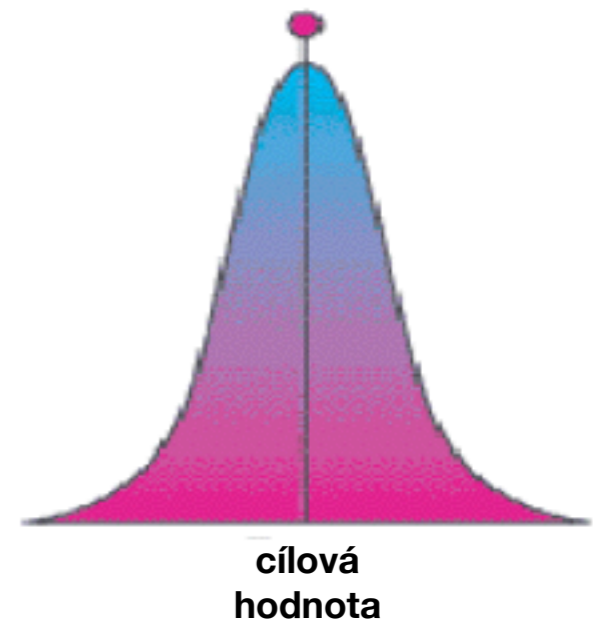
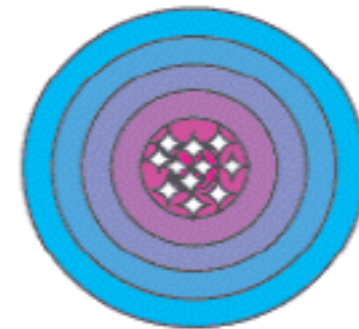
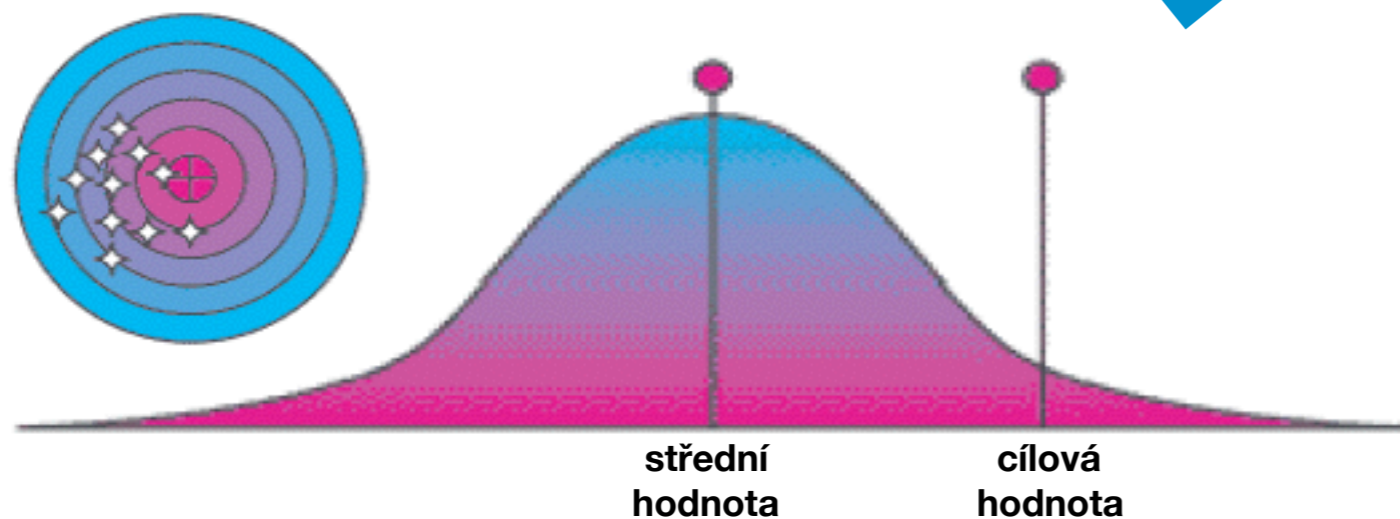


Základy navrhování průmyslových experimentů DOE



II. Jednofaktorové experimenty



Gejza Dohnal

Plánování experimentů - typy experimentu

Norma ČSN ISO 3534/3 Navrhování experimentů (1993)

- **Jednofaktorové experimenty**
- **Úplné vícefaktoriální experimenty** (znáhodnění, uspořádání do bloků)
- **Snížení počtu zkoušek** (latinské, řeckolatinské čtverce pro vyloučení vlivu rušivých faktorů)
- **Dílčí faktoriální návrh** (počáteční vyhledávání vlivných faktorů)
- **Hierarchický návrh** (vyhledání největších zdrojů variability)
- **Optimální návrhy** (optimální odezvové plochy)
- **Taguchiho ortogonální návrhy** (robustní návrhy)

Plánování experimentů - Jednofaktorové experimenty

• Jednofaktorové experimenty:

- uvažujeme vliv pouze jediného (hlavního) faktoru
- tento faktor může mít k úrovní
- pro každou úroveň provedeme n měření (replikací)
- musíme provést $k \times n$ měření, která můžeme rozdělit do bloků podle dalšího (vedlejšího) faktoru
- provádíme znáhodnění pořadí měření (buď přes celý experiment nebo pouze uvnitř bloků)

Statistický model:

$$y_{ij} = \mu + \tau_i + \epsilon_{ij}$$

odezva

společná úroveň

odchylka od společné úrovně, způsobená vlivem i -té úrovně faktoru, $i=1,2,\dots, k$

náhodná chyba v j -tém měření při i -té úrovni faktoru

**O náhodných chybách ϵ_{ij} předpokládáme, že jsou nezávislé, stejně rozdělené s nulovou střední hodnotou a stejným rozptylem σ^2 .
Speciálně, předpokládáme rozdělení $N(0, \sigma^2)$**

Plánování experimentů - Jednofaktorové experimenty

• Jednofaktorové experimenty:

- uvažujeme vliv pouze jediného (hlavního) faktoru
- tento faktor může mít k úrovní
- pro každou úroveň provedeme n měření (replikací)
- musíme provést $k \times n$ měření, která můžeme rozdělit do bloků podle dalšího (vedlejšího) faktoru
- provádíme znáhodnění pořadí měření (buď přes celý experiment nebo pouze uvnitř bloků)

Statistický model:

$$y_{ij} = \mu + \tau_i + \epsilon_{ij}$$

odezva

společná úroveň

odchylka od společné úrovně, způsobená vlivem i -té úrovně faktoru, $i=1,2,\dots, k$

náhodná chyba v j -tém měření při i -té úrovni faktoru

vliv i -té úrovně faktoru, $i=1,2,\dots, k$: $\mu_i = \mu + \tau_i$

Plánování experimentů - Jednofaktorové experimenty

pořadové číslo měření (replikace)

