Estatística

Sérgio Manuel Salazar dos Santos, N^o: 1020881

23 de Dezembro de 2019

Conteúdo

Resumo

Este trabalho consiste no estudo de Estatística das Entregas Expresso em duas regiões **A** e **B**, as variaveis em estudo é o tempo de demora das entregas e a variavel de numero de encomendas entregues num determinado unidade de tempo [u.t.]. Nestas situações foram retiradas 120 e 90 amostras nas duas regiões respectivamente.
A primeira é uma distribuição continua, o tempo, e a segunda uma distribuição discreta.
As materias abordadas vai ser **Amostragem**, **Estimação de parâmetros** e **Testes de Hipóteses**

.1 Introdução

As variáveis consideradas são:

- Regiao (REG): variável nominal com dois niveis
  Regiao A
  Região B
- Tempo de entrega (TEE), por encomenda: Variável expressa em u.t.
- Número de encomendas entregues (NEE) por u.t.

Admitindo que a amostra disponível é uma amostra aleatória representativa das populações.

Neste relatorio esta-se a trabalhar com duas grandezas precisamente o tempo (TEE) e quantidade por u.t (NEE), temos recolhidos 120 registos **TEE** na qual pela regra de sturges $c = int(1 + 3.3log(n))$, determina-se que é necesario sete [**7**] classes.
Podemos obter a amplitude de cada classe $h = b - a$ e sua marca $x_i = \frac{a+b}{2}$.

.2 O conjunto de dados

X_{i_A}- "Variavel aleatoria que representa o tempo de demora na Região **A** da entrega de uma encomenda Expresso em u.t." i=1,2,3, ...,120
X_{i_B}- "Variavel aleatoria que representa o tempo de demora na Região **B** da entrega de uma encomenda Expresso em u.t." i=1,2,3, ...,120
Abaixo o resultado da tabela TEE:

h_i	CLASSE	MARCA	n_{i_A}	n_{i_B}	$\frac{n_{i_A}}{h_i}$	$\frac{n_{i_B}}{h_i}$	f_{i_A}	f_{i_B}	F_{i_A}	F_{i_B}
4	[5,10[	7,5	8	1	2	0,25	0,0667	0,0083	0,0667	0,0083
4	[10,15[	12,5	16	18	4	4,5	0,1333	0,15	0,2	0,1583
4	[15,20[	17,5	40	28	10	7	0,3333	0,2333	0,5333	0,3917
4	[20,25[	22,5	25	41	6,25	10,25	0,2083	0,3417	0,7417	0,7333
4	[25,30[	27,5	26	22	6,5	5,5	0,2167	0,1833	0,9583	0,9167
4	[30,35[	32,5	4	8	1	2	0,0333	0,0667	0,9917	0,9833
5	[35,40]	37,5	1	2	0,2	0,4	0,0083	0,0167	1	1
			n=120	n=120						

n_i - frequência absoluta f_i - frequência relativa F_i - frequência acumulada

Recorrendo ao excell obeteve-se os seguintes resultados:

Média aritmetica dados classificados	Variância de uma amostra dados classificados
$\bar{x} = \frac{1}{n}\sum_{i=1}^{c} x_i n_i = \sum_{i=1}^{c} x_i f_i$	$s^2 = \frac{1}{n-1}\sum_{i=1}^{c}(x_i - \bar{x})^2 n_i$

Estatística	X_A	X_B
Mínimo	7,5	7,5
Q_1:1^o Quartil	17,5	17,5
m_d: mediana	17,5	22,5
Q_3:3^o Quartil	27,5	27,5
Máximo	37,5	37,5
$\bar{X}$: Média	20,0417	21,5417
s : desvio-padrão	6,4494	6,0909
m_o: moda	17,5	22,5
Tamanho amostral [n]	120	120

