

Medidas resumo

Wagner H. Bonat
Elias T. Krainski
Fernando P. Mayer

Universidade Federal do Paraná
Departamento de Estatística
Laboratório de Estatística e Geoinformação

27/03/2018



Sumário

1 Introdução

2 Medidas de posição

- Medidas de posição para um conjunto de dados
- Medidas de posição para VAs discretas

3 Medidas de dispersão

- Medidas de dispersão para um conjunto de dados
- Medidas de dispersão para VAs discretas

4 Exercícios recomendados

Introdução

Características importantes de qualquer conjunto de dados

- Centro
- Variação
- Distribuição
- Valores atípicos

Sumário

1 Introdução

2 Medidas de posição

- Medidas de posição para um conjunto de dados
- Medidas de posição para VAs discretas

3 Medidas de dispersão

- Medidas de dispersão para um conjunto de dados
- Medidas de dispersão para VAs discretas

4 Exercícios recomendados

Definição

É um valor no centro, ou meio, do conjunto de dados

Ferramentas para **resumo** e **análise** de dados

- Média
- Mediana
- Moda

Moda

A **moda** é o valor que ocorre com **maior frequência** em um conjunto de dados

Dependendo do conjunto de dados, ele pode ser

- **Sem moda** quando nenhum valor se repete
- **Unimodal** quando existe apenas um valor repetido com maior frequência
- **Bimodal** quando existem dois valores com a mesma maior frequência
- **Multimodal** quando mais de dois valores se repetem com a mesma frequência

Mediana

A **mediana** é uma medida de centro que é o **valor do meio**, quando os dados são arranjados de maneira **ordenada**

É o valor cuja posição separa o conjunto de dados em duas partes iguais

Quando as observações são ordenadas em ordem crescente, vamos denotar a menor observação por $x_{(1)}$, a segunda por $x_{(2)}$, e assim por diante, obtendo-se

$$x_{(1)} \leq x_{(2)} \leq \cdots \leq x_{(n-1)} \leq x_{(n)}$$

Estas observações ordenadas são chamadas de **estatísticas de ordem**.

Média

A **média aritmética** de um conjunto de dados é a medida de tendência central encontrada pela soma de todos os valores, dividida pelo número total de elementos, ou seja,

$$\bar{x}_{obs} = \frac{x_1 + x_2 + \cdots + x_n}{n} = \frac{\sum_{i=1}^n x_i}{n}.$$

Se os dados estiverem organizados em uma tabela de frequência, a média pode ser obtida com

$$\bar{x}_{obs} = \frac{n_1 x_1 + n_2 x_2 + \cdots + n_k x_k}{n_1 + n_2 + \cdots + n_k} = \frac{\sum_{i=1}^k n_i x_i}{n}.$$

Média

Como exemplo, considere a tabela de frequência abaixo:

Número	n_i	f_i
0	4	0,20
1	5	0,25
2	7	0,35
3	3	0,15
5	1	0,05
Total	20	1

A média é calculada por:

$$\begin{aligned}\bar{x}_{obs} &= \frac{1}{20} \cdot (0 \cdot 4 + 1 \cdot 5 + \dots + 5 \cdot 1) \\ &= \frac{1}{20} \cdot (33) \\ &= 1,65\end{aligned}$$

Média

Para variáveis resumidas em classes de valores, podemos usar o **ponto médio** de cada classe. Por exemplo:

Classe	n_i	f_i
[4, 8)	10	0,278
[8, 12)	12	0,333
[12, 16)	8	0,222
[16, 20)	5	0,139
[20, 24)	1	0,028
Total	36	1

Considerando os pontos médios de cada classe, a média é calculada por

$$\begin{aligned}\bar{x}_{obs} &= \frac{1}{36} \cdot (6 \cdot 10 + 10 \cdot 12 + \dots + 22 \cdot 1) \\ &= \frac{1}{36} \cdot (404) \\ &= 11,22\end{aligned}$$

Exemplo 4.1

Suponha que parafusos a serem utilizados em tomadas elétricas são embalados em caixas rotuladas como contendo 100 unidades. Em uma construção, 10 caixas de um lote tiveram o número de parafusos contados, fornecendo os valores 98, 102, 100, 100, 99, 97, 96, 95, 99 e 100. Calcular média, mediana e moda.

- $\bar{x}_{obs} = 98.6$.
- $md_{obs} = 99$.
- $mo_{obs} = 100$.

