

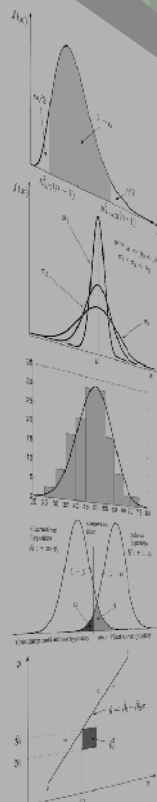
Jiří Neubauer, Marek Sedlačík, Oldřich Kříž

Základy statistiky

Aplikace v technických
a ekonomických oborech
2., rozšířené vydání

 GRADA®

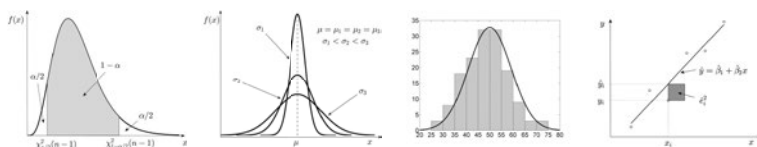
- měření a zjišťování
- teoretické modely
- empirické modely
- základy indukční statistiky
- počítačové zpracování dat
- praktické užití statistiky





Základy statistiky

Aplikace v technických
a ekonomických oborech



2., rozšířené vydání

Jiří Neubauer
Marek Sedlačík
Oldřich Kříž

Upozornění pro čtenáře a uživatele této knihy

Všechna práva vyhrazena. Žádná část této tištěné či elektronické knihy nesmí být reprodukována a šířena v papírové, elektronické či jiné podobě bez předchozího písemného souhlasu nakladatele. **Neoprávněné užití této knihy bude trestně stíháno.**

Jiří Neubauer, Marek Sedlačík, Oldřich Kříž

Základy statistiky

Aplikace v technických a ekonomických oborech

2., rozšířené vydání

Vydala Grada Publishing, a.s.
U Průhonu 22, Praha 7
obchod@grada.cz, www.grada.cz
tel.: +420 234 264 401, fax: +420 234 264 400
jako svou 6222. publikaci

Lektoroval: doc. RNDr. Jaroslav Michálek, CSc.
Recenzovali: prof. RNDr. Pavel Tlustý, CSc., doc. RNDr. Jaromír Kuben, CSc.
Odpovědná redaktorka: Mgr. Věra Slavíková
Počet stran 280
Druhé vydání, Praha 2016
Vytiskla Tiskárna v Ráji, s.r.o., Pardubice

Vydání odborné knihy schválila Vědecká redakce nakladatelství Grada Publishing, a.s.

© Grada Publishing, a.s., 2016
Cover Design © Grada Publishing, a. s., 2016

Názvy produktů, firem apod. použité v knize mohou být ochrannými známkami nebo registrovanými ochrannými známkami příslušných vlastníků.

ISBN 978-80-271-9198-7 (pdf)
ISBN 978-80-247-5786-5 (print)

Obsah

1	Úvod do statistiky	13
1.1	Historický přehled	13
1.2	Význam a pojetí moderní statistiky	19
1.3	Statistická jednotka a statistický soubor	23
1.4	Statistický znak	26
2	Popisná statistika	31
2.1	Vyjadřovací prostředky statistiky	31
2.2	Základní zpracování číselných dat	34
2.3	Charakteristiky polohy	41
2.4	Charakteristiky variability	47
2.5	Charakteristiky koncentrace	53
2.6	Kompletní zpracování dat pomocí aplikace STAT1	56
3	Pravděpodobnost	61
3.1	Základy kombinatoriky	61
3.2	Náhodný pokus a náhodný jev	65
3.3	Pravděpodobnost náhodného jevu	69
3.4	Klasická definice pravděpodobnosti	70
3.5	Geometrická definice pravděpodobnosti	74
3.6	Podmíněná pravděpodobnost	77
3.7	Pravidlo o násobení pravděpodobností	78
3.8	Pravidlo o sčítání pravděpodobností	81
3.9	Úplná pravděpodobnost a Bayesův vzorec	85
4	Náhodná veličina	89
4.1	Náhodná veličina	89
4.2	Distribuční funkce náhodné veličiny	90
4.3	Diskrétní náhodná veličina	91
4.4	Spojité náhodné veličiny	95

