

Guia docent de l'assignatura "Mostreig estadístic"

2011/2012

Codi: 100123

Crèdits ECTS: 6

Titulació	Pla	Tipus	Curs	Semestre
2501919 Estadística Aplicada	973 Graduat en Estadística Aplicada	OB	2	2

Contacte

Nom : Xavier Bardina Simorra

Email : Xavier.Bardina@uab.cat

Utilització d'idiomes

Llengua vehicular majoritària: català (cat)

Algun grup íntegre en anglès: No

Algun grup íntegre en català: Sí

Algun grup íntegre en espanyol: No

Prerequisits

No n'hi ha, però es recomana haver cursat el Càlcul de Probabilitats i la Inferència Estadística.

Objectius i contextualització

En aquesta assignatura introduïm a l'alumne en les diferents tècniques de mostreig.

Es parteix del coneixement del Càlcul de Probabilitats, i de la Inferència Estadística que s'han estudiat en els dos semestres anteriors.

El nostre objectiu serà introduir els termes relacionats amb el mostreig i presentar els mètodes de mostreig més comuns: mostreig aleatori simple amb i sense reposició, mostreig estrat cat, mostreig sistemàtic i mostreig per conglomerats. En tots aquests casos tractarem el problema de l'estimació de diferents paràmetres poblacionals com la mitjana (que podrà ser una proporció), el total poblacional, de vegades la mida de la població, etc... Estudiarem estimadors puntuals dels paràmetres i veurem com trobar intervals de confiança. També estudiarem el problema de trobar la mida necessària de la mostra per estimar els paràmetres amb una precisió fixada. A final del curs s'estudiaran també tècniques per estimar la mida de certes poblacions i s'introduiran els models de resposta aleatoritzada i el problema de la no-resposta.

És important que l'alumne conegui els diferents elements que cal tenir en compte per dissenyar una enquesta i desenvolupi una certa intuïció dels models que s'adaptin millor a les diferents situacions. Per exemple, un element que no podem oblidar a l'hora de dissenyar l'enquesta és el cost de realitzar-la.

Competències i resultats d'aprenentatge

2276:E01 - Identificar i seleccionar les fonts d'obtenció de dades i depurar-les per tractar-les estadísticament.

2276:E01.13 - Identificar les diferents fonts d'informació disponibles.

2276:E01.14 - Conèixer els diferents mètodes de recollida de dades.

2276:E01.15 - Depurar i emmagatzemar la informació en suport informàtic.

2276:E01.16 - Validar i gestionar la informació per a tractar-la estadísticament.

2276:E03 - Seleccionar el tipus de mostreig apropiat per a l'estudi.

2276:E03.01 - Reconèixer els diferents tipus de mostreig.

2276:E03.02 - Determinar la mida de la mostra i establir una estratègia de mostreig per a estudis d'estimació de paràmetres.

2276:E03.03 - Determinar la mida de la mostra i establir una estratègia de mostreig per a estudis de comparació de proporcions.

2276:E03.04 - Determinar la mida de la mostra i establir una estratègia de mostreig per a estudis de comparació de mitjanes.

2276:E03.05 - Determinar la mida de la mostra i establir una estratègia de mostreig per a comparacions especials.

2276:E11 - Utilitzar correctament una bona part del programari estadístic i de recerca operativa existent, escollir el més apropiat per a cada anàlisi estadística i ser capaç d'adaptar-lo a les noves necessitats.

2276:E11.10 - Utilitzar programari estadístic per gestionar bases de dades.

2276:E11.11 - Utilitzar programari estadístic per obtenir índexs de resum de les variables de l'estudi.

2276:E11.13 - Emprar programari estadístic per dur a terme el càlcul de la mida mostral.

2276:T06 - Desenvolupar l'interès pel coneixement i la interpretació de fenòmens susceptibles de quantificació.

2276:T06.00 - Desenvolupar l'interès pel coneixement i la interpretació de fenòmens susceptibles de quantificació.

2276:T12 - Implementar processos amb llenguatges de programació i amb paquets de càlcul simbòlic.

