



DATA SCIENCE

MÓDULO 2

Inferencia Estadística II



1 Pruebas de hipótesis para una población.

2 Prueba de hipótesis para dos poblaciones. Caso de grupo de tratamiento y de control.

3 Aplicación A/B Testing.

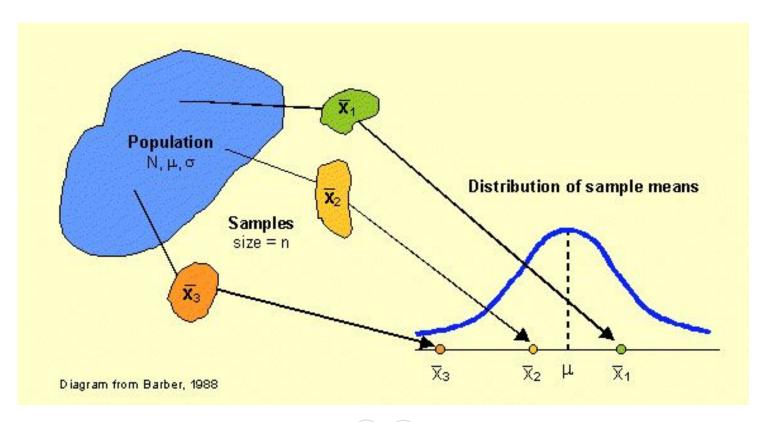
PRUEBA DE HIPÓTESIS





Distribución de las medias muestrales:

Simulación: https://gallery.shinyapps.io/CLT_mean/





Teorema (del límite central): Sea $X_1, X_2, ..., X_n$ un conjunto de variables aleatorias, independientes e idénticamente distribuidas de una distribución con media μ y varianza $\sigma^2 \neq 0$. Entonces, si \mathbf{n} es suficientemente grande, la variable aleatoria

$$ar{X} = rac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i$$

tiene aproximadamente una distribución normal con $\mu_{ar{X}}=\mu$ y $\sigma_{ar{X}}^2=rac{\sigma^2}{n}.$

Condiciones del TCL

- **Independencia**: las observaciones tienen que provenir de un muestreo aleatorio y deben ser independientes. Si el muestreo es sin reemplazo, entonces n < 10% de la población
- Si la distribución de una población es muy **asimétrica**, n deberá ser muy grande (a veces se menciona un n=30 como aproximación, pero en realidad depende de cuán asimétrica es la población). Si la población tiene distribución normal, no hay condiciones sobre n.



Un investigador de mercados y hábitos de comportamiento afirma que el tiempo que los niños de tres a cinco años dedican a ver la televisión cada semana es en promedio **22 horas**. Frente a este estudio, una empresa de investigación de mercados cree que la media es mayor y para probar su hipótesis toma **una muestra de 64 observaciones** procedentes de la misma población, obteniendo como resultado una **media de 25 y desvío estándar de 6 horas**. Verifique si la afirmación del investigador es realmente cierta utilizando un nivel de significación del 5%.

EJEMPLO de TEST DE HIPÓTESIS PARA LA MEDIA POBLACIONAL



Un investigador de mercados y hábitos de comportamiento afirma que el tiempo que los niños de tres a cinco años dedican a ver la televisión cada semana es en promedio **22 horas.** Frente a este estudio, una empresa de investigación de mercados cree que la media es mayor y para probar su hipótesis toma una **muestra de 64 observaciones** procedentes de la misma población, obteniendo como resultado **una media de 25 y desvío estándar de 6 horas**. Verifique si la afirmación del investigador es realmente cierta utilizando un nivel de significación del 5%.

¿Qué sabemos?

- ullet Tenemos una hipótesis sobre la media poblacional: $\mu=22$
- Tenemos una muestra: $n = 64, \bar{X} = 25 \, hs, S = 6 \, hs$



Un investigador de mercados y hábitos de comportamiento afirma que el tiempo que los niños de tres a cinco años dedican a ver la televisión cada semana es en promedio **22 horas.** Frente a este estudio, una empresa de investigación de mercados cree que la media es mayor y para probar su hipótesis toma una **muestra de 64 observaciones** procedentes de la misma población, obteniendo como resultado **una media de 25 y desvío estándar de 6 horas**. Verifique si la afirmación del investigador es realmente cierta utilizando un nivel de significación del 5%.