Média e mediana

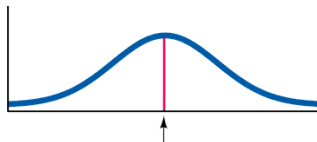
Para notar como a média é influenciada pela presença de valores extremos (se ao invés de 95, o valor fosse 45):

$$95 \ 96 \ 97 \ 98 \ 99 \ 99 \ 100 \ 100 \ 100 \ 102 \quad \Rightarrow \quad \bar{x}_{obs} = 98,6 \text{ e } Md = 99$$

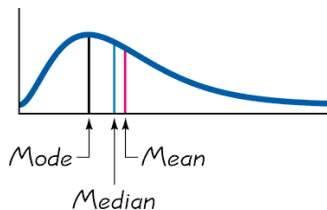
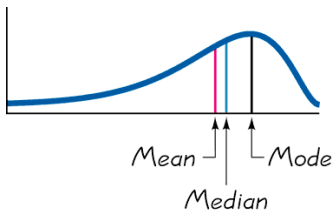
$$45 \ 96 \ 97 \ 98 \ 99 \ 99 \ 100 \ 100 \ 100 \ 102 \quad \Rightarrow \quad \bar{x}_{obs} = 93,6 \text{ e } Md = 99$$

Nos casos onde se deseja comparar bases de dados diferentes, normalmente a mediana é mais indicada, por ser uma medida mais **robusta**, *não influenciada por valores extremos*.

Média, mediana e moda



$$\text{Mode} = \text{Mean} = \text{Median}$$



Exemplo 4.4

Um estudante está procurando um estágio para o próximo ano. As companhias A e B têm programas de estágios e oferecem uma remuneração por 20 horas semanais com as seguintes características.

Companhia	A	B
média	2,5	2,0
mediana	1,7	1,9
moda	1,5	1,9

Qual companhia você escolheria?

Exemplo 4.3

Foram coletadas 150 observações da variável X , representando o número de vestibulares FUVEST (um por ano) que um mesmo estudante prestou. Com os dados da tabela abaixo, calcule as medidas de posição de X .

X	n_i
1	75
2	47
3	21
4	7

Suponha ainda que o interesse é estudar o gasto dos alunos associado com as despesas do vestibular. Para simplificar, suponha que se atribui para cada aluno, uma despesa fixa de 1300,00 relativa a preparação e mais 50 para cada vestibular prestado. Calcule as medidas de posição central para a variável D (despesa com vestibular).

Medidas de posição para VAs discretas

Sabemos que a descrição completa do comportamento de uma VA discreta é feita através de sua **função de probabilidade**.

Assim como fizemos para um conjunto de dados qualquer, podemos obter as medidas de posição para qualquer variável aleatória.

Lembrando que os possíveis valores de uma VA X sejam x_1, x_2, \dots, x_n , com correspondentes probabilidades p_1, p_2, \dots, p_k , então as medidas de posição podem ser definidas a seguir.

Medidas de posição para VAs discretas

A Média é chamada de **valor esperado** ou **esperança**

$$E(X) = \sum_{i=1}^k x_i p_i.$$

A Mediana é o valor Md que satisfaz as seguintes condições

$$P(X \geq Md) \geq 1/2 \quad \text{e} \quad P(X \leq Md) \leq 1/2.$$

A Moda é o valor (ou valores) com maior probabilidade de ocorrência

$$P(X = Mo) = \max\{p_1, p_2, \dots, p_k\}.$$

Exemplo 4.5

Considere a VA X com a seguinte função discreta de probabilidade:

X	-5	10	15	20
p_i	0.3	0.2	0.4	0.1

Calcule as medidas de tendência central.

Exemplo 4.6

Considere uma VA X com função de probabilidade dada por

X	2	5	8	15	20
p_i	0.1	0.3	0.2	0.2	0.2

Calcule as medidas de posição para a VA $Y = 5X - 10$.

Sumário

1 Introdução

2 Medidas de posição

- Medidas de posição para um conjunto de dados
- Medidas de posição para VAs discretas

3 Medidas de dispersão

- Medidas de dispersão para um conjunto de dados
- Medidas de dispersão para VAs discretas