2276:T12.00 - Implementar processos amb llenguatges de programació i amb paquets de càlcul simbòlic.

Continguts

1. Introducció.
 1. Conceptes bàsics
 2. Alternatives al model probabilístic
 3. Etapes del disseny i realització d'una enquesta mitjançant mostreig estadístic
2. Fonaments matemàtics del mostreig probabilístic. Mostreig aleatori simple amb reposició
 1. Notacions bàsiques del mostreig probabilístic
 2. Estimació de paràmetres mitjançant intervals de confiança: sota la hipòtesi de normalitat i usant la desigualtat de Txebychev
 3. Mostreig aleatori simple amb reposició: intervals de confiança per a la mitjana i la proporció poblacionals, selecció de la mida de la mostra i consideracions sobre el cost
3. Mostreig aleatori simple sense reposició
 1. Introducció
 2. Intervals de confiança sobre la mitjana i la proporció poblacionals
 3. Selecció de la mida de la mostra
 4. Consideracions sobre el cost
4. Reducció de la variància: mostreig estratificat
 1. Introducció a l'estratificació
 2. Intervals de confiança per a la mitjana i la proporció poblacionals
 3. El problema de l'assignació i la selecció de la mida de la mostra
 4. Altres consideracions sobre l'estratificació: la fabricació d'estrats i l'estratificació després de seleccionar la mostra
 5. Comparació entre el mostreig aleatori simple i l'estratificat
5. Reducció de la variància: estimació mitjançant estimacions auxiliars
 1. Estimador de raó
 2. Els estimadors de regressió i de diferència
6. Reducció del cost: mostreig sistemàtic
 1. Descripció del mètode
 2. Estimació de la mitjana i el total poblacionals. Selecció de la mida de la mostra
 3. Mostreig sistemàtic replicat

7. Reducció del cost: mostreig per conglomerats
 1. Descripció del mètode
 2. Estimació de la mitjana i el total poblacionals. Selecció de la mida de la mostra
 3. Mostreig per conglomerats amb probabilitats proporcionals a la mida
8. Mostreig per conglomerats en dues etapes
 1. Descripció del mètode de mostreig
 2. Estimació de la mitjana i el total poblacionals
 3. Selecció de la mida de la mostra
 4. Mostreig per conglomerats en dues etapes amb probabilitats proporcionals a la mida
9. Estimació de la mida de la població
 1. Mètode de captura i recaptura per mostreig directe i per mostreig invers
 2. Estimació de la densitat i de la mida de la població usant mostreig per quadrícules
 3. Estimació de la densitat i de la mida de la població usant quadrícules carregades
10. Temes complementaris
 1. El model de resposta aleatoritzada
 2. El problema de la no-resposta: selecció del nombre de reentrevistes

Metodologia

Cada setmana hi haurà una sessió de classe magistral de dues hores on s'exposarà la teoria i una sessió pràctica, també de dues hores, amb ordinadors. Els apunts de teoria es penjaran al campus virtuals prèviament a la realització de cada classe teòrica. També es faran públics al campus virtual els enunciats de les pràctiques abans de realitzar-les. Un cop s'hagi fet la sessió pràctica farem públiques les resolucions de les pràctiques.

Cada dimecres hi haurà classe de teoria de 15:00 a 17:00 i classe de pràctiques de 17:00 a 19:00 a les aules d'ordinadors de la Facultat de Ciències.

Tipologia d'activitat hores

Classes de teoria 30

Classes de Pràctiques 24

Parcials 8

Examen final 4

Estudi 45

Consulta de bibliografia, etc. 12

Preparació de les pràctiques 12

Tutories i altres activitats formatives 15

Total 150

Els temes de l'assignatura estan pensats per dedicar, aproximadament, dues hores a la teoria de cada tema i dues hores a les pràctiques. Al Campus Virtual trobareu desenvolupats tots els temes i els enunciats de totes les pràctiques.

Els alumnes que vulgueu seguir l'assignatura de forma virtual envieu un correu electrònic al professor (Xavier.Bardina@uab.cat).