¿Qué sabemos?

- Tenemos una hipótesis sobre la media poblacional: $\mu=22$
- Tenemos una muestra: $n = 64, \bar{X} = 25 \, hs, S = 6 \, hs$

Queremos saber si la muestra nos puede proveer evidencia para rechazar nuestra hipótesis sobre la media poblacional.

EJEMPLO de TEST DE HIPÓTESIS PARA LA MEDIA POBLACIONAL



¿Qué sabemos?

- Tenemos una hipótesis sobre la media poblacional: $\mu=22$
- Tenemos una muestra: $n = 64, \bar{X} = 25 \text{ hs}, S = 6 \text{ hs}$

Queremos saber si la muestra nos puede proveer evidencia para rechazar nuestra hipótesis sobre la media poblacional.

Planteamos nuestra hipótesis:

Ho:
$$\mu = 22$$

Ha:
$$\mu > 22$$

EJEMPLO de TEST DE HIPÓTESIS PARA LA MEDIA POBLACIONAL



10

¿Qué sabemos?

- Tenemos una hipótesis sobre la media poblacional: $\mu=22$
- Tenemos una muestra: $n = 64, \bar{X} = 25 \text{ hs}, S = 6 \text{ hs}$

Estadístico de prueba:

$$Z=rac{ar{X}-\mu}{\sigma/\sqrt{n}}$$



¿Qué sabemos?

- Tenemos una hipótesis sobre la media poblacional: $\mu=22$
- Tenemos una muestra: n = 64, $\bar{X} = 25$ hs, S = 6 hs

Estadístico de prueba:

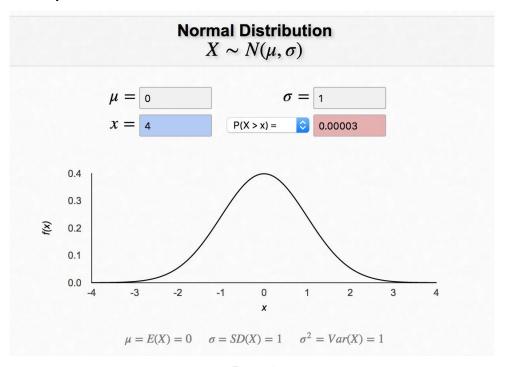
$$Z=rac{ar{X}-\mu}{\sigma/\sqrt{n}}$$

$$Z_{prueba} = \frac{\bar{x} - \mu}{\frac{S}{\sqrt{n}}} = \frac{25 - 22}{\frac{6}{\sqrt{64}}} = 4$$

EJEMPLO de TEST DE HIPÓTESIS PARA LA MEDIA POBLACIONAL



Vemos que las probabilidades de haber obtenido una muestra aleatoria de tamaño 64 y media muestral 25 hs, asumiendo que la media poblacional sean 22 hs es casi nula. **Tenemos argumentos para rechazar la hipótesis nula** y afirmar que muy probablemente la media poblacional sea mayor a 22 hs semanales.





Las hipótesis: siempre sobre un parámetro poblacional



Las hipótesis: siempre sobre un parámetro poblacional

Hipótesis nula vs. hipótesis alternativa



Las hipótesis: siempre sobre un parámetro poblacional

Hipótesis nula vs. hipótesis alternativa

Nivel de significación (alpha)

TESTS DE HIPÓTESIS



- Planteo más general. Pasos en un test de hipótesis.
 - Formular hipótesis nula y alternativa.



- Planteo más general. Pasos en un test de hipótesis.
 - Formular hipótesis nula y alternativa.
 - Identificar el estadístico de prueba apropiado y su distribución bajo la hipótesis nula (asumiendo que esta es cierta).

$$Test\ statistic = \frac{Sample\ statistic - Value\ of\ the\ population\ parameter\ under\ H_0}{Standard\ error\ of\ the\ sample\ statistic}$$



- Planteo más general. Pasos en un test de hipótesis.
 - Formular hipótesis nula y alternativa.
 - Identificar el estadístico de prueba apropiado y su distribución bajo la hipótesis nula (asumiendo que esta es cierta).
 - Fijar el nivel de significación (la probabilidad de equivocarme al rechazar HO que estoy dispuesto a tolerar).



