

Estatística Descritiva

Sumário

- ▣ Medidas de tendência central
- ▣ Medidas separatrizes

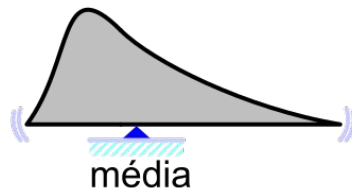
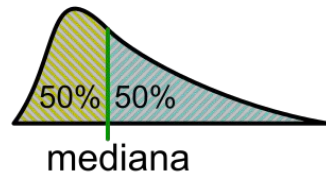
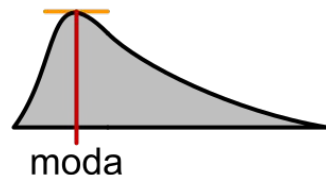
Tendência central



Tendência central

A tendência central é um conceito estatístico que procura representar uma amostra através de um único valor que sintetize o "centro" ou o ponto ao redor do qual os valores observados se distribuem. Esse valor serve como um resumo que facilita a compreensão e a comparação de diferentes amostras ou subconjuntos.

- ❑ Entre as medidas de tendência central, a mediana é um caso especial, pois é também uma medida de posição: ela indica o valor que separa a metade inferior da metade superior dos elementos (o 50º percentil) de uma amostra ordenada.





Média

É a medida de tendência central mais comum, intuitiva e amplamente conhecida. No entanto, é bastante sensível a valores extremos (*outliers*), o que pode comprometer sua qualidade como representação do centro dos valores da amostra.

❑ Média Aritmética:

- ❑ A soma de todos os valores observados, dividida pelo número de elementos na amostra.
- ❑ Adequada para valores em escala natural e sem a presença de *outliers* (extremos) que possam distorcer seu valor.

$$\bar{x} = \frac{x_1 + x_2 + \dots + x_n}{n} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i$$

Média

❑ Geométrica:

- ❑ A raiz n -ésima do produto dos n valores;
- ❑ Indicada para valores em escalas crescentes, ou proporções e percentuais;
- ❑ Mais resistente a *outliers*;
- ❑ Exemplos: aumento médio de preços (inflação), crescimento médio da dívida pública.

$$\left(\prod_{i=1}^n a_i \right)^{1/n} = \sqrt[n]{a_1 a_2 \cdots a_n}.$$

❑ Harmônica:

- ❑ Inverso da média aritmética dos inversos dos valores;
- ❑ Indicada para amostras de taxas ou proporções.
- ❑ Exemplos: rendimento médio de aplicação, proporção média entre área construída e área total de imóveis.

$$\frac{n}{\frac{1}{x_1} + \frac{1}{x_2} + \cdots + \frac{1}{x_n}}$$



Momentos amostrais

São ferramentas essenciais porque fornecem um resumo numérico que descreve as principais características da distribuição dos dados, permitindo uma compreensão inicial sobre sua forma e comportamento.

- ❑ Em termos gerais, o k -ésimo momento (ou momento de ordem k) de uma amostra é calculado como a média das k -ésimas potências dos valores (ou das diferenças dos valores em relação a algum ponto de referência, geralmente a média).

- ❑ **Momento bruto:** o primeiro momento bruto é sempre a média aritmética. A interpretação dos demais depende de contexto.

$$m_k = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^k$$

- ❑ **Momento central:** o primeiro momento central é sempre zero. O segundo é a variância.

$$m_k = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^k$$



Momentos amostrais

❑ **Identificação de Padrões:**

- ❑ A média (primeiro momento) indica a tendência central.
- ❑ A variância (segundo momento central) indica a dispersão, ajudando a identificar a homogeneidade ou heterogeneidade dos dados.
- ❑ A assimetria (terceiro momento central) revela se os dados estão inclinados para a direita ou para a esquerda.
- ❑ A curtose (quarto momento central) indica se os dados possuem caudas pesadas ou leves comparadas a uma distribuição normal.

❑ **Comparação de Distribuições:** Permitem comparar diferentes conjuntos de dados ou verificar se os dados seguem uma distribuição conhecida (como a normal), o que pode ser crucial para a escolha de métodos estatísticos e modelagem.