Activitats formatives

Activitat	Hores	ECTS	Resultats d'aprenentatge
Tipus: Dirigides			
Classe magistral	30	1.2	2276:E01.13 , 2276:E01.14 , 2276:E03.02 , 2276:E03.01 , 2276:E03.05 , 2276:T06.00 , 2276:E03.04 , 2276:E03.03

Pràctiques	24	0.96	2276:E01.13 , 2276:E01.14 , 2276:E01.15 , 2276:E11.10 , 2276:E11.13 , 2276:T12.00 , 2276:E11.11 , 2276:E01.16
Tipus: Supervisades			
Tutories	12	0.48	2276:E01.13 , 2276:E01.14 , 2276:E01.15 , 2276:E03.03 , 2276:E03.05 , 2276:E11.11 , 2276:T06.00 , 2276:T12.00 , 2276:E11.13 , 2276:E11.10 , 2276:E03.04 , 2276:E03.02 , 2276:E03.01 , 2276:E01.16
Tipus: Autònomes			
Altres activitats formatives	3	0.12	2276:E01.14 , 2276:E03.01 , 2276:T12.00
Consulta de bibliografia	12	0.48	2276:E01.13 , 2276:E03.01 , 2276:T06.00 , 2276:E01.14
Estudi	45	1.8	2276:E01.14 , 2276:E03.01 , 2276:E03.02 , 2276:T06.00 , 2276:E03.05 , 2276:E03.04 , 2276:E03.03
Preparació de les pràctiques	12	0.48	2276:E01.13 , 2276:T12.00 , 2276:E11.13 , 2276:E01.15 , 2276:E03.01 , 2276:E11.11 , 2276:E11.10

Avaluació

Es realitzaran tres parcials de l'assignatura. El primer parcial serà dels tres primer temes. L'objecte d'avaluació del segon parcial seran els temes 4, 5 i 6, però cal que tingueu present que per desenvolupar aquests temes es necessiten els conceptes introduïts en els temes anteriors. Finalment hi haurà un tercer parcial l'objecte d'avaluació del qual serà la resta de temes del curs.

Si la mitjana ponderada amb pesos (0.25, 0.375 i 0.375, respectivament) dels tres parcials és superior o igual a 5 s'haurà aprovat l'assignatura per avaluació continuada i l'examen final serà optatiu. A aquesta nota li direm nota d'avaluació continuada. La nota final serà el màxim entre la nota d'avaluació continuada i un 70% de la nota de l'examen final i un 30% de l'avaluació continuada.

Els alumnes que optin per seguir l'assignatura de forma virtual podran fer els parcials o bé realitzar l'avaluació continuada mitjançant lliuraments. En cas que optin pels lliuraments la nota final serà un 70% de la nota de l'examen final i un 30% de l'avaluació continuada.

Activitats d'avaluació

Activitat	Pes	Hores	ECTS	Resultats d'aprenentatge
Examen final (optatiu si s'aprova per avaluació continuada)	70%	4	0.16	2276:E01.13 , 2276:E01.14 , 2276:E01.16 , 2276:E01.15 , 2276:E03.03 , 2276:E03.05 , 2276:E11.11 , 2276:T06.00 , 2276:T12.00 , 2276:E11.13 , 2276:E11.10 , 2276:E03.04 , 2276:E03.02 , 2276:E03.01
parcial 1	25%	2	0.08	2276:E01.13 , 2276:E01.14 , 2276:E01.15 , 2276:E11.10 , 2276:E11.13 , 2276:T12.00 , 2276:T06.00 , 2276:E11.11 , 2276:E01.16
parcial 2	37.5%	2	0.08	2276:E03.01 , 2276:E11.10 , 2276:E11.11 , 2276:E03.02

