

# Ciência dos Dados

## Variáveis Aleatórias Contínuas

Distribuição de probabilidades  
Esperança e variância

**Magalhães e Lima, 7ª. Edição. Seção 6.1 e Seção 6.2**

# Objetivos de Aprendizagem

Os alunos devem ser capazes de:

- Classificar se uma função  $f(x)$  é dita uma função densidade de probabilidade (fdp ou *pdf, em inglês*);
- Obter e interpretar uma função de distribuição acumulada (fda ou *cdf, em inglês*);
- Calcular e interpretar esperança (média) e variância;
- Contrastar resultados teóricos e empíricos.

**Acompanhe, previamente, o PLANO DE AULA  
no BLACKBOARD!**

## O que vamos aprender?

- **Conceito de v.a. Contínua**
- **Distribuição de Probabilidades de uma v.a. Contínua**
- **Função de Distribuição Acumulada**
- **Características de uma v.a. Contínua**

# Variáveis Aleatórias

**Variável aleatória discreta:** conjunto de possibilidades é um conjunto finito ou enumerável.

**Variável aleatória contínua:** são variáveis cujos possíveis valores ocorrem aleatoriamente e pertencem a um intervalo dos números reais.

# Exemplos de Variáveis Aleatórias Contínuas

- Y – Tempo de execução de uma tarefa;
- Z – Nível de colesterol no sangue;
- W – Altura de trabalhadores de uma certa região.
- T – Tempo de espera em uma fila bancária:  $t \geq 0$
- U – Intenção de votos em um candidato em uma certa semana:  
$$0 \leq x \leq 1$$
- S – Variação do real frente ao dólar em um certo dia:  $-\infty \leq y \leq +\infty$

# **Distribuição Contínua de Probabilidades**

**De forma semelhante àquela desenvolvida para as v.a.'s discretas, precisamos estabelecer para as v.a.'s contínuas a atribuição de probabilidades às suas diversas realizações.**

**No entanto, agora a variável pode assumir um número infinito de valores diferentes.**

## Caso Discreto:

X: número da face observada no lançamento de um dado,  
 $x=1,2,\dots,6$ .

*Função de probabilidade:*  $P(X=x) = 1/6$ .

## Caso Contínuo:

**Y: Altura de um indivíduo**

**A v.a. Y pode assumir infinitos valores dentro do intervalo que representa um indivíduo (depende da precisão) .**

***“Função de probabilidade”:*  $P(Y=y) = 1/\infty = 0$ .**

**?? Como calcular probabilidade para v.a.'s contínuas ??**

# Função de Densidade de Probabilidade (fdp)

## Probability Density Function (pdf)

### Definição 1.

(função densidade de probabilidade – f.d.p.)

Dizemos que  $f(x)$  é uma f.d.p. para uma v.a. contínua  $X$ , se satisfaz a duas condições:

