Wahrscheinlichkeiten, mit denen (unter Testhypothese)

$T := \min(S^+, |S^-|)$ "wert" ausfällt, sind vertafelt

im Beispiel:

$t = 4$, $n = 8$, einseitiger Test
 aus Tafel: Gleichheit bei $t = 4$ ($\alpha = 0.025$) zu verwerfen zugunsten "I" ist größer;
 Gleichheit bei $t = 4$ ($\alpha = 0.01$) nicht verwerfen

- für große Stichproben ($n > 25$):

T in guter Approximation normalverteilt mit

$$\mu_T = \frac{n(n+1)}{4}$$

$$\sigma_T^2 = \frac{n(n+1)(2n+1)}{24}$$

und ("wie gehabt") Größe

$$g := (t - \mu_T) / \sigma_T$$

mittels $N(0,1)$ -Tafel prüfbar

LEERSEITE