

Métodos Quantitativos

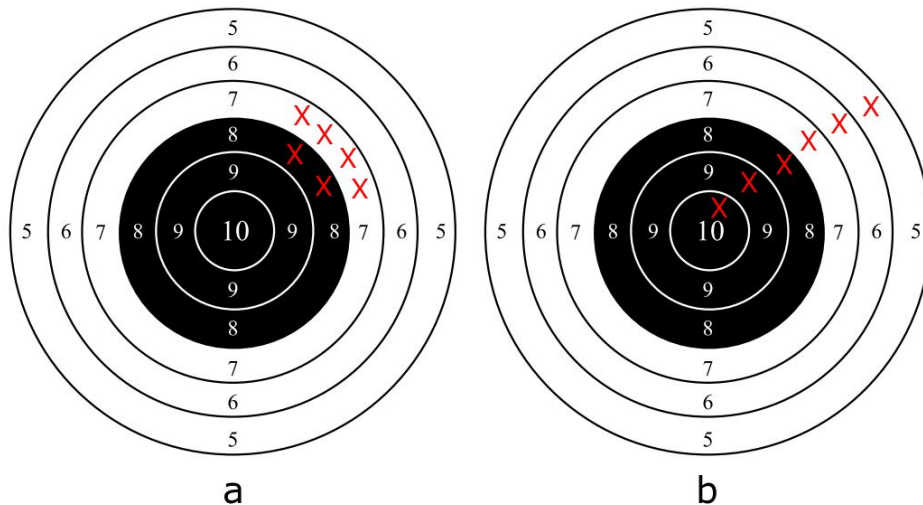
Aula 02

Revisão de Estatística

Roberto Massi de Oliveira
Alex Borges Vieira

Medidas de Localização

- Média, mediana, moda
- Resumem um conjunto de dados em um único valor
- Uso isolado pode omitir informações relevantes
- Ex. 01: Qual atirador é mais preciso: **a** ou **b**?

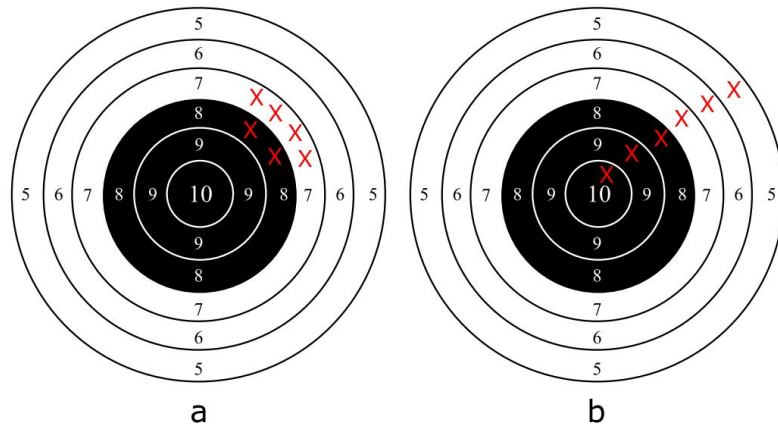


Medidas de Localização

- Método 1: observação da figura
 - Conclusão:
O atirador **a** é mais preciso, pois acertou a maioria dos tiros próximos entre si e do centro
- Método 2: observação das médias

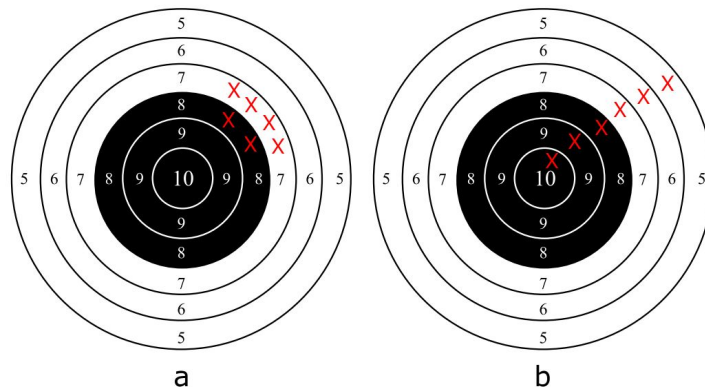
```
1 import numpy as np
2
3 a = [8, 8, 7, 7, 7, 7]
4 mean_a = np.mean(a)
5
6 b = [10, 9, 8, 7, 6, 5]
7 mean_b = np.mean(b)
```

- $\text{mean_a} = 7,33$
- $\text{mean_b} = 7,50$
- Conclusão: O atirador **b** é mais preciso, pois, em média, possui maior pontuação
- Como evitar esse problema? Usar medidas de localização junto com **medidas de dispersão**.



Medidas de Dispersão

- Variância, desvio padrão
- Determinam a variabilidade, ou dispersão, dos dados de uma dada amostra
- No Ex. 01, se, além da média, tivéssemos algum número que representasse a variação de distância entre os tiros, poderíamos concluir que o atirador **a** é mais preciso que o **b**.



