# Modulo II - Introdução à Estatística Básica

Umberto Mignozzetti

6/1/2020

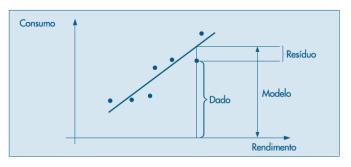




- Objetivo Stat é analisar dados.
- ► Três etapas:
  - 1. Entender os dados: análise descritiva
  - 2. Modelar os dados: probabilidade
  - 3. Formular hipóteses: inferencia estatística

 Modelagem: propor uma representação que explique a maior parte da variabilidade dos dados

Figura 1.1: Relação entre consumo e rendimento.



Podemos, então, escrever de modo esquemático:

Figure 1: f1

- Gráficos: visualizar os dados que temos.
- Objetivos:
  - Buscar padrões
  - Checar expectativas
  - Descobrir fenômenos
  - Confirmar suposições
  - Apresentar resultados
- Altamente recomendável!

- Softwares estatísticos:
  - ► R / S+
  - ► SPSS / PSPP
  - Excel / Calc
  - ► SAS
  - Stata
- ▶ Qual usar? Qual vc preferir. (Esse tipo de pergunta importa?!)
- Eu uso R. Motivo: de graça e bom!

# Medidas Resumo

#### Tipos de variáveis

- Qualitativas: descrevem atributos dos casos:
  - Pessoa casada
  - Votou no Bolsonaro
  - Cidade com mais Corona no Brasil
  - Superior completo...
- Quantitativas: realizações de uma contagem / mensuração
  - Idade
  - Renda
  - Numero de ligações

### Tipos de variáveis

Qualitativas:

► Nominais: sexo

Ordinais: escolaridade

Quantitativas:

Discretas: numero de filhos

Contínuas: salário

#### Tipos de variáveis

##

Classifique o banco:

```
dat <- read.csv('https://raw.githubusercontent.com/umberton
head(dat)
```

```
##
    N Estado. Civil Grau. de. Instrução N. de. Filhos Salario
           solteiro ensino fundamental
## 1 1
                                                 NΑ
## 2.2
             casado ensino fundamental
## 3 3
             casado ensino fundamental
## 4 4
           solteiro
                          ensino médio
                                                 NA
## 5 5
           solteiro ensino fundamental
                                                 NA
## 6 6
             casado ensino fundamental
##
```

Região.de.Procedência ## 1 interior

## 2 capital

capital ## 3

## 4 outra

outra

interior

## Tabela de frequência

- Contagem de valores para cada um dos níveis pré-definidos
- ► E.g., Grau de Instrução:

Tabela 2.2: Freqüências e porcentagens dos 36 empregados da seção de orçamentos da Companhia MB segundo o grau de instrução.

Grau de	Freqüência	Proporção	Porcentagem 100 f <sub>i</sub>
instrução	n <sub>1</sub>	f <sub>i</sub>	
Fundamental	12	0,3333	33,33
Médio	18	0,5000	50,00
Superior	6	0,1667	16,67
Total	36	1,0000	100,00

Figure 2: f2

# Tabela de frequência

Tabela 2.2: Freqüências e porcentagens dos 36 empregados da seção de orçamentos da Companhia MB segundo o grau de instrução.

Grau de instrução	Freqüência n <sub>i</sub>	Proporção $f_{_{\!f}}$	Porcentagem 100 f <sub>i</sub>
Fundamental Médio Superior	12 18 6	0,3333 0,5000 0,1667	33,33 50,00 16,67
Total	36	1,0000	100,00

Figure 3: f2

#### Stats:

Contagem

Frequencia (relativa):  $f_i = \frac{n_i}{n}$ Porcentagem:  $prop_i = 100 \times \frac{n_i}{n}$ 

#### Tabela de frequência

- Para uma variável quanti, temos o seguinte:
  - 1. Criamos intervalos
  - 2. Contamos valores nos intervalos

**Tabela 2.4:** Freqüências e porcentagens dos 36 empregados da seção de orçamentos da Companhia MB por faixa de salário.

Classe de salários	Freqüência n,	Porcentagem 100 f,
4,00 ⊢ 8,00	10	27,78
8,00 ← 12,00	12	33,33
12,00 ← 16,00	8	22,22
16,00 ← 20,00	5	13,89
20,00 ← 24,00	1	2,78
Total	36	100,00

Fonte: Tabela 2.1.