- Planteo más general. Pasos en un test de hipótesis.
 - Formular hipótesis nula y alternativa.
 - Identificar el estadístico de prueba apropiado y su distribución bajo la hipótesis nula (asumiendo que esta es cierta).
 - Fijar el nivel de significación (la probabilidad de equivocarme al rechazar H0 que estoy dispuesto a tolerar).
 - Establecer la regla de decisión (dado el nivel de significatividad tendré valores críticos que separan la región de no rechazo de la de rechazo).



20

- Planteo más general. Pasos en un test de hipótesis.
 - Formular hipótesis nula y alternativa.
 - Identificar el estadístico de prueba apropiado y su distribución bajo la hipótesis nula (asumiendo que esta es cierta).
 - Fijar el nivel de significación (la probabilidad de equivocarme al rechazar HO que estoy dispuesto a tolerar).
 - Establecer la regla de decisión (dado el nivel de significatividad tendré valores críticos que separan la región de no rechazo de la de rechazo).
 - Recolectar datos y calcular valor muestral del estadístico de prueba.



21

- Planteo más general. Pasos en un test de hipótesis.
 - Formular hipótesis nula y alternativa.
 - Identificar el estadístico de prueba apropiado y su distribución bajo la hipótesis nula (asumiendo que esta es cierta).
 - Fijar el nivel de significación (la probabilidad de equivocarme al rechazar HO que estoy dispuesto a tolerar).
 - Establecer la regla de decisión (dado el nivel de significatividad tendré valores críticos que separan la región de no rechazo de la de rechazo).
 - Recolectar datos y calcular valor muestral del estadístico de prueba.
 - Tomar la decisión estadística



- Definición de p-valor:
 - "La probabilidad de obtener el valor observado o más extremos del estadístico de prueba si la hipótesis nula fuese cierta"



Definición de p-valor:

 "La probabilidad de obtener el valor observado o más extremos del estadístico de prueba si la hipótesis nula fuese cierta"

Si p-value < nivel de significación, entonces rechazo H0. Forma alternativa de fijar la regla de decisión. No necesito buscar valores críticos en una tabla.



 Supongamos que dado un conjunto de datos se computa el estadístico de prueba y el p-value resulta de 0.001. Partamos de que H0 es cierta e imaginemos a otros investigadores repitiendo el experimento en idénticas condiciones.



- Supongamos que dado un conjunto de datos se computa el estadístico de prueba y el p-value resulta de 0.001. Partamos de que H0 es cierta e imaginemos a otros investigadores repitiendo el experimento en idénticas condiciones.
- Ese valor del p-value dice que si H0 es cierta solo 1 de cada 1000 investigadores puede obtener un valor del estadístico tan extremo como el obtenido.



- Supongamos que dado un conjunto de datos se computa el estadístico de prueba y el p-value resulta de 0.001. Partamos de que H0 es cierta e imaginemos a otros investigadores repitiendo el experimento en idénticas condiciones.
- Ese valor del p-value dice que si H0 es cierta solo 1 de cada 1000 investigadores puede obtener un valor del estadístico tan extremo como el obtenido.
- Notemos que el p-value no es la probabilidad de que H0 sea cierta.
- Sin importar la cantidad de repeticiones del experimento H0 es siempre cierta o falsa.

TESTS PARA UNA POBLACIÓN



TESTS DE HIPÓTESIS PARA UNA POBLACIÓN. TESTS PARA LA MEDIA.



- Especificaciones de las hipótesis nula y alternativa
 - Hipótesis unilaterales

Ho:
$$\mu = \mu 0$$

Ha:
$$\mu = > \mu 0$$

Ho:
$$\mu = \mu 0$$

Ha:
$$\mu = < \mu 0$$

Hipótesis bilaterales

Ho:
$$\mu = \mu 0$$

Ha:
$$\mu = <> \mu 0$$



Estadístico de prueba

$$Z=rac{ar{X}-\mu}{\sigma/\sqrt{n}}$$

Bajo H0, manteniendo que H0 es verdadera, este estadístico tiene distribución normal estándar (con media 0 y desvío 1).