úroveň faktoru (ošetření)

	1	2	3	...	n
1	y	y	y	...	y
2	y	y	y	...	y
3	y	y	y	...	y
:	:	:	:	⋮	:
k	y	y	y	...	y

Plánování experimentů - Jednofaktorové experimenty

pořadové číslo měření (replikace)

úroveň faktoru (ošetření)

	1	2	3	...	n
1	y	y	y	...	y
2	y	y	y	...	y
3	y	y	y	...	y
:	:	:	:	⋮	:
k	y	y	y	...	y
	blok 1		blok 2		blok r

Plánování experimentů - Jednofaktorové experimenty

Statistický model při uspořádání do bloků:

$$y_{ij} = \mu + \tau_i + \beta_j + \epsilon_{ij}$$

odezva

společná úroveň

$$\mu_i = \mu + \tau_i$$

vliv i-té úrovně faktoru, $i=1,2,\dots, k$

$$\sum_{i=1}^k \tau_i = 0$$

vliv j-tého bloku, $j=1,2,\dots, r$

$$\sum_{j=1}^r \beta_j = 0$$

náhodná chyba v j-tém bloku při i-té úrovni faktoru

$$H_0 : \mu_1 = \mu_2 = \dots = \mu_k$$

$$H_A : \mu_i \neq \mu_m, \quad 1 \leq i < m \leq k$$

**O náhodných chybách ϵ_{ij} předpokládáme, že jsou nezávislé, stejně rozdělené s nulovou střední hodnotou a stejným rozptylem σ^2 .
Speciálně, předpokládáme rozdělení $N(0, \sigma^2)$**

Plánování experimentů - Jednofaktorové experimenty

1 faktor, 2 úrovně (nezávislá měření):

	1	2	3	...	n
A	y	y	y	...	y
B	y	y	y	...	y

1 faktor, 2 úrovně (závislá měření):

	1	2	3	...	n
A	y	y	y	...	y
B	y	y	y	...	y

Jednofaktorové experimenty

Model

Odezva: Y - výběrem na základě zadání

Faktor: X - na základě analýzy procesu, počet úrovní k (X_1, X_2, \dots, X_k)

Počet replikací: n , budeme pozorovat Y_{ij} $i=1, \dots, k$, $j=1, \dots, n$

Počet měření: $k \times n$

Experiment: počet úrovní, závislost měření (blokové uspořádání), znáhodnění

Metoda vyhodnocení: t-test, párový test, ANOVA, neparametrický test

$$H_0 : \mu_1 = \mu_2 = \dots = \mu_k$$

$$H_A : \mu_i \neq \mu_m, \quad 1 \leq i < m \leq k$$

Srovnání pevnosti dvou druhů vláknem

Odezva: pevnost vlákna v tahu (v MPa)

Faktor: druh vlákna, 2 hodnoty

Počet replikací: 4

Počet měření: $2 \times 4 = 8$

Experiment: 1 faktor, 2 úrovně, nezávislá měření

Znáhodnění (pořadí druhu vlákna při měření): 2, 1, 2, 1, 1, 2, 1, 2

Výsledky měření: 22,3 21,8 21,9 20,4 21,1 21,2 21,3 22,8

	1	2	3	4	průměr	rozptyl
A1	21,8	20,4	21,1	21,3	21,15	0,3367
A2	22,3	21,9	21,2	22,8	22,05	0,4567

Metoda vyhodnocení: Dvouvýběrový t-test

Srovnání pevnosti dvou druhů vláknem

Metoda vyhodnocení: Dvouvýběrový t-test

$$\bar{y}_i = \frac{\sum_{j=1}^r y_{ij}}{r}, \quad s_i^2 = \frac{\sum_{j=1}^r (y_{ij} - \bar{y}_i)^2}{r-1}$$

Testová statistika je dána vzorcem

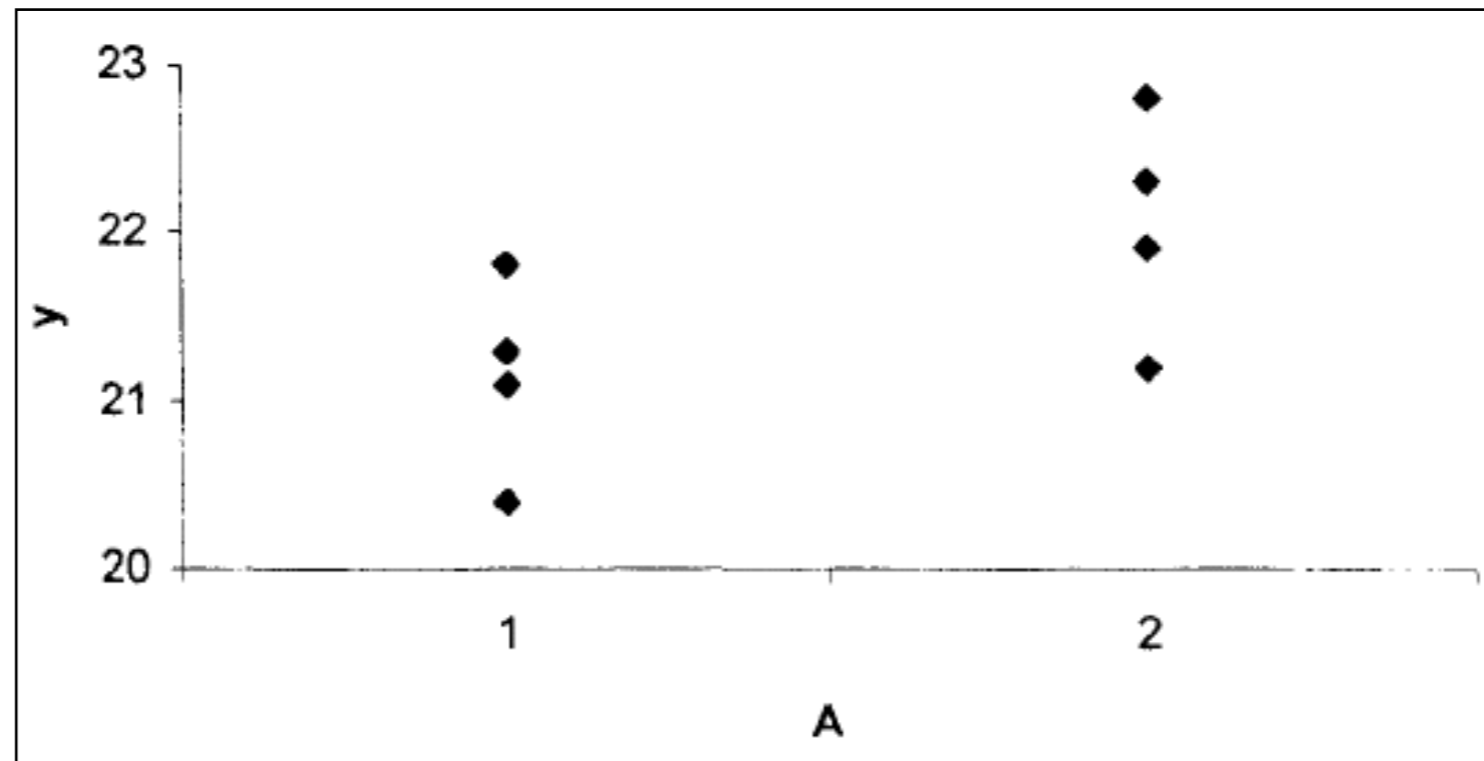
$$t = \frac{\bar{y}_1 - \bar{y}_2}{\sqrt{\frac{2s^2}{r}}},$$