Figure 4: f3

#### Gráficos

Basta colocar as tabelas que montamos em figuras!?

Figura 2.2: Gráfico em barras para a variável Y: grau de instrução.

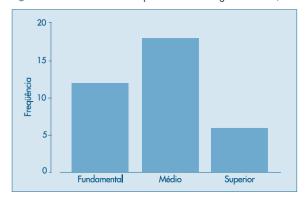
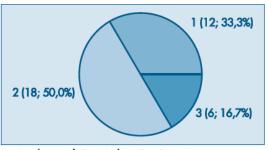


Figure 5: f4

#### Gráficos

Basta colocar as tabelas que montamos em figuras!?

Figura 2.3: Gráfico em setores para a variável Y: grau de instrução.



1 = Fundamental, 2 = Médio e 3 = Superior

Figure 6: f5

#### Gráficos

Basta colocar as tabelas que montamos em figuras!?

Figura 2.7: Histograma da variável S: salários.

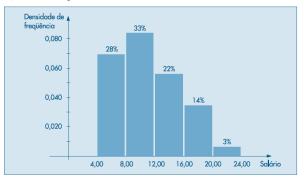


Figure 7: f6

#### Exercício

 As taxas médias geométricas de incremento anual (por 100 habitantes) dos 30 maiores municípios do Brasil estão dadas abaixo.

3,67	1,82	3,73	4,10	4,30
1,28	8,14	2,43	4,17	5,36
3,96	6,54	5,84	7,35	3,63
2,93	2,82	8,45	5,28	5,41
7,77	4,65	1,88	2,12	4,26
2,78	5,54	0,90	5,09	4,07

(a) Construa um histograma.

Figure 8: f7

Medidas-Resumo

#### Medidas Resumo

- Dois tipos mais importantes:
  - Posição
  - Dispersão
- Além dessas, temos algumas outras que são boas para analisar os dados.

# Medidas de posição

Média:

$$\bar{x} = \frac{\sum_{i=1}^{n} x_i}{n}$$

► Média (com frequências relativas):

$$\bar{x} = \frac{\sum_{i=1}^{k} f_i x_i}{n}$$

Exercício: calcule a média dos dados: 1,5,2,3,2,4,10

#### Medidas de posição

Posição e medidas de ordem: em que lugar está o dado se ordenarmos?

Consideremos, agora, as observações ordenadas em ordem crescente. Vamos denotar a menor observação por  $x_{(1)}$ , a segunda por  $x_{(2)}$ , e assim por diante, obtendo-se

$$X_{(1)} \le X_{(2)} \le \dots \le X_{(n-1)} \le X_{(n)}.$$
 (3.4)

Por exemplo, se  $x_1=3$ ,  $x_2=-2$ ,  $x_3=6$ ,  $x_4=1$ ,  $x_5=3$ , então  $-2 \le 1 \le 3 \le 3$ , de modo que  $x_{(1)}=-2$ ,  $x_{(2)}=1$ ,  $x_{(3)}=3$ ,  $x_{(4)}=3$  e  $x_{(5)}=6$ .

Figure 9: f8

**E**x.:

$$x \leftarrow c(3,-2,6,1,3)$$

## [1] 3 -2 6 1 3

# Medidas de posição

► Mediana:

 $x \leftarrow c(3,-2,6,1,3)$ 

## [1] 3 -2 6 1 3 sort(x)

## [1] -2 1 3 3 6

median(x)

## [1] 3

$$\operatorname{md}(X) = \begin{cases} \frac{X_{\left(\frac{n+1}{2}\right)}}{2}, & \text{se } n \text{ impar;} \\ \frac{X_{\left(\frac{n}{2}\right)} + X_{\left(\frac{n}{2} + 1\right)}}{2}, & \text{se } n \text{ par.} \end{cases}$$

## Medidas de dispersão

Suponha as notas dos alunos em cinco grupos:

```
grupo A (variável X): 3, 4, 5, 6, 7 grupo B (variável Y): 1, 3, 5, 7, 9 grupo C (variável Z): 5, 5, 5, 5, 5 grupo D (variável W): 3, 5, 5, 7 grupo E (variável V): 3, 5, 5, 6, 6
```

Figure 11: f10

Exercício: quais são as médias? Elas ajudam a diferenciar esses dados?