Bibliografia

- [AS] Abad, A., Servín, L.A. Introducción al muestreo. Editorial Limusa (1984)
- [AS2] Azorín, F., Sánchez-Crespo, J.L. Métodos y aplicaciones del muestreo. Alianza Universidad (1986)
- [C] Cochran, W.G. Técnicas de muestreo. CECSA (1984)
- [FM1] Fernández, F.R., Mayor, J.A. Muestreo en poblaciones finitas: curso básico. EUB (1995)
- [FM2] Fernández, F.R., Mayor, J.A. Ejercicios y prácticas de muestreo en poblaciones finitas. EUB (1995)
- [J] Jacquart, H. Qui? quoi? comment? ou la pratique des sondages. Editions Eyrolles (1988)
- [K] Kalton, G. Introduction to survey sampling. Sage Publications (1983)
- [LL] Levy, P.S., Lemeshow, S. Sampling of populations. Wiley (1991)
- [L] Lohr, S.L., Muestreo: diseño y análisis. Internacional Thomson Editores (2000)
- [M] Mirás, J. Elementos de muestreo para poblaciones finitas. Instituto Nacional de Estadística (1985)
- [R] Rodríguez Osuna, J. Métodos de muestreo. Casos prácticos. Centro de Investigaciones Sociológicas (1993)
- [SMO] Scheaer, R.L., Mendenhall, W., Ott, L. Elementos de muestreo. Grupo Editorial Iberoamérica (1987)
- [S1] Sánchez-Crespo, J.L. Curso intensivo de muestreo en poblaciones finitas. Instituto Nacional de Estadística (1980)
- [S2] Sánchez-Crespo, J.L. Principios elementales del muestreo y estimaciones de proporciones. Instituto Nacional de Estadística (1971)
- [SP] Sánchez-Crespo, J.L., Parada, J. Ejercicios y problemas resueltos de muestreo en poblaciones finitas. Instituto Nacional de Estadística (1990)
- [Su] Sukhatme, P.V. Teoría de encuestas por muestreo con aplicaciones. Fondo de cultura económica (1956)
- [T] Thompson, S. K. Sampling. Wiley (2002)

La bibliografía fonamental està formada pels llibres [SMO], [LL] i [C]. La resta de la bibliografía és complementària.

Als biblioteques de matemàtiques és difícil trobar molts llibres de mostreig. No obstant això, aquests llibres són habituals en biblioteques de ciències socials o ciències medico-biològiques.

En aquesta assignatura disposem d'un llibre que s'adapta perfectament al contingut del curs i que l'alumne podrà utilitzar com a llibre de text: es tracta del llibre de Scheaer, Mendenhall i Ott. Aquest llibre incorpora a més molts exemples i exercicis que ajudaran a l'alumne a entendre la teoria. Els llibres [FM1] i [FM2] són una mica més teòrics però també contenen la totalitat del temari del curs i poden ser seguits per l'alumnat. Un altre llibre amb exemples de problemes resoltos dels diferents tipus de mostreig és [SP].

Un altre llibre interessant és [L] que conté la totalitat del temari de l'assignatura a un nivell adequat per a l'alumne, i a més inclou un Cd-rom amb dades de poblacions i mostres que poden utilitzar-se en la classe de pràctiques.

El llibre de Cochran és sens dubte el text de referència per excel·lència sobre tècniques de mostreig. Es tracta d'un llibre imprescindible per al professor i pot ser útil a l'alumnat per aprofundir en alguns temes en els quals estigui interessat.

El llibre d'Azorín i Sánchez-Crespo és una mica teòric, no obstant això conté diversos capítols molt interessants dedicats a les aplicacions del mostreig a la biologia, a l'economia, al disseny d'enquestes de llars, a la inspecció per mostreig, al control de qualitat, etc...

El llibre de Jacquart el recomanem per a la primera part del curs, sobre el disseny d'enquestes, i que es treballarà en les primeres classes.

Recomanem també, potser per anal de curs, el llibre de Rodríguez Osuna, que recull el disseny i desenvolupament de tres mostres realitzades pel Centre d'Investigacions Sociològiques on s'apliquen els diferents tipus de mostreig que haurem après durant el curs.

Altres llibres que contenen els diferents temes del curs són [K], [M], [AS], [S1] i, a un nivell més elevat i més complet, [LL] i [Su]. D'altra banda en el llibre [S2] trobem una bona introducció teòrica als principis elementals del mostreig i dedica la segona part del llibre a l'estudi de l'estimació de proporcions per als diferents tipus de mostreig