$$\text{a) } f(x) \geq 0, x \in (-\infty; +\infty)$$

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

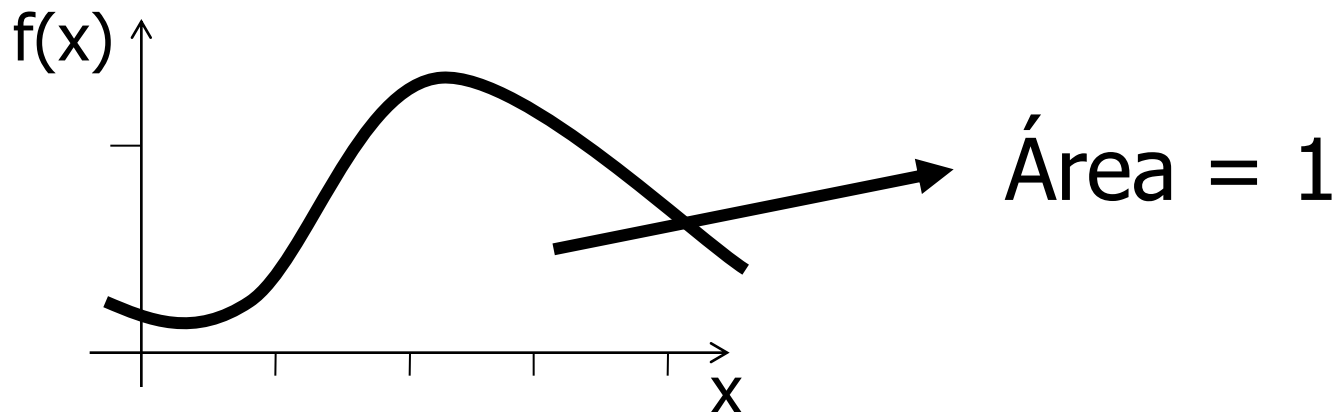


# Função de Densidade de Probabilidade (fdp)

## Probability Density Function (pdf)

### Definição 1. (cont.)

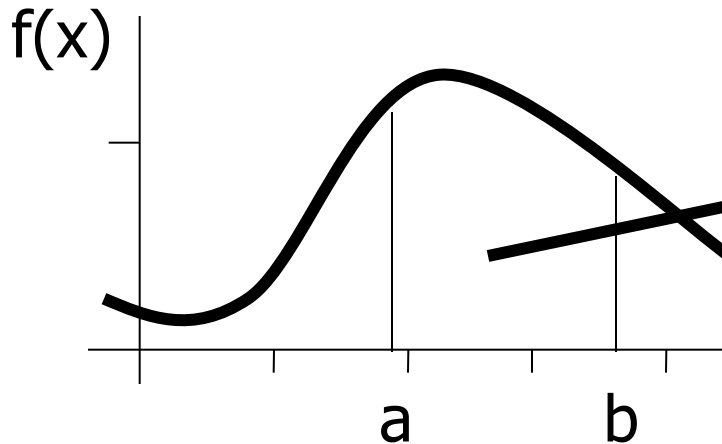
(função densidade de probabilidade – f.d.p)



# Função de Densidade de Probabilidade (fdp)

## Probability Density Function (pdf)

### Definição 2.



$$P(a \leq X \leq b) = ?$$

$$P(a \leq X \leq b) = \int_a^b f(x) dx$$

# Função de Densidade de Probabilidade (fdp)

## Probability Density Function (pdf)

### Definição 2. (cont.)

Para calcular probabilidades, temos que

$$P(a \leq X \leq b) = \int_a^b f(x) dx;$$

para  $a \leq b$ .

A integral acima retorna a área sob a função  $f(\cdot)$  definida pelo intervalo  $[a;b]$ .

# Exemplo 1

O tempo de execução de um determinado loop (uso de um “for”, por exemplo) pode demorar de  $(0,4]$  segundos. Logo, esse tempo é uma variável aleatória, aqui representada por  $X$ .

A distribuição de probabilidades de  $X$  é dada pela seguinte função:

$$f(x) = \begin{cases} cx(4-x), & \text{se } 0 < x \leq 4 \\ 0, & \text{caso contrário} \end{cases}$$

- a) Encontre  $c$  para que  $f(x)$  seja considerada uma fdp.
- b) Qual a probabilidade de um loop demorar até 2,5 segundos?
- c) Qual a probabilidade de um loop demorar até 0,5 segundo?
- d) E menor do que um valor  $k$ , sendo  $k$  qualquer valor entre 0 e 4?
- e) Qual a probabilidade de um loop demorar entre 0,5 e 2,5?
- f) Qual o tempo média de execução e a variância do tempo de execução.

# Solução do Exemplo 1

## Definição 1:

$$i) f(x) \geq 0, x \in (-\infty; +\infty)$$

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

$$a) \int_0^4 cx(4-x)dx = 1 \Rightarrow c \int_0^4 x(4-x)dx = 1 \Rightarrow c \int_0^4 (4x - x^2)dx = 1 \Rightarrow$$