Média Aritmética Simples

- Medida de localização de centro de amostra
- Pode resumir um conjunto de dados com um único número
- Numa amostra **x** com **n** elementos, é dada por:

$$\bar{x} = \frac{\sum_{i=1}^n x_i}{n}$$

```
1 import numpy as np
2
3 x = [20000, 14000, 2000, 800]
4 mean_x = np.mean(x)
```

Média Aritmética Simples

- Ex. 02: Suponha que, numa empresa, os salários são atribuídos aos cargos conforme especificado na tabela:

Cargo	Salário
Presidente	R\$20.000,00
Vice-presidente	R\$14.000,00
Engenheiros	R\$2.000,00
Estagiários	R\$800,00

- A média salarial é de R\$ 9.200,00. Esse dado passa a falsa impressão de que os funcionários são bem remunerados.

Média Ponderada

- É uma extensão da média simples, que utiliza pesos para as informações do conjunto de dados
- Numa amostra \mathbf{x} de tamanho n com \mathbf{k} pesos, é dada por:

$$\bar{X} = \frac{\sum_{i=1}^k k_i x_i}{n}$$

```
1 import numpy as np
2
3 x = [20000, 14000, 2000, 800]
4 ni = [1, 1, 12, 6]
5 average_x = np.average(x, weights = ni)
```

Média Ponderada

- Ex. 03: Continuando o Ex. 02, se acrescentarmos a quantidade de funcionários que ocupam cada cargo, temos:

Cargo	Quantidade	Salário
Presidente	1	R\$20.000,00
Vice-presidente	1	R\$14.000,00
Engenheiros	12	R\$2.000,00
Estagiários	6	R\$800,00

- Nesse caso, a média salarial ponderada é de R\$ 3.140,00. Então, temos noção um pouco mais realista do que a obtida através da média simples

Mediana

- Outra localização de centro de distribuição de dados
- Separa a amostra em dois subgrupos: os maiores e os menores
- Ex. 04: Numa amostra $x = [1, 5, 4, 2, 3]$ qual é a mediana?
 - Primeiro, ordena-se a amostra: $x = [1, 2, 3, 4, 5]$
 - O valor central é a mediana: $\text{median}_x = 3$

```
1 import numpy as np
2
3 x = [1, 5, 4, 2, 3]
4 median_x = np.median(x)
```

- Se o número de elementos na amostra é par, a mediana é igual à média dos dois números centrais da mesma
 - Qual a mediana da amostra $x = [1, 2, 3, 4, 5, 6]$?

Moda

- É o valor mais frequente em uma amostra
- Usada para identificar tendências
- Ex. 05: Numa amostra $x = [1, 1, 1, 2, 2, 3]$, qual a moda?
 - O número 1 aparece 3 vezes
 - O número 2 aparece 2 vezes
 - O número 3 aparece 1 vez
 - Então, o número 1 é a moda.

```
1 import numpy as np
2
3 x = [1, 1, 1, 2, 2, 3]
4 counts = np.bincount(x)
5 moda_x = np.argmax(counts)
```

```
1 import numpy as np
2
3 x = [3, 2, 2, 1, 1, 1]
4 counts = np.bincount(x)
5 print(counts)
```

[0 3 2 1]

```
1 moda_x = np.argmax(counts)
2 print(np.argmax(counts))
```

Variância

- Mede a dispersão estatística de uma amostra
- Mostra o quão longe os valores de uma amostra estão em relação à média
- Em uma amostra \mathbf{x} de tamanho \mathbf{n} , a variância é dada por:

$$s^2 = \frac{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2}{n - 1}$$

<https://pt.khanacademy.org/math/ap-statistics/summarizing-quantitative-data-ap/more-standard-deviation/v/another-simulation-giving-evidence-that-n-1-gives-us-an-unbiased-estimate-of-variance>

```
1 import numpy as np
2
3 x = [10, 9, 8, 7, 6, 5]
4 var_x = np.var(x)
```

Desvio Padrão

- Outra medida de dispersão, calculada através da raiz quadrada da variância
- Menos sensível a *outliers* que a variância
- Comumente usado em conjunto com a média para expressar a confiabilidade

$$s = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2}{n-1}}$$

```
1 import numpy as np
2
3 x = [10, 9, 8, 7, 6, 5]
4 std_x = np.std(x)
```

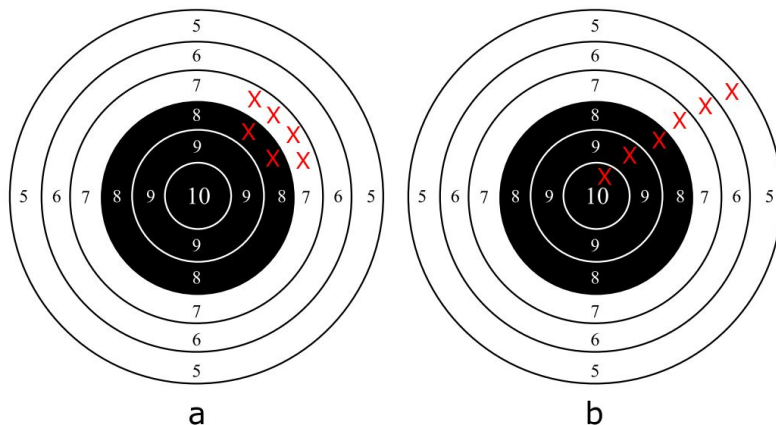
Desvio Padrão

- Ex. 06: Lembre-se que, no Ex. 01, calculamos as médias $\text{mean}_a = 7,33$ e $\text{mean}_b = 7,50$ e chegamos à conclusão errônea de que o atirador **b** é mais preciso. Como resolver esse problema?

