

Relación 2 de EDIP.

Gonzalo Moreno Soto
Alejandro Pérez Argüello
Miguel Piñar Pérez
Gerardo Tirado García
Irene Trigueros Lorca
Alejandro Villanueva Prados

30 de marzo de 2019

1. Se han lanzado 2 dados varias veces, obteniendo los resultados que se presentan en la siguiente tabla, donde X designa el resultado del primer dado e Y, el resultado del segundo:

X	1	2	2	3	5	4	1	3	3	4	1	2	5	4	3	4	4	5	3	1	6	5	4	6
Y	2	3	1	4	3	2	6	4	1	6	6	5	1	2	5	1	1	2	6	6	2	1	2	5

- a) Construir la tabla de frecuencias.

X \ Y	1	2	3	4	5	6	$n_{i.}$	$x_i n_{i.}$	$(x_i - \bar{x})^2 n_{i.}$
1	0	1	0	0	0	3	4	4	361/16
2	1	0	1	0	1	0	3	6	363/64
3	1	0	0	2	1	1	5	15	45/64
4	2	3	0	0	0	1	6	24	75/32
5	2	1	1	0	0	0	4	20	169/16
6	0	1	0	0	1	0	2	12	441/32
$n_{.j}$	6	6	2	2	3	5	24	81	6043/32
$y_j n_{.j}$	7	10	6	8	15	30	76		
$(y_j - \bar{y})^2 n_{.j}$	2809/36	841/96	25/288	361/288	1849/192	22445/576	87.6929		

- b) Calcular las puntuaciones medias obtenidas de cada dado y ver cuáles son más homogéneas.

$$\bar{y} = \frac{\sum_{j=1}^6 (y_j * n_{.j})}{N} = \frac{77}{24} \simeq 3,208333 \simeq 3 \text{ puntos}$$

$$\bar{x} = \frac{\sum_{i=1}^6 (x_i * n_{i.})}{N} = \frac{81}{24} \simeq 3,375 \simeq 3 \text{ puntos}$$

$$\sigma_y = \sqrt{\sum_{j=1}^6 \frac{(y_j - \bar{y})^2 n_{.j}}{N}} = \sqrt{\frac{87,6929}{24}} = 1,91151$$

$$\sigma_x = \sqrt{\sum_{i=1}^6 \frac{(x_i - \bar{x})^2 n_{i.}}{N}} = \sqrt{\frac{6043}{32 * 24}} = 2,80508$$

Las puntuaciones obtenidas por el dado Y son más homogéneas.

c) ¿Qué resultado del 2º dado es más frecuente cuando en el 1º se obtiene un 3?

El 4

d) Calcular la puntuación máxima del 50 % de las puntuaciones más bajas obtenidas con el primer dado si con el segundo se ha obtenido un 2 o un 5?

	(4,2)	(5,2) = (2,5)	(6,2) = (3,5)	(6,5)
z_i	6	7	8	11
n_i	3	2	2	1
N_i	3	5	7	8

Mediana: $\frac{N}{2} = 4 \Rightarrow \text{Me} = 7$

2. Medidos los pesos, X (en kg) y las alturas (en cm) Y, a un grupo de individuos se han obtenido los siguientes resultados:

X \ Y	160	162	164	166	168	170	$n_{i.}$	$x_i n_{i.}$	$(x_i - \bar{x})^2 n_{i.}$
48	3	2	2	1	0	0	8	384	304.6922
51	2	3	4	2	2	1	14	714	140.8114
54	1	3	6	8	5	1	24	1296	0.7053
57	0	0	1	2	8	3	14	798	112.0114
60	0	0	0	2	4	4	10	600	339.72245
$n_{.j}$	6	8	13	15	19	9	70	3792	897.84275
$y_j n_{.j}$	960	1296	2132	2490	3192	1530	11600		
$(y_j - \bar{y})^2 n_{.j}$	9600/49	5408/49	1872/49	60/49	4864/49	8100/49	4272/7		

