



Estadística II

Tema 0. Repaso de conceptos básicos

Curso 2013/14



Tema 0. Repaso de conceptos básicos

Contenidos

- ▶ Variables aleatorias y distribuciones de probabilidad
- ▶ La distribución normal
- ▶ Muestras aleatorias, estadísticos y distribuciones en el muestreo
- ▶ La distribución de la media muestral
- ▶ Teorema central del límite



Tema 0. Repaso de conceptos básicos

Referencias en la bibliografía

- ▶ Meyer, P. "Probabilidad y aplicaciones estadísticas" (1992)
 - ▶ Capítulos 4, 9, 12 y 13
- ▶ Newbold, P. "Estadística para los negocios y la economía" (1997)
 - ▶ Capítulos 4, 5 y 6



Variables aleatorias

- ▶ **Experimento aleatorio:** proceso con distintos resultados posibles, siendo incierto el correspondiente a una realización concreta
- ▶ **Variable aleatoria:** variable que toma valores (numéricos) asociados a los resultados de un experimento aleatorio
 - ▶ **Variable aleatoria discreta:** Si puede tomar un número finito o numerable de valores
 - ▶ **Variable aleatoria continua:** Si puede tomar un número infinito no numerable de valores (por ejemplo, valores en un intervalo de la recta real)
- ▶ **Notación:** representaremos las variables aleatorias con letras mayúsculas, X , y sus valores con letras minúsculas, x_1 .

Ejemplos:

- ▶ El número de parados en un periodo de tiempo en una cierta región
- ▶ Los beneficios de una empresa en un periodo de tiempo
- ▶ La variación en la cotización en Bolsa de una empresa en una semana



Distribuciones de probabilidad

- ▶ Asociamos probabilidades a los valores de una variable aleatoria
- ▶ Definimos funciones (funciones de probabilidad, distribución, densidad) correspondientes a las probabilidades para valores o conjuntos de valores de la variable
- ▶ Clasificamos las variables aleatorias por la forma de sus funciones de probabilidad, densidad

Variables discretas

- ▶ Para una variable aleatoria discreta X con posibles valores $\{x_1, x_2, \dots\}$, definimos su **función de probabilidad** o **función de masa** como

$$p_i = P[X = x_i], \text{ para } i = 1, 2, \dots$$

- ▶ La **función de probabilidad acumulada** se define como

$$F(x_0) = P[X \leq x_0] = \sum_{i: x_i \leq x_0} p_i.$$



Distribuciones de probabilidad

Propiedades

- ▶ $0 \leq P[X = x_i] \leq 1$
- ▶ $F(\infty) = \sum_i P[X = x_i] = 1$
- ▶ $F(y) \leq F(x), \quad \forall y \leq x$
- ▶ $P[X > x] = 1 - P[X \leq x] = 1 - F(x)$
- ▶ $E[X] = \sum_i x_i p_i$
- ▶ $\text{Var}[X] = \sum_i (x_i - E[X])^2 p_i = \sum_i x_i^2 p_i - E[X]^2$



Distribuciones de probabilidad

Ejercicio 0.1

Una variable aleatoria discreta X toma valores con las probabilidades que se indican en la tabla siguiente:

| | | | | |
|--------------|-----|-----|-----|-----|
| Valor | 0 | 1 | 2 | 3 |
| Probabilidad | 0.1 | 0.3 | 0.2 | 0.4 |

- ▶ Calcula su valor esperado y su varianza.
- ▶ Calcula el valor esperado de la variable definida como $Y = \max(2, X)$

Resultados

$$\begin{aligned} E[X] &= 0 \times 0,1 + 1 \times 0,3 + 2 \times 0,2 + 3 \times 0,4 = 1,9 \\ \text{Var}[X] &= \sum_i (x_i - E[X])^2 p_i = 1,09 \\ E[Y] &= 2 \times (0,1 + 0,3 + 0,2) + 3 \times 0,4 = 2,4 \end{aligned}$$



Distribuciones de probabilidad

Ejercicio 0.1

Una variable aleatoria discreta X toma valores con las probabilidades que se indican en la tabla siguiente:

| | | | | |
|--------------|-----|-----|-----|-----|
| Valor | 0 | 1 | 2 | 3 |
| Probabilidad | 0.1 | 0.3 | 0.2 | 0.4 |