### Medidas de dispersão

- Não ajudam nesses casos: os dados acima eram claramente diferentes!
- Duas medidas mais usadas: desvio-médio absoluto e variância.

$$dm(X) = \frac{\sum_{i=1}^{n} |X_i - \overline{X}|}{n},$$

$$var(X) = \frac{\sum_{i=1}^{n} (X_i - \overline{X})^2}{n},$$

Figure 12: f11

 Exercício: vamos fazer no R? Considere os dados do exercício acima.

#### Medidas de dispersão: exercício

- Quer se estudar o número de erros de impressão de um livro. Para isso escolheu-se uma amostra de 50 páginas, encontrando-se o número de erros por página da tabela abaixo.
  - (a) Qual o número médio de erros por página?
  - (b) E o número mediano?
  - (c) Qual é o desvio padrão?
  - (d) Faça uma representação gráfica para a distribuição.
  - (e) Se o livro tem 500 páginas, qual o número total de erros esperado no livro?

Erros	Freqüência
0	25
1	20
2	3
3	1
4	1

Figure 13: f12

**►** □...

- Apenas com média e desvio-padrão não temos ideia do que está acontecendo nos dados:
  - Valores extremos?
  - Assimetria?
- Quantís: boas medidas de resumo dos dados
- Posição e medidas de ordem: em que lugar está o dado se ordenarmos?

Consideremos, agora, as observações ordenadas em ordem crescente. Vamos denotar a menor observação por  $x_{(1)}$ , a segunda por  $x_{(2)}$ , e assim por diante, obtendo-se

$$X_{(1)} \le X_{(2)} \le \dots \le X_{(n-1)} \le X_{(n)}.$$
 (3.4)

Por exemplo, se  $x_1=3$ ,  $x_2=-2$ ,  $x_3=6$ ,  $x_4=1$ ,  $x_5=3$ , então  $-2 \le 1 \le 3 \le 6$ , de modo que  $x_{(1)}=-2$ ,  $x_{(2)}=1$ ,  $x_{(3)}=3$ ,  $x_{(4)}=3$  e  $x_{(5)}=6$ .

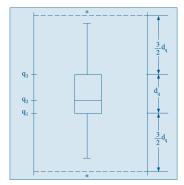
Figure 14: f8

- Quantís: medidas de posição, para uma dada ordem nos dados.
- ▶ E.g.: mediana: q(0.5): valor que divide os dados pela metade.
- ▶ E.g.: percentil 0.95: q(0.95): valor que divide os dados com 95% dos casos abaixo e 5% acima desse valor.

```
x \leftarrow c(15, 5, 3, 8, 10, 2, 7, 11, 12)
sort(x)
## [1] 2 3 5 7 8 10 11 12 15
quantile(x)
## 0% 25% 50% 75% 100%
## 2 5 8 11 15
quantile(x, probs = 0.95)
## 95%
## 13.8
summary(x)
##
     Min. 1st Qu. Median Mean 3rd Qu. Max.
##
    2.000 5.000 8.000
                          8.111 11.000 15.000
```

- Box-plot: jeito de apresentar os quantís que dá uma noção da distribuição e disperção dos dados.
- $\blacktriangleright$  LS = MD + 1.5 × IIQ
- $ightharpoonup LI = MD 1.5 \times IIQ$
- IIQ = q(0.75) q(0.25)

Figura 3.4: Box Plot.



#### Motivo estatístico

Figura 3.8: Área sob a curva normal entre LI e LS.

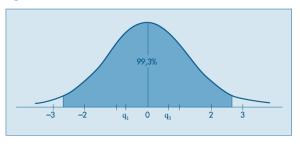


Figure 16: f14

#### Exercício

Faça uma análise dos dados da empresa MB.

# Análise bidimensional

#### Análise Bidimensional

- ► Três tipos:
  - Quali x Quali
  - Quali x Quant
  - Quant x Quant

# Associação Quali-Quali

Tabela 4.2: Distribuição conjunta das freqüências das variáveis grau de instrução (Y) e região de procedência (V).

V	Ensino Fundamental	Ensino Médio	Superior	Total
Capital Interior	4	5	2	11
Interior	3	7	2	12
Outra	5	6	2	13
Total	12	18	6	36

Fonte: Tabela 2.1.