4.5	Charakteristiky polohy	98
4.6	Charakteristiky variability	101
4.7	Charakteristiky koncentrace	104
5	Modely rozdělení pravděpodobností pro diskrétní náhodné veličiny	109
5.1	Poissonovo rozdělení	109
5.2	Alternativní rozdělení	112
5.3	Binomické rozdělení	113
5.4	Hypergeometrické rozdělení	116
6	Modely rozdělení pravděpodobností pro spojité náhodné veličiny	119
6.1	Rovnoměrné rozdělení	119
6.2	Exponenciální rozdělení	121
6.3	Normální rozdělení	124
6.4	Normované normální rozdělení	127
6.5	Logaritmicko-normální rozdělení	130
6.6	Rozdělení některých funkcí náhodných veličin	133
7	Teoretické základy statistiky	138
7.1	Zákon velkých čísel	138
7.2	Součet nezávislých náhodných veličin	139
7.3	Centrální limitní věty	142
7.4	Věty o normálním rozdělení	149
8	Výběrová šetření	153
8.1	Druhy výběrového šetření	153
8.2	Náhodný výběr a výběrové charakteristiky	156
8.3	Výběrová rozdělení	157
8.4	Populace, výběr a statistické usuzování	160
9	Odhady charakteristik základního souboru	163
9.1	Bodové odhady parametrů	163
9.2	Intervalové odhady parametrů	168
9.3	Intervalové odhady parametrů normálního rozdělení	170
9.4	Intervalový odhad střední hodnoty pro výběry velkého rozsahu	182
9.5	Intervalový odhad parametru alternativního rozdělení	188
10	Testování statistických hypotéz	192
10.1	Pojem hypotézy a podstata testování hypotéz	192
10.2	Jednovýběrové testy hypotéz	199
10.3	Dvouvýběrové testy hypotéz	207
10.4	Testy hypotéz o rozdělení základního souboru	220

11	Analýza závislostí	233
11.1	Vícerozměrná data	233
11.2	Charakteristiky těsnosti závislosti	236
11.3	Vícerozměrná náhodná veličina	241
11.4	Dvourozměrné normální rozdělení	249
11.5	Test nezávislosti v kontingenční tabulce	253
11.6	Regresní analýza	256
	Použité zdroje	272

O autorech

doc. Mgr. Jiří Neubauer, Ph.D. (*1975)

Vystudoval Přírodovědeckou fakultu Masarykovy univerzity v Brně. Dizertační práci v doktorském studijním oboru aplikovaná matematika obhájil v roce 2006 na Přírodovědecké fakultě Ostravské univerzity v Ostravě. Od roku 2008 absolvoval odborné stáže postupně na Institute of Statistics, Graz University of Technology, Graz, Rakousko, na Department of Statistics, Faculty of Science, University of Malta, Malta a na University of Maribor, Maribor, Slovinsko. V současné době pracuje na Univerzitě obrany jako vedoucí skupiny Katedry ekonometrie. Věnuje se problematice analýzy časových řad se zaměřením na více-rozměrné modely a detekci změn v náhodných procesech. V pedagogické oblasti se věnuje výuce základních statistických metod. Podílí se na řešení výzkumných projektů v rámci své specializace. Publikuje v domácích i zahraničních časopisech.

doc. RNDr. Marek Sedlačík, Ph.D. (*1975)

Vystudoval Přírodovědeckou fakultu Masarykovy univerzity v Brně. Dizertační práci ve studijním oboru Obecné otázky matematiky obhájil roce 2006 na Přírodovědecké fakultě Masarykovy univerzity v Brně, rovněž rigorózní práci v oboru Statistika a analýza dat obhájil na MU v Brně. Od roku 2008 absolvoval odborné stáže postupně na Institute of Statistics, Graz University of Technology, Graz, Rakousko, na Department of Statistics, Faculty of Science, University of Malta, Malta a na National University of Public Service, Budapest, Maďarsko. V současné době pracuje na Univerzitě obrany jako prorektor pro vzdělávání a záležitosti studentů. Věnuje se problematice mnohorozměrných statistických metod se zaměřením na klasifikační techniky. Garantuje a vede výuku v rámci akreditovaného studia. Podílí se na řešení vědeckých projektů v rámci své specializace. Publikuje v domácích i zahraničních časopisech.

RNDr. Oldřich Kříž (*1945)

Vystudoval Přírodovědeckou fakultu Palackého univerzity v Olomouci. V roce 1993 absolvoval specializované studium statistiky na Fakultě informatiky a statistiky Vysoké školy ekonomické v Praze a v roce 1997 absolvoval licenční studium Počítačové zpracování dat při kontrole a řízení jakosti na Fakultě chemicko-technologické Pardubické univerzity. Od roku 2004 působil na katedře ekonometrie Fakulty ekonomiky a managementu Univerzity obrany v Brně. Ve výzkumné oblasti řešil úkoly v souvislosti s distančním vzděláváním statistiky a podílel se na řešení projektů v oblasti senzorické analýzy potravin. Publikoval v domácích i zahraničních časopisech. Je autorem a spoluautorem řady didaktických titulů. V současné době spolupracuje s katedrou externě.

Úvodní slovo recenzentů

Dnešní uspěchaná doba se vyznačuje záplavou informací, které se na nás valí ze všech stran a zásadním způsobem ovlivňují naše názory, životní styl i chování. Nutně tedy vyvstává potřeba najít metody, jak se v takovém množství informací orientovat. Právě statistika dává návod, jak nepřeborné množství dat výstižně shrnout do několika ukazatelů, které lze snadno interpretovat.

Otvíráte knihu zkušeného autorského kolektivu Neubauer, Sedlačík, Kříž s názvem Základy statistiky. Jde v pořadí o druhé, rozšířené vydání. Autoři v ní osvědčili své bohaté zkušenosti s výukou statistických metod a představili čtenářům základy statistického uvažování v moderním pojetí s využitím počítačového softwaru.