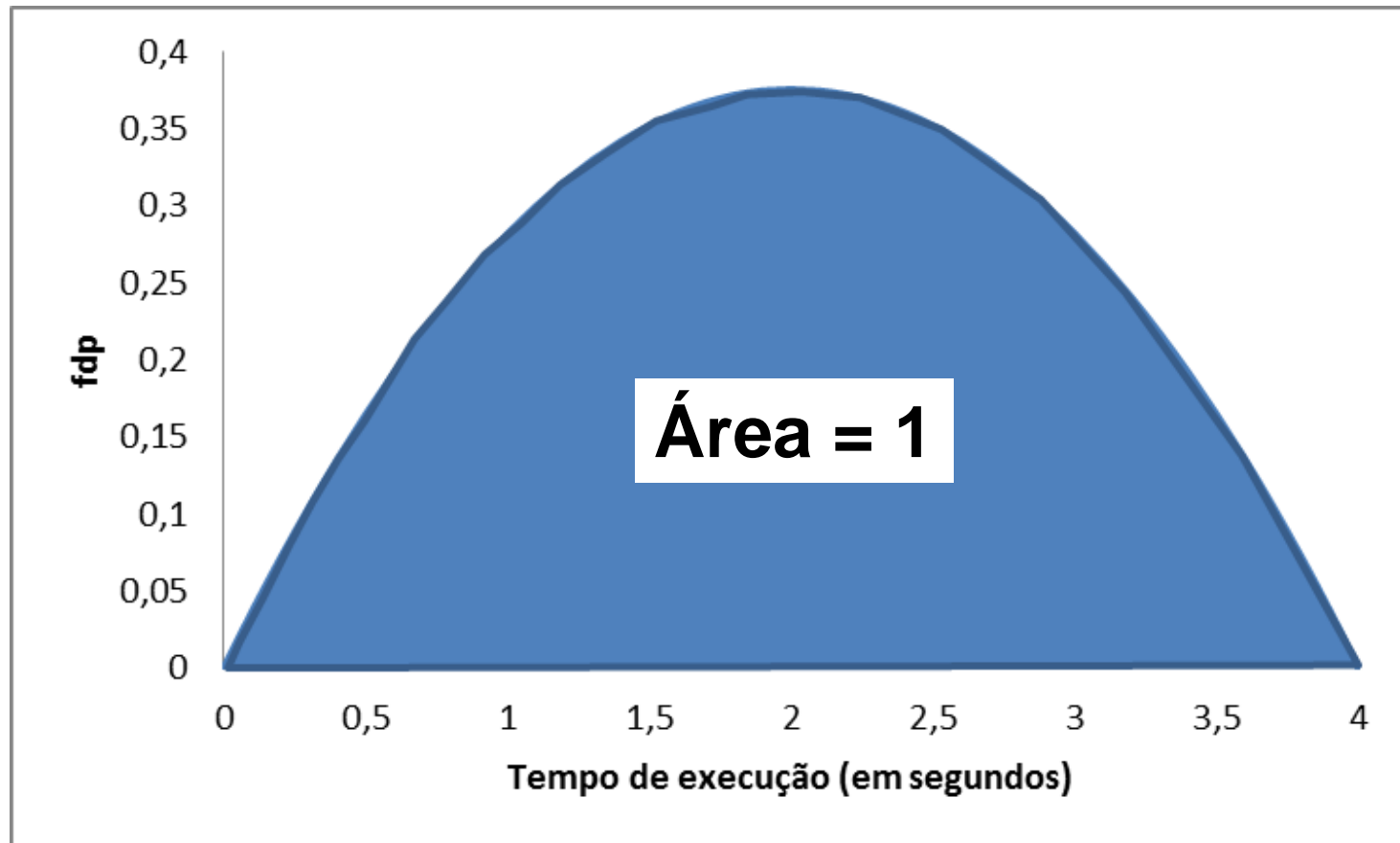
$$\Rightarrow c \left[ \int_0^4 4x dx - \int_0^4 x^2 dx \right] = 1 \Rightarrow c \left[ 2x^2 \Big|_0^4 - \frac{x^3}{3} \Big|_0^4 \right] = 1 \Rightarrow$$

$$\Rightarrow c \left[ 32 - \frac{64}{3} \right] = 1 \Rightarrow c \left[ \frac{96 - 64}{3} \right] = 1 \Rightarrow c \left[ \frac{32}{3} \right] = 1 \Rightarrow c = \frac{3}{32}$$

## Solução do Exemplo 1 (cont.)

a)

$$f(x) = \begin{cases} \frac{3}{32} x(4-x), & \text{se } 0 \leq x \leq 4 \\ 0, & \text{caso contrário} \end{cases}$$



# Exemplo 1

O tempo de execução de um determinado loop (uso de um “for”, por exemplo) pode demorar de  $(0,4]$  segundos. Logo, esse tempo é uma variável aleatória, aqui representada por  $X$ .

