

Geração de números aleatórios pelo Método da Inversa

Jaqueline Lamas da Silva

05/04/2023

Sumário

Geração de 1000 valores	2
Comparação Histograma x Densidade teórica	3
Comparação função de distribuição empírica + teste	4
QQ-plot + qqline	6

Geração de 1000 valores

Temos uma variável aleatória X com fdp $f_x(x)$ definida por partes, para gerar números aleatórios desta distribuição aplicamos o Método da Inversa. Ou seja, primeiro geramos números de uma uniforme e depois aplicamos ao valores a função quantilica $Q_x(x)$ de X .

$$f_x(x) = \begin{cases} x & \text{se } 0 \leq x < 1 \\ -x + 2 & \text{se } 1 \leq x \leq 2 \end{cases}$$

$$Q_x(p) = \begin{cases} \sqrt{2p} & \text{se } 0 \leq p < 1/2 \\ 2 - \sqrt{2(1-p)} & \text{se } 1/2 \leq p \leq 1 \end{cases}$$

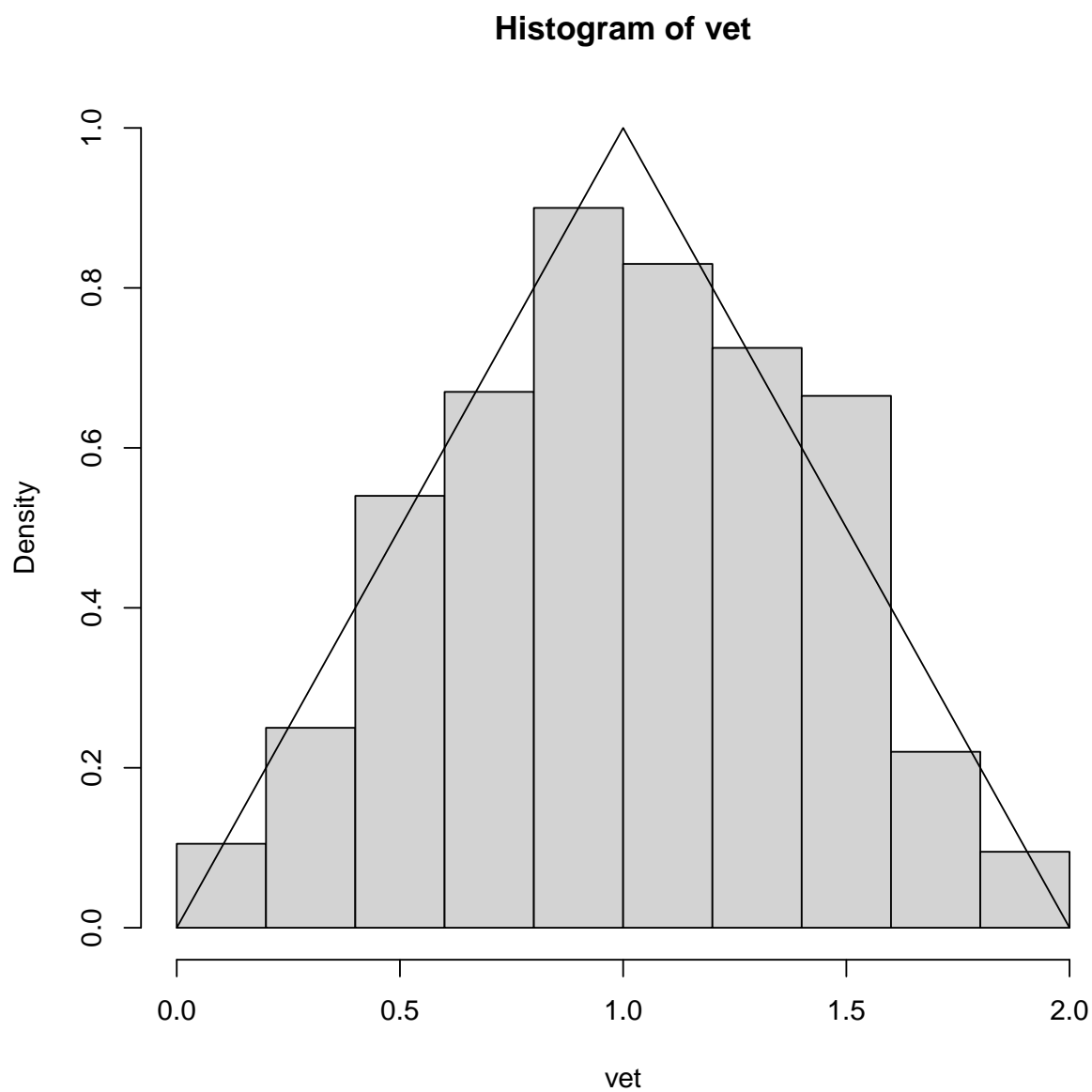
```
Qx<-function(u)
{
  ifelse(u<0.5, sqrt(2*u), 2-sqrt(2*(1-u)))
}

gerar.tri<-function()
{
  u<-runif(1)
  Qx(u)
}

vet<-replicate(1000, gerar.tri())
```