Publikace je členěna do 11 kapitol. Úvodní kapitola je věnována historii statistiky, která provází lidstvo od starověkých civilizací až do současnosti. Následující kapitola seznamuje čtenáře s tzv. popisnou statistikou. V dalších čtyřech kapitolách se autoři zabývají vybudováním pravděpodobnostního aparátu, který představuje nezbytné teoretické východisko pro odvození a aplikaci pokročilejších metod matematické statistiky. Vzhledem k tomu, že cílem autorů bylo především naučit čtenáře uvedené metody aplikovat, uvádějí tvrzení teoretické povahy bez důkazu, což bezesporu přispělo k lepší srozumitelnosti textu. Závěrečné kapitoly jsou věnovány základním metodám matematické statistiky – bodovým a intervalovým odhadům, testování statistických hypotéz a analýze závislostí.

Výklad je psán přehledně a srozumitelně. K porozumění textu přispívá i velký počet řešených příkladů, které jsou v mnoha případech voleny záměrně jednoduše, aby bylo možné demonstrovat veškeré potřebné výpočty. K samostatné práci čtenáře jsou určeny závěrečné partie jednotlivých kapitol, kde najdeme množství úloh k procvičení a jejich výsledky. Nespornou výhodou této knihy spatřuji ve výpočetní aplikaci STAT1, kterou autoři vytvořili v EXCELU, pro snadnější výpočty konkrétních statistických úloh. Uvedená aplikace umožňuje elegantním způsobem provádět praktické výpočty k veškeré teorii obsažené v knize.

Domnívám se, že uvedená publikace představuje dobrého „průvodce“ zajímavým světem statistiky, neboť přístupným jazykem naučí čtenáře všemu podstatnému, co potřebuje ze statistiky znát.

prof. RNDr. Pavel Tlustý, CSc.

Katedra matematiky, Pedagogická fakulta, Jihočeská univerzita

Kniha, kterou jste právě otevřeli, je věnována základům matematické statistiky. Je určena jak úplným začátečníkům, tak pokročilejším uživatelům. Celý text druhého vydání je rozdělen do 11 kapitol. V první kapitole se čtenář poučí o historii statistiky a zejména se dozví, co jsou hromadné jevy, čím se statistika vlastně zabývá a kde všude se uplatňuje. Ve druhé kapitole je probírána popisná statistika, která představuje první krok při zpracování statistických dat. Jádrem knihy je ovšem matematická statistika, která vychází z teorie pravděpodobnosti. Proto je v následujících kapitolách 3–7 uveden stručný souhrn základních poznatků o pravděpodobnosti, náhodných proměnných, nejdůležitějších diskrétních a spojitých rozděleních a hlavní teoretické výsledky, které matematická statistika využívá. V kapitolách 8–10 jsou pak probírány základní statistické metody, zejména poznatky o náhodných výběrech, bodové a intervalové odhady číselných charakteristik a testy statistických hypotéz. Závěrečná jedenáctá kapitola je pak úvodem do studia stochastických závislostí. Začíná přehledem potřebných poznatků o náhodných vektorech a soustředí se na kontingenční tabulky a úvod do regresní analýzy.

Autoři se snaží v úvodu každé kapitoly motivovat všechny zaváděné pojmy a usnadnit čtenáři jejich pochopení. Celý text obsahuje řadu řešených příkladů z nejrůznějších oblastí lidských činností, které pomáhají porozumět statistickým metodám a zároveň ilustrují ohromnou šíři aplikací matematické statistiky. Aby umožnili čtenáři praktické vyzkoušení metod vyložených v knize včetně numerických výpočtů, vytvořili autoři v prostředí MS Excel volně dostupnou aplikaci STAT1, v níž si mohou zájemci interaktivně procvičit jednotlivé metody na příkladech z knihy i provést analýzu vlastních dat.

Věřím, že kniha *Základy statistiky* bude užitečná pro širokou škálu uživatelů, kteří nemají profesionální matematické vzdělání, avšak potřebují se seznámit se základy popisné a matematické statistiky a užívat statistické metody ve své práci.

doc. RNDr. Jaromír Kuben, CSc.

Katedra matematiky a fyziky, Fakulta vojenských technologií, Univerzita obrany

Předmluva

Autoři knihy, kterou právě držíte v ruce, se výuce statistiky na vysoké škole věnují již řadu let. Ve snaze předat svoje zkušenosti studentům, ale i dalším uživatelům statistiky, vytvořili předložený text. Hlavním cílem při jeho přípravě byla snaha podat výklad statistiky jednoduchým způsobem, který by akcentoval základy statistické práce a usuzování, přitom však přiměřeně respektoval exaktní pozadí této vědní disciplíny. Proto je kniha vhodná především pro studium základů statistiky zejména na fakultách s ekonomickým nebo technickým zaměřením.