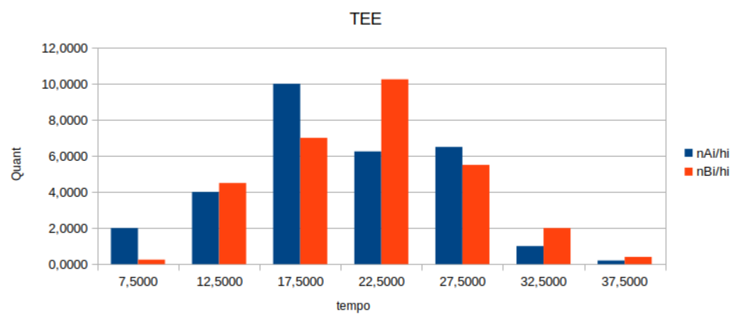

Figura 1: TEE

A mediana pode ser obtida pela frequencia acumulativa quando esta é igual a 50%, ou seja, $F_i(Mediana) = 0,5$

Linearização mediana **TEE**

Regiao **A**:
0.2 $\Longrightarrow$ 12.5
0.5333 $\Longrightarrow$ 17.5
$\therefore$
Midiana A =
12.5 + 0.9 x (17.5-12.5) = 17
com:
skew = -0,1051 e kurt = -0,4016

Regiao **B**:
0.3917 $\Longrightarrow$ 17.5
0.7333 $\Longrightarrow$ 22.5
$\therefore$
Midiana B =
17.5 + 0.317 x (22.5-17.5) = 19.085
com :
skew = 0,1119 e kurt = -0,1835

Na prática, considera-se que a qualidade da aproximação é suficientemente boa quando $n \geqslant 30$.
Pode-se tomar que $\delta \cong s$.

$$\begin{cases} \mu \\ \delta \end{cases} \Longrightarrow \qquad \bar{X} = \frac{\sum_{i=1}^{n} X_i}{n} \sim N(\mu; \frac{\delta^2}{n})$$

$\bar{x}_{A_0}$ = 20,0417 $\quad$ $\bar{x}_{B_0}$ = 21,5417
δ_A = 6,4494 $\quad$ δ_B = 6,0909

Tratamento dos dados da Segunda Variavel Aleatótia
Y_{i_A}- "Variavel aleatoria que representa o numero de encomendas entregues pela Expresso na Regiao **A** por u.t." i=1,2,3, ...,90
Y_{i_B}- "Variavel aleatoria que representa a numero de encomendas entregues pela Expresso na Regiao **B** por u.t." i=1,2,3, ...,90
Abaixo o resultado da tabela NEE:

Y_i	n_{i_A}	n_{i_B}	f_{i_A}	f_{i_B}	F_{i_A}	F_{i_B}
3	6	3	0,0667	0,0333	0,0667	0,0333
4	8	6	0,0889	0,0667	0,1556	0,1
5	19	13	0,2111	0,1444	0,3677	0,2444
6	15	7	0,1667	0,0778	0,5333	0,3222
7	13	19	0,1444	0,2111	0,6778	0,5333
8	11	15	0,1222	0,1667	0,8	0,7
9	6	8	0,0667	0,0889	0,8667	0,7889
10	5	11	0,0556	0,1222	0,9222	0,9111
11	4	3	0,0444	0,0333	0,9667	0,9444
12	0	2	0	0,0222	0,9667	0,9667
13	2	1	0,0222	0,0111	0,9889	0.9778
14	1	0	0,0111	0	1	0,9778
15	0	1	0	0,0111	1	0,9889
16	0	1	0	0,0111	1	1

Estatística	Y_A	Y_B
Mínimo	3	3
Q_1:1^o Quartil	5	6
m_d: mediana	6	7
Q_3:3^o Quartil	8	9
Máximo	14	16
$\bar{Y}$: Média	6,6111	7,5111
s : desvio-padrão	2,3112	2,5140
m_o: moda	5	7
Tamanho amostral [n]	90	90