Estadístico de prueba

$$Z=rac{ar{X}-\mu}{\sigma/\sqrt{n}}$$

Bajo H0, manteniendo que H0 es verdadera, este estadístico tiene distribución normal estándar (con media 0 y desvío 1).

Nota: si la varianza no es conocida pero podemos asumir la normalidad de la distribución de la media muestral, podemos utilizar al desvío estándar de la muestra como estimador de sigma.



Ejemplo:

- Fijamos nivel de significación (alpha) en 5%.
- Se obtiene una muestra de n=25 donde la media muestral es 80.94, se sabe que el desvío poblacional es 11.6.

Ho: $\mu = 85$

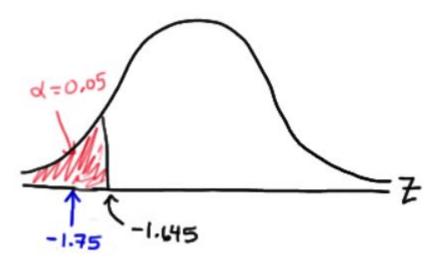
Ha: μ < 85

El valor del estadístico resulta:

$$Z = \frac{80.94 - 85}{11.6/\sqrt{25}} = -1.75$$



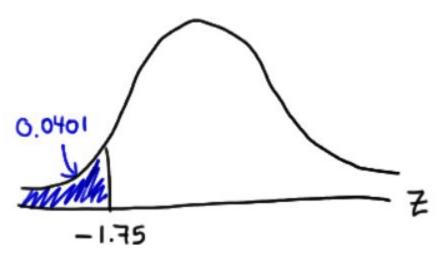
El enfoque de la región crítica nos dice que rechacemos la hipótesis nula en el nivel α = 0.05 si Z <-1.645. Por lo tanto, rechazamos la hipótesis nula porque Z = -1.75 <-1.645, y por lo tanto cae en la región de rechazo:





33

Otra forma de tomar la decisión es mediante el cálculo del p-value:



• En este enfoque rechazamos H0 si p-value es menor que el nivel α = 0.05. En este caso, el p-value es Probabilidad (Z < -1.75) = 0.0401 < 0.05



Si no conocemos la varianza poblacional y no podemos asegurar las condiciones de normalidad de la distribución de la media muestral, entonces utilizamos el estadístico de prueba T-Student con n-1 grados de libertad:

$$T=rac{ar{X}-\mu_0}{S/\sqrt{n}}$$



Ejemplo:

- Muestra de n = 100
- Media muestral de 130.1 con una desviación estándar de 21.21.

Ho: μ = 120

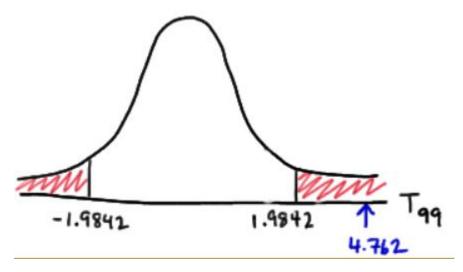
Ha: *μ* <> 120

El valor del estadístico resulta

$$t = \frac{130.1 - 120}{21.21/\sqrt{100}} = 4.762$$

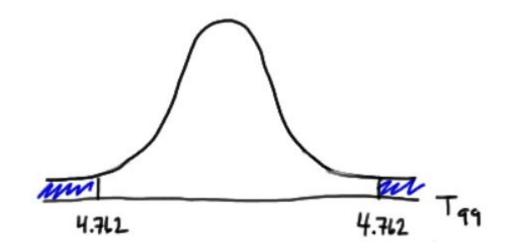


El enfoque de la región crítica nos dice que rechacemos la hipótesis nula al nivel α = 0.05 si t ≥ t0.025,99 = 1.9842 o si t ≤ t0.025,99 = -1.9842. Por lo tanto, rechazamos la hipótesis nula porque t = 4.762> 1.9842, y por lo tanto cae en la región de rechazo:





- Sacamos la misma conclusión al usar el enfoque del p-value. El enfoque del p-value nos dice que rechacemos la hipótesis nula al nivel α = 0.05 si el valor p-value $< \alpha$ = 0.05.
- En este caso, el p-value es 2 × P (T99> 4.762) <2 × P (T99> 1.9842) = 2 (0.025)
 = 0.05. Rechazamos H0 porque p-value<0.05



TESTS DE HIPÓTESIS PARA UNA POBLACIÓN. TESTS PARA LA PROPORCIÓN. .