Statistika je vědní disciplína, která je vybudovaná na třech pilířích: teorii pravděpodobnosti, teorii náhodné veličiny a popisné statistice. Abychom dobře porozuměli smyslu statistiky a jejímu možnému uplatnění, musíme pochopit podstatu pravděpodobnosti, neboť všechny závěry, ke kterým statistika svými metodami a prostředky dojde, neplatí s exaktní matematickou přesností, ale mají vždy platnost pouze s jistou pravděpodobností – hovoří se o spolehlivosti. Slovo „pouze“ nepředurčuje statistice význam menší než matematice, ale jiný než matematice. Statistika je totiž disciplína velmi praktická a zabývá se všemi takovými reálnými situacemi, ve kterých se potřebujeme opřít o neznámé informace. Ty jsou zjednodušeně řečeno zatím skryté v tzv. teoretických modelech, popisujících tzv. náhodné veličiny. Odkrývání neznámých informací v nejrůznějších reálných situacích nám umožní popisná statistika, která pracuje s naměřenými nebo zjištěnými daty a informace o nich shrne do tzv. empirického modelu.

Na první pohled je zřejmé, že vyjmenované pilíře tu „pravou“ statistiku ještě netvoří. Vztah mezi teoretickým a empirickým modelem přímo souvisí s filozofií statistiky. Taková statistika má totiž induktivní charakter a zabývá se tím, jak odhadnout ty vlastnosti teoretického modelu, které nás zajímají a přitom je neznáme, pomocí modelu empirického. Výklad celé problematiky v této učebnici je proto založen na vybudování základních pojmů a vztahů, srozumitelném popisu základních metod a je protkán řadou řešených příkladů. Teoretické základy se opírají zejména o vlastnosti normálního rozdělení a o centrální limitní větu a závislost mezi jevy.

Potřeba zpracovávat pozorování či měření, shrnout data a postihnout, co říkají, zanedbat nepodstatné detaily a odhalit společné vlastnosti je přítomná v mnoha vědních oborech. Proto nachází metody matematické statistiky praktické uplatnění v široké třídě oblastí, při řešení nepřehledného množství praktických problémů. Neustále se proto i v textu zdůrazňuje nejdůležitější atribut statistiky, a tím je praktická a reálná podoba řešených problémů.

Součástí dnešního moderního světa je užití výpočetní techniky ve všech sférách života. Statistika je, právě s ohledem na práci s datovými množinami, přímo předurčena k využití počítačů. Na tuto skutečnost reaguje i přístup pedagogů k výuce statistiky na mnoha fakultách. Výklad a řešení praktických úloh je v této učebnici přímo podporován elektronickou aplikací STAT1, která pracuje v excelovském prostředí a umožňuje každému studentovi interaktivně vnímat popsané statistické metody. U vybraných příkladů je použití této aplikace podrobně popsáno. Aplikaci je možné použít i na analýzy vlastních dat. Aplikaci STAT1 spolu se statistickými tabulkami najdete na adrese <http://k101.unob.cz/stat1/>.

Rádi bychom poděkovali kolegovi doc. RNDr. Jaroslavu Michálkovi, CSc. z Univerzity obrany Brno, který se ujal úlohy lektora, knihu pozorně přečetl a doporučil několik úprav. Dík patří též recenzentům, prof. RNDr. Pavlu Tlustému, CSc. a doc. RNDr. Jaromíru Kubenovi, CSc., za jejich podnětné nápady a připomínky.

V Brně 20. 2. 2016

Autoři

Kapitola 1

Úvod do statistiky

První kapitolu této knihy věnujeme úvodnímu seznámení se statistikou. Představíme si statistiku jako vědní disciplínu, která se vyvinula z původních starověkých sčítání obyvatel a majetku až k současnosti. Dozvíme se, co si vlastně máme představit pod pojmem *statistika* a jakou roli hraje statistika v moderní společnosti. Začneme si budovat odborný slovník a zavedeme si základní pojmy, abychom se v odborném prostředí domluvili a také rozuměli tomu, co se kde ve „statistickém jazyku“ píše či mluví.

1.1 Historický přehled

Slovo statistika pochází z italského *stato*, původně s významem *stav*, od konce středověku také *státní území*, resp. *stát*. Jako první jej patrně použil Girolamo Ghilini (1589–1669) v práci *Ristretto della civile, politica, statistica e militare scienza (Shrnutí civilní, politické, statistické a vojenské vědy)*, ve které shromáždil různé znalosti té doby o státu, o jeho obyvatelích, životě, právu, obchodu i výrobě, náboženství i armádě. Především v tomto smyslu se potom slovo *stato* rozšířilo i do jiných jazyků, např. ve tvaru *state*, *Staat*, *état*, *estato*.