kde průměr z rozptylů uvnitř skupin $s^2 = (s_1^2 + s_2^2) / 2$

H_1	Kritická hodnota	H_0 zamítneme, když
$\mu_1 - \mu_2 > 0$	$t_{1-\alpha}$	$t > t_{1-\alpha}$
$\mu_1 - \mu_2 < 0$	t_α	$t < t_\alpha$
$\mu_1 - \mu_2 \neq 0$	$t_{1-\alpha/2}$	$ t > t_{1-\alpha/2}$

Pro $\alpha = 0,05$ je $t_{0,95}(6) = 1,943$

Srovnání pevnosti dvou druhů vláknem



	A1	A2
Stř. hodnota	21,15	22,05
Rozptyl	0,336666667	0,456666667
Pozorování	4	4
Společný rozptyl	0,396666667	
Hyp. rozdíl stř. hodnot	0	
Stupně volnosti	6	
t stat	-2,020899209	
P(T<=t) (1)	0,044894253	
t krit (1)	1,943180905	
P(T<=t) (2)	0,089788507	
t krit (2)	2,446913641	

Srovnání výkonnosti v závislosti na typu stroje

(1 faktor, závislá měření)

Odezva: výkon v počtu výrobků za hodinu

Faktor: typ stroje

Počet replikací: 8 (máme 8 operátorů)

můžeme volit a) 16 znáhodněných "nezávislých měření"

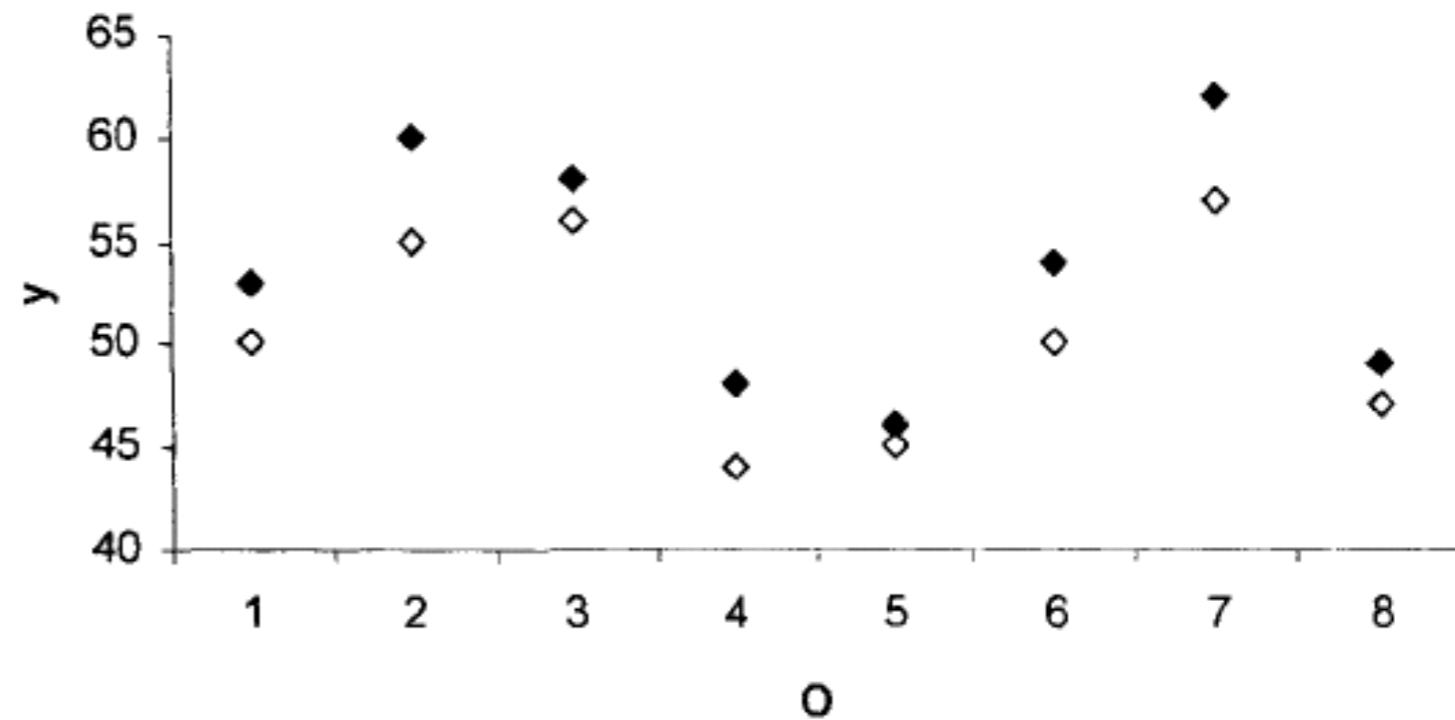
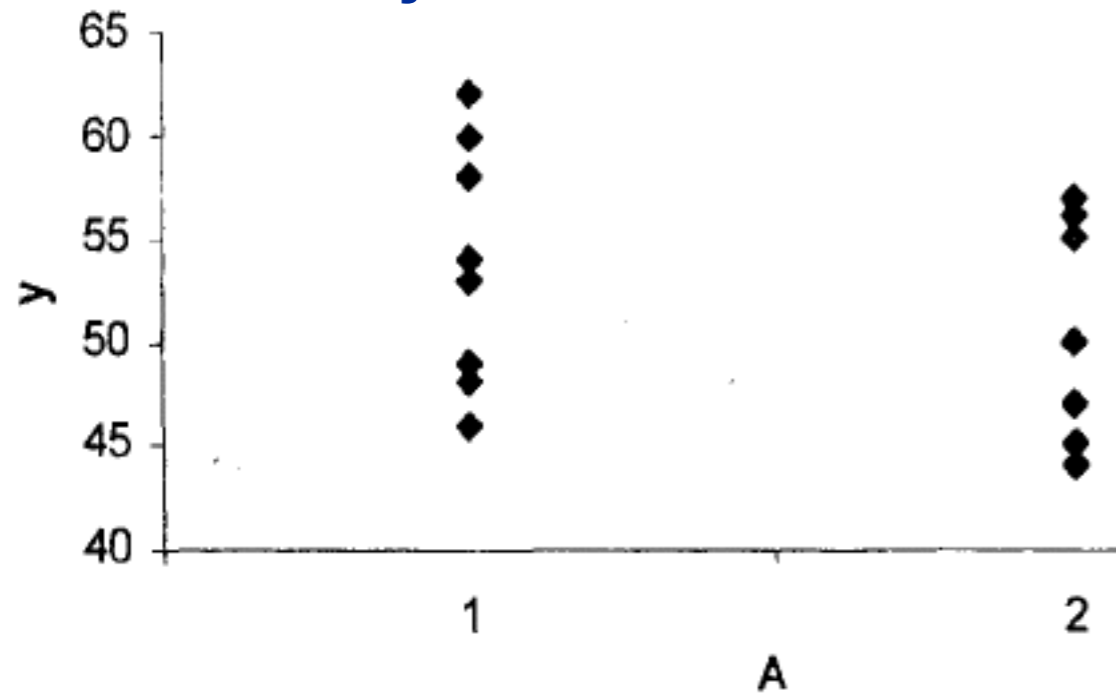
b) 8 párových (závislých měření)