Figure 17: f15

# Associação Quali-Quali

**Tabela 4.3:** Distribuição conjunta das proporções (em porcentagem) em relação ao total geral das variáveis Y e V definidas no texto.

V	Fundamental	Médio	Superior	Total
Capital Interior Outra	11% 8% 14%	14% 19% 17%	6% 6% 5%	31% 33% 36%
Total	33%	50%	17%	100%

Fonte: Tabela 4.2.

Figure 18: f16

**Tabela 4.4:** Distribuição conjunta das proporções (em porcentagem) em relação aos totais de cada coluna das variáveis Ye V definidas no texto.

V	Fundamental	Fundamental Médio		Total	
Capital Interior Outra	33% 25% 42%	28% 39% 33%	33% 33% 34%	31% 33% 36%	
Total	100%	100%	100%	100%	

Fonte: Tabela 4.2.

Figure 19: f17

**Tabela 4.7:** Distribuição conjunta das freqüências e proporções (em porcentagem), segundo o sexo (X) e o curso escolhido (Y).

X	Masculino	Feminino	Total
Física	100 (71%)	20 (33%)	120 (60%)
Ciências Sociais	40 (29%)	40 (67%)	80 (40%)
Total	140 (100%)	60 (100%)	200 (100%)

Fonte: Dados hipotéticos.

Figure 20: f18

Tabela 4.8: Cooperativas autorizadas a funcionar por tipo e estado, junho de 1974.

Estado		Total				
Estado	Consumidor	Produtor	Escola	Outras	loidi	
São Paulo	214 (33%)	237 (37%)	78 (12%)	119 (18%)	648 (100%)	
Paraná	51 (17%)	102 (34%)	126 (42%)	22 (7%)	301 (100%)	
Rio G. do Sul	111 (18%)	304 (51%)	139 (23%)	48 (8%)	602 (100%)	
Total	376 (24%)	643 (42%)	343 (22%)	189 (12%)	1.551 (100%)	

Fonte: Sinopse Estatística da Brasil — IBGE, 1977.

Figure 21: f19

**Tabela 4.9:** Valores esperados na Tabela 4.8 assumindo a independência entre as duas variáveis.

Estado		<b>T</b> . I			
	Consumidor	Produtor	Escola	Outras	Total
São Paulo	157 (24%)	269 (42%)	143 (22%)	79 (12%)	648 (100%)
Paraná	73 (24%)	124 (42%)	67 (22%)	37 (12%)	301 (100%)
Rio G. do Sul	146 (24%)	250 (42%)	133 (22%)	73 (12%)	602 (100%)
Total	376 (24%)	643 (42%)	343 (22%)	189 (12%)	1.551 (100%)

Fonte: Tabela 4.8.

Figure 22: f20

Tabela 4.10: Desvios entre observados e esperados.

Estado	Tipo de Cooperativa							
LSIGGO	Consumidor	Produtor	Escola	Outras				
São Paulo	57 (20,69)	-32 (3,81)	-65 (29,55)	40 (20,25)				
Paraná	-22 (6,63)	-22 (3,90)	59 (51,96)	-15 (6,08)				
Rio G. do Sul	-35 (8,39)	54 (11,66)	6 (0,27)	-25 (8,56)				

Fonte: Tabelas 4.8 e 4.9.

Figure 23: f21

6. Uma companhia de seguros analisou a freqüência com que 2.000 segurados (1.000 homens e 1.000 mulheres) usaram o hospital. Os resultados foram:

	Homens	Mulheres
Usaram o hospital	100	150
Não usaram o hospital	900	850

- (a) Calcule a proporção de homens entre os indivíduos que usaram o hospital.
- (b) Calcule a proporção de homens entre os indivíduos que não usaram o hospital.
- (c) O uso do hospital independe do sexo do segurado?

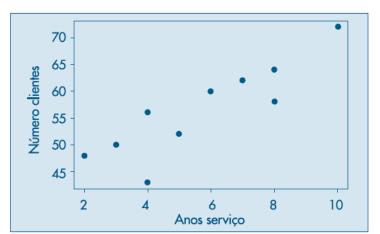
Figure 24: f22b

Quanti x Quanti

- A medida principal de associação entre duas variáveis quanti é o coeficiente de correlação.
- O coeficiente de correlação é uma medida que varia entre -1 e 1 onde:
  - Mais próximo de -1 significa correlação negativa
  - Mais próximo de 0 significa ausência de correlação
  - Mais próximo de 1 significa correlação positiva
- Mas como funciona a correlação?