Podněty pro vznik statistiky

První historické zmínky o činnostech, které z dnešního pohledu připomínají statistiku, pocházejí už ze starověku. Záznamy o *sčítání obyvatel a majetku* můžeme najít už v písemnostech starých Babyloňanů z období před rokem 3800 př. n. l. Historicky nejstarším směrem ovlivňujícím také vznik statistiky byla existence prvních městských států v 3. a 2. tisíciletí př. n. l. ve starověkých civilizacích, jakými byly Egypt, Čína, Mezopotámie, Palestina, Řecko nebo Řím. Se vznikem městských států vzniká také potřeba jejich správy, se kterou jsou spojené nemalé náklady, proto se zvyšuje výběr daní. K určení jejich výše je ale nezbytné mít číselné údaje o území, obyvatelstvu, zemědělství, obchodu, řemeslech apod. Tyto informace se získávají zejména na základě soupisu obyvatelstva a dalších šetření, která mají z dnešního pohledu charakter statistických šetření.

Jednu z prvních zmínek o statistickém šetření nalezneme také v Bibli, kde je ve Starém zákoně ve 4. knize Mojžíšově informace o sčítání provedeném Mojžíšem po odchodu izraelského národa z Egypta a obsahuje konkrétní počty bojovníků, oddílů a velitelů. Později také nařídil sčítání lidu motivované vojensky král David.

Velké sčítání lidu zavedli také ve starověkém Římě v 5. století př. n. l. Sčítání měli na starosti vysocí úředníci, nazývaní *cenzoři*. Sčítání (cenzy) se konala každých pět let a zjišťovaly se nejen počty obyvatel a jejich majetek, ale také např. počet otroků.

Podobné průzkumy se postupně rozšiřovaly i na další evropské země až do období středověku. Od 16. století byly zřizovány církevní matriky, které se na dlouhou dobu staly základním zdrojem informací o obyvatelstvu.

Tři kořeny statistiky

Vlastní termín *statistika* se začal používat až v 18. století v Německu pro označení *nauky o státu*. Tato vědecká disciplína se začala rozvíjet v 16. století na univerzitách v Itálii a později také právě v Německu, proto se jí říká *univerzitní statistika*. Tehdejší statistické studie obsahovaly především údaje o evropských státech – geografické, politické, ekonomické a další. Na rozdíl od dnešní statistiky neobsahovaly mnoho čísel, většina zaznamenaných údajů měla charakter slovní.

Jedno z prvních státovědných děl *O vládě a správě v různých královstvích a republikách* vyšlo v roce 1562 v Benátkách a napsal je Francesco Sansovina. Přesně o sto let později uveřejnil Ludwig von Seckendorff svou státovědnou knihu *Německý knížecí stát*. Na jejích práce navazuje nejvýznamnější teoretik statistiky v německé jazykové oblasti Gottfried Achenwall (1719–1772). Byl profesorem statistiky na univerzitě v Göttingenu a autorem populární učebnice statistiky, která byla předepsána pro přednášky statistiky i na Karlově univerzitě v Praze.

V Anglii mezitím vznikl zcela jiný okruh statistiky, a to takzvaná *politická aritmetika*, která vycházela z údajů o narozeních a úmrtích, a na tomto základě se pokoušela pozorovat a srovnávat informace o obyvatelstvu za delší časové úseky. Tyto průzkumy vycházely z údajů tehdejších církevních matrik a na jejich základě se snažily odvodit některé obecně platné zákonitosti (např. že se rodí obecně více chlapců než děvčat).

Její nejvýznamnější představitelé jsou William Petty (1623–1687) a John Graunt (1620 až 1674). Petty je považován za předchůdce moderní statistiky i klasické politické ekonomie. Jeho nejvýznamnější dílo *Pět esejí o politické aritmetice* bylo vydáno posmrtně (1960). Graunt byl obchodník a zabýval se především demografií. Napsal první ucelenou demografickou studii s poněkud pochmurným názvem *Přirozená a politická pozorování založená na seznamech zemřelých* (1662).

V 18. století se toto zaměření statistiky začalo prosazovat i v Německu a obě statistické školy se začaly vzájemně ovlivňovat a postupně sblížovat. Statistika začala ve větší míře používat čísla a přestala se zabývat pouze popisem státních pozoruhodností. Postupně začala pronikat i do jiných vědeckých disciplín, aby se nakonec prosadila jako samostatná věda.

Nezávisle na statistice se od 17. století začala rozvíjet ještě jiná teoretická disciplína, která vznikla jako součást matematiky – *teorie pravděpodobnosti*. Zatímco statistika zkoumá hromadné jevy, teorie pravděpodobnosti se naopak zabývá jevy individuálními, jedinečnými. Pravděpodobnost je chápána jako číselné ohodnocení šance – naděje, že sledovaný konkrétní jev nastane. Ve skutečnosti však statistika a teorie pravděpodobnosti představují dva pohledy na stejný problém. Každý hromadný jev je totiž tvořen jednotlivými jevy individuálními, a naopak opakováním individuálního jevu získáme jev hromadný. V současné době nelze

teorii pravděpodobnosti a statistiku od sebe oddělit – teorie pravděpodobnosti je považována za teoretický základ statistiky.