- Vamos calcular o desvio padrão de ambos.

```
1 import numpy as np
2
3 a = [8, 8, 7, 7, 7, 7]
4 std_a = np.std(a)
5
6 b = [10, 9, 8, 7, 6, 5]
7 std_b = np.std(b)
```

- $\text{std}_a = 0,47$
- $\text{std}_b = 1,71$
- Conclusão: Com pequena diferença entre as médias, os resultados do atirador **a** possuem um desvio padrão muito menor que os do **b**. Portanto, o atirador **a** é mais preciso.



Parênteses: Outlier

- Ex. 07: Como um outlier afeta as estatísticas amostrais?

```
1 import numpy as np
2 import matplotlib.pyplot as plt
3
4 sample1 = [1, 2, 2, 2, 5, 6, 7, 8, 10, 10]
5 sample2 = [1, 2, 2, 2, 5, 6, 7, 8, 10, 100]
```

```
1 print('SAMPLE 1')
2 print('-----')
3 print('média =', np.mean(sample1))
4 print('mediana =', np.median(sample1))
5 print('moda =', np.argmax(np.bincount(sample1)))
6 print('variância =', round(float(np.var(sample1)),2))
7 print('desvio padrão =', round(float(np.std(sample1)),2))
8 print('-----')
```

```
SAMPLE 1
-----
média = 5.3
mediana = 5.5
moda = 2
variância = 10.61
desvio padrão = 3.26
-----
```

```
1 print('SAMPLE 2')
2 print('-----')
3 print('média =', np.mean(sample2))
4 print('mediana =', np.median(sample2))
5 print('moda =', np.argmax(np.bincount(sample2)))
6 print('variância =', round(float(np.var(sample2)),2))
7 print('desvio padrão =', round(float(np.std(sample2)),2))
8 print('-----')
```

```
SAMPLE 2
-----
média = 14.3
mediana = 5.5
moda = 2
variância = 824.21
desvio padrão = 28.71
-----
```

Coeficiente de Variação

- C.V. é o desvio padrão expresso como uma porcentagem média
- Útil para comparar a variação de conjuntos de observações que diferem na média ou são medidos em grandezas diferentes (unidades diferentes)
 - CVs menores passam a ideia de estabilidade, solidez, homogeneidade
 - Ex.: Se o CV da pulsação humana $CV_p = 0,127$ e o CV do ácido úrico $CV_a = 0,232$, conclui-se que a pulsação é mais estável que o ácido úrico.

$$CV = \frac{s}{\bar{x}}$$

Coeficiente de Correlação

- Quando dispomos das amostras \mathbf{x} e \mathbf{y} de dados bivariados (e.g., peso e altura de um grupo de indivíduos), o coeficiente de correlação é dado por:

$$r_{xy} = \frac{Cov(X, Y)}{S_x S_y} = \frac{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})}{\sqrt{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2 \sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2}}$$

```
1 import numpy as np
2
3 x = [1.6, 1.7, 1.8, 1.9]
4 y = [60, 70, 80, 90]
5 xy = [x, y]
6
7 r = np.corrcoef(xy)
```


Coeficiente de Correlação

- Varia de -1,0 a 1,0.



- Quando $r > 0$, à medida que **x** cresce também cresce **y** (em média)
- Quando $r < 0$, à medida que **x** cresce, **y** decresce (em média)

Coefficiente de Correlação

- Ex. 08: Um aluno, com bastante dificuldade numa dada disciplina, foi estudando cada vez mais para melhorar suas notas a cada prova e evitar a reprovação. A tabela abaixo resume o número de horas estudadas por dia antes de cada prova realizada e a nota tirada nas mesmas. Qual o coeficiente de correlação entre as horas estudadas por dia e as notas?

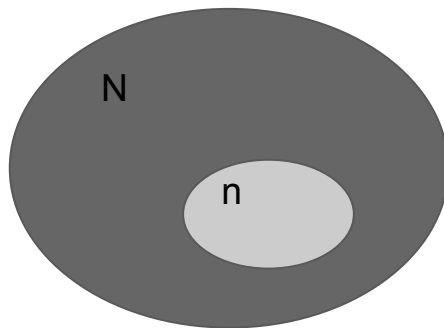
Estudo/Dia	1 h	2 h	3 h
Nota	3,0	7,0	9,0

```
1 import numpy as np
2
3 t = [1, 2, 3]
4 n = [3, 7, 10]
5 tn = [t, n]
6
7 r = np.corrcoef(tn)
```

r =	r(t,t)	r(t,n)
	r(n,t)	r(n,n)
r =	1	0,997
	0,997	1

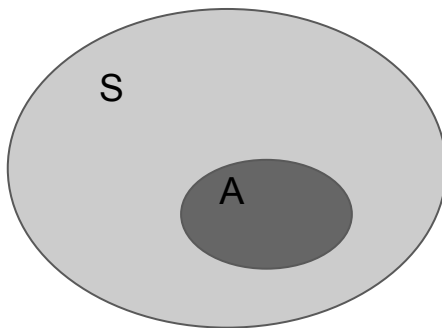
Teoria de Conjuntos

- População (ou universo): todos os **N** membros de uma classe ou grupo
 - Ex.: todos os processos executados em uma máquina
- Amostra: uma parte da população, denotada por **n**
 - Ex.: todos os processos executados em uma máquina em 12/12/2012