A distribuição de probabilidades de  $X$  é dada pela seguinte função:

$$f(x) = \begin{cases} \frac{3}{32} x(4-x), & \text{se } 0 < x \leq 4 \\ 0, & \text{caso contrário} \end{cases}$$

- a) Encontre  $c$  para que  $f(x)$  seja considerada uma fdp.
- b) Qual a probabilidade de um loop demorar até 2,5 segundos?
- c) Qual a probabilidade de um loop demorar até 0,5 segundo?
- d) E menor do que um valor  $k$ , sendo  $k$  qualquer valor entre 0 e 4?
- e) Qual a probabilidade de um loop demorar entre 0,5 e 2,5?
- f) Qual o tempo média de execução e a variância do tempo de execução.

# Função de Distribuição Acumulada (fda)

## Cumulative Distribution Function (cdf)

### Definição 3.

Dada uma v.a.  $X$  com f.d.p.  $f(x)$ , podemos definir a sua função de distribuição acumulada,  $F(x)$ , por

$$F(x) = P(X \leq x), -\infty \leq x \leq \infty.$$

Assim, segue-se que

$$F(x) = \int_{-\infty}^x f(t) dt,$$

para todo real  $x$ .



# Função de Distribuição Acumulada (fda)

## Cumulative Distribution Function (cdf)

É fácil ver que  $0 \leq F(x) \leq 1$ , para todo  $x$  real; além disso,  $F(x)$  é não-decrescente e possui as duas seguintes propriedades:

$$(i) \quad \lim_{x \rightarrow -\infty} F(x) = 0,$$

$$(ii) \quad \lim_{x \rightarrow \infty} F(x) = 1.$$

# Função de Distribuição Acumulada (fda)

## Cumulative Distribution Function (cdf)

### Proposição.

Para todos os valores de  $x$  para os quais  $F(x)$  é derivável temos

$$F'(x) = \frac{dF(x)}{dx} = f(x)$$

## Solução do Exemplo 1 (cont.)

**d)**

$$F(k) = P(X \leq k) = \int_0^k \frac{3}{32} x(4-x) dx = \frac{3}{32} \int_0^k (4x - x^2) dx =$$

$$= \frac{3}{32} \left[ 2x^2 \Big|_0^k - \frac{x^3}{3} \Big|_0^k \right] = \frac{3}{32} \left[ 2k^2 - \frac{k^3}{3} \right] = \frac{k^2}{32} [6 - k]$$

# Exemplo 1

O tempo de execução de um determinado loop (uso de um “for”, por exemplo) pode demorar de  $(0,4]$  segundos. Logo, esse tempo é uma variável aleatória, aqui representada por  $X$ .

A distribuição de probabilidades de  $X$  é dada pela seguinte função:

$$f(x) = \begin{cases} \frac{3}{32} x(4-x), & \text{se } 0 < x \leq 4 \\ 0, & \text{caso contrário} \end{cases}$$

- a) Encontre  $c$  para que  $f(x)$  seja considerada uma fdp.
- b) Qual a probabilidade de um loop demorar até 2,5 segundos?
- c) Qual a probabilidade de um loop demorar até 0,5 segundo?
- d) E menor do que um valor  $k$ , sendo  $k$  qualquer valor entre 0 e 4?
- e) Qual a probabilidade de um loop demorar entre 0,5 e 2,5?
- f) Qual o tempo média de execução e a variância do tempo de execução.

# Função de Distribuição Acumulada (fda)

## Cumulative Distribution Function (cdf)

### Resultado:

$$\begin{aligned} P(a \leq X \leq b) &= P(X \leq b) - P(X \leq a) = \\ &= F(b) - F(a), \end{aligned}$$

**para todo  $a \leq b$ .**

# Exemplo 1

O tempo de execução de um determinado loop (uso de um “for”, por exemplo) pode demorar de  $(0,4]$  segundos. Logo, esse tempo é uma variável aleatória, aqui representada por  $X$ .

A distribuição de probabilidades de  $X$  é dada pela seguinte função:

$$f(x) = \begin{cases} \frac{3}{32} x(4-x), & \text{se } 0 < x \leq 4 \\ 0, & \text{caso contrário} \end{cases}$$

- a) Encontre  $c$  para que  $f(x)$  seja considerada uma fdp.
- b) Qual a probabilidade de um loop demorar até 2,5 segundos?
- c) Qual a probabilidade de um loop demorar até 0,5 segundo?
- d) E menor do que um valor  $k$ , sendo  $k$  qualquer valor entre 0 e 4?
- e) Qual a probabilidade de um loop demorar entre 0,5 e 2,5?
- f) Qual o tempo média de execução e a variância do tempo de execução.