Rozvoj teorie pravděpodobnosti byl zpočátku inspirován hlavně hazardními hrami. Za její počátek se považuje slavná výměna dopisů mezi matematiky Blaisem Pascalem (1623–1662) a Pierrem de Fermatem (1601–1665) zahájená roku 1654. Šlo jim tehdy o otázku, jak spravedlivě rozdělit bank mezi hráče, jestliže série hazardních her musela být předčasně přerušena. Tehdy rozvíjené teorii pravděpodobnosti dnes říkáme *klasická pravděpodobnost*. Mezi další osobnosti, které se věnovaly teorii pravděpodobnosti, patří švýcarští matematici (bratři) Jacob Bernoulli (1656–1705) a Johann Bernoulli (1667–1748), francouzští matematici Abraham de Moivre (1667–1754), Pierre Simon Laplace (1749–1827) a také Siméon Denis Poisson (1781–1840), se kterým se setkáme v 5. kapitole – viz *Poissonovo rozdělení pravděpodobnosti*, které je vhodné pro popis jevů s nízkou pravděpodobností jevu při značném rozsahu výběrového souboru. Významný příspěvek k teorii chyb předložil také vynikající německý matematik Carl Friedrich Gauss (1777–1855), který přispěl k formulování tzv. *normálního rozdělení pravděpodobnosti* – viz 6. kapitola.

Statistika jako nová věda

Postupným splýváním nauky o státu, politické aritmetiky a teorie pravděpodobnosti vznikla v 18. a 19. století statistika jako samostatná vědní disciplína, která popisovala hromadné jevy v nově vznikajících vědách – přírodních, technických i ekonomických. Statistika tohoto období se zabývala především popisem zkoumaných hromadných jevů, proto se také nazývá *popisná – deskriptivní statistika*. Metodou statistických průzkumů byla vyčerpávající šetření prováděná podle zásady: čím více údajů získáme, tím přesnější budou závěry. Toto pravidlo ve statistice převládalo až do konce 19. století.

Významnou osobností nové statistiky byl belgický matematik Adolphe Jacques Quételet (1796–1874), který je zakladatelem prvního národního statistického úřadu (1841) v Evropě. Mimo jiné se věnoval rozsáhlému sběru dat o lidské populaci a prezentoval svůj pojem „průměrného člověka“ jako centrální hodnoty, kolem které se měřené tělesné míry shlukují podle Gaussovy křivky – viz 6. kapitola. V té souvislosti zavedl také pojem index tělesné hmotnosti používaný dodnes pro stanovení míry obezity a známý pod zkratkou BMI (body mass index). Naznačil tak budoucí směřování statistiky k normálnímu rozdělení, střední hodnotě a rozptylu. Pomohl rovněž zavést statistické techniky do kriminalistiky, pomocí statistické analýzy porozuměl Quételet vztahu mezi zločinem a ostatními sociologickými faktory.

Na přelomu 19. a 20. století však dochází ve vývoji statistiky k zásadní změně. Začala éra *matematické – induktivní statistiky*, která na základě teorie pravděpodobnosti umožňuje získat kvalifikované závěry – odhady o sledovaném jevu i z malého dostupného vzorku údajů. Nové statistické postupy otevřely možnosti pro nejrůznější typy průzkumů, ve kterých se z vlastností části usuzuje na chování celku. Na bázi induktivní statistiky vznikly také extrapoláčnické – prognostické metody, které na základě znalosti dat z minulosti umožní vytvořit kvalifikovaný odhad chování v budoucnosti.

Těžiště rozvoje induktivní statistiky se do značné míry přesunulo do anglo-americké oblasti a je spojeno především se jménem anglického statistika sira Ronalda Aylmera Fishera (1890–1962), který stál u vzniku mnoha dnes obvyklých metod statistické analýzy. Je pova-

žován za zakladatele teorie plánování experimentů v biologickém a zemědělském výzkumu. Významných výsledků dosáhl i další anglický statistik William Sealy Gosset (1876–1937), který pracoval jako chemik v irském pivovaru Guinness a tam vymyslel postup, který umožnil provádět z malých výběrů použitelné závěry, přinejmenším však poznat, jak posuzovat vypovídací hodnotu takových výběrů. Gosset se pod svá průkopnická díla podepisoval pseudonymem „Student“, protože jeho firma mu publikování výsledků pod vlastním jménem zakázala.

Další významní představitelé anglické statistické školy byli Francis Galton (1822–1911) a Charles Pearson (1857–1936), kteří položili základy zkoumání závislostí mezi hromadnými jevy. K rozvoji matematické statistiky přispěli také ruští matematici: Pafnutij Lvovič Čebyšev (1821–1894), Andrej Andrejevič Markov (1856–1922) a Andrej Nikolajevič Kolmogorov (1903–1987), který je považován za zakladatele moderní teorie pravděpodobnosti.

U nás dosáhly pozoruhodných výsledků dvě osobnosti. Prvním byl profesor Jaroslav Janko (1893–1965). Svou celoživotní činností velmi významně přispěl k rozvoji matematicko-statistických metod, k jejich nanejvýš užitečnému uplatnění ve výzkumu a praxi, a zapsal se tak do historie matematické statistiky u nás. Známá jsou jeho díla *Jak vytváří statistika obrazy světa a života*, *Základy statistické indukce a Statistické tabulky*. Druhým byl profesor Jaroslav Hájek (1926–1974), kterého lze považovat za nejvýznamnějšího českého statistika v historii české matematiky. Jeho odborné aktivity byly zaměřené na neparametrické statistické metody.