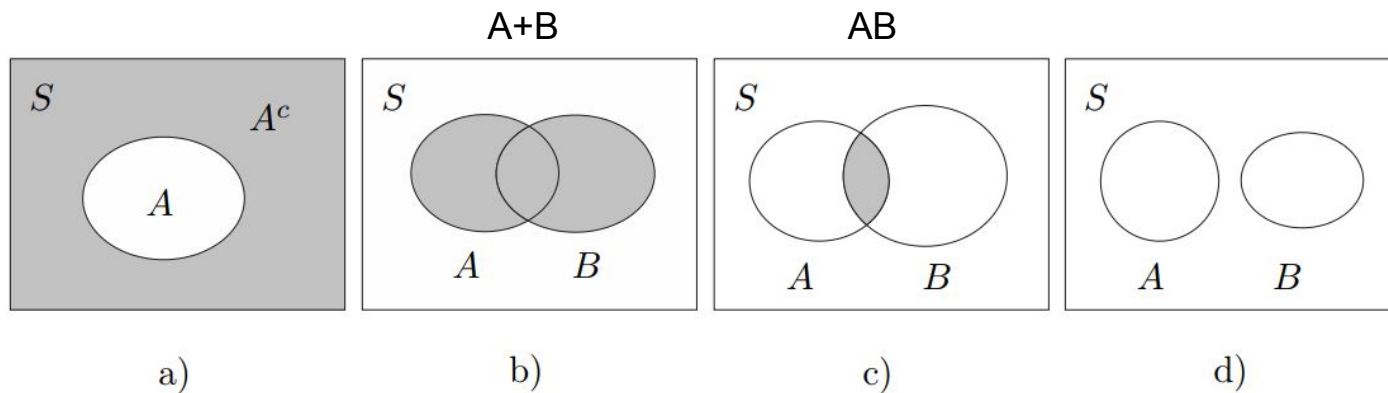
Teoria de Conjuntos

- Espaço amostral: conjunto de possibilidades de resultados, denotado por **S**
 - Ex: $S = \{1, 2, 3, 4, 5, 6\}$ é o espaço amostral do lançamento de um dado de 6 faces
- Evento: Conjunto de resultados (subconjunto do espaço amostral) aos quais são associados probabilidades. Denotado por letras maiúsculas
 - Ex.: $A = \{2, 4, 6\}$ é o evento no qual os resultados do lançamento do dado são pares



Teoria de Conjuntos

- Tipos de eventos (diagramas de Venn):



a) complemento, b) união, c) interseção de eventos, e d) eventos disjuntos

Definições de Probabilidade

- A probabilidade $P(\mathbf{A})$ de um evento \mathbf{A} , onde n_A é o número de ocorrências de \mathbf{A} e n é tamanho do espaço amostral, é dada por:

$$P(A) = \frac{n_A}{n}$$

- Se \mathbf{A} e \mathbf{B} eventos mutuamente exclusivos, ou disjuntos ($A \cap B = \emptyset$, eventos que não podem ocorrer ao mesmo tempo; e.g., resultados do lançamento de uma moeda), então:

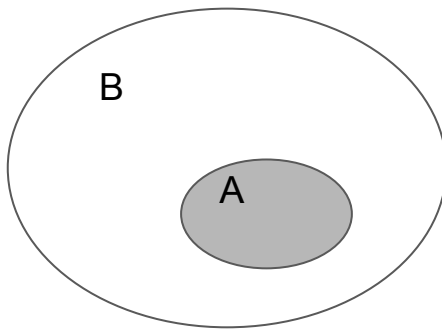
$$P(A + B) = P(A) + P(B)$$

- Senão:

$$P(A + B) = P(A) + P(B) - P(AB)$$

Definições de Probabilidade

- Algumas outras propriedades do cálculo de probabilidade:
 - $0 \leq P(A) \leq 1$
 - $P(S)=1$
 - Se $A \subset B$, então $P(A) \leq P(B)$
 - $P(\emptyset)=0$ e $P(\bar{A})=1-P(A)$, sendo \emptyset o vazio e \bar{A} o complementar de A



Definições de Probabilidade

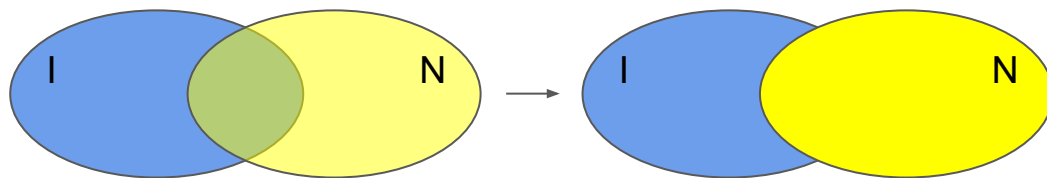
- Ex. 9: Na fila de processos de um computador, há 5 processos I/O bound, 3 processos CPU bound e 4 processos memory bound. Supondo que a resolução da fila de processos se dá de forma totalmente aleatória e que os tipos de processos são disjuntos entre si, qual a probabilidade do primeiro processo a ser atendido seja I/O bound ou CPU bound?
 - Do enunciado:
 - Número total de processos: ($n = 5 + 3 + 4 = 12$)
 - Tipos disjuntos: e.g., não existem processos ao mesmo tempo I/O bound e CPU bound
 - Sendo n_I o número de processos I/O bound e n_C o número de processos CPU bound

$$P(I \cup C) = P(I + C) = P(I) + P(C) = \frac{n_I}{n} + \frac{n_C}{n} = \frac{5+3}{12} = 0,67$$