Experiment: 1 faktor, 2 úrovně, závislá měření - blokové (párové) uspořádání

operátor	1	2	3	4	5	6	7	8
stroj A1	53	60	58	48	46	54	62	49
stroj A2	50	55	56	44	45	50	57	47
rozdíl d_j	3	5	2	4	1	4	5	2

Metoda vyhodnocení: Párový t-test

Srovnání výkonnosti v závislosti na typu stroje



Metoda vyhodnocení: Párový t-test

$$t = \frac{\bar{d}}{\sqrt{\frac{s_d^2}{r}}}$$

kde

$$\bar{d} = \frac{\sum_{j=1}^r d_j}{r}, \quad s_d^2 = \frac{\sum_{j=1}^r (d_j - \bar{d})^2}{r-1}$$

	y1	y2
Stř. hodnota	53,75	50,5
Rozptyl	34,5	25,42857
Pozorování	8	8
Pears. korelace	0,974278	
Hyp. rozdíl stř. hodnot	0	
Stupně volnosti	7	
t stat	6,177483	
P(T<=t) (1)	0,000228	
t krit (1)	1,894578	
P(T<=t) (2)	0,000455	
t krit (2)	2,364623	

Srovnání pevnosti vláken od tří dodavatelů

Odezva: pevnost vlákna v tahu (v MPa)

Faktor: dodavatel vlákna, 3 hodnoty

Počet replikací: 6

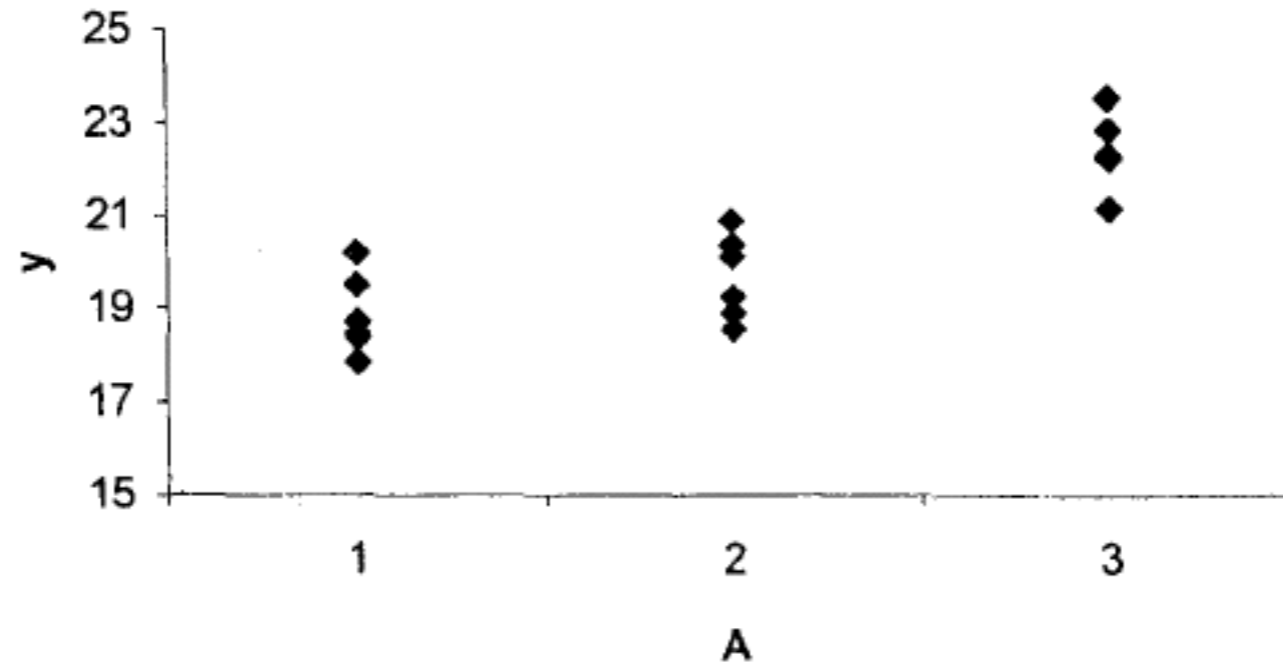
Počet měření: $3 \times 6 = 18$

Experiment: 1 faktor, 3 úrovně, nezávislá měření)

	1	2	3	4	5	6	průměr	rozptyl
A1	17,9	18,7	18,4	18,5	20,2	19,5	18,867	0,6987
A2	20,9	19,3	20,1	18,9	18,6	20,4	19,7	0,82
A3	22,3	22,8	23,5	22,2	22,3	21,2	22,383	0,5737

Metoda vyhodnocení: ANOVA pro 1 faktor

Srovnání pevnosti vláken od tří dodavatelů



$$SS_A = r \sum_{i=1}^a (\bar{y}_i - \bar{y})^2,$$

$$SS_E = \sum_{i=1}^a \sum_{j=1}^r (y_{ij} - \bar{y}_i)^2,$$

$$SS_T = \sum_{i=1}^a \sum_{j=1}^r (y_{ij} - \bar{y})^2$$

Srovnání pevnosti vláken od tří dodavatelů

Metoda vyhodnocení: ANOVA pro 1 faktor

Zdroj variability	Součet čtverců	Stupně volnosti	Průměrný čtverec	F	P-hodnota
faktor	SS_A	$a - 1$	$MS_A = \frac{SS_A}{a - 1}$	$F = \frac{MS_A}{MS_E}$	
reziduální	SS_E	$a(r - 1)$	$MS_E = \frac{SS_E}{a(r - 1)}$		
celkový	SS_T	$ar - 1$			

kde

$$SS_A = r \sum_{i=1}^a (\bar{y}_i - \bar{y})^2,$$

$$SS_E = \sum_{i=1}^a \sum_{j=1}^r (y_{ij} - \bar{y}_i)^2,$$

$$SS_T = \sum_{i=1}^a \sum_{j=1}^r (y_{ij} - \bar{y})^2$$

$$F = \frac{\frac{SS_A}{a-1}}{\frac{SS_E}{a(r-1)}} = \frac{MS_A}{MS_E}$$

má Fisherovo-Snedecorovo rozdělení o $(a-1)$ a $a(r-1)$ stupních volnosti

Srovnání pevnosti vláken od tří dodavatelů

Metoda vyhodnocení: ANOVA pro 1 faktor

ANOVA

Zdroj variability	SS	St. vol.	MS	F	Hodnota P	F krit
faktor A	40,52333	2	20,26167	29,0513	6,94E-06	3,682317
reziduální	10,46167	15	0,697444			
celkový	50,985	17				

