Instituto Superior de Engenharia do Porto

Estatística

Sérgio Manuel Salazar dos Santos, N^o: 1020881

24 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

Tratamento dos dados da Variavel Aleatótia
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}	e_{i_A}
$-\infty$	< 5		0	0							1,1812
4	[5,10[	7,5	8	1	2	0,25	0,0667	0,0083	0,0667	0,0083	5,9871
4	[10,15[	12,5	16	18	4	4,5	0,1333	0,15	0,2	0,1583	18,8942
4	[15,20[	17,5	40	28	10	7	0,3333	0,2333	0,5333	0,3917	33,6282
4	[20,25[	22,5	25	41	6,25	10,25	0,2083	0,3417	0,7417	0,7333	33,7887
4	[25,30[	27,5	26	22	6,5	5,5	0,2167	0,1833	0,9583	0,9167	19,1663
4	[30,35[	32,5	4	8	1	2	0,0333	0,0667	0,9917	0,9833	6,1316
5	[35,40]	37,5	1	2	0,2	0,4	0,0083	0,0167	1	1	1,1044
$+\infty$	>40		0	0							0,1183
			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

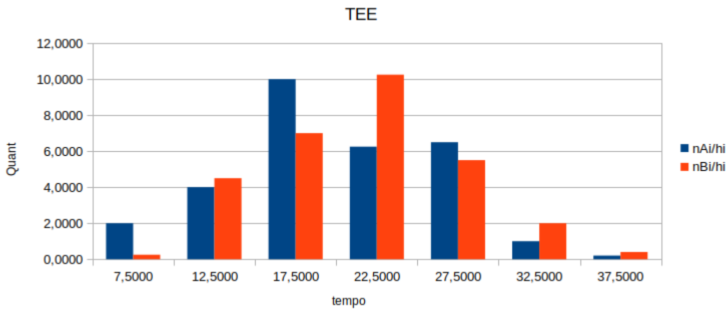

Figura 1: TEE

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}	e_{i_B}
<3	0	0					1,2765
3	6	3	0,0667	0,0333	0,0667	0,0333	2,8549
4	8	6	0,0889	0,0667	0,1556	0,1	5,3855
5	19	13	0,2111	0,1444	0,3677	0,2444	8,6724
6	15	7	0,1667	0,0778	0,5333	0,3222	11,9216
7	13	19	0,1444	0,2111	0,6778	0,5333	13,9899
8	11	15	0,1222	0,1667	0,8	0,7	14,0145
9	6	8	0,0667	0,0889	0,8667	0,7889	11,9847
10	5	11	0,0556	0,1222	0,9222	0,9111	8,7490
11	4	3	0,0444	0,0333	0,9667	0,9444	5,4522
12	0	2	0	0,0222	0,9667	0,9667	2,9005
13	2	1	0,0222	0,0111	0,9889	0.9778	1,3172
14	1	0	0,0111	0	1	0,9778	0,5106
15	0	1	0	0,0111	1	0,9889	0,1690
16	0	1	0	0,0111	1	1	0,0477
>16	0	0					0,0330

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

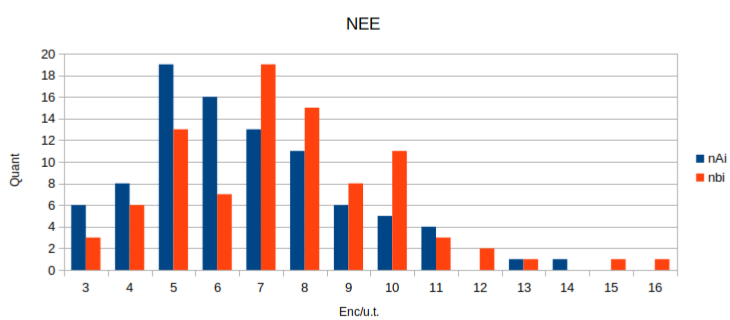

Figura 2: NEE

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

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

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

.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 [μ] 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:

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

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

$P(Y_A < 6) = P(Y_A \leqslant 5) = F_{i_B}(5) \cong 0,3677$ 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 proporçôes 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. Considrerando uma significância de 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:

$$\begin{cases} \mu = 0 \\ \delta = s \end{cases} \implies \bar{X} = \bar{X}_A - \bar{X}_B \backsim N\left(0\,, \frac{\delta_A^2}{n_A} + \frac{\delta_B^2}{n_B}\right) \quad ; \quad \frac{\delta_A^2}{n_A} + \frac{\delta_B^2}{n_B} \cong 0.6558$$

$$P(\bar{X}_{H_0} \leqslant C) = 0.05 \implies RC_X\,]-\infty\,, -1.332] \qquad \bar{x}_A - \bar{x}_B = -1.5 \in RC_X$$

$$z_0 = \frac{\bar{x}_A - \bar{x}_B}{\sqrt{\frac{\delta_A^2}{n_A} + \frac{\delta_B^2}{n_B}}} \cong -1.8523 \qquad RC_z =]-\infty\,, -1.6448] \qquad pvalue = P(Z < z_0) = 0.032$$

Condição NEE:

$$\begin{cases} \mu = 0 \\ \delta = s \end{cases} \implies \bar{Y} = \bar{Y}_A - \bar{Y}_B \backsim N\left(0\,, \frac{\delta_A^2}{n_A} + \frac{\delta_B^2}{n_B}\right) \quad ; \quad \frac{\delta_A^2}{n_A} + \frac{\delta_B^2}{n_B} \cong 0.1296$$

$$P(\bar{Y}_{H_0} \leqslant C) = 0.05 \implies RC_Y\,]-\infty\,, -0.5921] \qquad \bar{y}_A - \bar{y}_B = -0.9 \in RC_Y$$

$$z_0 = \frac{\bar{y}_A - \bar{y}_B}{\sqrt{\frac{\delta_A^2}{n_A} + \frac{\delta_B^2}{n_B}}} \cong -2.5 \qquad RC_z =]-\infty\,, -1.6448] \qquad pvalue = P(Z < z_0) = 0.0062$$

A Hipotese de proximdade entre as regiões é falsa, ambos os criterios estão dentro da região de rejeição logo a hipotese imposta é falsa. O valor de prova também reforça a ideia pois a percentagem de favorecimento é quase nulo.

.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%.

k-numero de classes ; m-numero de parâmetros

TEE Região A:

k=6 , m=2 e α=0.05

$$\begin{cases} H_0 : X \backsim N(20.0417\ ,\ 6.4494^2) \\ H_1 : X \nsim N(20.0417\ ,\ 6.4494^2) \end{cases}$$

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

$RC_{\chi^2} = [\ InvChiCD(0.05, 3)\ ,\ +\infty\ ] \quad \rightarrow \quad RC = [\ 7.8147\ ,\ +\infty\ ]$

$q_0 = 7.2234 < 7.8147$

NEE Região B:

k=8 , m=2 e α=0.05

$$\begin{cases} H_0 : X \backsim N(7.5111\ ,\ 2.5140^2) \\ H_1 : X \nsim N(7.5111\ ,\ 2.5140^2) \end{cases}$$

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

$RC_{\chi^2} = [\ InvChiCD(0.05, 5)\ ,\ +\infty\ ] \quad \rightarrow \quad RC = [\ 11.0705\ ,\ +\infty\ ]$

$q_0 = 8.5532 < 11.0705$

Ambas as condições propostas são aceitaveis como distribuições com um grau de confiança de 95%, pois estão fora da região de rejeição.

.3.5 Relação Erro Tipo 1 e 2 da alinea 3.3

Apresente um gráfico expressando a relação entre o erro tipo I (α) e a potência do teste (1-β), para valores hipotéticos das verdadeiras diferenças de médias calculadas anteriormente no ponto 3.3.