Definições de Probabilidade

- Ex. 10: Suponha um grupo de 100 pessoas, no qual algumas têm psicose (P), enquanto outras têm neurose (N), sendo algumas idosas (I), enquanto outras são adolescentes (A). A tabela seguinte dá a classificação das referidas pessoas. Escolhendo-se ao acaso uma pessoa desse grupo, qual será a probabilidade dessa ser idosa ou ter alguma neurose?

	P	N	Total
A	1	29	30
I	2	68	70
Total	3	97	100



$$P(I \cup N) = P(I) + P(N) - P(I \cap N) = \frac{70 + 97 - 68}{100} = \frac{99}{100}$$

Probabilidade Condicional

- Probabilidade de ocorrência de um evento **B**, dado que um evento **A** ocorra
 - Ex.: Duas chances para responder uma questão com 5 opções de resposta. A probabilidade de acerto da segunda tentativa é influenciada pela primeira.
- Denotada por $P(A|B)$ e obtida por:

$$P(A|B) = \frac{P(AB)}{P(B)}$$

- Teorema de Bayes:

$$P(AB) = P(A|B)P(B) = P(B|A)P(A)$$

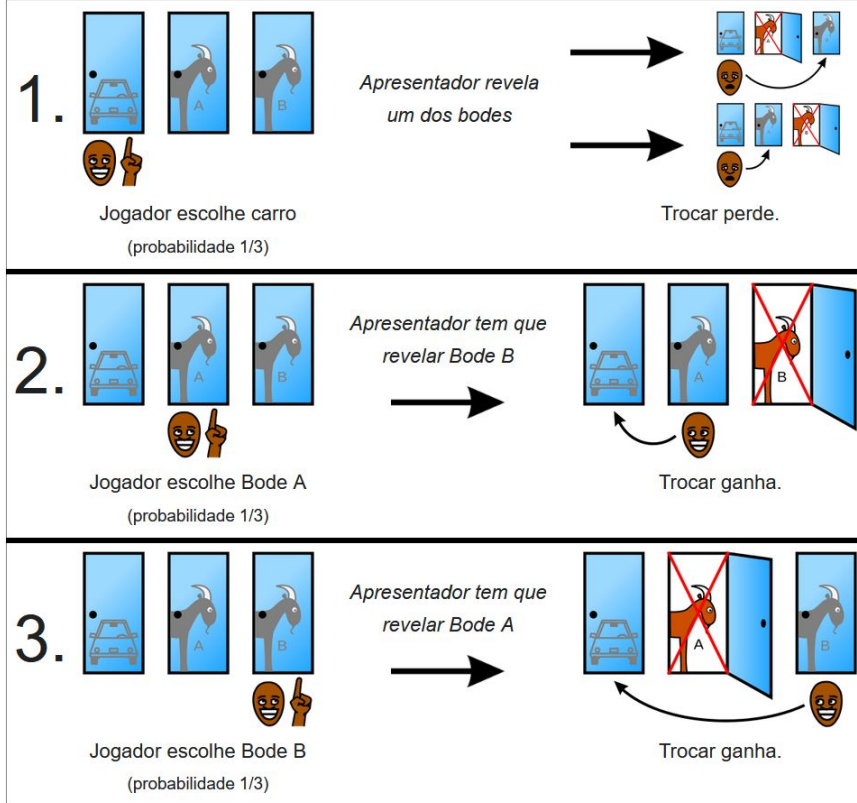
Probabilidade Condicional

- Ex. 11:



Probabilidade Condicional

- Ex. 11:



https://pt.wikipedia.org/wiki/Problema_de_Monty_Hall

O jogador tem uma chance igual de inicialmente selecionar o carro, Bode A, ou Bode B. A troca resulta em uma vitória 2/3 das vezes.

Probabilidade Condicional

- Ex. 12: Calcule a probabilidade de obter **soma 8** no lançamento de dois dados em que o resultado do lançamento foram dois números **ímpares**.
 - Seja A = Obter soma 8 e B = Obter dois números ímpares

Probabilidade Condicional

- Ex. 12: Calcule a probabilidade de obter **soma 8** no lançamento de dois dados em que o resultado do lançamento foram dois números **ímpares**.
 - Seja A = Obter soma 8 e B = Obter dois números ímpares
 - $P(A \cap B)$ é a probabilidade de se obter apenas números ímpares que somam 8 no lançamento de dois dados. As únicas 2 combinações possíveis são: $\{3,5\}$ e $\{5,3\}$

Probabilidade Condicional

- Ex. 12: Calcule a probabilidade de obter **soma 8** no lançamento de dois dados em que o resultado do lançamento foram dois números **ímpares**.
 - Seja A = Obter soma 8 e B = Obter dois números ímpares
 - $P(A \cap B)$ é a probabilidade de se obter apenas números ímpares que somam 8 no lançamento de dois dados. As únicas 2 combinações possíveis são: $\{3,5\}$ e $\{5,3\}$
 - Total de combinações possíveis no lançamento de 2 dados é 36 ($\{1,1\}, \{1,2\}, \{1,3\}, \dots, \{6,6\}$)