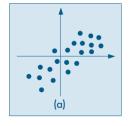
- Diagrama de dispersão: ajuda a observar os dados.
  - Como fazer: colocar os dados em dois eixos coordenados.

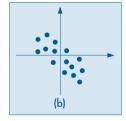
**Figura 4.2:** Gráfico de dispersão para as variáveis *X*: anos de serviço e *Y*: número de clientes.



- Como correlação aparece no diagrama de dispersão:
  - Na esquerda temos uma correlação positiva.
  - No centro, correlação negativa.
  - Na direita, correlação zero.
- Para calcular correlação precisamos medir a concentração dos dados nos quadrantes.

Figura 4.6: Tipos de associações entre duas variáveis.





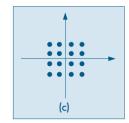


Figure 26: f23

- Para isso, fazemos os seguintes passos:
  - 1. Subtraímos a média do valor de cada variável. Isso centraliza a variável no zero (fig. esquerda).
  - 2. Dividimos pelo desvio-padrão: isso faz com que a unidade de variação da variável desapareça (fig. direita).

Figura 4.7: Mudança de escalas para o cálculo do coeficiente de correlação.

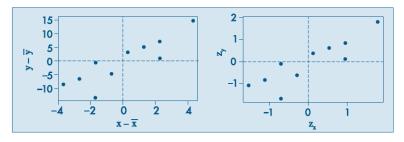


Figure 27: f25

#### Olha como fica na tabela:

Tabela 4.15: Cálculo do coeficiente de correlação.

Agente	Anos X	Clientes y	$X - \overline{X}$	$y-\bar{y}$	$\frac{X - \overline{X}}{dp(x)} = Z_x$	$\frac{y - \overline{y}}{dp(y)} = Z_y$	$Z_x \cdot Z_y$
Α	2	48	-3,7	-8,5	-1,54	-1,05	1,617
В	3	50	-2,7	-6,5	-1,12	-0,80	0,846
C	4	56	-1,7	-0,5	-0,71	-0,06	0,043
D	5	52	-0,7	-4,5	-0,29	-0,55	0,160
E	4	43	-1,7	-13,5	-0,71	-1,66	1,179
F	6	60	0,3	3,5	0,12	0,43	0,052
G	7	62	1,3	5,5	0,54	0,68	0,367
Н	8	58	2,3	1,5	0,95	0,19	0,181
	8	64	2,3	7,5	0,95	0,92	0,874
J	10	72	4,3	15,5	1 <i>,7</i> 8	1,91	3,400
Total	57	565	0	0			8,769

 $\bar{x} = 5.7$ , dp(X) = 2.41,  $\bar{y} = 56.5$ , dp(Y) = 8.11

Figure 28: f24

#### E essa é a fórmula:

**Definição.** Dados n pares de valores  $(x_1, y_1)$ ,  $(x_2, y_2)$ , ...,  $(x_n, y_n)$ , chamaremos de coeficiente de correlação entre as duas variáveis X e Y a

$$\operatorname{corr}(X, Y) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^{n} \left( \frac{x_i - \overline{X}}{dp(X)} \right) \left( \frac{y_i - \overline{Y}}{dp(\overline{Y})} \right), \tag{4.7}$$

ou seja, a média dos produtos dos valores padronizados das variáveis.

Não é difícil provar que o coeficiente de correlação satisfaz

$$-1 \le \operatorname{corr}(X, Y) \le 1. \tag{4.8}$$

Figure 29: f26

#### Exercício

11. Abaixo estão os dados referentes à porcentagem da população economicamente ativa empregada no setor primário e o respectivo índice de analfabetismo para algumas regiões metropolitanas brasileiras.

Regiões metropolitanas	Setor primário	Índice de analfabetismo
São Paulo	2,0	17,5
Rio de Janeiro	2,5	18,5
Belém	2,9	19,5
Belo Horizonte	3,3	22,2
Salvador	4,1	26,5
Porto Alegre	4,3	16,6
Recife	7,0	36,6
Fortaleza	13,0	38,4

Fonte: Indicadores Sociais para Áreas Urbanas — IBGE — 1977.