Současná statistika

Statistika dnes představuje vědní disciplínu se širokým praktickým uplatněním. Používá se zejména jako důležitý nástroj získávání informací ve veřejných sférách našeho života, ale i jako důležitý nástroj řešení nejrůznějších odborných problémů, zejména technických, přírodovědných, ekonomických, vojenských, sociálních. Je tomu tak proto, že moderní statistika využívá všech postupů a metod, které během svého dlouhého vývoje vytvořila nebo si osvojila. Používá jak prvky klasické popisné statistiky, založené na analýze hromadných dat, tak i prvky moderní matematické statistiky, postavené na teorii pravděpodobnosti. Proto statistiku vnímáme nejen jako nástroj poznání (velký nepřehledný soubor dat dokáže nahradit několika výstižnými charakteristikami), ale také jako nástroj rozhodování v neurčitosti (na základě vlastnosti vzorku usuzuje na vlastnosti celého souboru, popř. z informací o minulosti předvídá vývoj v budoucnosti).

Velký význam pro rozvoj a využití statistických metod měl nástup výpočetních technologií, zejména osobních počítačů. Počítač vítězí nad člověkem především v těch úkonech, které jsou pro člověka tradičně nejdélnější – třídění, vyhledávání a výpočty s velkým množstvím dat. Počítačům jsou vlastní také možnosti tabulkového zpracování a grafického vyjadřování. Mezi nejznámější profesionální statistické programy se širokým portfoliem metod a technik patří Statistica, SPSS, SAS, Statgraphics, Minitab a další, z českých produktů QCExpert. Pro potřebu výuky statistiky využívá řada škol i tabulkový kalkulátor MS Excel, který patří k základní výbavě osobního počítače. Naše učebnice bude podporovaná jednoduchou aplikací STAT1, vytvořenou právě v excelovském prostředí.

Statistika byla zpočátku využívána spíše ve vědách přírodních (fyzika, chemie) a technických, v posledních letech však zaznamenává úspěch také v disciplínách humanitního charakteru, například v psychologii, sociologii, pedagogice, ale také v ekonomii, která pů-

vodně vznikla jako věda sociální, během času se svými metodami přiblížila spíše vědám přírodním. K výraznějšímu rozvoji statistických metod došlo na přelomu 19. a 20. století, a to zejména díky novým objevům ve statistice (zejména nástupu metod matematické statistiky). To vedlo k dalšímu přibližování statistiky reálnému životu a prudkému rozvoji aplikací statistiky v nejrůznějších oborech lidské činnosti. Vznikaly tak postupně speciální statistické metody, které tvořily základ speciálních vědních disciplín. Pod názvem *biostatistika*, resp. *biometrika* se např. rozumí aplikace statistiky na biologické problémy, zatímco pro analýzu chemických dat se spíše užívá termín *chemometrie*. Hlavním cílem aplikací statistických metod v *biomedicínském výzkumu* je zajistit správnost a odbornost statistického vyhodnocování dat a interpretace získaných výsledků. Používání počítačů k těmto účelům je v dnešní době samozřejmé.

Aplikací statistických metod na ekonomická a sociálně-ekonomická data vznikla samostatná statistická disciplína, *ekonomická statistika*. Předmětem ekonomické statistiky je analýza stavu a vývoje jevů v hospodářské oblasti jako východiska k hospodářskému rozhodování či stanovení hospodářské politiky. Na využití statistických metod je založený průzkum trhu, plánování výroby, prognostika, kontrola kvality výroby, personální politika, výroční zprávy (určené akcionářům). Ještě k vyšší kvalitě ekonomické analýzy vede disciplína označovaná jako *ekonometrie*. Ta představuje syntézu ekonomické teorie, informatiky, matematiky a statistiky. Tato syntéza není však mechanickým spojením ekonomické analýzy s aparátem matematiky a statistiky, resp. elektronickými prostředky, ale jde o propojení vzájemně se podmiňujících vědních disciplín.

Statistika v Českých zemích

Statistika je s historií našeho území spjata již od nepaměti. Důvody jsou zcela praktické a zřejmé. Každý vládce chtěl mít přehled, jaký má majetek, kolik má k dispozici mužů do vojska či od kolika poddaných může vymáhat daně. Ale důvody pro statistické zjišťování byly mnohdy i zcela jiného, humánnějšího rázu. Například za vlády císaře Rudolfa II. v roce 1583 vypukla v českých zemích epidemie moru. V jejím důsledku bylo zahájeno šetření o „zdraví populace“, které mělo zmapovat vznik a rozvoj zhoubných epidemií a umožnit přijímání včasných protiopatření.