❑ **Identificação de Outliers:** Uma alta variância ou uma assimetria acentuada podem sugerir a presença de *outliers*, que precisam ser investigados ou tratados adequadamente.



Moda

É a observação (ou classe) com maior frequência (maior número de ocorrências na amostra).

- ❑ Caso duas ou mais classes apresentem a mesma frequência, a amostra pode ser considerada bimodal ou multimodal.
- ❑ Caso todas as classes tenham a mesma frequência, a amostra é considerada amodal.
- ❑ Em muitos casos, no entanto, a amostra é dita 'amodal' pela inexistência de uma classe com frequência absoluta maior que todas as outras;



Mediana

É o valor que ocupa a posição central de uma amostra ordenada. De modo que 50% dos valores observados na amostra estão abaixo da mediana, e 50% acima.

- ❑ Se o número de observações for ímpar, a mediana é o valor central;
- ❑ Se for par, é a média dos dois valores centrais.



Média

Exemplo de fragilidade da média.

- ❑ Média da receita: R\$ 77.545,45;
- ❑ Média de anos: 4,81 anos;

Investidor	Anos de pregão	Receita último período (R\$)
Obadias	1	21.000,00
Ageu	2	38.000,00
Naum	3	47.000,00
Jonas	4	48.000,00
Sofonias	3	53.000,00
Malaquias	4	55.000,00
Habacuque	3	56.000,00
Joel	3	73.000,00
Miquéias	7	105.000,00
Amós	9	146.000,00
Zacarias	14	211.000,00



Média

Exemplo de fragilidade da média.

- ❑ Média da receita: R\$ 178.550,00;
- ❑ Média de anos: 9.91 anos;

Investidor	Anos de pregão	Receita último período (R\$)
Obadias	1	21.000,00
Ageu	2	38.000,00
Naum	3	47.000,00
Jonas	4	48.000,00
Sofonias	3	53.000,00
Malaquias	4	55.000,00
Habacuque	3	56.000,00
Joel	3	73.000,00
Miquéias	7	105.000,00
Amós	9	146.000,00
Zacarias	14	211.000,00
Isaías	66	1.292.000,00

Média

Exemplo de fragilidade da média.

- ❑ Receita:
 - ❑ Média: R\$ 178.550,00;
 - ❑ Média geométrica: R\$ 81.792,76
 - ❑ Média harmônica: R\$ 58.101,04
 - ❑ Mediana: R\$ 55.500,00;
 - ❑ Moda: indefinida/amodal;
- ❑ Anos:
 - ❑ Média: 9.91 anos;
 - ❑ Média geométrica: 4.8 anos;
 - ❑ Média harmônica: 3.26 anos;
 - ❑ Mediana: 3.5 anos;
 - ❑ Moda: 3 anos;

Investidor	Anos de pregão	Receita último período (R\$)
Obadias	1	21.000,00
Ageu	2	38.000,00
Naum	3	47.000,00
Jonas	4	48.000,00
Sofonias	3	53.000,00
Malaquias	4	55.000,00
Habacuque	3	56.000,00
Joel	3	73.000,00
Miquéias	7	105.000,00
Amós	9	146.000,00
Zacarias	14	211.000,00
Isaías	66	1.292.000,00

Obs.: MA > MG > MH



Medidas populacionais vs amostrais

- ❑ Medidas Populacionais: Calculadas com dados de toda a população.
 - ❑ Exemplo: Média populacional (μ), Variância populacional (σ^2).
 - ❑ Vantagem: Precisão, pois utiliza todos os dados.
 - ❑ Limitação: Muitas vezes impraticável ou custosa de se obter.
- ❑ Medidas Amostrais: Calculadas com base nos dados da amostra.
 - ❑ Exemplo: Média amostral (\bar{x}), Variância amostral (s^2).
 - ❑ Vantagem: Viabilidade prática e redução de custos.
 - ❑ Limitação: Estimativas sujeitas a erro de amostragem e variabilidade.



Erro amostral

É a discrepância entre um parâmetro populacional (como a média real de uma população) e a estimativa desse parâmetro obtida a partir de uma amostra.