- a) Calcular el peso medio y la altura media y decir cuál es más representativo.

$$\bar{y} = \frac{\sum_{j=1}^6 (y_j * n_{.j})}{N} = \frac{11600}{70} \simeq 165,7143 \simeq 166 \text{ cm}$$

$$\sigma_y^2 = \sum_{j=1}^6 \frac{(y_j - \bar{y})^2 n_{.j}}{N} = \frac{2136}{245} \simeq 8,7184 \text{ cm}^2$$

$$\sigma_y = \sqrt{\sigma_y^2} = 2,952688156$$

$$C.V.P.(y) = \frac{\sigma_y}{\bar{y}} = 0,0178179$$

$$\bar{x} = \frac{\sum_{i=1}^6 (x_i * n_{i.})}{N} = \frac{3792}{70} \simeq 54,1714 \simeq 54 \text{ kg}$$

$$\sigma_x^2 = \sum_{i=1}^5 \frac{(x_i - \bar{x})^2 n_{i.}}{N} = \frac{897,94275}{70} \simeq 12,82775 \text{ kg}^2$$

$$\sigma_x = \sqrt{\sigma_x^2} = 3,581585$$

$$C.V.P.(x) = \frac{\sigma_x}{\bar{x}} = 0,0661158$$

La media de la altura es más representativa, ya que el coeficiente de variación de Pearson de Y es menor.

- b) Calcular el porcentaje de individuos que pesan menos de 55 kg y miden más de 165 cm.

Tal y como se presentan las variables en la tabla, la altura y el peso son variables discretas, por lo que el número de individuos que pesan menos de 55 kg son los que pesan menos o igual a 54 kg; los que miden más de 165 cm son los que miden más o igual a 166 cm.

$$\sum_{i=1}^3 \sum_{j=4}^6 \frac{n_{ij}}{N} * 100 = \frac{1 + 2 + 8 + 2 + 5 + 1 + 1}{70} * 100 = 28,5714 \%$$

- c) Entre los que miden más de 165 cm, ¿cuál es el porcentaje de los que pesan más de 52 kg?

Número de personas que miden más de 165 cm: $70 - 27 = 43$

$$\sum_{i=3}^5 \sum_{j=4}^6 \frac{n_{ij}}{43} * 100 = \frac{8+5+1+2+8+3+2+4+4}{43} * 100 = 86,0465 \%$$

d) ¿Cuál es la altura más frecuente entre los individuos cuyo peso oscila entre 51 y 57 kg?

La altura más frecuente entre los individuos que pesan entre 51 kg y 57 kg es 168 cm.

e) ¿Qué peso medio es más representativo el de los individuos que miden 164 cm o el de los que miden 168 cm?

$$\bar{x}_{y=164 \text{ cm}} = \frac{\sum_{i=1}^5 (x_i * n_{.i})}{N} = \frac{2 * 48 + 4 * 51 + 6 * 54 + 1 * 57}{13} = \frac{681}{13} \text{ kg} = 52,3846 \text{ kg}$$

$$\sigma_{x_{y=164 \text{ cm}}}^2 = \sum_{i=1}^5 \frac{(x_i - \bar{x})^2 n_{.i}}{N} = \frac{1080}{169} \simeq 6,3905 \text{ kg}^2$$

$$\sigma_{x_{y=164 \text{ cm}}} = \sqrt{\sigma_{x_{y=164 \text{ cm}}}^2} = \frac{6\sqrt{30}}{13}$$

$$C.V.P.(x_{y=164 \text{ cm}}) = \frac{\sigma_{x_{y=164 \text{ cm}}}}{\bar{x}_{y=164 \text{ cm}}} = 0,0482575$$

