Probabilidade

Distribuição contínua

Prof. Dr. Tetsu Sakamoto
Instituto Metrópole Digital - UFRN
Sala A224, ramal 182
Email: tetsu@imd.ufrn.br

Slides e notebook em:

github.com/tetsufmbio/IMD0033/

Na aula passada

Distribuição:

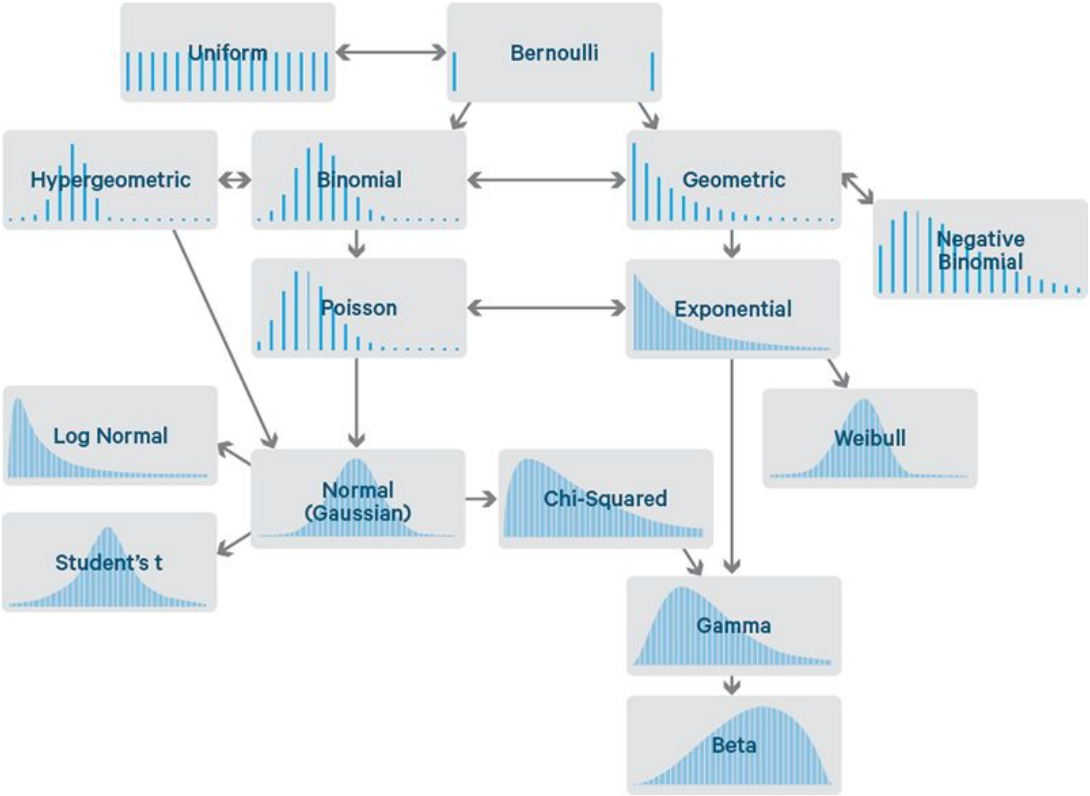
- Não deve haver probabilidades negativas;
- Soma deve ser 1;

Distribuição de Bernoulli

- Média: p
- Variância: pq

Distribuição Binomial

- Média: np
- Variância: npq



Tipos de variáveis aleatórias

Quando os valores do espaço amostral...

- possuem valores bem definido, contáveis → **Discretas**;
- se encontram em um intervalo de valores que são dificilmente definidos, incontáveis → **Contínuas**;

Variável aleatória contínua

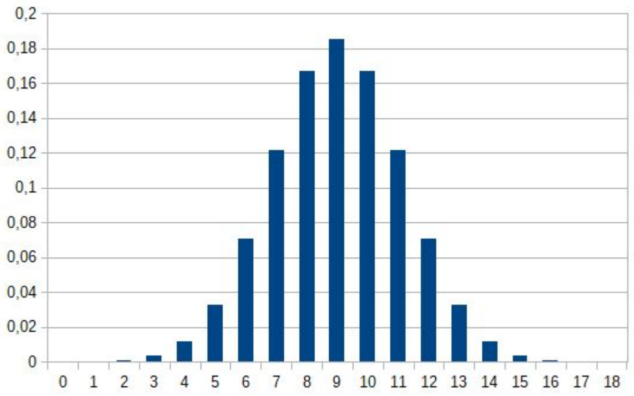
Muitas variáveis são contínuas:

- Tempo
- Espaço
- Massa
- Temperatura

Muitas outras são tratadas como contínuas:

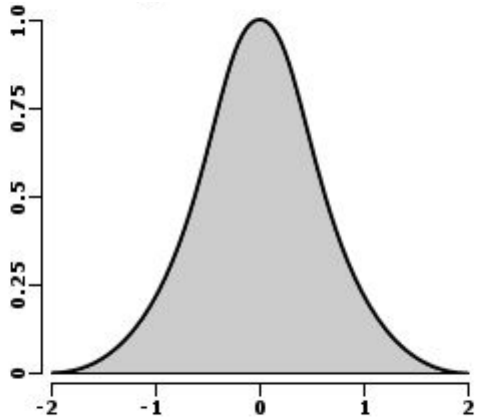
- Custo
- Taxas

Distr. Discreta X Distr. Contínua



Função massa de probabilidade P(x)

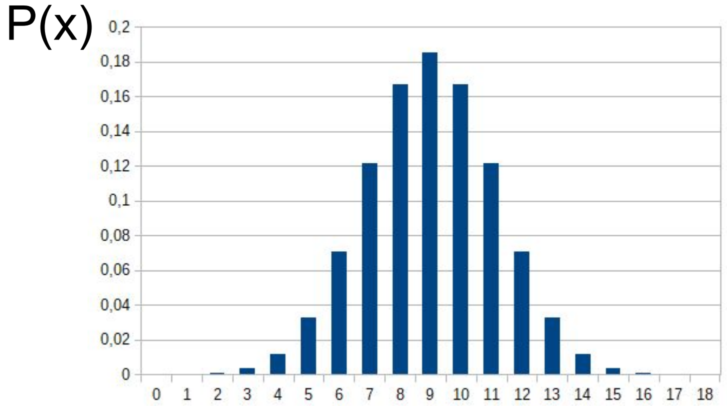
- $P(x) \geq 0$;
- $\sum P(x_i) = 1$;



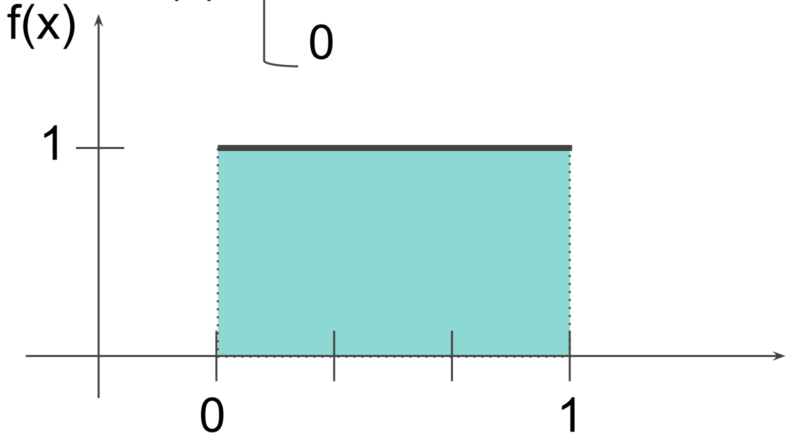
Função densidade de probabilidade f(x)

- $f(x) \geq 0$;
- Área sob a curva = 1;

f(x) não é probabilidade de x (P(x))