Hipotese na qual a população reflect a destribuição da amostra:

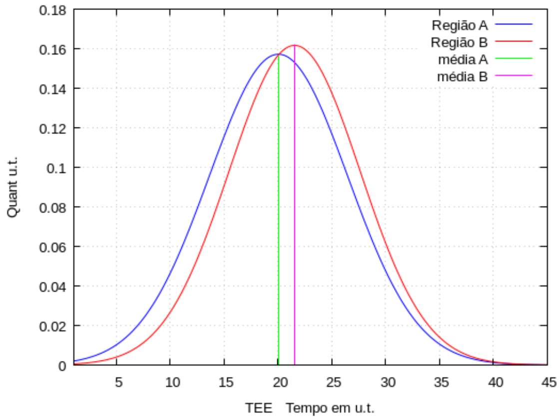

Figura 3: TEE Região A e B

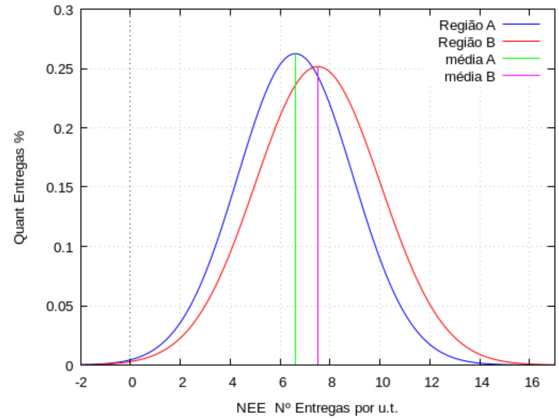

Figura 4: NEE Região A e B

.4 Resultados e interpretação

A mediana é o ponto de equilibriu da destribuição nos informa o ponto na qual o pesso em ambos os lados é igual, em conjunto com a média e a moda nos pode dar mais informação sobre sua identidade, sobre sua calda e sua forma. Neste trabalho temos quatro destribuições Normais que diferem uma das outras, ou seja cada região tem um comprtamento que lhe é próprio.

.5 Conclusões

Este relatório foi feito recorrendo ao excell do libreoffice, em conjunto com a calculadora da Casio fx-9860GII, portanto todos os resultados não estão apresentados no excell devido aos calculos auxiliares tem sido feitos apart.

A ortographia do relatorio pode ter erros, os exercicios propostos são muito abrangentes e o tempo definido curto para sua conclusão, sendo que podia ser muito mais elaborado e feito mais testes para ter um estudo mais aprofundado. Muitas das questões levam a ter dúvidas de forma a aprofundar a matéria, dando a sensação na qual não conseguimos obter uma completa percepção no seu todo, sendo possivel explorar varias ideias de enfrentar os problemas.

O relatório é um estudo aceca da esattistica mais ao redor da **Destribuição Normal** em que sua Média = Mediana = Moda, é 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.

Fazer o estudo de uma população para poder inferir seu comportamento através de tiros no escuro, ou seja, hipoteses tomadas como verdades e comparar com os resultados de forma a poder tirar uma decisão da sua preposicão.

No caso do χ^2 podermos averiguar qual o grau de proxidade da destribuição proposta para representar nossos dados, para podermos depois analizar o desconhecido pelo já adquirido, sempre com uma margem de incerteza. Fazer inferencias acerca de uma população atravez de amostras há sempre a possibilidade de erro, neste caso são dois os tipos identificados. O primeiro tipo é quando se rejeita a hipotese imposta quando ela é verdade, e a segunda aceitar uma hipotese que é falsa, sendo que a segunda no meu ver é mais grave, dado que errar e estar tudo bem é sempre uma boa surpresa, caso contrario um desastre.

Lista de Figuras

[] [1]

[1]Apontamentos Estatistica