$$\bar{x}_{y=168 \text{ cm}} = \frac{\sum_{i=1}^5 (x_i * n_{.i})}{N} = \frac{2 * 51 + 5 * 54 + 8 * 57 + 4 * 60}{19} = \frac{1086}{19} \text{ kg} = 56,2105 \text{ kg}$$

$$\sigma_{x_{y=168 \text{ cm}}}^2 = \sum_{i=1}^5 \frac{(x_i - \bar{x})^2 n_{.i}}{N} = \frac{2682}{361} \simeq 7,4294 \text{ kg}^2$$

$$\sigma_{x_{y=168 \text{ cm}}} = \sqrt{\sigma_{x_{y=168 \text{ cm}}}^2} = \frac{3\sqrt{298}}{19}$$

$$C.V.P.(x_{y=168 \text{ cm}}) = \frac{\sigma_{x_{y=168 \text{ cm}}}}{\bar{x}_{y=168 \text{ cm}}} = 0,047687$$

La media más representativa es la de los individuos de 168 cm.

3. En una encuesta de familias sobre el número de individuos que la componen (X) y el número de personas activas en ellas (Y) se han obtenido los siguientes resultados:

$X \backslash Y$	1	2	3	4
1	7	0	0	0
2	10	2	0	0
3	11	5	1	0
4	10	6	6	0
5	8	6	4	2
6	1	2	3	1
7	1	0	0	1
8	0	0	1	1

- a) Calcular la recta de regresión de Y sobre X .

$$y = 0,3147x + 0,5322.$$

- b) ¿Es adecuado suponer una relación lineal para explicar el comportamiento de Y a partir de X ?
Según el coeficiente de correlación lineal

$$r = \frac{\sigma_{xy}}{\sigma_x \sigma_y} = 0,535$$

el ajuste no es el idóneo, pero los hay peores.

4. Se realiza un estudio sobre la tensión de vapor de agua (Y , en ml. de Hg.) a distintas temperaturas (X , en $^{\circ}\text{C}$). Efectuadas 21 medidas, los resultados son:

$X \backslash Y$	(0.5, 1.5]	(1.5, 2.5]	(2.5, 5.5]
(1, 15]	1	2	0
(15, 25]	1	4	2
(25, 30]	0	3	5

Explicar el comportamiento de la tensión de vapor en términos de la temperatura mediante una función lineal. ¿Es adecuado asumir este tipo de relación?

La recta de regresión es

$$y = 0,0935x + 0,608.$$

En principio sí, porque se supone que a mayor temperatura habrá mayor evaporación. Según el coeficiente de correlación lineal

$$r = \frac{\sigma_{xy}}{\sigma_x \sigma_y} = 0,6565$$

el ajuste es más o menos adecuado, pero los hay mejores.

5. Estudiar la dependencia o independencia de las variables en cada una de las siguientes distribuciones. Dar, en cada caso, las curvas de regresión y la covarianza de las dos variables.

$X \backslash Y$	1	2	3	4	5	$n_{i\cdot}$
10	2	4	6	10	8	30
20	1	2	3	5	4	15
30	3	6	9	15	12	45
40	4	8	12	20	16	60
$n_{\cdot j}$	10	20	30	50	40	150

Se aprecia que

$$n_{ij} = \frac{n_{i\cdot} \cdot n_{\cdot j}}{n} \quad \forall j = 1, 2, 3, 4, 5 \quad \forall i = 1, 2, 3, 4$$

por lo que son independientes.

Por ser independientes, la covarianza es nula:

$$\sigma_{xy} = 0.$$

No tiene sentido en este caso hacer la recta y la curva de regresión. Aunque la recta de regresión sería

$$y = 3,6$$

la curva de regresión de X sobre Y sería

$$(29, 1), (29, 2), (29, 3), (29, 4), (29, 5)$$

y la curva de regresión de Y sobre X sería

$$(10, 3,6), (20, 3,6), (30, 3,6), (40, 3,6), (50, 3,6).$$

$X \backslash Y$	1	2	3	$n_{i\cdot}$
-1	0	1	0	1
0	1	0	1	2
1	0	1	0	1
$n_{\cdot j}$	1	2	1	4

En la segunda fila y en la segunda columna hay dos frecuencias no nulas, por lo que no hay dependencia funcional.