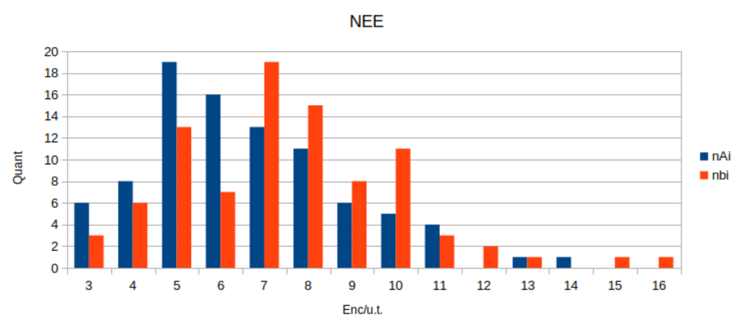

Figura 2: NEE

Na Região **A** a Média > Mediana > Moda
com skew = 0.74553 e kurt = 0.49789
Na Região **B** a Média > Mediana = Moda
com skew = 0.67659 e kurt = 1.01076

$$\begin{cases} \mu \\ \delta \end{cases} \Longrightarrow \qquad \bar{Y} = \frac{\sum_{i=1}^{n} Y_i}{n} \sim N\left(\mu; \frac{\delta^2}{n}\right)$$

$\bar{y}_{A_0} = 6{,}6111$ $\qquad \bar{y}_{B_0} = 7{,}5111$
$\delta_A = 2{,}3112$ $\qquad \delta_B = 2{,}5140$

.3 Metodologia Estatística

.3.1 Indice de Confiançã tempo médio TEE

Estimação do tempo médio para as regiões **A** e **B** com um indice de confiança de 95%.

$IC_{1-\alpha} = [A, B]$; para $1-\alpha = 0.95$, $\alpha = 0.05$, $\frac{\alpha}{2} = 0.025$
Zona critica $Z_c = Z_{1-\frac{\alpha}{2}} = \Phi^{-1}(0.975) \cong 1.96$
$P(A \leqslant \mu \leqslant B) = 1-\alpha$
$\triangle = Z_c \times \frac{\delta}{\sqrt{n}}$
$A = \bar{x} - \triangle \qquad and \qquad B = \bar{x} + \triangle$
$\therefore$
$IC_{A_{0.95}} = [\,18.8877\,,\,21.1956\,]$ and $IC_{B_{0.95}} = [\,20.4519\,,\,22.6314\,]$

Pode-se estimar que o tempo médio $[\,\mu\,]$ de entrega na população esta dentro dos intervalos acima mencionados com 95% de confiança.

.3.2 Verificar diferença de valores num intervalo

Verificar se os dados permitem afirmar que existe diferença significativa entre a % de períodos com menos de **6** entregas por u.t. na região **A** e na região **B**. Responda com base num intervalo de confiança de 97%.

Destribuição discreta:

$\bar{y}_{A_0} = 6{,}6111 \qquad \bar{y}_{B_0} = 7{,}5111 \qquad n = 90$
$\delta_A = 2{,}3112 \qquad \delta_B = 2{,}5140$

$$\left\{\begin{array}{l}\mu \\ \delta\end{array}\right. \qquad \Longrightarrow \qquad \bar{Y} = \frac{\sum_{i=1}^{n} Y_i}{n} \sim N\left(\mu; \frac{\delta^2}{n}\right)$$

$P(Y_A < 6) = P(Y_A \leqslant 5) = F_{i_B}(5) \cong 0,3677$ e $P(Y_B < 6) = P(Y_B \leqslant 5) = F_{i_B}(5) \cong 0,2444$

$\hat{P}_A - \hat{P}_B \sim N\left(p_A - p_B; \frac{p_A q_A}{n_A} + \frac{p_B q_B}{n_B}\right) \qquad \triangle = z_{(1-\frac{\alpha}{2})}\sqrt{\frac{\hat{p_A}\hat{q_A}}{n_A} + \frac{\hat{p_B}\hat{q_B}}{n_B}} \qquad q = (1-p)$

$IC_{97\%}(\hat{P}_A - \hat{P}_B) = [(\hat{p_A} - \hat{p_B}) - \triangle\,;\,(\hat{p_A} - \hat{p_B}) + \triangle]$

$\hat{P}_A - \hat{P}_B \sim N(0,1233\,;\,0,02788) \qquad z_{(1-\frac{\alpha}{2})} = \phi^{-1}(0,985) = 2,1701$

Recorrendo a calculadaora casio $fx - 9860GII$:

$\triangle = InvNorm(0.985)\sqrt{\frac{0.3677(1-0.3677)}{90} + \frac{0.2444(1-0.2444)}{90}} \cong 0.3677$
$\therefore$
$IC_{97\%}(\hat{P}_A - \hat{P}_B) = [\,(\hat{p_A} - \hat{p_B}) - 0,3624\,;\,(\hat{p_A} - \hat{p_B}) + 0,3624\,]$

A Diferença de proporções é 36,24%.