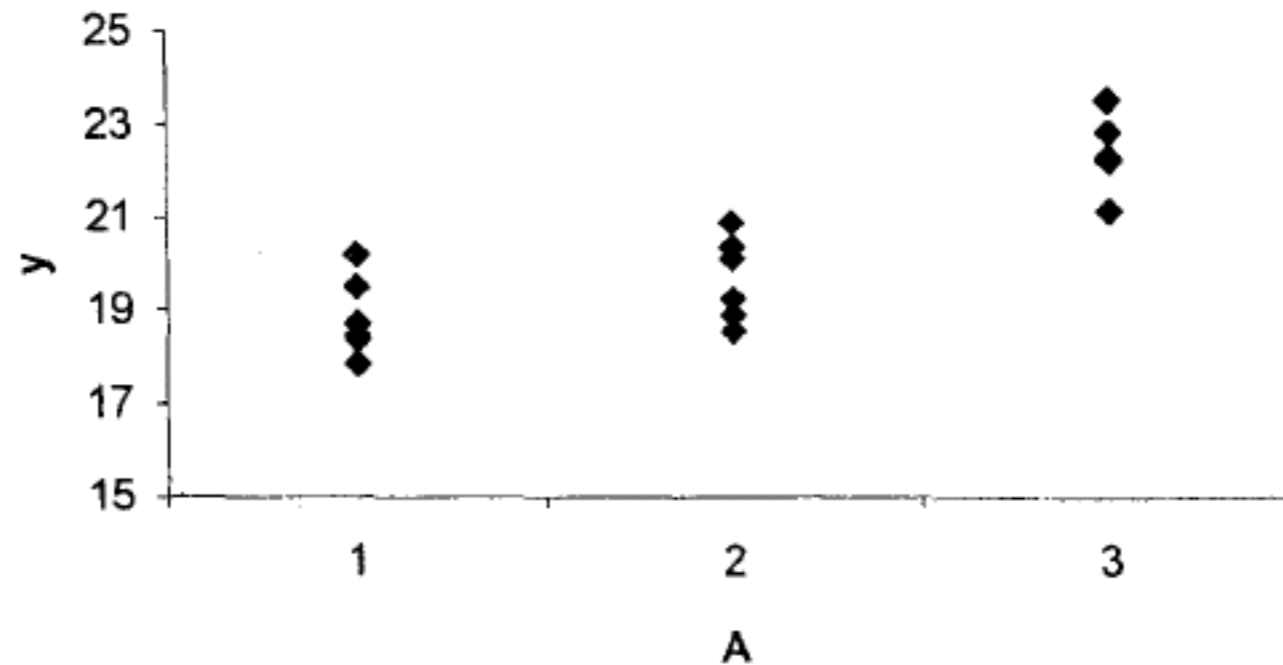
kde

$$SS_A = r \sum_{i=1}^a (\bar{y}_i - \bar{y})^2, \quad SS_E = \sum_{i=1}^a \sum_{j=1}^r (y_{ij} - \bar{y}_i)^2, \quad SS_T = \sum_{i=1}^a \sum_{j=1}^r (y_{ij} - \bar{y})^2$$

$$F = \frac{\frac{SS_A}{a-1}}{\frac{SS_E}{a(r-1)}} = \frac{MS_A}{MS_E}$$

má Fisherovo-Snedecorovo rozdělení o $(a-1)$ a $a(r-1)$ stupních volnosti

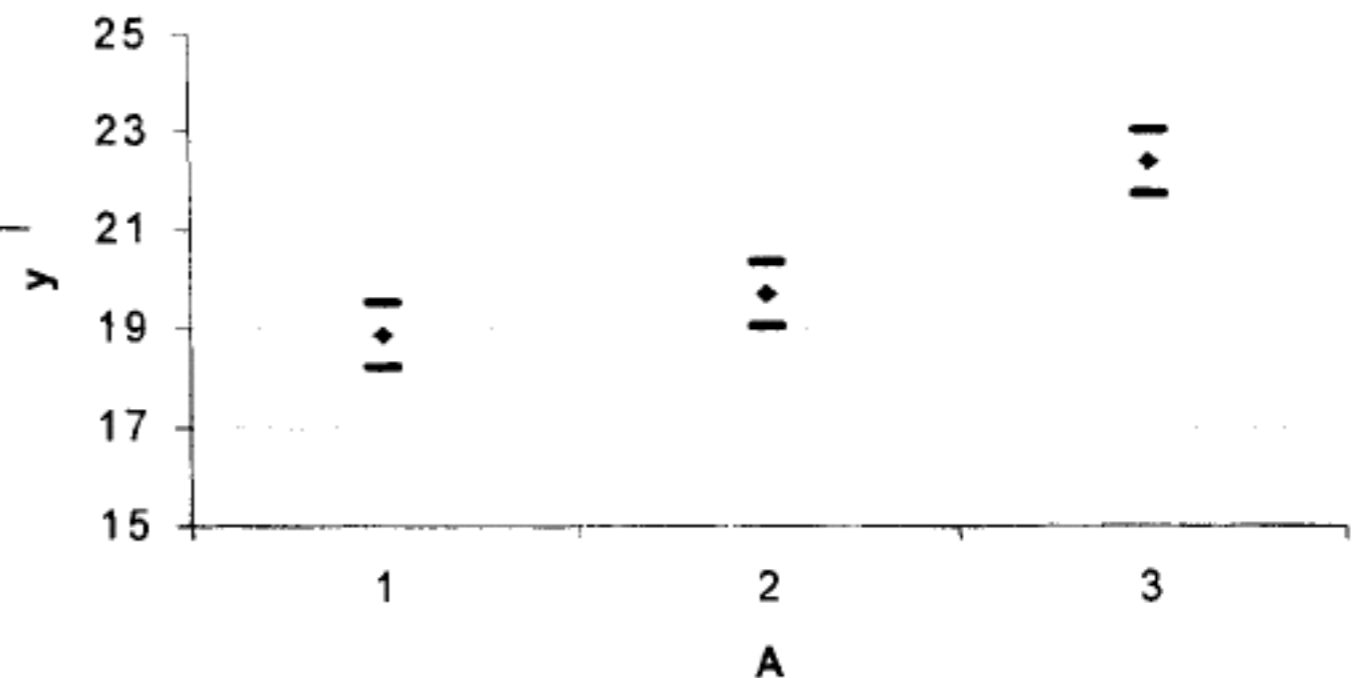
Srovnání pevnosti vláken od tří dodavatelů