También, se aprecia que

$$n_{11} = 0 \neq \frac{n_{1\cdot} \cdot n_{\cdot 1}}{n} = \frac{1}{4},$$

por lo que no son independientes.

$$m_{10} = \bar{x} = 0$$

$$m_{01} = \bar{y} = 2$$

$$m_{11} = 0$$

$$\sigma_{xy} = m_{11} - m_{10}m_{01} = 0$$

La covarianza es nula.

Podemos considerar una recta de regresión como

$$y = 2.$$

La curva de regresión de X sobre Y es

$$(0, 1), (0, 2), (0, 3).$$

La curva de regresión de Y sobre X es

$$(-1, 2), (0, 2), (1, 2).$$

6. Dada la siguiente distribución bidimensional:

$X \backslash Y$	1	2	3	4	$n_{i.}$
10	1	3	0	0	4
12	0	1	4	3	8
14	2	0	0	2	4
16	4	0	0	0	4
$n_{.j}$	7	4	4	5	20

a) ¿Son estadísticamente independientes X e Y?

Se aprecia que

$$n_{21} = 0 \neq \frac{n_{2.} \cdot n_{.1}}{n} = \frac{56}{20},$$

por lo que no son independientes.

b) Calcular y representar las curvas de regresión de X/Y e Y/X .

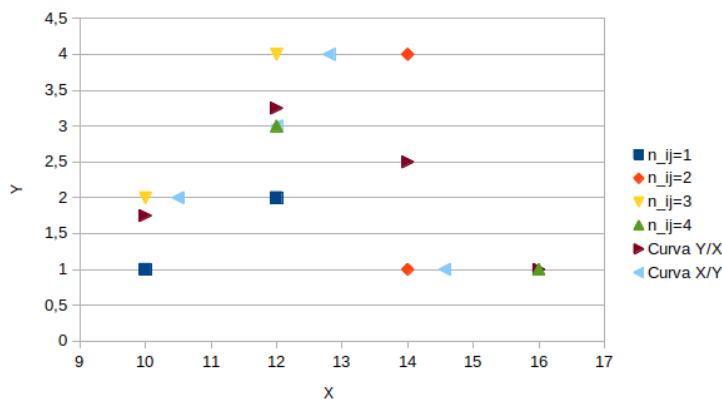
La curva de regresión de Y sobre X es

$$(10, 1'75), (12, 3'25), (14, 2'5), (16, 1).$$

La curva de regresión de X sobre Y es

$$(14'5714, 1), (10'5, 2), (12, 3), (12'8, 4).$$

Representación:



c) Cuantificar el grado en que cada variable es explicada por la otra mediante la correspondiente curva de regresión.

Esto es cuantificado por la razón de correlación η^2 :

$$\eta_{Y/X}^2 = \frac{\sigma_{ey}^2}{\sigma_y^2},$$

donde σ_{ey}^2 es la varianza explicada por la regresión

$$\sigma_{ey}^2 = \sigma_y^2 - \sigma_{ry}^2$$

donde σ_{ry}^2 es la varianza residual

$$\sigma_{ry}^2 = \sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^p f_{ij} [y_j - f(x_i)]^2$$

y σ_y^2 es la varianza de Y

$$\sigma_y^2 = \mu_{02} = \sum_{j=1}^p f_{.j} (y_j - \bar{y})^2.$$

η^2 está entre 0 y 1; cuánto más cerca esté de 1 mejor ajustada está la correlación.