4 Exercícios recomendados

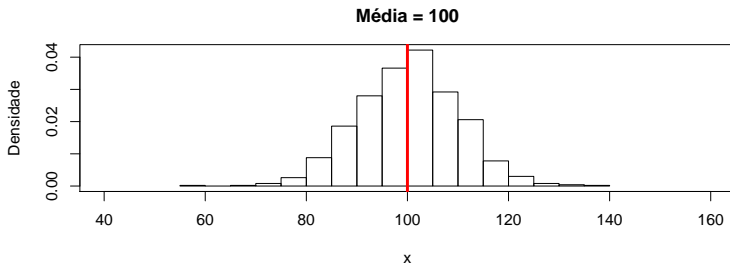
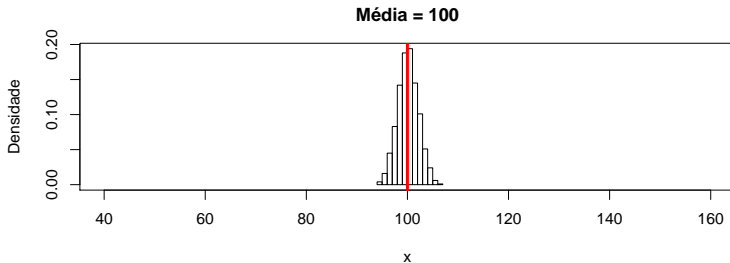
Introdução

O resumo de um conjunto de dados exclusivamente por uma medida de centro, **esconde** toda a informação sobre a variabilidade do conjunto de observações.

Não é possível analisar um conjunto de dados apenas através de uma medida de tendência central.

Por isso precisamos de medidas que resumam a **variabilidade** dos dados em relação à um valor central

Introdução



Introdução

Cinco grupos de alunos se submeteram a um teste, obtendo as seguintes notas

Grupo	Notas	\bar{x}
A	3, 4, 5, 6, 7	5
B	1, 3, 5, 7, 9	5
C	5, 5, 5, 5, 5	5
D	3, 5, 5, 7	5
E	3, 5, 5, 6, 6	5

O que a média diz a respeito das notas quando comparamos os grupos?

Definição

São medidas estatísticas que caracterizam o quanto um conjunto de dados está disperso em torno de sua tendência central.

Ferramentas para **resumo** e **análise** de dados:

- Amplitude
- Desvio-médio (ou mediano)
- Variância
- Desvio-padrão
- Coeficiente de Variação

Amplitude

A **amplitude** de um conjunto de dados é a diferença entre o maior e o menor valor.

$$\Delta = \max - \min$$

Como a amplitude usa **apenas** os valores máximo e mínimo, é muito **sensível** a valores extremos.

Para melhorar a medida de variabilidade, devemos considerar **todos os dados disponíveis**.

A melhor forma de se fazer isso é considerar o **desvio** de cada valor em relação à uma medida de posição (média ou mediana).

Desvio médio e mediano

Como queremos um **resumo** da variabilidade, devemos fazer a **média** dos desvios dos valores **absolutos**.

Se a medida de tendência central utilizada for a mediana, então temos o **desvio mediano**

$$\text{desvio mediano} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n |x_i - md_{obs}|.$$

Mas se a média for utilizada, então temos o **desvio médio**

$$\text{desvio médio} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n |x_i - \bar{x}_{obs}|.$$

Desvio médio

Considere as notas do grupo A do exemplo acima ($\bar{x} = 5$). O desvio médio (DM) pode ser calculado da seguinte forma:

Grupo A	$x_i - \bar{x}$	$ x_i - \bar{x} $
3	-2	2
4	-1	1
5	0	0
6	1	1
7	2	2
Soma	0	6

$$DM = \frac{6}{5} = 1,2$$

Mas, o desvio médio é baseado em uma operação **não algébrica** (módulo), o que torna mais difícil o estudo de suas propriedades.

Variância e desvio-padrão de um conjunto de dados

Uma alternativa melhor seria usar a **soma dos quadrados dos desvios**, que dá origem à **variância** de um conjunto de dados

$$var_{obs} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x}_{obs})^2$$

Para manter as mesmas unidades dos dados originais, definimos o **desvio padrão** como

$$dp_{obs} = \sqrt{var_{obs}}$$

Uma expressão alternativa da variância (mais fácil de calcular) é

$$var_{obs} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2 - \bar{x}_{obs}^2$$

Exemplo

No exemplo anterior

Grupo A	$x_i - \bar{x}$	$ x_i - \bar{x} $	$(x_i - \bar{x})^2$	x_i^2
3	-2	2	4	9
4	-1	1	1	16
5	0	0	0	25
6	1	1	1	36
7	2	2	4	49
Soma	0	6	10	135

A variância é

$$var_{obs} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x}_{obs})^2 = var_{obs} = \frac{10}{5} = 2.$$

Ou, usando a fórmula alternativa

$$var_{obs} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2 - \bar{x}_{obs}^2 = var_{obs} = \frac{135}{5} - 5^2 = 2.$$

Coeficiente de variação

O **coeficiente de variação** para um conjunto de dados é definido por

$$CV_{obs} = \frac{dp_{obs}}{\bar{x}_{obs}}$$

É uma medida **adimensional**, e geralmente apresentada na forma de porcentagem.