Probabilidade Condicional

- Ex. 12: Calcule a probabilidade de obter **soma 8** no lançamento de dois dados em que o resultado do lançamento foram dois números **ímpares**.
 - Seja A = Obter soma 8 e B = Obter dois números ímpares
 - $P(A \cap B)$ é a probabilidade de se obter apenas números ímpares que somam 8 no lançamento de dois dados. As únicas 2 combinações possíveis são: $\{3,5\}$ e $\{5,3\}$
 - Total de combinações possíveis no lançamento de 2 dados é 36 ($\{1,1\}, \{1,2\}, \{1,3\}, \dots, \{6,6\}$)
 - Portanto, $P(A \cap B) = 2/36$

Probabilidade Condicional

- Ex. 12: Calcule a probabilidade de obter **soma 8** no lançamento de dois dados em que o resultado do lançamento foram dois números **ímpares**.
 - Seja A = Obter soma 8 e B = Obter dois números ímpares
 - $P(A \cap B)$ é a probabilidade de se obter apenas números ímpares que somam 8 no lançamento de dois dados. As únicas 2 combinações possíveis são: $\{3,5\}$ e $\{5,3\}$
 - Total de combinações possíveis no lançamento de 2 dados é 36 ($\{1,1\}, \{1,2\}, \{1,3\}, \dots, \{6,6\}$)
 - Portanto, $P(A \cap B) = 2/36$
 - $P(B)$ é a probabilidade de obter somente números ímpares no lançamento de dois dados. As únicas combinações dentro das 36 possíveis são: $\{1,1\}; \{1,3\}; \{1,5\}; \{3,1\}; \{3,3\}; \{3,5\}; \{5,1\}; \{5,3\}$ e $\{5,5\}$

Probabilidade Condicional

- Ex. 12: Calcule a probabilidade de obter **soma 8** no lançamento de dois dados em que o resultado do lançamento foram dois números **ímpares**.
 - Seja A = Obter soma 8 e B = Obter dois números ímpares
 - $P(A \cap B)$ é a probabilidade de se obter apenas números ímpares que somam 8 no lançamento de dois dados. As únicas 2 combinações possíveis são: {3,5} e {5,3}
 - Total de combinações possíveis no lançamento de 2 dados é 36 ({1,1}, {1,2}, {1,3}, ..., {6,6})
 - Portanto, $P(A \cap B) = 2/36$
 - $P(B)$ é a probabilidade de obter somente números ímpares no lançamento de dois dados. As únicas combinações dentro das 36 possíveis são: {1,1}; {1,3}; {1,5}; {3,1}; {3,3}; {3,5}; {5,1}; {5,3} e {5,5}
 - Portanto, $P(B) = 9/36$

$$P(A|B) = \frac{P(AB)}{P(B)}$$

Probabilidade Condicional

- Ex. 12: Calcule a probabilidade de obter **soma 8** no lançamento de dois dados em que o resultado do lançamento foram dois números **ímpares**.
 - Seja A = Obter soma 8 e B = Obter dois números ímpares
 - $P(A \cap B)$ é a probabilidade de se obter apenas números ímpares que somam 8 no lançamento de dois dados. As únicas 2 combinações possíveis são: $\{3,5\}$ e $\{5,3\}$
 - Total de combinações possíveis no lançamento de 2 dados é 36 ($\{1,1\}, \{1,2\}, \{1,3\}, \dots, \{6,6\}$)
 - Portanto, $P(A \cap B) = 2/36$
 - $P(B)$ é a probabilidade de obter somente números ímpares no lançamento de dois dados. As únicas combinações dentro das 36 possíveis são: $\{1,1\}; \{1,3\}; \{1,5\}; \{3,1\}; \{3,3\}; \{3,5\}; \{5,1\}; \{5,3\}$ e $\{5,5\}$
 - Portanto, $P(B) = 9/36$
 - $P(A|B) = \frac{P(A \cap B)}{P(B)} = (2/36) / (9/36) = 2/9$

Eventos Independentes

- A ocorrência do evento **A** não afeta a ocorrência do evento **B**
 - Isso não quer dizer que eles não tenham interseções
 - Eventos mutuamente exclusivos NÃO SÃO INDEPENDENTES
 - Coeficiente de correlação é zero, pois $\text{cov}(A,B) = 0$
 - Ex: Resultados de 2 lançamentos de moeda
- Se **A** e **B** são independentes, então:

$$P(A|B) = P(A)$$

- Consequentemente, pela regra de Bayes:

$$P(A \cap B) = P(AB) = P(A)P(B)$$

Eventos Independentes

- Ex. 13: Uma moeda é lançada duas vezes. Calcule a probabilidade de obtermos cara no segundo lançamento sabendo que obtivemos cara no primeiro lançamento.
 - Considerando que "c" representa cara e "k" coroa, temos:
 - $S = \{cc, ck, kc, kk\}$
 - $n = 4$