- Se tira un dado con 4 caras (tetraedro) 1000 veces y se registra que salen
 290 veces el número 4.
- ¿Hay evidencia para concluir que el dado está sesgado, es decir, que se observan más veces el número 4 que lo esperado?





Si el dado está equilibrado cada cara tiene probabilidad 0.25 de aparecer.
 Supongamos inicialmente que este es el caso

$$H_0$$
: $p = 0.25$

En base a la muestra la proporción observada resulta

$$\hat{p} = \frac{y}{n} = \frac{290}{1000} = 0.29$$



Según el Teorema Central del Límite la proporción muestral

$$\hat{p} = \frac{Y}{n}$$

tiene distribución asintóticamente normal con media (bajo H0)

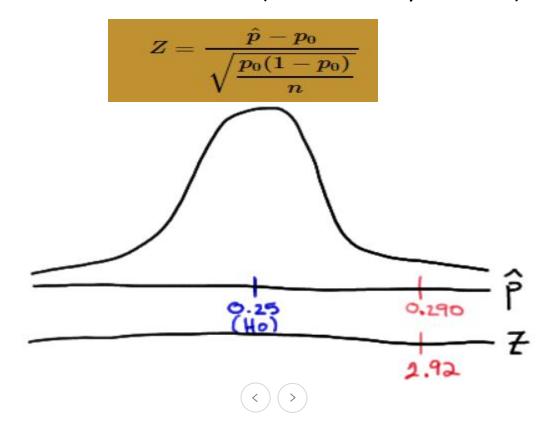
$$p_0=0.25$$

y desvío estándar (bajo H0)

$$\sqrt{rac{p_0(1-p_0)}{n}} = \sqrt{rac{0.25(0.75)}{1000}} = 0.01369$$

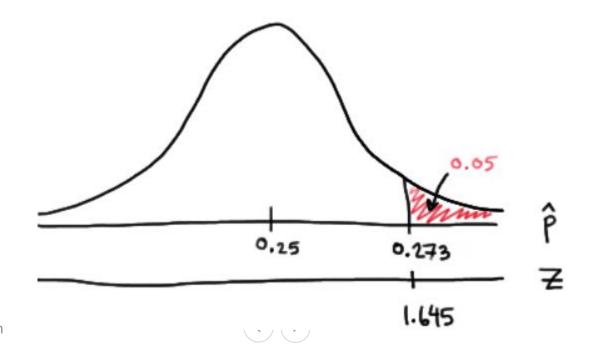


 Por lo que, bajo H0, manteniendo que H0 es verdadera, este estadístico tiene distribución normal estándar (con media 0 y desvío 1)





- Buscamos testear H0 que la probabilidad, en la población, de obtener un 4 es igual igual a 0.25 versus H1, que esta probabilidad es mayor que 0.25.
- Si fijamos el nivel de significación en 0.05 entonces rechazamos si Z>1.645





¿Qué pasa si no podemos aplicar el TCL para realizar un test de hipótesis para una proporción?

- Imaginemos que sospechamos que una moneda está cargada. Queremos testearlo. Para eso, decidimos hacer 10 tiradas.
- Una estrategia es contrastar hipótesis
- Puedo construir una distribución muestral de cada una de las tiradas de la moneda suponiendo que la moneda está equilibrada (esa sería la Ho).
- De hecho, podemos hacerlo utilizando la distribución binomial...



44

$$f(x)=inom{n}{x}p^x(1-p)^{n-x}, \ \ 0\leq p\leq 1$$

$$\binom{n}{x} = \frac{n!}{x!(n-x)!}$$

Para 0 caras = $1 \times 0.5 **0 \times 0.5 **10$ Para 1 cara = $10!/1! \times 0.5 **1 \times 0.5 **9$ etc..