- ❑ Reflete a variabilidade natural do processo de amostragem;
- ❑ **Erro tolerável (E_0):** a margem máxima de erro que se aceita em um processo de medição ou estimativa sem comprometer a qualidade, a confiabilidade ou a tomada de decisão. Essa tolerância é definida com base em critérios técnicos, normativos ou práticos e serve como um limite para avaliar se um.
- ❑ Tamanho mínimo da amostra:
 - ❑ Aproximação n_0 (sem conhecimento do tamanho da população):
$$n_0 = \frac{1}{E_0^2}$$
 - ❑ Refinamento n (com tamanho da população N definido):
$$n = \frac{N \cdot n_0}{N + n_0}$$



Erro médio

Medida que representa a diferença, em média, entre os valores observados (ou medidos) e os valores esperados (ou reais). Em outras palavras, ele indica o viés ou a precisão média de um conjunto de medições ou estimativas.

- ❑ **Erro médio absoluto:** utiliza o valor absoluto das diferenças, evitando que erros positivos e negativos se cancelem;

$$MAE = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n |y_i - p_i|$$

- ❑ **Erro quadrático médio:** média aritmética do desvio quadrático de cada observação.

$$MSE = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (Y_i - \hat{Y}_i)^2$$

Prática





Exercícios:

1. Escolha uma variável contínua em sua amostra e identifique sua moda, média e mediana.
 - 1.1. Anote no caderno de análise se essas medidas são coincidentes e qual a interpretação associada (tanto para o caso afirmativo, quanto negativo);
 - 1.2. Identifique também as médias geométrica e harmônica, recorrendo a respeito de qual delas apresenta uma melhor informação acerca da amostra.
2. Exiba um histograma da variável escolhida, acrescentando:
 - 2.1. Uma linha vertical azul para indicar a moda;
 - 2.2. Uma linha vertical verde para marcar a média;
 - 2.3. E uma linha vertical cinza para indicar a mediana.

Medidas Separatrizes





Medidas separatrizes

Valores limítrofes das posições que dividem uma amostra ordenada em partes iguais, auxiliando na compreensão da distribuição dos dados.

- ❑ Ajudam a identificar a posição relativa de cada observação dentro da distribuição, facilitando a análise da dispersão e a identificação de assimetrias e outliers.
- ❑ **Quartis:** dividem uma amostra ordenada em quatro partes iguais.
 - ❑ Primeiro quartil (Q1): valor que delimita os 25% menores valores observados
 - ❑ Segundo quartil (Q2): coincide com a mediana, representando 50% dos elementos
 - ❑ Terceiro quartil (Q3): valor que delimita os 75% dos dados
- ❑ **Percentis:** dividem uma amostra ordenada em 100 partes iguais. Por exemplo, quando um valor está no percentil 75, significa que ele é maior que 75% dos dados da distribuição e menor que 25% dos valores restantes.



Medidas separatrizes

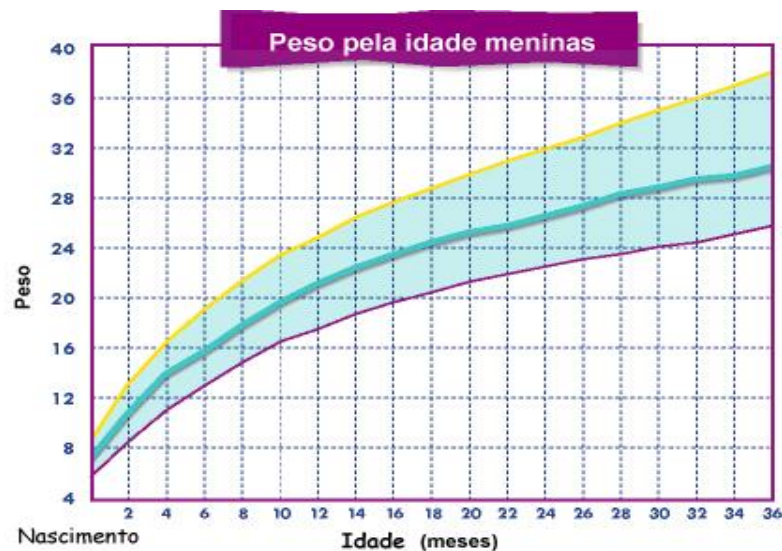
- ❑ **Quantis:** generalização dos quartis e percentis, sendo valores que dividem um conjunto ordenado de dados em partes iguais. Assim:
 - ❑ Quartis são quantis que dividem em 4 partes;
 - ❑ Percentis são quantis que dividem em 100 partes;
 - ❑ Decis são quantis que dividem em 10 partes;
- ❑ **Aplicações:**
 - ❑ Análise da distribuição de elementos na amostra;
 - ❑ Identificação de valores extremos;
 - ❑ Comparação de posições relativas;