Comparação Histograma x Densidade teórica

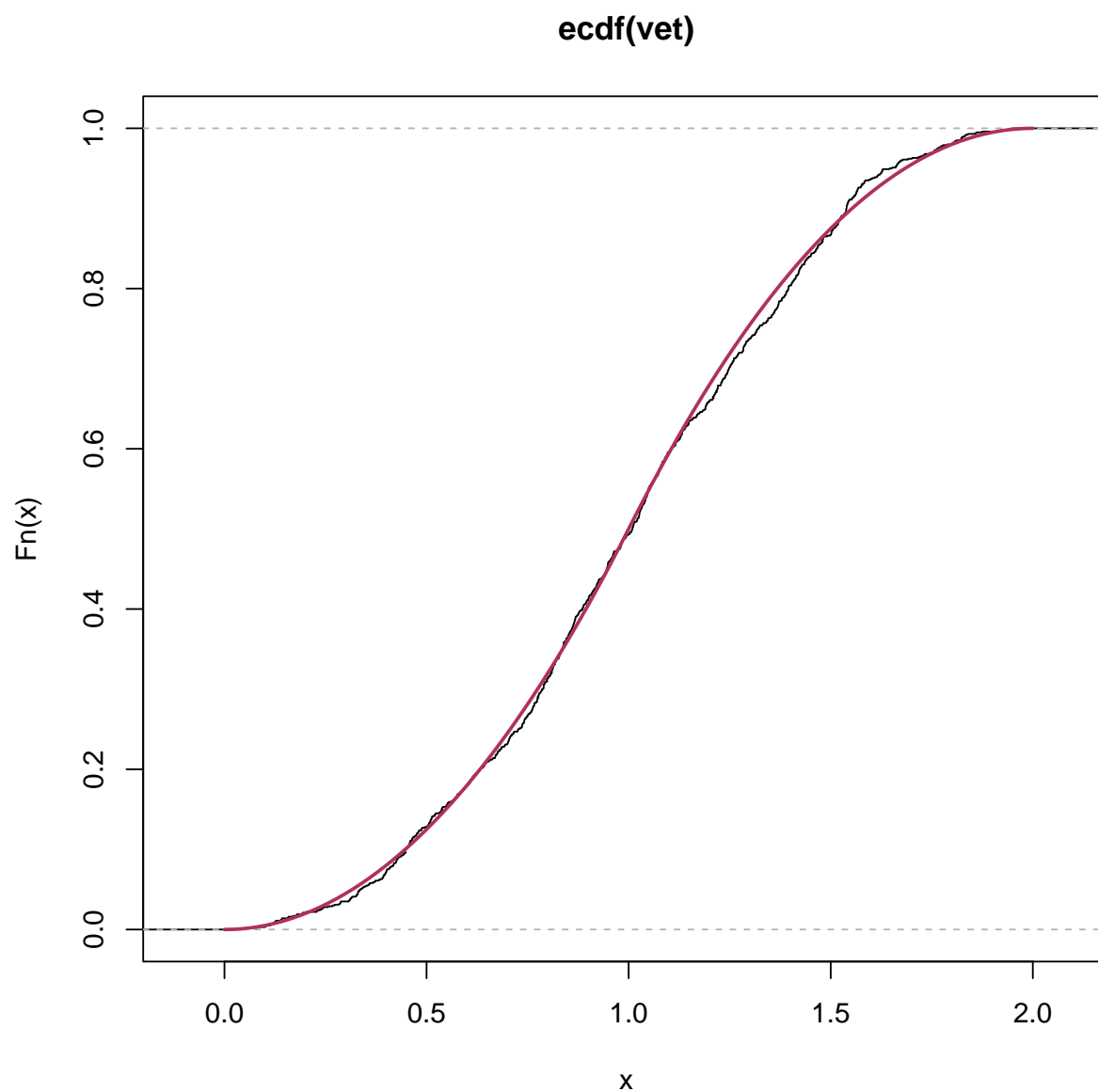
```
fx<- function(x)
{
  ifelse(x<=1, x, 2-x)
}
hist(vet, freq = F, ylim=c(0,1))
curve(fx, from=0, to=2, add = T)
```



Comparação função de distribuição empírica + teste

```
Fn<-ecdf(vet)
plot(Fn)

Fx<-function(x)
{
  ifelse(x<=1,(x^2)/2, (((-x^2)+4*x-2)/2))
}
curve(Fx, from=0, to=2, add = T, col="maroon", lwd=2)
```



```
ks.test(vet, y=Fx)
```

```
##  
## Asymptotic one-sample Kolmogorov-Smirnov test  
##  
## data: vet  
## D = 0.027033, p-value = 0.458  
## alternative hypothesis: two-sided
```

A probabilidade de observar um valor mais extremo que o observado no caso da hipótese nula ser verdadeira é grande, maior que 0.05. Ou seja, não temos evidências para rejeitar a hipótese nula, dessa forma os dados parecem vir da distribuição $F_x(x)$. Isso é um indicativo que nosso gerador é bom.

QQ-plot + qqline

```
probs_acumul<-seq_along(vet)/length(vet)
quantil_amostra<-sort(vet)
quantil_teorico<-Qx(probs_acumul)
plot(x=quantil_teorico, y=quantil_amostra)

pt_amostra<-quantile(vet, c(0.25,0.75))
pt_teorico<-Qx(c(0.25, 0.75))
points(x=pt_teorico, y=pt_amostra, pch=3, col="red", cex=2)
b1<-diff(pt_amostra)/diff(pt_teorico)
b0<-pt_amostra[1]-(b1*pt_teorico[1])
abline(a=b0, b=b1)
```