- (a) Faça o diagrama de dispersão.
- (b) Você acha que existe uma dependência linear entre as duas variáveis?
- (c) Calcule o coeficiente de correlação.
- (d) Existe alguma região com comportamento diferente das demais? Se existe, elimine o valor correspondente e recalcule o coeficiente de correlação.

Figure 30: f26b

- Cruzar uma quali versus uma quanti é mais complicado.
- ▶ Note esse cruzamento, entre salário e escolaridade:

Figura 4.8: Box plots de salário segundo grau de instrução.

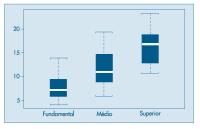


Figure 31: f34

Tabela 4.16: Medidas-resumo para a variável salário, segundo o grau de instrução, na Companhia MB.

Grau de instrução	п	3	dp(S)	var(S)	s <sub>10</sub>	$q_{_1}$	$q_{_2}$	$q_{_3}$	Sid
Fundamental Médio Superior	12 18 6	7,84 11,54 16,48	2,79 3,62 4.11	7,77 13,10 16.89	4,00 5,73 10,53	6,01 8,84 13.65	7,13 10,91 16,74	9,16 14,48 18.38	13,65 19,40 23.30
Todos	36	11,12	4,52	20,46	4,00	7,55	10,17	14,06	23,30

Figure 32: f35

Compare agora com esse cruzamento, entre salário e região de procedência:

Tabela 4.17: Medidas-resumo para a variável salário segundo a região de procedência, na Companhia MB.

Região de procedência	п	īs	dp(S)	var(S)	S <sub>(1)</sub>	$q_{_1}$	$q_{_{2}}$	$q_{_3}$	S <sub>(n)</sub>
Capital	-11	11,46	5,22	27,27	4,56	7,49	9,77	16,63	19,40
Interior	12	11,55	5,07	25,71	4,00	7,81	10,64	14,70	23,30
Outra	13	10,45	3,02	9,13	5,73	8,74	9,80	12,79	16,22
Todos	36	11,12	4,52	20,46	4,00	7,55	10,17	14,06	23,30

Figura 4.9: Box plots de salário segundo região de procedência.

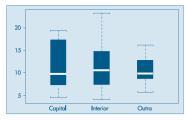


Figure 33: f36

- ► Salário x Idade: aparentemente mais relacionadas
- Salário x região: aparentemente menos relacionadas
- Como medir a associação? Note as variâncias!

- Se compararmos as variâncias dentro dos grupos, com a variância total, temos uma medida!
  - Essa medida é o quanto a nossa quali consegue explicar nossa quanti.
  - O nome disso é ANOVA: ANalysis Of VAriance.
  - Como fazer?

- A variância intra grupo é a média ponderada da variância em cada grupo.
- ► A gente calcula assim:
  - Variância intra-grupo:

$$\overline{var(X)} = \frac{\sum_{i=1}^{k} n_i var_i(S)}{\sum_{i=1}^{k} n_i}$$

▶ Variância total: variância dos dados: *var*(*X*)...

► Associação entre as variáveis: R<sup>2</sup>:

$$0 \le R^2 = 1 - \frac{\overline{var(X)}}{var(X)} \le 1$$

**Exemplo 4.9.** Voltando aos dados do Exemplo 4.8, vemos que para a variável  $\mathcal S$  na presença de grau de instrução, tem-se

$$\overline{\text{var}(S)} = \frac{12(7,77) + 18(13,10) + 6(16,89)}{12 + 18 + 6} = 11,96,$$
$$\text{var}(S) = 20,46,$$

de modo que

$$R^2 = 1 - \frac{11,96}{20,46} = 0,415,$$

e dizemos que 41,5% da variação total do salário é *explicada* pela variável grau de instrução.

Para S e região de procedência temos

$$\overline{\text{var}(S)} = \frac{11(27,27) + 12(25,71) + 13(9,13)}{11 + 12 + 13} = 20,20,$$

e, portanto,

$$R^2 = 1 - \frac{20,20}{20,46} = 0,013,$$

Figure 34: f37

#### Exercício

- Calcule no banco MB a associação entre estado civil e idade.
- ► Faça análises uni e bidimensional de uma das bases de dados que temos na pasta (escolha sua):
  - ► MB
  - voteincome
  - PErisk

Px aula: probabilidade!