Eventos Independentes

- Ex. 13: Uma moeda é lançada duas vezes. Calcule a probabilidade de obtermos cara no segundo lançamento sabendo que obtivemos cara no primeiro lançamento.
 - Considerando que "c" representa cara e "k" coroa, temos:
 - $S = \{cc, ck, kc, kk\}$
 - $n = 4$
 - Evento A = {obtenção de c no 2º lançamento}, Evento B = {obtenção de c no 1º lançamento}
 - $A = \{cc, kc\}$, $B = \{cc, ck\}$, $AB = \{cc\}$

Eventos Independentes

- Ex. 13: Uma moeda é lançada duas vezes. Calcule a probabilidade de obtermos cara no segundo lançamento sabendo que obtivemos cara no primeiro lançamento.
 - Considerando que "c" representa cara e "k" coroa, temos:
 - $S = \{cc, ck, kc, kk\}$
 - $n = 4$
 - Evento A = {obtenção de c no 2º lançamento}, Evento B = {obtenção de c no 1º lançamento}
 - $A = \{cc, kc\}$, $B = \{cc, ck\}$, $AB = \{cc\}$
 - Portanto: $P(A) = P(B) = 2/4 = 1/2$, $P(AB) = 1/4$

Eventos Independentes

- Ex. 13: Uma moeda é lançada duas vezes. Calcule a probabilidade de obtermos cara no segundo lançamento sabendo que obtivemos cara no primeiro lançamento.
 - Considerando que "c" representa cara e "k" coroa, temos:
 - $S = \{cc, ck, kc, kk\}$
 - $n = 4$
 - Evento A = {obtenção de c no 2º lançamento}, Evento B = {obtenção de c no 1º lançamento}
 - $A = \{cc, kc\}$, $B = \{cc, ck\}$, $AB = \{cc\}$
 - Portanto: $P(A) = P(B) = 2/4 = 1/2$, $P(AB) = 1/4$
 - Sabemos que $P(A|B) = P(AB)/P(B) = (1/4) / (2/4) = 1/2$

Eventos Independentes

- Ex. 13: Uma moeda é lançada duas vezes. Calcule a probabilidade de obtermos cara no segundo lançamento sabendo que obtivemos cara no primeiro lançamento.
 - Considerando que "c" representa cara e "k" coroa, temos:
 - $S = \{cc, ck, kc, kk\}$
 - $n = 4$
 - Evento $A = \{\text{obtenção de c no 2º lançamento}\}$, Evento $B = \{\text{obtenção de c no 1º lançamento}\}$
 - $A = \{cc, kc\}$, $B = \{cc, ck\}$, $AB = \{cc\}$
 - Portanto: $P(A) = P(B) = 2/4 = 1/2$, $P(AB) = 1/4$
 - Sabemos que $P(A|B) = P(AB)/P(B) = (1/4) / (2/4) = 1/2$
 - Observem que $P(A|B) = P(A)$

Eventos Independentes

- Ex. 14: Lança-se uma moeda 3 vezes. Sejam os eventos:
A: ocorrem três caras ou três coroas; **B**: ocorrem ao menos duas caras;
C: ocorrem no máximo duas caras.
Dos pares **(A,B)**, **(A,C)** e **(B,C)** quais são independentes?
- Considerando que "c" representa cara e "k" coroa, temos:
 - $S = \{ccc, kkk, cck, ckc, kcc, ckk, kck, kkc\}$, $n = 8$

Eventos Independentes

- Ex. 14: Lança-se uma moeda 3 vezes. Sejam os eventos:
A: ocorrem três caras ou três coroas; **B**: ocorrem ao menos duas caras;
C: ocorrem no máximo duas caras.
Dos pares **(A,B)**, **(A,C)** e **(B,C)** quais são independentes?
 - Considerando que "c" representa cara e "k" coroa, temos:
 - $S = \{ccc, kkk, cck, ckc, kcc, ckk, kck, kkc\}$, $n = 8$
 - $A = \{ccc, kkk\}$, $B = \{cck, ckc, kcc, ccc\}$, $C = \{kkk, ckk, kck, kkc, kcc, ckc, cck\}$

Eventos Independentes

- Ex. 14: Lança-se uma moeda 3 vezes. Sejam os eventos:
A: ocorrem três caras ou três coroas; **B**: ocorrem ao menos duas caras;
C: ocorrem no máximo duas caras.
Dos pares **(A,B)**, **(A,C)** e **(B,C)** quais são independentes?
 - Considerando que "c" representa cara e "k" coroa, temos:
 - $S = \{ccc, kkk, cck, ckc, kcc, ckk, kck, kkc\}$, $n = 8$
 - $A = \{ccc, kkk\}$, $B = \{cck, ckc, kcc, ccc\}$, $C = \{kkk, ckk, kck, kkc, kcc, ckc, cck\}$
 - $AB = \{ccc\}$, $AC = \{ccc\}$, $BC = \{cck, ckc, kcc\}$