- ▶ Calcula su valor esperado y su varianza.
- ▶ Calcula el valor esperado de la variable definida como $Y = \max(2, X)$

Resultados

$$\begin{aligned} E[X] &= 0 \times 0,1 + 1 \times 0,3 + 2 \times 0,2 + 3 \times 0,4 = 1,9 \\ \text{Var}[X] &= \sum_i (x_i - E[X])^2 p_i = 1,09 \\ E[Y] &= 2 \times (0,1 + 0,3 + 0,2) + 3 \times 0,4 = 2,4 \end{aligned}$$



Distribuciones de probabilidad

Variables continuas

- ▶ Para una variable aleatoria continua X , su **función de distribución** se define como

$$F(x) = P[X \leq x]$$

- ▶ Para una variable aleatoria continua (sin masa en ningún punto) se tiene $P(X = x) = 0$
- ▶ En lugar de la función de probabilidad, definimos la función de densidad como

$$f(x) = \frac{dF(x)}{dx} = F'(x)$$



Distribuciones de probabilidad

Propiedades

- ▶ $F(-\infty) = 0$
- ▶ $F(\infty) = 1$
- ▶ $F(y) \leq F(x), \quad \forall y \leq x$
- ▶ $f(x) \geq 0 \quad \forall x \in \mathbb{R}$
- ▶ $P(a \leq X \leq b) = \int_a^b f(x) dx \quad \forall a, b \in \mathbb{R}$
- ▶ $F(x) = P(X \leq x) = \int_{-\infty}^x f(u) du$
- ▶ $\int_{-\infty}^{\infty} f(x) dx = 1$
- ▶ $E[X] = \int xf(x) dx$
- ▶ $\text{Var}[X] = \int x^2 f(x) dx - E[X]^2$



La distribución normal

Descripción

- ▶ Distribución continua más conocida y utilizada
- ▶ Relacionada con otras distribuciones (sumas, media muestral)

Definición

- ▶ Una variable continua X sigue una **distribución normal** con parámetros μ y σ , $X \sim \mathcal{N}(\mu, \sigma)$, si su densidad tiene la forma

$$f(x) = \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} \exp \left\{ -\frac{1}{2\sigma^2} (x - \mu)^2 \right\}$$

- ▶ En este caso, $E[X] = \mu$ y $\text{Var}[X] = \sigma^2$



La distribución normal

Transformaciones lineales

- ▶ La combinación lineal de un número finito de variables aleatorias normales independientes tiene distribución normal
- ▶ $E[\sum_i a_i X_i] = \sum_i a_i E[X_i]$ y $\text{Var}[\sum_i a_i X_i] = \sum_i a_i^2 \text{Var}[X_i]$
- ▶ Si $X \sim \mathcal{N}(\mu, \sigma)$, entonces $Y = aX + b \sim \mathcal{N}(a\mu + b, a\sigma)$

Estandarización

- ▶ Si $X \sim \mathcal{N}(\mu, \sigma)$, se cumple que

$$Z = \frac{X - \mu}{\sigma} \sim \mathcal{N}(0, 1)$$

- ▶ La distribución $\mathcal{N}(0, 1)$ se conoce como **distribución normal estándar**
 - ▶ Basta con disponer de (una tabla de) valores para la distribución normal estándar



La distribución normal

Ejercicio 0.2

- ▶ Para una distribución normal con media 2,5 y varianza 4, calcula la probabilidad de que tome un valor mayor que 4.
- ▶ Considera dos variables normales independientes X_1 y X_2 con los parámetros anteriores. Calcula la probabilidad de que $X_1 - X_2$ sea mayor que 1.

