

Guia docent de l'assignatura "Distribucions Multidimensionals" 2011/2012

Codi: 103201

Crèdits ECTS: 6

Titulació	Pla	Tipus	Curs	Semestre
2501919 Estadística Aplicada	973 Graduat en Estadística Aplicada	FB	2	1

Contacte

Nom : Antoni Sintes Blanc

Email : Antoni.Sintes@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

Probabilitat elemental. Variables aleatòries reals. Càlcul diferencial i integral de funcions d'una variable real.
Àlgebra elemental: espais vectorials i determinants.

Objectius i contextualització

L'objectiu bàsic de l'assignatura és l'estudi de la distribució de probabilitat d'un vector aleatori, tant en el cas discret com en el continu. S'analitzen les característiques principals de la distribució conjunta: vector de mitjanes, matriu de variàncies-covariàncies, distribucions condicionals, etc. En particular s'estudia la distribució normal multidimensional, de gran importància degut a les seves aplicacions a la Teoria de Models Lineals i a l'Anàlisi Multivariant.

Les eines principals pel treball amb les distribucions conjuntes són les del Càlcul Integral y Diferencial amb les funcions de varies variables. És doncs natural introduir ací les tècniques de càlcul amb diverses variables (que corresponen a la troncalitat d'anàlisi), amb una motivació i un enfoc dirigit al càlcul de probabilitats multivariant.

Competències i resultats d'aprenentatge**2279:E04 - Resumir i descobrir patrons de comportament en l'exploració de les dades.**

2279:E04.03 - Dominar el llenguatge i les eines bàsiques del càlcul (una i diverses variables).

2279:E12 - Implementar processos amb llenguatges de programació i amb paquets de càlcul simbòlic.

2279:E12.03 - Utilitzar càlcul simbòlic implementant processos per resoldre problemes de probabilitat d'una variable i de diverses variables.

2279:T12 - Expressar i aplicar rigorosament els coneixements adquirits en la resolució de problemes.

2279:T12.00 - Expressar i aplicar rigorosament els coneixements adquirits en la resolució de problemes.

Continguts

1. Els vectors aleatoris.

Vectors aleatoris k-dimensionals. Variables components d'un vector aleatori. Definició de llei conjunta d'un vector aleatori: cas discret i cas absolutament continu. Funció de distribució de probabilitat conjunta d'un vector aleatori. Distribucions bivariants discretes finites. Distribucions marginals.

2. Càlcul diferencial i integral de funcions de vàries variables.

Derivades parcials. Diferencial. Regla de la cadena. Integració en dominis afitats. Teorema de Fubini. Aplicacions diferenciables. Jacobiana. Canvi de variables en la integral múltiple. Integració múltiple en dominis no afitats. Aplicació al càlcul de probabilitats amb vectors aleatoris continus.

3. Estudi de les distribucions conjuntes.

Distribucions bivariants discretes generals. Distribucions marginals. Distribucions multivariants discretes. Distribucions marginals. Estudi d'un exemple: La distribució multinomial. Funcions de dues o més variables aleatòries. Distribucions bivariants contínues. Distribucions marginals. Distribucions multivariants contínues. Distribucions marginals. Funcions de dues o més variables aleatòries: cas continu.

4. Independència i distribucions condicionals.

Variables aleatòries estadísticament independents. Distribucions condicionades.

5. Esperança i altres característiques numèriques.

Esperança d'una funció d'un vector aleatori. Covariància i coeficient de correlació. La matriu de variàncies-covariàncies. Propietats de l'esperança, la variància i la funció generatriu dels moments per a certes funcions de variables aleatòries estadísticament independents. Esperança i variància condicionades. Teorema de la doble esperança.

6. La distribució normal multidimensional.

Estudi de la llei normal bidimensional. La distribució normal multidimensional. Distribucions relacionades amb la normal: χ^2 (khi-quadrada), t de Student, F de Fisher-Snedecor. Teorema de Student.

Metodologia

La metodologia docent es basa en les següents activitats i material:

- Classes magistrals.
- Classes pràctiques de problemes.
- Pràctiques de laboratori.
- Dossier de treball personal.
- Llibres de text de teoria i de problemes.
- Guies d'estudi i treball personal setmanals (GETPS's, Campus Virtual).

Activitats formatives

Activitat	Hores	ECTS	Resultats d'aprenentatge
Tipus: Dirigides			
Classes magistrals	30	1.2	2279:E04.03 , 2279:E12.03 , 2279:T12.00
Tipus: Supervisades			
Classes pràctiques de problemes	13	0.52	2279:E04.03 , 2279:E12.03 , 2279:T12.00

Pràctiques de laboratori	13	0.52	2279:E12.03
Tipus: Autònomes			
Dossier de treball personal d'exercicis i de teoria	43	1.72	2279:E04.03 , 2279:T12.00 , 2279:E12.03

Avaluació

L'avaluació és individual i continuada. Els estudiants poden aconseguir fins a 3 punts amb treballs realitzats al llarg del curs: el dossier de treball personal i els exercicis d'aula, que cal entregar al llarg del curs dins dels plaços establerts. Es faran 2 proves parcials i un examen final presencials. La resta dels punts s'aconsegueixen amb l'examen final que tindrà dues parts "substituïbles" pels corresponents parcials. Per tal de poder aconseguir una avaluació global positiva de l'assignatura, cal obtenir un mínim de 3 punts sobre 10 en cadascuna d'aquestes dues parts.

Activitats d'avaluació

Activitat	Pes	Hores	ECTS	Resultats d'aprenentatge
2 exàmens parcials + 1 examen final	entre 0% i 100%	8	0.32	2279:E04.03 , 2279:E12.03 , 2279:T12.00
Dossier de treball personal d'exercicis i de teoria	entre 0% i 20%	20	0.8	2279:E04.03 , 2279:E12.03 , 2279:T12.00
Exercicis d'aula	entre 0% i 10%	23	0.92	2279:E04.03 , 2279:E12.03 , 2279:T12.00

Bibliografia

J.E. Marsden & A.J. Tromba: *Cálculo Vectorial* (Addison-Wesley).

M. de Groot: *Probabilidad y Estadística* (Addison-Wesley).

D. Peña: *Fundamentos de Estadística* (Alianza Editorial).

D. Peña: *Análisis de datos multivariantes* (McGraw-Hill).

J.G. Kalbfleisch: *Probabilidad e Inferencia Estadística* (Vol. 1) (AC).

V. Zaiats; M.L. Calle; R. Presas: *Probabilitat i Estadística. Exercicis I*. U.A.B. (Materials, 107).