$$\bar{y} = 2,35$$

$$\sigma_y^2 = 1,4275$$

$$\sigma_{ry}^2 = 0,6625$$

$$\sigma_{ey}^2 = 1,4275 - 0,6625 = 0,765$$

$$\eta_{Y/X}^2 = \frac{0,765}{1,4275} = 0,5359$$

La variable Y es parcialmente explicada por X mediante la curva de regresión de Y/X .

$$\bar{x} = 12,8$$

$$\sigma_x^2 = 4,16$$

$$\sigma_{ry}^2 = 1,8757$$

$$\sigma_{ey}^2 = 4,16 - 1,8757 = 2,2842$$

$$\eta_{X/Y}^2 = \frac{2,2842}{4,16} = 0,5491$$

La variable X es parcialmente explicada por Y mediante la curva de regresión de X/Y .

d) ¿Están X e Y correladas linealmente? Dar las expresiones de las rectas de regresión.

La correlación lineal se mide mediante el coeficiente de correlación lineal r :

$$r = \frac{\sigma_{xy}}{\sigma_x \sigma_y}$$

donde σ_{xy} es la covarianza

$$\sigma_{xy} = \mu_{11} = m_{11} - \bar{x}\bar{y}$$

donde m_{11} es el momento conjunto respecto al origen de órdenes 1 y 1,

$$m_{11} = \sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^p f_{ij} x_i y_j,$$

$\sigma_x = +\sqrt{\sigma_x^2}$ es la desviación típica de X , y recíprocamente para Y .

r está entre -1 y 1; cuánto más cerca esté de 0 menor es la correlación lineal.

$$m_{11} = 29,3$$

$$\sigma_{xy} = 29,3 - 12,8 \cdot 2,35 = -0,78$$

$$r = \frac{-0,78}{\sqrt{4,16}\sqrt{1,4275}} = -0,32008$$

La correlación lineal no explica bien la distribución.

En la recta de regresión $y = ax + b$, a es

$$a = \frac{\sigma_{xy}}{\sigma_x^2}$$

y b es

$$b = \bar{y} - \frac{\sigma_{xy}}{\sigma_x^2} \bar{x}.$$

Las expresiones de las rectas de regresión lineal son

$$y = -0,1875x + 4,75$$

y

$$x = -0,5464y + 14,08.$$

7.

8.

9.

10.

11.

12. De las estadísticas de “Tiempos de vuelo y consumos de combustible” de una compañía aérea, se han obtenido datos relativos a 24 trayectos distintos realizados por el avión DC-9. A partir de estos datos se han obtenido las siguientes medidas:

$$\begin{aligned}\sum y_i &= 219,719 & \sum y_i^2 &= 2396,504 & \sum x_i y_i &= 349,486 \\ \sum x_i &= 31,470 & \sum x_i^2 &= 51,075 & \sum x_i^2 y_i &= 633,993 \\ \sum x_i^4 &= 182,977 & \sum x_i^3 &= 93,6\end{aligned}$$

La variable Y expresa el consumo total de combustible, en miles de libras, correspondiente a un vuelo de duración X (el tiempo se expresa en horas, y se utilizan como unidades de orden inferior fracciones decimales de la hora).

- a) Ajustar un modelo del tipo $Y = aX + b$. ¿Qué consumo total se estimaría para un programa de vuelos compuesto de 100 vuelos de media hora, 200 de una hora y 100 de dos horas? ¿Es fiable esta estimación?
- Solución:* Comenzamos analizando nuestra población y los datos que tenemos: observamos que la población es de tamaño $n = 24$, además nos indican que los 24 vuelos son distintos así que $n_i = 1; \forall i \in \{1 \dots 24\}$

