

Inferència estadística**2015/2016**

Codi: 100128

Crèdits: 6

Titulació	Tipus	Curs	Semestre
2500149 Matemàtiques	OT	4	0

Professor de contacte

Nom: Juan del Castillo Franquet

Correu electrònic: Joan.DelCastillo@uab.cat

Utilització de llengües

Llengua vehicular majoritària: català (cat)

Prerequisits

Tot i que no hi ha requisits oficials, es recomana haver cursat Inferència I i tenir una base sòlida de càlcul i de càlcul de probabilitats.

Objectius

Aquesta assignatura dona les bases matemàtiques de la inferència es-tadística, que és la part de l'Estadística que pretén obtenir informació sobre una població a partir de les dades d'una mostra "representativa".

L'assignatura té un caràcter central dins dels estudis ja que en aquest curs es presenten tècniques que seran emprades en tots els procediments estadístics que es puguin fer en el desenvolupament professional.

Començarem amb els aspectes més pràctics de la modelització i la estimació puntual.

Tractarem després la teoria asimptòtica que ens proporciona els errors de les estimacions. Estudiarem la distribució asimptòtica del estimador dels moments i de màxima versemblança, fent servir el mètode delta.

Estudiarem els contrastos no-paramètrics de bondat d'ajust de Pearson i de Kolmogorov-Smirnov.

Finalment estudiarem el Lema de Neymann i Pearson i el test del quocient de versemblances.

Competències

- Davant de situacions reals amb un nivell mig de complexitat, demanar i analitzar dades i informació rellevants, proposar i validar models utilitzant eines matemàtiques adequades per a, finalment, obtenir conclusions
- Formular hipòtesis i imaginar estratègies per confirmar-les o refutar-les.
- Generar propostes innovadores i competitives en la recerca i en l'activitat professional.
- Que els estudiants sàpiguen aplicar els seus coneixements al seu treball o vocació d'una forma professional i posseeixin les competències que solen demostrar-se per mitjà de l'elaboració i defensa d'arguments i la resolució de problemes dins de la seva àrea d'estudi.
- Utilitzar aplicacions informàtiques d'anàlisi estadística, càlcul numèric i simbòlic, visualització gràfica, optimització o altres per experimentar en Matemàtiques i resoldre problemes

Resultats d'aprenentatge

1. Anàlisi de dades.
2. Capacitat d'elaboració i construcció de models i la seva validació.
3. Coneixement, identificació i selecció de fonts estadístiques.
4. Depurar i emmagatzemar la informació en suport informàtic.
5. Disseny, programació i implantació de paquets estadístics.
6. Generar propostes innovadores i competitives en la recerca i en l'activitat professional.
7. Gestió de bases de dades.
8. Identificar la informació rellevant per resoldre un problema.
9. Interpretar resultats a partir de models estadístics.
10. Pensament i raonament quantitatiu.
11. Que els estudiants sàpiguen aplicar els seus coneixements al seu treball o vocació d'una forma professional i posseeixin les competències que solen demostrar-se per mitjà de l'elaboració i defensa d'arguments i la resolució de problemes dins de la seva àrea d'estudi.
12. Representació gràfica de dades.
13. Utilitzar correcta i racionalment el programari.
14. Validar i gestionar la informació per a tractar-la estadísticament.

Continguts

Tema 1: Modelització i Inferència.

- Dades i models. Distribucions binomial, normal i gamma, Pareto.
- Modelització del temps de vida. Distribucions exponencial i de Poisson.
- Funció de versemblança, *score vector* i curvatura.
- Moments i funcions generatrius.
- Desigualtat de Cramer-Rao. Concepte d'eficiència.
- Introducció als mètodes Bayesianes.

Tema 2: Estadística Asimptòtica

- Criteris d'estimació. Comparació d'estimadors.
- Distribució asimptòtica dels moments.
- El mètode delta.
- Distribució asimptòtica del estimador màxim versemblant.
- Distribució asimptòtica del test de raó de versemblança.
- Altres tests asimptòtics (Tests del *score*, Wald...)

Tema 3: Contrastos d'hipòtesis.

- Test de Pearson de bondat d'ajust.
- Proves de Kolgomorov-Smirnov, Cràmer von Mises i Anderson-Darling.
- Anàlisis gràfiques. Plots de probabilitats i de quantils.
- Proves basades en el signe i proves basades en rangs.
- El Lema de Neyman i Pearson. Funció de potència.

Metodologia

Teoria i Problemes:

A les classes de teoria anirem introduint els conceptes i tècniques que descriu el programa del curs. Donat el seu contingut estàndard d'un curs d'inferència estadística es pot seguir fent us de la bibliografia bàsica recomanada.

També s'aniran penjant al Campus Virtual Moodle uns apunts dels diferents capítols que seran ajustats al que es vagi fent a classe.

Pràctiques:

Fer estadística sense un ordinador no té sentit en aquests dies, doncs, en el laboratori veurem com implementar les tècniques que es desenvolupin durant el curs, i també com utilitzar els recursos que hi ha en R per a això.

Activitats formatives

Títol	Hores	ECTS	Resultats d'aprenentatge
Tipus: Dirigides			
Classes de problemes	14	0,56	
Classes de teoria	28	1,12	
Pràctiques amb ordinador	14	0,56	
Tipus: Supervisades			
Treballs pràctics	20	0,8	
Tipus: Autònomes			
Estudi individual	60	2,4	

Avaluació

Per a l'avaluació de l'assignatura es tindran en compte quatre qualificacions:

Una prova escrita bàsica a mitjan semestre: 30%.

Pràctiques al llarg del curs (assistència, treball de classe i lliuraments): 20%.

Prova pràctica al laboratori docent la darrera setmana de curs: 20%

Una prova escrita final en període d'exàmens (juny): 30%

La primera prova bàsica obligatòria podrà en part ser recuperada per la prova final.

Activitats d'avaluació

Títol	Pes	Hores	ECTS	Resultats d'aprenentatge
Examen final	30%	2	0,08	1, 2, 6, 7, 8, 11

Pràctica 1	20%	5	0,2	7, 8, 9, 10
Pràctica 2	20%	5	0,2	3, 4, 9, 12, 14
Prova parcial	30%	2	0,08	3, 5, 6, 13

Bibliografia

- Bickel, P.J. and Doksum, K.A, *Mathematical Statistics, Basic Ideas and selected Topics Vol I.*, Prentice Hall 2007 (reprint f 2nd ed.)
- Casella, G..and Berger, R. *Statistical Inference*, 2^o ed. Wadsworth, Belmont, CA. 2002.
- Freund, J., Miller, I. & Miller, M. *Fundamentos de Estadística con Aplicaciones*. 6ena edició. Ed. Prentice & Hall. 2000.
- Millar, R. (2011). *Maximum Likelihood Estimation and Inference*. Wiley
- Peña, D. *Fundamentos de Estadística*. Alianza Editorial 2001.
- Rizzo, M. *Statistical computing with R*, Chapman & Hall/CRC, cop. 2008
- Luis Ruiz Maya Pérez, Francisco Javier Martín-Pliego López. *Estadística. II, Inferencia*. Editoria AC. 2006
- Verzani, J. *Using R for introductory Statistics* , Chapman and Hall/CRC 2004
- Zaiats, V., Calle, M.L. *Probabilitat i estadística. Exercicis II* Materials UAB, núm 108. 2001.