Bonferroniho metoda mnohonásobného srovnání úrovní faktorů:

Úroveň	Průměr	Dolní mez	Horní mez
A ₁	18,867	18,217	19,516
A ₂	19,700	19,051	20,349
A ₃	22,383	21,734	23,033

$$\bar{y}_i \pm t_{1-\alpha/2p} \cdot \sqrt{\frac{MS_E}{2 \cdot a}}$$



Vliv katalyzátoru na výtěžek chemického procesu

Odezva: výtěžek procesu (množství vyráběné látky)

Faktor: druh katalyzátoru, 4 hodnoty

Počet replikací: 6

Počet měření: $4 \times 6 = 24$

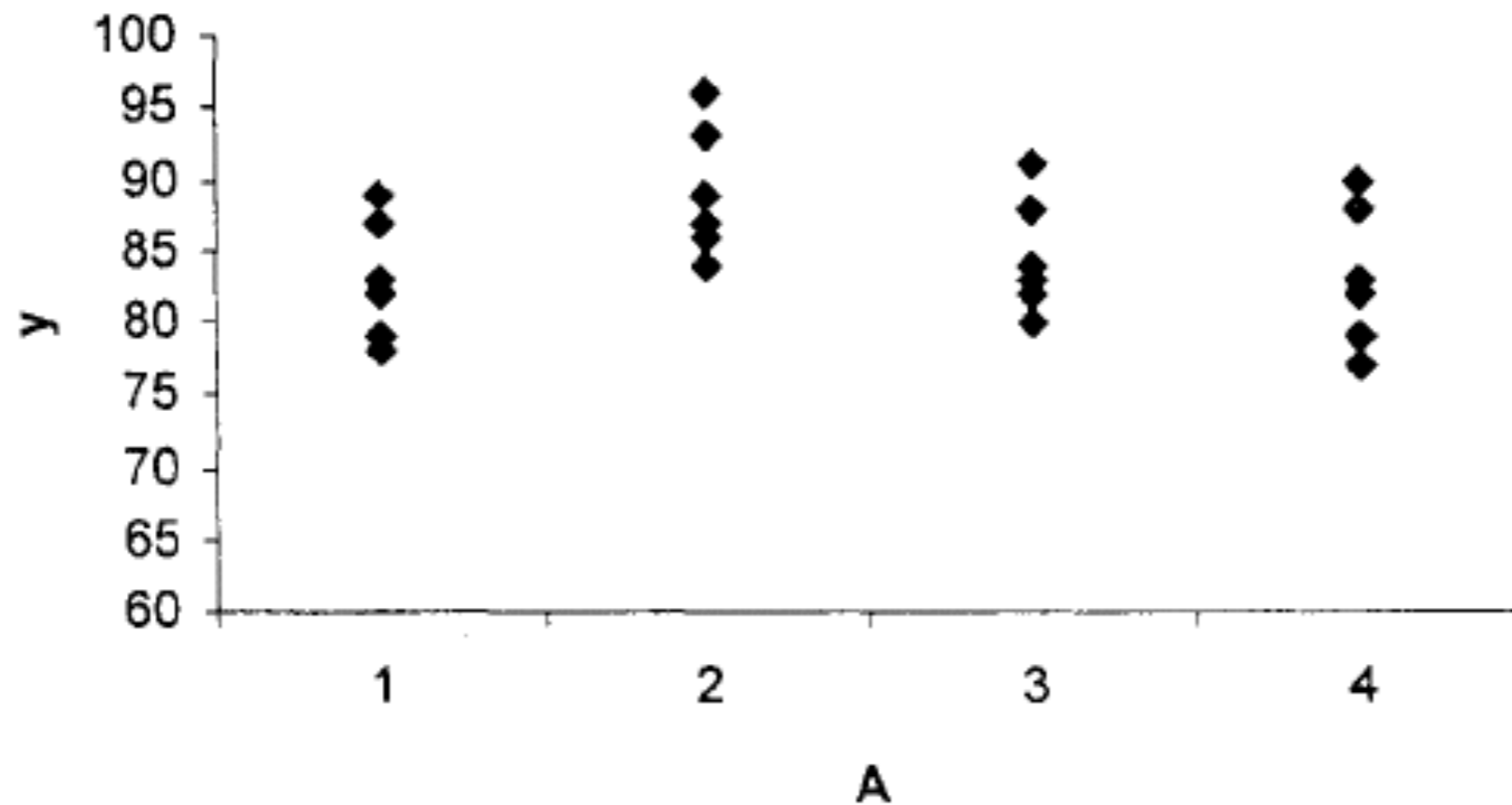
Vedlejší faktor: vliv várky vstupní suroviny

Experiment: 1 faktor, 4 úrovně, uspořádání do bloků, znáhodnění v blocích)

várka	1	2	3	4	5	6	průměr	rozptyl
A1	87	79	82	89	83	78	83	18,8
A2	93	84	89	96	86	87	89,2	20,57
A3	88	80	84	91	83	82	84,7	16,67
A4	88	77	83	90	82	79	83,2	25,37

Metoda vyhodnocení: ANOVA pro 2 faktory (bez opakování)

Vliv katalyzátoru na výtěžek chemického procesu



	b_1	b_2	b_3	b_4	b_5	b_6	Součet
A_1	87	79	82	89	83	78	498
A_2	93	84	89	96	86	87	535
A_3	88	80	84	91	83	82	508
A_4	88	77	83	90	82	79	499
Součet	356	320	338	366	334	326	2040

Vliv katalyzátoru na výtěžek chemického procesu

Postup výpočtu:

Testujeme hypotézu $H_0: \mu_1 = \mu_2 = \mu_3 = \mu_4$

- (1) Řádkové součty umocníme na druhou, sečteme vzniklé čtverce a celkový součet dělíme počtem hodnot v každém řádku

$$\frac{1}{6}(498^2 + 535^2 + 508^2 + 499^2) = 173\,549.$$

- (2) Sloupcové součty umocníme na druhou, sečteme vzniklé čtverce a celkový součet dělíme počtem hodnot v každém sloupci

$$\frac{1}{4}(356^2 + 320^2 + \dots + 334^2 + 326^2) = 173\,792.$$

- (3) Utvoříme součet čtverců jednotlivých hodnot

$$87^2 + 79^2 + \dots + 82^2 + 79^2 = 173\,956$$

- (4) Celkový součet všech hodnot umocníme na druhou a dělíme celkovým počtem hodnot

$$\frac{1}{24}(87 + 79 + \dots + 82 + 79)^2 = 173\,400.$$

Vliv katalyzátoru na výtěžek chemického procesu

Postup výpočtu:

Pro součty čtverců platí

$$SS_A = (1) - (4) = 173\,549 - 173\,400 = 149$$

$$SS_b = (2) - (4) = 173\,792 - 173\,400 = 392$$

$$SS_E = (3) - (1) - (2) + (4) = 15$$

ANOVA

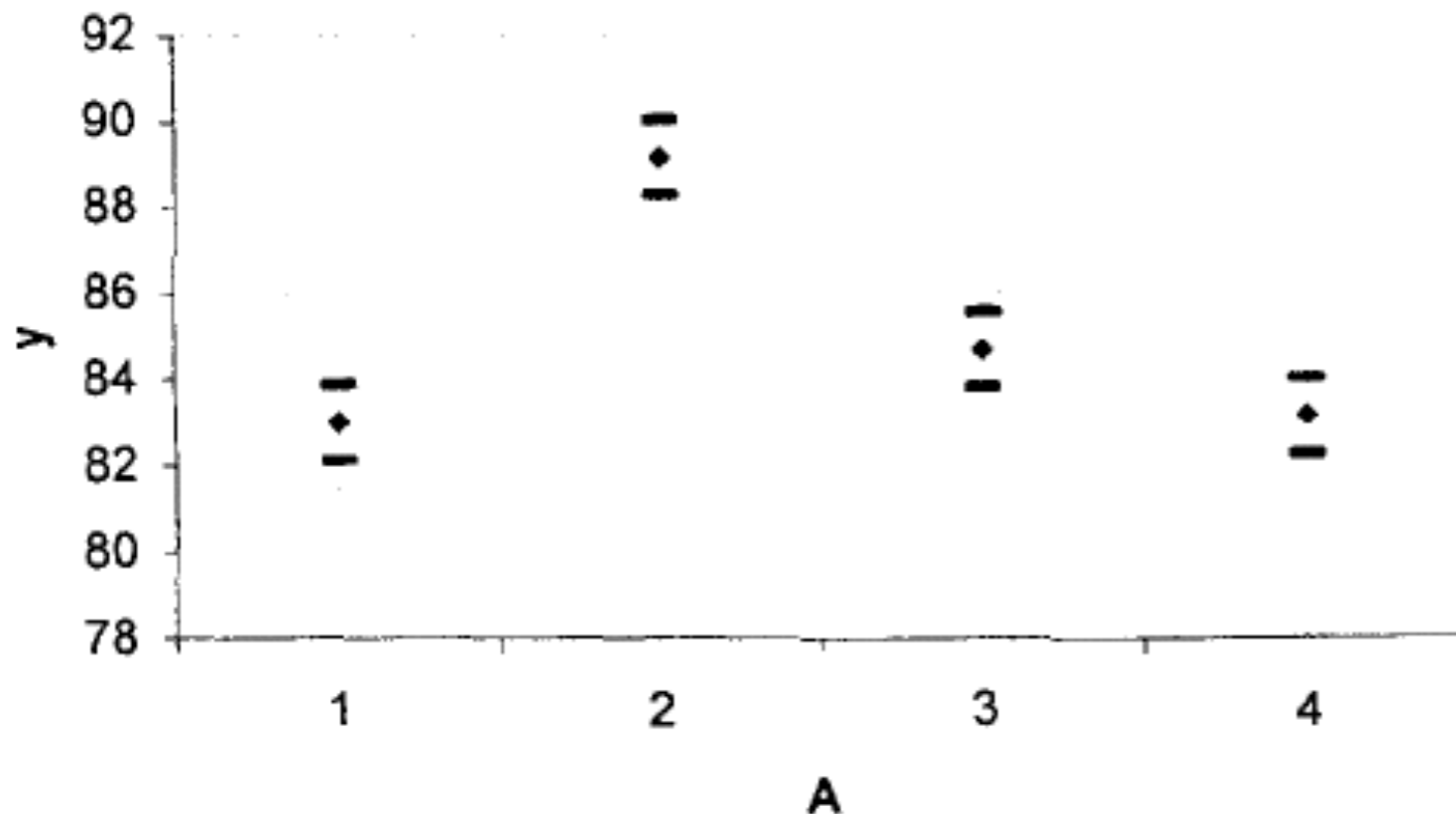
Zdroj variability	SS	St.vol	MS	F	Hodnota P	F krit
Faktor A	149	3	49,66667	49,66667	5,03E-08	3,287383
Bloky	392	5	78,4	78,4	3,28E-10	2,901295
Reziduální	15	15	1			
Celkový	556	23				

Vliv katalyzátoru na výtěžek chemického procesu

Bonferroniho metoda mnohonásobného srovnání srovnání úrovní faktorů:

Úroveň	Průměr	Dolní mez	Horní mez
A ₁	83,0	82,1	83,9
A ₂	89,2	88,3	90,0
A ₃	84,7	83,8	85,5
A ₄	83,2	82,3	84,0

$$\bar{y}_i \pm t_{1-\alpha/2p} \cdot \sqrt{\frac{MS_E}{2 \cdot a}}$$



Plánování experimentů - Jednofaktorové experimenty

- **Latinské čtverce:**

- uvažujeme vliv pouze jediného (hlavního) faktoru
- tento faktor může mít k úrovní
- uvažujeme další dva vedlejší faktory, každý o k úrovních
- cílem je provést k replikací měření s maximálním vyloučením vlivů vedlejších faktorů

1. vedlejší faktor

	1	2	3	4	5
1	A	B	C	D	E
2	B	C	D	E	A
3	C	D	E	A	B
4	D	E	A	B	C
5	E	A	B	C	D

2. vedlejší faktor

Plánování experimentů - Jednofaktorové experimenty

- **Latinské čtverce:**

- uvažujeme vliv pouze jediného (hlavního) faktoru
- tento faktor může mít k úrovní
- uvažujeme další dva vedlejší faktory, každý o k úrovních
- cílem je provést k replikací měření s maximálním vyloučením vlivů vedlejších faktorů

operátor

	1	2	3	4	5
1	A	B	C	D	E
2	B	C	D	E	A
3	C	D	E	A	B
4	D	E	A	B	C
5	E	A	B	C	D

materiál

Příklad:

Hlavní faktor:

Účinek plnidel na mechanickou pevnost tyčkových bakelitových vzorků

Odezva: pevnos v ohybu (MPa)