.3.3 Verificar diferenças entre as regiões

Testar se a região (REG) tem um efeito estatisticamente significativo sobre TEE e NEE ao nível de diferença de médias. Considrere uma significância à sua escolha inferior ou igual a 5%. Use o critério do valor de prova para fundamentar a decisão.

$$\begin{cases} H_0: & \mu_A - \mu_B = 0 \\ \\ H_1: & \mu_A - \mu_B < 0 \end{cases}$$

Condição TEE:

$$\begin{cases} \mu &= 0 \\ \delta &= s \end{cases} \implies \quad \bar{X_A} - \bar{X_B} \quad \backsim N\left(0\,,\, \frac{\delta_A^2}{n_A} + \frac{\delta_B^2}{n_B}\right)$$

$\bar{x_A} - \bar{x_B} = -1.5$

$\frac{\delta_A^2}{n_A} + \frac{\delta_B^2}{n_B}$

$$z_0 = \frac{\bar{x}_A - \bar{x}_B}{\sqrt{\frac{\delta_A^2}{n_A} + \frac{\delta_B^2}{n_B}}} \qquad RC_z =]-\infty, -z_{1-\alpha}] \qquad pvalue = P(Z < z_0)$$

Condição REE:

$$\begin{cases} \mu &= 0 \\ \delta &= s \end{cases} \implies \quad \bar{Y_A} - \bar{Y_B} \quad \backsim N\left(0\,,\, \frac{\delta_A^2}{n_A} + \frac{\delta_B^2}{n_B}\right)$$

$\bar{y_A} - \bar{y_B} = -0.9$

$\frac{\delta_A^2}{n_A} + \frac{\delta_B^2}{n_B}$

$$z_0 = \frac{\bar{y}_A - \bar{y}_B}{\sqrt{\frac{\delta_A^2}{n_A} + \frac{\delta_B^2}{n_B}}} \qquad RC_z =]-\infty, -z_{1-\alpha}] \qquad pvalue = P(Z < z_0)$$

.3.4 Ajuste distribuição teórica à Empirica

Ajuste uma distribuição teórica à distribuição empírica das variaveis TEE na região A (considerando as classes definidas) e NEE na região B. Verifique a qualidade do ajuste ao nível de 5%.

<u>TEE Região A:</u>

$$\begin{cases} H_0 : X \backsim N(20.0417 \text{ , } 6.4494^2) \\ \\ H_1 : X \not\backsim N(20.0417 \text{ , } 6.4494^2) \end{cases}$$

$q_0 = \sum_{i=1}^{n} \frac{(n_i - e_i)^2}{e_i} \ \backsim \ \chi^2_{(k-p-1)}$

<u>NEE Região B:</u>

$$\begin{cases} H_0 : X \backsim N(7.5111 \text{ , } 2.5140^2) \\ \\ H_1 : X \not\backsim N(7.5111 \text{ , } 2.5140^2) \end{cases}$$

$q_0 = \sum_{i=1}^{n} \frac{(n_i - e_i)^2}{e_i} \ \backsim \ \chi^2_{(k-p-1)}$

.4 Resultados e interpretação

fazer tabela só com resultados

.5 Conclusões

A Destribuição normal tem a Média = Mediana = Moda, devido a ter uma destribuição simetrica, quando estamos a analizar valores discretos isto não acontece devido a não ser simetrico podendo ter varios casos diferentes, e quanto menor o numero de amostras da população maior a dificuldade de se poder inferir e estimar valores.

Falar da skew e curt.

Lista de Figuras

Bibliografia

[1] *Probabilidades e estatística Volume 1*. McGraw-Hill, 1990.

[2] *Probabilidades e Processos Estocásticos*. Universidade de Aveiro, 2002.

[1]

[1] Apontamentos Estatistica