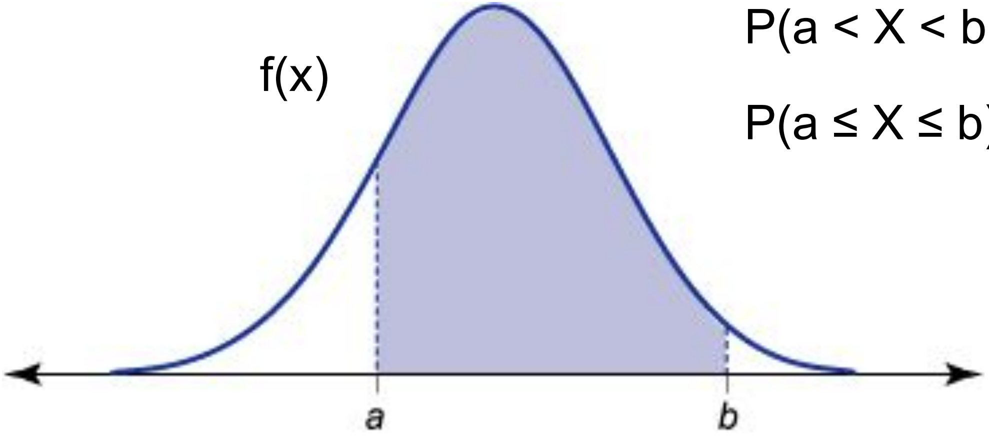


$$f(x) \begin{cases} 1 \text{ se } 0 < x < 1 \\ 0 \end{cases}$$



Em uma função densidade de probabilidade, a probabilidade corresponde a **área da curva**.

A probabilidade corresponde a área sob a curva



f(x)

P(a < X < b)

P(a ≤ X ≤ b)

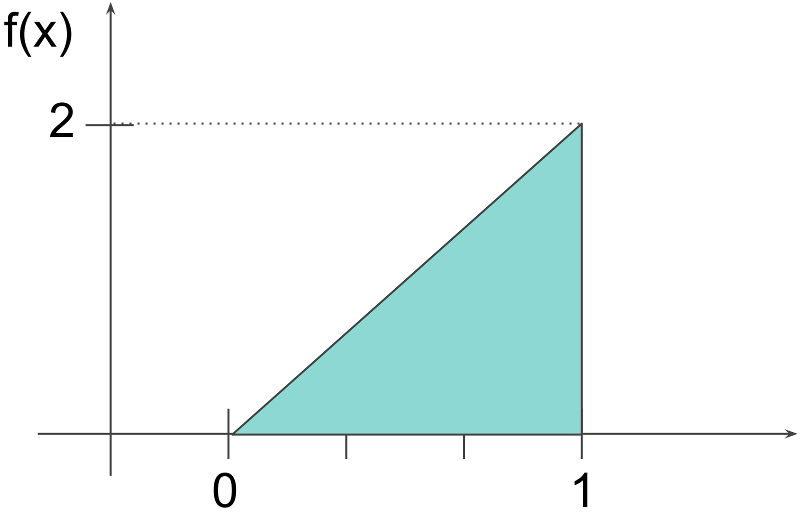
P(X = a) = 0

P(X = b) = 0

P(a < X < b) = P(X < b) - P(X < a)

f(x) pode ser maior que 1

$$f(x) \begin{cases} 2x \text{ se } 0 < x < 1 \\ 0 \end{cases}$$



Esperança

Discreta

$$E(X) = \sum_{x} p_x \,.\, x$$

Contínua

$$E(X) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x).\, x\; dx$$

Uniforme

$$f(x) \begin{cases} 1 \text{ se } 0 < x < 1 \\ 0 \end{cases}$$

$$E(X) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x).\, x\; dx$$

$$E(X) = \int_{0}^{1} 1.x\; dx$$

$$E(X) = \frac{x^2}{2} \Big|_0^1$$

$$E(X) = \frac{1}{2}$$

Triângulo

$$f(x) \begin{cases} 2x \text{ se } 0 < x < 1 \\ 0 \end{cases}$$

$$E(X) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x).\, x\; dx$$

$$E(X) = \int_{0}^{1} 2x.\, x\; dx$$

$$E(X) = \frac{2x^3}{3} \Big|_0^1$$

$$E(X) = \frac{2}{3}$$

Variância

Discreta

$$V(X) = \sum_x p_x . (x - \mu)^2$$

$$V(X) = E(X^2) - E(X)^2$$

Contínua

$$V(X) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x).(x - \mu)^2 \, dx$$

$$V(X) = E(X^2) - E(X)^2$$

$$V(X) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x).(x - \mu)^2 \, dx$$

$$V(X) = \int f(x).(x^2 - 2x\mu + \mu^2) \, dx$$

$$V(X) = \int f(x).x^2 \, dx - \int f(x).2x\mu \, dx + \int f(x).\mu^2 \, dx$$

$$V(X) = E(X^2) - 2\mu^2 + mu^2 = E(X^2) - E(X)^2$$

Variância

Discreta

$$V(X) = \sum_x p_x . (x - \mu)^2$$

$$V(X) = E(X^2) - E(X)^2$$

Contínua

$$V(X) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x) . (x - \mu)^2 \, dx$$