Resultados

$$P(X > 4) = P\left(\frac{X - 2,5}{\sqrt{4}} > \frac{4 - 2,5}{\sqrt{4}}\right) = P(Z > 0,75) = 0,227$$
$$\text{Var}[X_1 - X_2] = 2\text{Var}[X_1] = 8, \quad \sim N(0, \sqrt{8})$$
$$P(X_1 - X_2 > 1) = P\left(\frac{X_1 - X_2}{\sqrt{8}} > \frac{1}{\sqrt{8}}\right) = P(Z > 0,354) = 0,362$$



La distribución normal

Ejercicio 0.2

- ▶ Para una distribución normal con media 2,5 y varianza 4, calcula la probabilidad de que tome un valor mayor que 4.
- ▶ Considera dos variables normales independientes X_1 y X_2 con los parámetros anteriores. Calcula la probabilidad de que $X_1 - X_2$ sea mayor que 1.

Resultados

$$P(X > 4) = P\left(\frac{X - 2,5}{\sqrt{4}} > \frac{4 - 2,5}{\sqrt{4}}\right) = P(Z > 0,75) = 0,227$$
$$\text{Var}[X_1 - X_2] = 2\text{Var}[X_1] = 8, \quad \sim N(0, \sqrt{8})$$
$$P(X_1 - X_2 > 1) = P\left(\frac{X_1 - X_2}{\sqrt{8}} > \frac{1}{\sqrt{8}}\right) = P(Z > 0,354) = 0,362$$



Muestras aleatorias

Definiciones

- ▶ **Población:** conjunto completo de información sobre el valor de interés
- ▶ **Muestra:** subconjunto de valores de la población
- ▶ **Inferencia:** proceso de obtención de información sobre valores desconocidos de la población a partir de valores muestrales (con coste reducido)

Muestra aleatoria simple

- ▶ Cada miembro de la población tiene la misma probabilidad de pertenecer a una muestra aleatoria simple
- ▶ La selección se realiza de manera independiente
 - ▶ La selección de un individuo no afecta a la probabilidad de seleccionar cualquier otro



Distribuciones en el muestreo

Definiciones

- ▶ **Estadístico:** una función de la información en la muestra
 - ▶ Un estadístico es una variable aleatoria, su valor depende de la muestra escogida
- ▶ **Distribución muestral:** distribución de probabilidad de un estadístico sobre todas las muestras con el mismo tamaño. Cambia con el tamaño de la muestra

La media de la población

- ▶ La **media poblacional** es un parámetro muy relevante en muchas situaciones prácticas
- ▶ Estadístico: para una muestra aleatoria simple X_1, \dots, X_n , haremos inferencia sobre la media poblacional partiendo de la media muestral,

$$\bar{X} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i$$



La distribución de la media muestral

Propiedades

- ▶ El valor esperado de la media de la muestra es la media de la población

$$E[\bar{X}] = E\left[\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i\right] = E[X]$$

- ▶ La varianza de la media muestral vale

$$\text{Var}[\bar{X}] = \text{Var}\left[\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i\right] = \frac{1}{n} \text{Var}[X]$$

- ▶ El valor de la varianza decrece si n aumenta
- ▶ Podemos reducir el error aumentando el tamaño de la muestra



La distribución de la media muestral

Distribución

- ▶ Deseamos conocer la distribución de la media muestral
 - ▶ En muchos casos se necesita información adicional a la media y varianza (probabilidades)
- ▶ Si la variable X sigue una distribución normal $\mathcal{N}(\mu, \sigma)$, para una muestra aleatoria simple de tamaño n ,

$$\frac{\bar{X} - \mu}{\sigma/\sqrt{n}} \sim N(0, 1)$$

- ▶ Si X no sigue una distribución normal, resultados aproximados basados en el **teorema central del límite**
 - ▶ Si las variables X_i tienen media μ y desviación típica σ (ambas finitas), y si n es grande, se tiene (aproximadamente) que

$$\frac{\bar{X} - \mu}{\sigma/\sqrt{n}} \sim \mathcal{N}(0, 1)$$



El teorema central del límite

Ejercicio 0.3

Se tiene una muestra aleatoria simple de 100 valores de una distribución con media 25 y desviación típica 20