Nota: 0.5**10 = 1/1.024

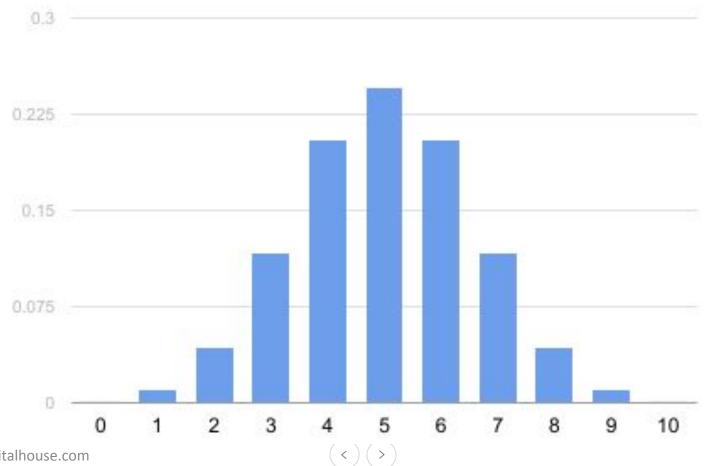
EJEMPLO: TIRADA DE DADOS



- Puedo calcular las probabilidades de obtener 0, 1, 2,..., 10 caras en 10 tiradas de monedas.
- La forma es a través de una distribución binomial que permite calcular las probabilidades de obtener x éxitos en n repeticiones de un experimento -¿cuál sería el experimento, cuál el éxito y cuántas repeticiones habría en este caso?
- ¿Qué suceso es más probable (si la moneda NO estuviese cargada)?
- ¿Cuándo rechazaríamos que la moneda NO está cargada?

#	Fav / Pos	Prob	
0	1 / 1024	0,001	
1	10 / 1024	0,010	
2	45 / 1024	0,044	
3	120 / 1024	0,117	
4	210 / 1024	0,205	
5	252 / 1024	0,246	
6	210 / 1024	0,205	
7	120 / 1024	0,117	
8	45 / 1024	0,044	
9	10 / 1024	0,010	
10	1 / 1024	0,001	







La anterior es la distribución de probabilidad de obtener 0 a 10 caras en 10 tiradas de monedas si la moneda no estuviera cargada... es decir...

SI LA HIPÓTESIS NULA FUERA VERDADERA

- Ahora, nosotros realizamos el experimento (o extraemos la muestra).
 - Definimos un alfa de 0.1
 - Tiramos la moneda 10 veces y obtenemos 7 caras...
 - ¿Qué dirían sobre la Ho?
 - ¿Y si hubiéramos obtenido 1vcara en 10 tiradas?

TIPOS DE ERRORES EN UN TEST DE HIPÓTESIS





Decisión Adoptada	Hipótesis H ₀		
P	Cierta	Falsa	
No rechazar H ₀	Decisión Acertada (1 - α)	Error de Tipo II (β)	
Rechazar H ₀	Error de Tipo I (α)	Decisión Acertada (1 - β)	

- Nivel máximo de error que estamos dispuesto a tolerar.
- Dado que nos encontramos trabajando con muestras nunca podemos estar 100% seguros de si hemos tomado la decisión correcta al rechazar o no una HO. ¿Por qué?

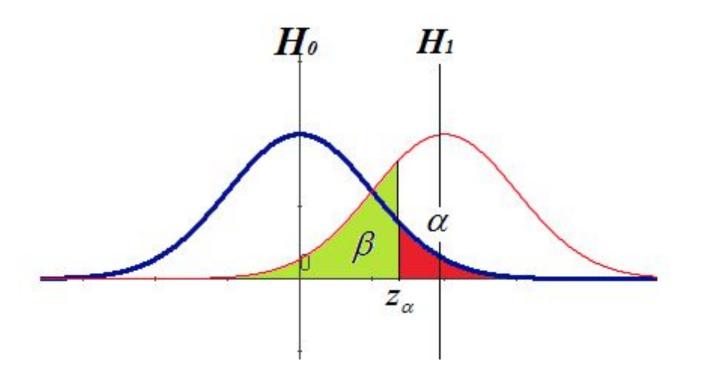


Decisión Adoptada	Hipótesis H ₀		
1	Cierta	Falsa	
No rechazar H ₀	Decisión Acertada (1 - α)	Error de Tipo II (β)	
Rechazar H ₀	Error de Tipo I (α)	Decisión Acertada (1 - β)	

— alfa y beta varían en forma inversa… ¿por qué?



alfa y beta varían en forma inversa... ¿por qué?