Faktor: druh plnidla, 5 hodnot

Počet replikací: 5

Počet měření: $5 \times 5 = 25$

Vedlejší faktor: bakelizační doba, vliv polohy vzorku v matici

Experiment: 1 faktor, 5 úrovní, 2 vedlejší faktory, uspořádání do (znáhodněného) latinského čtverce

Řádky (1.blokový faktor)	Sloupce (2.blokový faktor)			
	1	2	3	4
1	A	B	D	C
2	B	C	A	D
3	C	D	B	A
4	D	A	C	B

Účinek plnidel na mechanickou pevnost tyčkových bakelitových vzorků

Odezva: pevnos v ohybu (MPa)

Faktor: druh plnidla, 5 hodnot

Počet replikací: 5

Počet měření: $5 \times 5 = 25$

Vedlejší faktor: bakelizační doba, vliv polohy vzorku v matici

Experiment: 1 faktor, 5 úrovní, 2 vedlejší faktory, uspořádání do (znáhodněného) latinského čtverce

	1	2	3	4		1	2	3	4		1	2	3	4
1	A	B	C	D	1	C	D	A	B	1	D	B	C	A
2	B	C	D	A	2	D	A	B	C	2	A	C	D	B
3	C	D	A	B	3	A	B	C	D	3	B	D	A	C
4	D	A	B	C	4	B	C	D	A	4	C	A	B	D

Účinek plnidel na mechanickou pevnost tyčkových bakelitových vzorků

Odezva: pevnos v ohybu (MPa)

Faktor: druh plnidla, 5 hodnot

Počet replikací: 5

Počet měření: $5 \times 5 = 25$

Vedlejší faktor: bakelizační doba, vliv polohy vzorku v matici

Experiment: 1 faktor, 5 úrovní, 2 vedlejší faktory, uspořádání do (znáhodněného) latinského čtverce

Doba (série)	Poloha v matici				
	1	2	3	4	5
1	B 15,5	E 17,0	C 12,0	A 16,0	D 15,5
2	C 13,5	A 16,0	D 14,0	B 13,5	E 17,5
3	E 17,0	C 13,0	A 15,0	D 13,0	B 15,0
4	A 19,5	D 17,0	B 19,0	E 18,5	C 16,0
5	D 14,5	B 13,5	E 12,0	C 11,0	A 14,0

Metoda vyhodnocení:
ANOVA pro 3 faktory

Účinek plnidel na mechanickou pevnost tyčkových bakelitových vzorků

Zdroj variability	Součet čtverců	Stupně volnosti	Průměrný čtverec	Podíl F
faktor L	SS_L	$k - 1$	$MS_F = \frac{SS_L}{k - 1}$	$\frac{MS_L}{MS_E}$
řádky	SS_r	$k - 1$	$MS_r = \frac{SS_r}{k - 1}$	$\frac{MS_r}{MS_E}$
sloupce	SS_c	$k - 1$	$MS_c = \frac{SS_c}{k - 1}$	$\frac{MS_c}{MS_E}$
reziduální	SS_E	$(k - 1)(k - 2)$	$MS_E = \frac{SS_E}{(k - 1)(k - 2)}$	
celkový	SS_T	$k^2 - 1$		

$$SS_T = SS_L + SS_r + SS_c + SS_E$$

Podíl F má Fisherovo rozdělení s $(k-1)$ a $(k-1)(k-2)$ stupni volnosti

Metoda vyhodnocení:
ANOVA pro 3 faktory

Účinek plnidel na mechanickou pevnost tyčkových bakelitových vzorků

Postup výpočtu:

Doba (série)	Poloha v matici					Řádkové součty
	1	2	3	4	5	
1	B 15,5	E 17,0	C 12,0	A 16,0	D 15,5	76,0
2	C 13,5	A 16,0	D 14,0	B 13,5	E 17,5	74,5
3	E 17,0	C 13,0	A 15,0	D 13,0	B 15,0	73,0
4	A 19,5	D 17,0	B 19,0	E 18,5	C 16,0	90,0
5	D 14,5	B 13,5	E 12,0	C 11,0	A 14,0	65,0
Sloupcové součty	80,0	76,5	72,0	72,0	78,0	378,5

Plnidlo	A	B	C	D	E
Součet	80,5	76,5	65,5	74,0	82,0

Účinek plnidel na mechanickou pevnost tyčkových bakelitových vzorků

Postup výpočtu:

- (1) Řádkové součty umocníme na druhou, sečteme vzniklé čtverce a celkový součet dělíme počtem hodnot v každém řádku

$$\frac{1}{5}(76^2 + 74,5^2 + 73^2 + 90^2 + 65^2) = 5796,05.$$

- (2) Sloupcové součty umocníme na druhou, sečteme vzniklé čtverce a celkový součet dělíme počtem hodnot v každém sloupci

$$\frac{1}{5}(80^2 + 76,5^2 + 72^2 + 72^2 + 78^2) = 5740,85.$$

- (3) Součty podle jednotlivých úrovní zkoumaného faktoru umocníme na druhou, sečteme vzniklé čtverce a celkový součet dělíme počtem úrovní faktoru

$$\frac{1}{5}(80,5^2 + 76,5^2 + 65,5^2 + 74^2 + 82^2) = 5764,55.$$

- (4) Utvoříme součet čtverců jednotlivých hodnot

$$15,5^2 + 13,5^2 + \dots + 16^2 + 14^2 = 5851,25.$$

Účinek plnidel na mechanickou pevnost tyčkových bakelitových vzorků

Postup výpočtu:

(5) Celkový součet všech hodnot umocníme na druhou a dělíme celkovým počtem hodnot

$$\frac{1}{25} 378,5^2 = 5730,49.$$

Vypočteme potřebné součty čtverců pro tabulku ANOVA

$$SS_p = (3) - (5) = 5764,55 - 5730,49 = 34,06$$

$$SS_r = (1) - (5) = 5796,05 - 5730,49 = 65,56$$

$$SS_c = (2) - (5) = 5740,85 - 5730,49 = 10,36$$

$$SS_E = (4) - (1) - (2) - (3) + 2 \cdot (5) = 5851,25 - 5796,05 - 5740,85 - 5764,55 + 2 \cdot 5730,49 = 10,78$$

Účinek plnidel na mechanickou pevnost tyčkových bakelitových vzorků

Zdroj variability	Součet čtverců	Stupně volnosti	Průměrný čtverec	Podíl F
faktor L	34,06	4	8,515	9,479
řádky	65,56	4	16,390	18,245
sloupce	10,36	4	2,590	2,883
reziduální	10,78	12	0,898	

Kritická hodnota F-rozdělení: $F_{0,95}(4,12) = 3,259$.

Mnohonásobná porovnávání (Bonferroni):

Úroveň	Průměr	Dolní mez	Horní mez
A	16,1	15,1	17,1
B	15,3	14,3	16,3
C	13,1	12,1	14,1
D	14,8	13,8	15,8
E	16,4	15,4	17,4