Calcula la probabilidad de que la media de la muestra esté entre 22 y 28

Resultados

$$\begin{aligned}\frac{\bar{X} - \mu}{\sigma/\sqrt{n}} &\sim N(0,1) \\ P(22 \leq \bar{X} \leq 28) &= P\left(\frac{22 - 25}{20/\sqrt{100}} \leq \frac{\bar{X} - \mu}{\sigma/\sqrt{n}} \leq \frac{28 - 25}{20/\sqrt{100}}\right) \\ &= P(-1,5 \leq Z \leq 1,5) = 0,866\end{aligned}$$



El teorema central del límite

Ejercicio 0.3

Se tiene una muestra aleatoria simple de 100 valores de una distribución con media 25 y desviación típica 20

Calcula la probabilidad de que la media de la muestra esté entre 22 y 28

Resultados

$$\begin{aligned}\frac{\bar{X} - \mu}{\sigma/\sqrt{n}} &\sim N(0,1) \\ P(22 \leq \bar{X} \leq 28) &= P\left(\frac{22 - 25}{20/\sqrt{100}} \leq \frac{\bar{X} - \mu}{\sigma/\sqrt{n}} \leq \frac{28 - 25}{20/\sqrt{100}}\right) \\ &= P(-1,5 \leq Z \leq 1,5) = 0,866\end{aligned}$$



El teorema central del límite

Aproximaciones para proporciones

- ▶ Queremos estudiar las proporciones de cumplimiento de una propiedad en la población
 - ▶ Si X_i representa si se cumple o no la propiedad de interés en un miembro de una muestra aleatoria simple de tamaño n , y la probabilidad de cumplimiento es p , entonces
 - ▶ X_i sigue una distribución Bernoulli
 - ▶ el número de casos en la muestra $X = \sum_i X_i$ sigue una distribución binomial con parámetros n y p
 - ▶ Si n es elevado, se puede aplicar el teorema central del límite para aproximar la distribución de $\hat{p} = X/n$, la proporción en la muestra (y un estimador para p)
- ▶ En este caso, las variables X_i tienen media p y desviación típica $p(1-p)$ y por el teorema central del límite se tiene (aproximadamente) que

$$\frac{X/n - p}{\sqrt{p(1-p)/n}} \sim \mathcal{N}(0, 1)$$



El teorema central del límite

Ejercicio 0.4

Un candidato en unas elecciones locales ha encargado un sondeo sobre una muestra de 36 personas. Si la proporción de personas dispuestas a votarle en la población fuese del 36 %,

- ▶ Calcula la probabilidad de que la proporción observada en la encuesta sea superior al 38 %
- ▶ Como cambia el resultado si la muestra aumenta a 100 personas?

Resultados

$$\begin{aligned} \frac{\hat{p} - p}{\sqrt{p(1-p)/n}} &\sim N(0, 1) \\ P(\hat{p} \geq 0,38) &= P\left(\frac{\hat{p} - p}{\sqrt{p(1-p)/n}} \geq \frac{0,38 - 0,36}{\sqrt{0,36(1-0,36)/36}}\right) \\ &= P(Z \geq 0,25) = 0,401 \\ P(\hat{p} \geq 0,38) &= P\left(Z \geq \frac{0,38 - 0,36}{\sqrt{0,36(1-0,36)/100}}\right) = 0,338 \end{aligned}$$



El teorema central del límite

Ejercicio 0.4

Un candidato en unas elecciones locales ha encargado un sondeo sobre una muestra de 36 personas. Si la proporción de personas dispuestas a votarle en la población fuese del 36 %,

- ▶ Calcula la probabilidad de que la proporción observada en la encuesta sea superior al 38 %
- ▶ Como cambia el resultado si la muestra aumenta a 100 personas?

Resultados

$$\frac{\hat{p} - p}{\sqrt{p(1-p)/n}} \sim N(0, 1)$$

$$\begin{aligned} P(\hat{p} \geq 0,38) &= P\left(\frac{\hat{p} - p}{\sqrt{p(1-p)/n}} \geq \frac{0,38 - 0,36}{\sqrt{0,36(1-0,36)/36}}\right) \\ &= P(Z \geq 0,25) = 0,401 \end{aligned}$$

$$P(\hat{p} \geq 0,38) = P\left(Z \geq \frac{0,38 - 0,36}{\sqrt{0,36(1-0,36)/100}}\right) = 0,338$$