TESTS PARA DOS POBLACIONES





Ejemplo: estudio sobre el efecto de jugar videojuegos durante el almuerzo y su efecto sobre el consumo de snacks durante la tarde.

- Muestra: 44 pacientes. 22 mujeres y 22 hombres
- Se estratifica por género y se los divide aleatoriamente en dos grupos de 22 personas.
- Al grupo 1 se le pide que juegue a un videojuego mientras almuerzan, intentando ganar la mayor cantidad de puntos posibles.
- Al grupo de control se le pide que almuerce sin distracciones.
- A los dos grupos se les provee el mismo almuerzo y los mismos snacks durante la tarde.
- El objetivo es determinar si el grupo que jugó a los videojuegos consume significativamente más snacks que el grupo de control.



Ejemplo: estudio sobre el efecto de jugar videojuegos durante el almuerzo y su efecto sobre el consumo de snacks durante la tarde.

Datos:

Consumo de snack	Media Muetral	Desv. Est	n
Videojuegos	52.1 gr	45.1 gr	22
No distracciones	27.1 gr	26.4 gr	22



Ejemplo: estudio sobre el efecto de jugar videojuegos durante el almuerzo y su efecto sobre el consumo de snacks durante la tarde.

Intervalo de confianza para la diferencia de medias muestrales:

$$(\bar{x}_1 - \bar{x}_2) \pm t_{df}^* SE_{(\bar{x}_1 - \bar{x}_2)}$$

$$SE_{(\bar{x_1}-\bar{x_2})} = \sqrt{\frac{S_1^2}{n_1} + \frac{S_2^2}{n_2}}$$

$$df=\min\left(n_1-1,n_2-1\right)$$



Ejemplo: estudio sobre el efecto de jugar videojuegos durante el almuerzo y su efecto sobre el consumo de snacks durante la tarde.

Intervalo de confianza con nivel de confianza de 95% para la diferencia de medias:

$$(\overline{X}_{wd} - \overline{X}_{wod}) \pm t_{df}^{*} SE = (52.1 - 27.1) \pm 2.08 \times \frac{45.1^{2}}{22} + \frac{26.4^{2}}{22}$$

$$= 25 \pm 2.08 \times 11.14$$

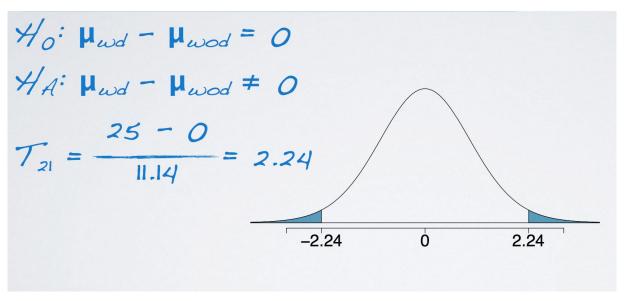
$$= 25 \pm 23.17$$

$$= (1.83, 48.17)$$



Ejemplo: estudio sobre el efecto de jugar videojuegos durante el almuerzo y su efecto sobre el consumo de snacks durante la tarde.

Test de Hipótesis:





Ejemplo: estudio sobre el efecto de jugar videojuegos durante el almuerzo y su efecto sobre el consumo de snacks durante la tarde.