Medidas Separatrizes

Exemplo de uso do percentil



— Percentil 95%
— Percentil 50%
— Percentil 5%

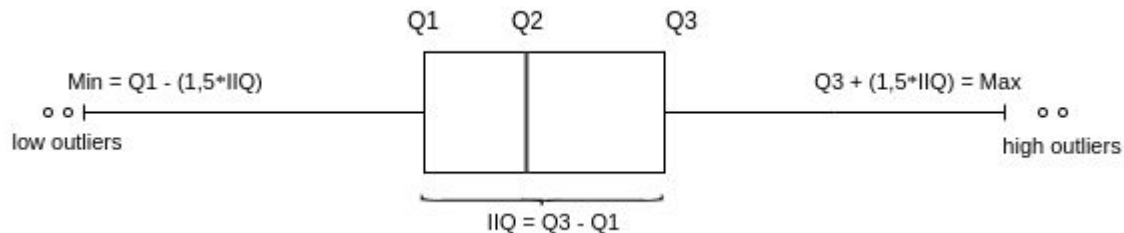


— Percentil 95%
— Percentil 50%
— Percentil 5%



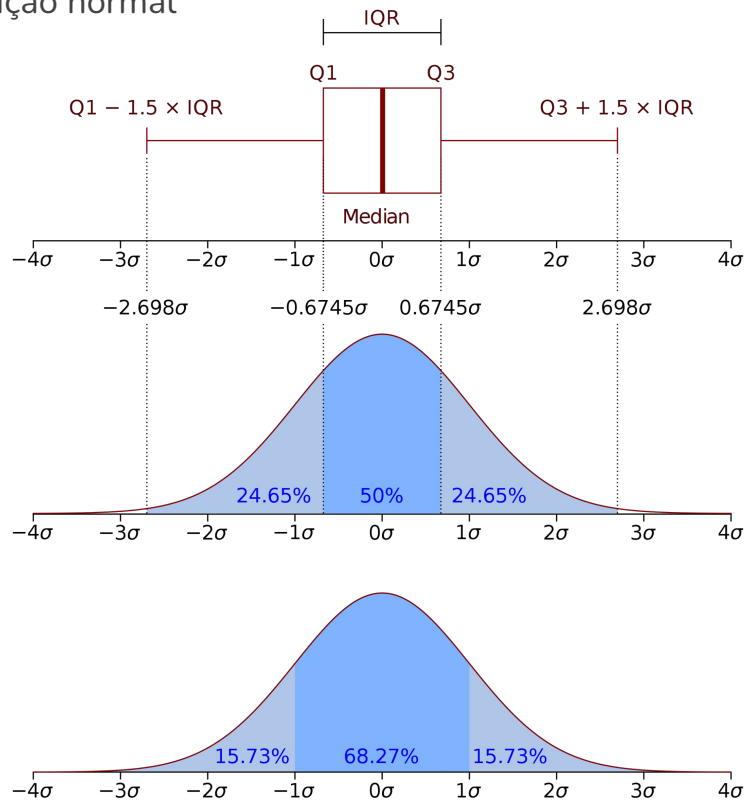
Boxplot

- ❑ O *boxplot* é uma ferramenta visual, utilizada para informar a distribuição das observações de uma amostra ao longo dos quartis.



Medidas separatrizes

Relação entre boxplot e distribuição normal



Prática





Tópicos para discussão:

- ❑ Escolha uma variável quantitativa em seu dataset e exiba um boxplot.
- ❑ Identifique a existência, ou não, de *outliers*
- ❑ Compare o primeiro e terceiro quartil de sua amostra, discorra em seu cader sobre os achados

Obrigado

Stefano Mozart

linkedin.com/in/stefano-mozart/

github.com/stefanomozart