Una vez tomadas estas consideraciones, nos centramos en la pregunta: encontrar un ajuste lineal mediante un polinomio de grado 1. La expresión de la función será:

$$y - \bar{y} = \frac{\sigma_{xy}}{\sigma_x^2} (x - \bar{x}),$$

así que pasamos a calcular los datos necesarios:

$$\begin{aligned}\bar{x} &= \frac{1}{n} \sum x_i = \frac{31,470}{24} \approx 1,311 \text{ Horas de vuelo,} \\ \bar{y} &= \frac{1}{n} \sum y_i = \frac{219,719}{24} \approx 9,155 \text{ Miles de libras de combustible,} \\ \sigma_{xy} &= \frac{1}{n} \sum (x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y}) = m_{11} - m_{10}m_{01} = \frac{1}{n} \sum x_i y_i - \frac{1}{n^2} \sum x_i \sum y_i \approx 2,557 \\ \sigma_x^2 &= \frac{1}{n} \sum (x_i - \bar{x})^2 = \frac{1}{n} \sum x_i^2 - \bar{x}^2, \approx 0,40854\end{aligned}$$

finalmente, la recta de regresión queda:

$$y = 6,26x + 0,946.$$

Pasamos ahora a la segunda cuestión del apartado, para ello aplicamos la función obtenida:

$$6,26 \cdot 0,5 + 0,946 = 4,076 \text{ (Consumo estimado para un vuelo de media hora)}$$

$$6,26 \cdot 1 + 0,946 = 7,206 \text{ (Consumo estimado para un vuelo de una hora)}$$

$$6,26 \cdot 2 + 0,946 = 13,466 \text{ (Consumo estimado para un vuelo de dos horas)}$$

Ahora escalamos estos resultados multiplicando por el número de vuelos y sumamos todo, obteniendo un consumo total de 3195,4 miles de libras de combustible.

Para cuantificar la fiabilidad de la predicción, vamos a emplear el coeficiente de correlación lineal, dado por

$$r = \pm \sqrt{r^2} = \frac{\sigma_{xy}}{\sigma_x \sigma_y},$$

calculamos σ_x y σ_y :

$$\begin{aligned}\sigma_x &= \sqrt{\sigma_x^2} = \sqrt{0,401} \approx 0,640 \\ \sigma_y &= \sqrt{\frac{1}{n} \left(\sum y_i^2 - \frac{1}{n} \sum y_i^2 \right)} \approx 4,005,\end{aligned}$$

con estos datos, el coeficiente de correlación lineal queda 0,99758, lo que nos indica un ajuste casi perfecto y una muy alta fiabilidad.

- b) Ajustar un modelo del tipo $Y = a + bX + cX^2$. ¿Qué consumo total se estimaría para el mismo programa de vuelos del apartado a)?

Solución: Los coeficientes de nuestra función de ajuste vienen dados por las soluciones del siguiente sistema:

$$\begin{cases} m_{01} &= a_0 + a_1 m_{10} + a_2 m_{20}, \\ m_{11} &= a_0 m_{10} + a_1 m_{20} + a_2 m_{30}, \\ m_{21} &= a_0 m_{20} + a_1 m_{30} + a_2 m_{40}. \end{cases}$$

Para ello calculamos los distintos momentos valiéndonos de los datos iniciales y resolvemos el sistema, obtenemos:

$$a_0 = 0,800 \quad a_1 = 6,558 \quad a_2 = -0,112.$$

Con estos resultados nuestra función de ajuste nos queda: $Y = -0,112X^2 + 6,558X + 0,8$. Volviendo a calcular las predicciones con esta función nos queda un consumo estimado de 3198,275 miles de libras de combustible.

- c) ¿Cuál de los dos modelos se ajusta mejor? Razonar la respuesta.

Solución: Para comparar los dos modelos vamos a usar el coeficiente de correlación, definido como sigue:

$$\eta^2_{Y/X} = \frac{\sigma_{ey}^2}{\sigma_y^2},$$

donde $\sigma_{ey}^2 = \frac{1}{n} \sum (\hat{y}_j - \bar{y})^2 =$

NOTA: no está terminado el apartado c), no sé cómo hacerlo :’(