$$V(X) = E(X^2) - E(X)^2$$

Uniforme $\quad f(x) = 1$ se $0 < x < 1$

$$E(X^2) = \int_0^1 f(x) . x^2 \, dx$$

$$E(X^2) = \frac{x^3}{3} \Big|_0^1 = \frac{1}{3}$$

$$V(X) = E(X^2) - E(X)^2$$

$$V(X) = \frac{1}{3} - \frac{1}{2}^2 = \frac{1}{12}$$

Triângulo $\quad f(x) = 2x$ se $0 < x < 1$

$$E(X^2) = \int_0^1 2x . x^2 \, dx$$

$$E(X^2) = \frac{x^4}{2} \Big|_0^1 = \frac{1}{2}$$

$$V(X) = E(X^2) - E(X)^2$$

$$V(X) = \frac{1}{2} - \frac{2}{3}^2 = \frac{1}{18}$$

Exercício

Suponha que X é uma variável aleatória contínua com a função densidade de probabilidade dada por:

$$f(x) = \begin{cases} cx^2, & \text{se } |x| < 1. \\ 0, & \text{caso contrário.} \end{cases}$$

1. Ache a constante c;
2. Determine E(X);
3. Determine V(X);
4. Determine P(X > ½);

Exercício

Ache a constante c;

$$f(x) = \begin{cases} cx^2, & \text{se } |x| < 1. \\ 0, & \text{caso contrário.} \end{cases}$$

$$\int_{-\infty}^{+\infty} f(x)\, dx = 1$$

$$\int_{-1}^{+1} cx^2\, dx = 1$$

$$\frac{cx^3}{3} \Big|_{-1}^{1} = 1$$

$$\frac{2c}{3} = 1 \qquad c = \frac{3}{2}$$

Exercício

Determine E(X);

$$f(x) = \begin{cases} cx^2, & \text{se } |x| < 1. \\ 0, & \text{caso contrário.} \end{cases}$$

$$E(X) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x)x \, dx$$

$$E(X) = \int_{-1}^{+1} cx^2 . x \, dx$$

$$E(X) = \frac{cx^4}{4} \Big|_{-1}^{1}$$

$$E(X) = 0$$

Exercício

Determine V(X);

$$V(X) = E(X^2) - E(X)^2$$

$$f(x) = \begin{cases} cx^2, & \text{se } |x| < 1. \\ 0, & \text{caso contrário.} \end{cases}$$

$$E(X^2) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x)x^2 \; dx$$

$$E(X^2) = \int_{-1}^{+1} cx^2 . x^2 \; dx$$

$$E(X^2) = \frac{cx^5}{5} \Big|_{-1}^{1}$$

$$E(X^2) = \frac{2c}{5} = \frac{3}{5}$$

Exercício

Determine P(X > ½);

$$f(x) = \begin{cases} cx^2, & \text{se } |x| < 1. \\ 0, & \text{caso contrário.} \end{cases}$$

$$P(X > \tfrac{1}{2}) = \int_{\frac{1}{2}}^{1} f(x)dx$$

$$P(X > \tfrac{1}{2}) = \int_{\frac{1}{2}}^{1} \frac{3x^2}{2}dx$$

$$P(X > \tfrac{1}{2}) = \frac{3x^3}{6} \Big|_{\frac{1}{2}}^{1}$$

$$P(X > \tfrac{1}{2}) = \frac{1}{2} - \frac{1}{16} = \frac{7}{16}$$

Exercício

$$f_X(x) = \begin{cases} 4x^3 & 0 < x \leq 1 \\ 0 & \text{caso contrário} \end{cases}$$

Determine: $P(X \leq \frac{2}{3} | X > \frac{1}{3}) = \frac{P(\frac{1}{3} < X \leq \frac{2}{3})}{P(X > \frac{1}{3})}$

$$= \frac{\int_{\frac{1}{3}}^{\frac{2}{3}} 4x^3 dx}{\int_{\frac{1}{3}}^{1} 4x^3 dx}$$

$$= \frac{3}{16}.$$