No exemplo anterior: $dp_{obs} = \sqrt{var_{obs}} = \sqrt{2} = 1,414$.

Portanto:

$$CV_{obs} = \frac{dp_{obs}}{\bar{x}_{obs}} = \frac{1,414}{5} = 0,283 \approx 2,8\%$$

Variância em tabelas de frequência

Assim como no caso da média, se tivermos n observações da variável X , das quais n_1 são iguais a x_1 , n_2 são iguais a x_2 , \dots , n_k são iguais a x_k , então a variância pode ser definida por:

$$var_{obs}(X) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n n_i (x_i - \bar{x}_{obs})^2$$

Ou, pela fórmula alternativa:

$$var_{obs}(X) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n n_i x_i^2 - \bar{x}_{obs}^2$$

Exemplo

Como exemplo, considere a tabela de frequência abaixo ($\bar{x} = 1,65$):

Número	n_i	f_i	$x_i - \bar{x}$	$(x_i - \bar{x})^2$
0	4	0,20	-1,65	2,72
1	5	0,25	-0,65	0,42
2	7	0,35	0,35	0,12
3	3	0,15	1,35	1,82
5	1	0,05	3,35	11,22
Total	20	1		

A variância pode ser calculada por:

$$\begin{aligned}
 var_{obs} &= \frac{1}{20} \cdot [4 \cdot 2,72 + 5 \cdot 0,42 + \dots + 1 \cdot 11,22] \\
 &= \frac{1}{20} \cdot (30,55) \\
 &= 1,528
 \end{aligned}$$

Exemplo

Considere a seguinte tabela de distribuição de frequência ($\bar{x} = 11,22$):

Classe	PM = x_i	n_i	f_i	$x_i - \bar{x}$	$(x_i - \bar{x})^2$
[4, 8)	6	10	0,278	-5,222	27,272
[8, 12)	10	12	0,333	-1,222	1,494
[12, 16)	14	8	0,222	2,778	7,716
[16, 20)	18	5	0,139	6,778	45,938
[20, 24)	22	1	0,028	10,778	116,160
Total		36	1		

Considerando os **pontos médios** de cada classe como os valores x_i , a variância pode ser calculada por

$$\begin{aligned}
 var_{obs} &= \frac{1}{36} \cdot [10 \cdot 27,272 + 12 \cdot 1,494 + \dots + 1 \cdot 116,160] \\
 &= \frac{1}{36} \cdot (698,22) \\
 &= 19,395
 \end{aligned}$$

Exemplo 4.9

No Exemplo 4.3, definimos a quantidade D , despesa no vestibular, obtida a partir de X pela expressão $D = 50X + 1300$, com X indicando o número de vestibulares prestados.

X	n_i
1	75
2	47
3	21
4	7

Calcule a variância de D .

Fazer também: Exemplo 4.10.

Variância de uma va

- $Var(X) = \sum_{i=1}^k (x_i - \mu)^2 p_i.$
- $Var(X) = E[(X - \mu)^2] = E(X^2) - E^2(X).$
- Ver Tabelas resumo 4.2 e 4.3 pg. 111.

Exemplo 4.11

Uma pequena cirurgia dentária pode ser realizada por três métodos diferentes cujos tempos de recuperação (em dias) são modelados pelas variáveis X_1 , X_2 e X_3 . Admita suas funções de probabilidades são dadas por

X_1	0	4	5	6	10
p_i	0.2	0.2	0.2	0.2	0.2

X_2	1	5	9
p_i	1/3	1/3	1/3

X_3	4	5	6
p_i	0.3	0.4	0.3

Calcule as medidas de posição central e dispersão para cada VA e decida sobre o método mais eficiente.

Esperança e variância de modelos teóricos

- Exemplo 4.14: Seja X com distribuição Bernoulli de parâmetro p . Calcule a esperança e a variância de X .
- Exemplo 4.15: Seja X com distribuição Binomial parâmetros n e p . Calcule a esperança e a variância de X .
- Ver resultados da Tabela 4.4 pg. 113.

Sumário

1 Introdução

2 Medidas de posição

- Medidas de posição para um conjunto de dados
- Medidas de posição para VAs discretas

3 Medidas de dispersão

- Medidas de dispersão para um conjunto de dados
- Medidas de dispersão para VAs discretas

4 Exercícios recomendados

Exercícios recomendados

- Seção 4.2 - 1, 2, 3, 4 e 6.
- Seção 4.3 - 1, 2, 3, 4, 5 e 6.