Jako významný mezník lze označit datum 13. října 1753, kdy byl vydán *patent císařovny Marie Terezie* o každoročním sčítání lidu. Zdokonalení evidence obyvatel souviselo s rozsáhlou reformní činností Marie Terezie (1717–1780), neboť k provedení četných reforem bylo nutné získat objektivní informace o obyvatelstvu. Za vlády Marie Terezie došlo také k reformě evidence narozených a zemřelých. V této souvislosti byla zavedena i první jednoduchá statistická klasifikace příčin úmrtí.

Jak už víme, první statistický úřad v Evropě byl založen v roce 1841 v Belgii. Řada evropských zemí Quételetův úřad následovala. V roce 1897 byl zřízen *Zemský statistický úřad Království českého*, který se stal prvním skutečně statistickým úřadem na území dnešní České republiky. Poprvé byla soustředěna na jednom místě všechna statistická pracoviště, která až do té doby působila v rámci různých ministerstev a dalších institucí.

Brzy po vzniku samostatného Československa, už v roce 1919, byl založen *Státní úřad statistický* (SÚS) jako nový orgán pověřený celostátními statistickými šetřeními, mezi něž patřilo jako jedno z nejdůležitějších i sčítání lidu. Úřad se v období mezi světovými válkami

rozvíjel, zdokonaloval a rozšiřoval svoji činnost. K tomu přispělo i úzké sepětí se statistickou teorií. Ve 20. a 30. letech 20. století byla téměř polovina kapacity statistického úřadu věnována vědecké a teoretické činnosti.

V období 2. světové války se činnost statistiky v Čechách a na Moravě omezila a odpovídala válečným podmínkám i postavení našeho území. Perzekuována byla řada pracovníků SÚS, někteří z nich byli popraveni (např. předseda úřadu Dr. Jan Auerhan byl 6. 6. 1942 zatčen gestapem a 9. 6. 1942 zastřelen), jiní zemřeli v nacistických věznicích a koncentračních táborech. Bezprostředně po skončení 2. světové války byla činnost Státního úřadu statistického obnovena, s cílem vrátit jej na předválečnou úroveň. Po roce 1948 se československá statistika (zejména v ekonomické oblasti) zaměřovala zejména na úkoly národohospodářské evidence a kontrolu plnění plánu.

Po pádu komunistického režimu v roce 1989 se obnovily předpoklady pro budování objektivní, nestranné a nestraničké státní statistické služby. K 1. 1. 1993, se vznikem ČR, převzal Český statistický úřad (ČSÚ) všechny kompetence národního statistického úřadu. Jeho úkoly a postavení, stejně jako zásady a úkoly fungování státní statistické služby v ČR, upravil zákon č. 89/1995 Sb., o státní statistické službě, který byl ještě novelizován k 1. 1. 2001. Jeho hlavním úkolem je shromažďovat a zveřejňovat statistické informace o sociálním a ekonomickém rozvoji České republiky a obstarávat statistické informace pro potřeby dalších orgánů státní správy a územní samosprávy. Vedle centrálního pracoviště ČSÚ v Praze existují krajské reprezentace ve všech 14 krajských městech. Prvním předsedou ČSÚ byl čechokanaďan Edvard Outrata (*1936). Mimo oficiální soustavu státní statistiky stojí řada specializovaných komerčních agentur, které se především zabývají statistickými průzkumy (např. marketingovými) pro podnikatelské subjekty, ale jsou také pověřovány úkoly pro státní statistiku.

V současnosti existují orgány statistické služby prakticky ve všech zemích Evropy. Jejich konkrétní podoba a struktura se však může stát od státu lišit, i když v poslední době dochází ke koordinaci státních statistik v rámci všech členských i přidružených zemí EU. Centrálním statistickým orgánem Evropské unie je EUROSTAT, který má sídlo v Lucemburku, jeho současným generálním ředitelem je Walter Radermacher (*1952). Shromažďuje statistické informace o členských zemích Evropské unie, ale také o dalších evropských zemích. Šest středoevropských zemí (ČR, Maďarsko, Polsko, Rumunsko, Slovinsko a Slovensko) spolupracuje na výměně statistických informací také prostřednictvím společné nadnárodní instituce CESTAT.

Příklady k procvičení

- Zjistěte na stránkách ČSÚ (www.czso.cz), jaký je v ČR aktuální počet obyvatel.
- Jaká instituce zabezpečuje v ČR sčítání lidu?
- Kdy byl založen Zemský statistický úřad Království českého?
- Je možné souhlasit s následujícími výroky?
 - Začátky statistiky spadají do 18. století.
 - Za prvopočátky statistiky lze považovat záznaky o sčítání lidu a majetku ve starověku.
 - Pravděpodobnost dnes představuje neoddělitelnou součást statistiky.
 - Označení deskriptivní a induktivní statistika představuje z praktického pohledu totéž.
 - Stav a vývoj v ekonomické oblasti sleduje disciplína označovaná jako ekonometrie.
 - Vrcholný statistický úřad EU je Eurostat.
- Vyjmenujte některé historické kořeny statistiky.

Řešení.

- Český statistický úřad;
- 1897;
- a) ne; b) ano; c) ano; d) ne; e) ne; f) ano;
- německá státověda, anglická politická aritmetika a teorie pravděpodobnosti.