Test de Hipótesis:

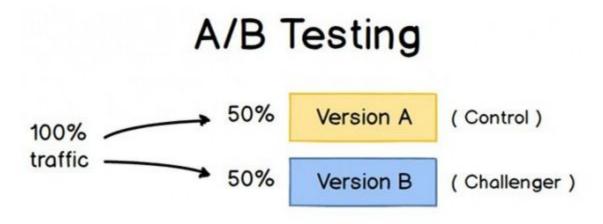
$$\mathcal{H}_{0}: \mu_{\omega d} - \mu_{\omega o d} = 0$$

$$\mathcal{H}_{A}: \mu_{\omega d} - \mu_{\omega o d} \neq 0$$

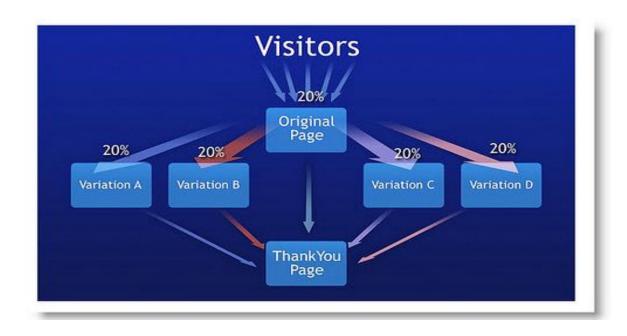
$$\mathcal{T}_{21} = \frac{25 - 0}{11.14} = 2.24$$

p- valor = 3.6% → Rechazamos la hipótesis nula.











Apliquemos un ejemplo...

- Una de tus principales responsabilidades es la optimización de las conversiones.
- Uno de tus anunciantes ha desarrollado una nueva bebida energética dirigida a científicos de datos, y el VP de Advertisements quiere tu ayuda eligiendo entre el anuncio A y el anuncio B.
- Decidís aplicar A/B testing para definir cuál es el mejor anuncio...



- Digamos que N_A personas ven el anuncio A y que de estas n_A hacen click en él.
- Podemos pensar en cada vista de un anuncio como una prueba de Bernoulli donde p_{Δ} es la probabilidad que alguien haga click en el anuncio A.
- Entonce si N_A es grande, que es el caso aquí, sabemos que n_A/N_A es aproximadamente una variable aleatoria normal con media p_A y desvío estándar $\sigma_A = \sqrt{p_A(1-p_A)/N_A}$



- Entonces si N_B es grande, que es el caso aquí, sabemos que n_B/N_B es aproximadamente una variable aleatoria normal con media p_B y desvío estándar $\sigma_B = \sqrt{p_B(1-p_B)/N_B}$
- Si asumimos que estas dos normales son independientes (lo que parece razonable porque las pruebas Bernoulli individuales deben serlo), entonces su diferencia debe ser también normal con media $p_R p_\Delta$ y desvío estándar

$$\sqrt{\sigma_A^2 + \sigma_B^2}$$



• Esto significa que podemos testear la hipótesis nula de que pB-pA es cero (p_B y p_Δ son iguales) usando el estadístico

```
def estimated_parameters(N, n):
    p = n / N
    sigma = math.sqrt(p * (1 - p) / N)
    return p, sigma

def a_b_test_statistic(N_A, n_A, N_B, n_B):
    p_A, sigma_A = estimated_parameters(N_A, n_A)
    p_B, sigma_B = estimated_parameters(N_B, n_B)
    return (p_B - p_A) / math.sqrt(sigma_A ** 2 + sigma_B ** 2)
```

que debería ser aproximadamente una normal estándar.



 Por ejemplo si A obtiene 200 clicks de 1000 vistas y B obtiene 180 clicks de 100 vistas el estadístico es igual a

```
z = a_b_test_statistic(1000, 200, 1000, 180) # -1.14
```

La probabilidad de ver una diferencia tan grande si las medias fueran realmente iguales sería

two_sided_p_value(z) # 0.254

que es lo suficientemente grande para que no podamos concluir que existe mucha diferencia.



Por otro lado, si B sólo obtuviera 150 clicks tendríamos

```
z = a_b_test_statistic(1000, 200, 1000, 150) # -2.94
two_sided_p_value(z) # 0.003
```

lo que significa que sólo existe una probabilidad de 0.003 de ver una diferencia tan grande si los anuncios fueran igualmente efectivos.



¿Quién hace esto?







Análisis





And the winner is..



https://blog.optimizely.com/2010/11/29/how-obama-raised-60-million-by-running-a-simple-experiment/