# Momentos de uma v.a. Esperança e Variância

## Definição 4.

(Valor médio de uma v.a. contínua):

$$E(X) = \int_{-\infty}^{\infty} xf(x)dx$$

## Definição 5.

(Variância para uma v.a. contínua):

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

# Momentos de uma v.a. Esperança e Variância

## Propriedade:

$$\begin{aligned}\text{Var}(X) &= E[(X - E(X))^2] = \\ &= E(X^2) - [E(X)]^2\end{aligned}$$

No caso discreto

$$E(X^2) = \sum_x x^2 P(X = x)$$

No caso contínuo

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



## Solução do Exemplo 1 (cont.)

$$\mathbf{f)} \quad f(x) = \begin{cases} \frac{3}{32} x(4-x), & \text{se } 0 < x \leq 4 \\ 0, & \text{caso contrário} \end{cases}$$

$$E(X) = \int_{-\infty}^{\infty} xf(x)dx$$

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

## Solução do Exemplo 1 (cont.)

f)

$$E(X) = \int_0^4 x f(x) dx = \int_0^4 x \frac{3}{32} x(4-x) dx = \frac{3}{32} \int_0^4 x^2 (4-x) dx = 2$$

$$\begin{aligned} \text{Var}(X) &= \int_0^4 (x-2)^2 f(x) dx = \int_0^4 (x-2)^2 \frac{3}{32} x(4-x) dx = \\ &= \frac{3}{32} \int_0^4 (x^2 - 4x + 4)x(4-x) dx = \\ &= \frac{3}{32} \int_0^4 (4x^3 - x^4 - 16x^2 + 4x^3 + 16x - 4x) dx = \dots = 0,80 \end{aligned}$$

# Exercícios

# Exercício 1

A f.d.p. abaixo modela o tempo, em horas, até a execução de uma tarefa.

$$f(x) = \begin{cases} \frac{2}{25}x, & 0 \leq x \leq 5 \\ 0, & \text{caso contrário} \end{cases}$$

Determine a probabilidade de

- a) uma pessoa levar mais de 1 hora.
- b) uma pessoa levar menos de  $\frac{1}{2}$  hora, uma vez que se sabe que levou menos de 1 hora.
- c) uma pessoa levar exatamente 1 hora.
- d) Encontre a função de distribuição acumulada (cdf).
- e) Qual o tempo médio e desvio padrão de execução da tarefa?
- f) Qual o tempo mediano de execução da tarefa?

## Exercício 2

**Seja  $X$  a variável aleatória que denota a sentença de prisão, em anos, para pessoas condenadas por furtos num particular estado brasileiro. Suponha que a f.d.p. de  $X$  seja dada por**

$$f(x) = \begin{cases} c \cdot x^2, & 0 < x < 4 \\ 0, & \text{caso contrário} \end{cases}$$

## Exercício 2 (cont.)

**É correto afirmar que:**

- (1) O valor da constante  $c$  para que a função descrita anteriormente represente uma função de probabilidade deve ser igual a  $\frac{3}{64}$ .**
- (2) Em média, a sentença de prisão para pessoas condenadas por furtos neste particular estado brasileiro é de 3 anos.**
- (3) A probabilidade da pena de uma pessoa ser superior a 18 meses, devido a este tipo de delito, é inferior a 90%.**
- (4) O desvio padrão das sentenças é igual a 3,1 anos.**

## Exercício 3

Seja  $X$  uma v.a. com f.d.p. dada por

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

Verifique se as seguintes afirmações são verdadeiras ou falsas:

- (1) O valor de  $c$ , para que  $f(x)$  seja uma função densidade de probabilidade, é igual a  $2/3$ .
- (2) O valor  $k$  tal que  $F_x(k) = 1/2$  é igual a 0. Logo, do exposto, podemos interpretar  $k$  como sendo a mediana da distribuição de  $X$ .

## Exercício 4

O tempo entre a realização de duas vendas pode ser representado por uma v.a. com f.d.p. dada por

$$f(x) = 0,2e^{-0,2x}, \quad x > 0$$

- a. Encontre a função distribuição acumulada.
- b. Determine  $P(2 < X < 4)$ .



# Jupyter Notebook

## Façam a leitura prévia da aula:

<Aula12 PARTE 2 Modelos Probabilísticos Contínuos - Uniforme e exponencial.pdf>

## Atividade:

<Aula12 Atividade\_ModeloProbabilístico Exponencial.ipynb>