Eventos Independentes

- Ex. 14: Lança-se uma moeda 3 vezes. Sejam os eventos:
A: ocorrem três caras ou três coroas; **B**: ocorrem ao menos duas caras;
C: ocorrem no máximo duas caras.
Dos pares **(A,B)**, **(A,C)** e **(B,C)** quais são independentes?
 - Considerando que "c" representa cara e "k" coroa, temos:
 - $S = \{ccc, kkk, cck, ckc, kcc, ckk, kck, kkc\}$, $n = 8$
 - $A = \{ccc, kkk\}$, $B = \{cck, ckc, kcc, ccc\}$, $C = \{kkk, ckk, kck, kkc, kcc, ckc, cck\}$
 - $AB = \{ccc\}$, $AC = \{kkk\}$, $BC = \{cck, ckc, kcc\}$
 - $P(A) = 2/8 = 1/4$, $P(B) = 4/8 = 1/2$, $P(C) = 7/8$, $P(AB) = 1/8$, $P(AC) = 1/8$, $P(BC) = 3/8$

Eventos Independentes

- Ex. 14: Lança-se uma moeda 3 vezes. Sejam os eventos:
A: ocorrem três caras ou três coroas; **B**: ocorrem ao menos duas caras;
C: ocorrem no máximo duas caras.
Dos pares **(A,B)**, **(A,C)** e **(B,C)** quais são independentes?

- Considerando que "c" representa cara e "k" coroa, temos:
 - $S = \{ccc, kkk, cck, ckc, kcc, ckk, kck, kkc\}$, $n = 8$
 - $A = \{ccc, kkk\}$, $B = \{cck, ckc, kcc, ccc\}$, $C = \{kkk, ckk, kck, kkc, kcc, ckc, cck\}$
 - $AB = \{ccc\}$, $AC = \{ccc\}$, $BC = \{cck, ckc, kcc\}$
 - $P(A) = 2/8 = 1/4$, $P(B) = 4/8 = 1/2$, $P(C) = 7/8$, $P(AB) = 1/8$, $P(AC) = 1/8$, $P(BC) = 3/8$

Como provaremos independência? Pela regra de Bayes:

$$P(A \cap B) = P(AB) = P(A)P(B)$$

Eventos Independentes

- Ex. 14: Lança-se uma moeda 3 vezes. Sejam os eventos:
A: ocorrem três caras ou três coroas; **B**: ocorrem ao menos duas caras;
C: ocorrem no máximo duas caras.
Dos pares **(A,B)**, **(A,C)** e **(B,C)** quais são independentes?
 - Considerando que "c" representa cara e "k" coroa, temos:
 - $S = \{ccc, kkk, cck, ckc, kcc, ckk, kck, kkc\}$, $n = 8$
 - $A = \{ccc, kkk\}$, $B = \{cck, ckc, kcc, ccc\}$, $C = \{kkk, ckk, kck, kkc, kcc, ckc, cck\}$
 - $AB = \{ccc\}$, $AC = \{ccc\}$, $BC = \{cck, ckc, kcc\}$
 - $P(A) = 2/8 = 1/4$, $P(B) = 4/8 = 1/2$, $P(C) = 7/8$, $P(AB) = 1/8$, $P(AC) = 1/8$, $P(BC) = 3/8$
 - $P(A)P(B) = 1/4 * 1/2 = 1/8 = P(AB)$. Portanto, A e B são independentes

Eventos Independentes

- Ex. 14: Lança-se uma moeda 3 vezes. Sejam os eventos:
A: ocorrem três caras ou três coroas; **B**: ocorrem ao menos duas caras;
C: ocorrem no máximo duas caras.

Dos pares **(A,B)**, **(A,C)** e **(B,C)** quais são independentes?

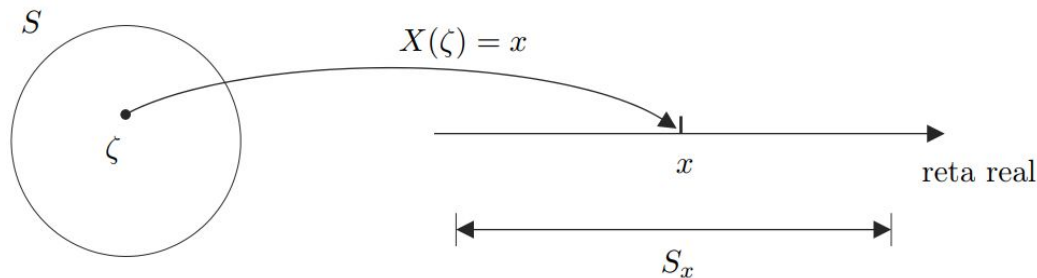
- Considerando que "c" representa cara e "k" coroa, temos:
 - $S = \{ccc, kkk, cck, ckc, kcc, ckk, kck, kkc\}$, $n = 8$
- $A = \{ccc, kkk\}$, $B = \{cck, ckc, kcc, ccc\}$, $C = \{kkk, ckk, kck, kkc, kcc, ckc, cck\}$
- $AB = \{ccc\}$, $AC = \{ccc\}$, $BC = \{cck, ckc, kcc\}$
- $P(A) = 2/8 = 1/4$, $P(B) = 4/8 = 1/2$, $P(C) = 7/8$, $P(AB) = 1/8$, $P(AC) = 1/8$, $P(BC) = 3/8$
- $P(A)P(B) = 1/4 * 1/2 = 1/8 = P(AB)$. Portanto, A e B são independentes
- $P(A)P(C) = 1/4 * 7/8 = 7/32 \neq P(AC)$. Portanto, A e C não são independentes

Eventos Independentes

- Ex. 14: Lança-se uma moeda 3 vezes. Sejam os eventos:
A: ocorrem três caras ou três coroas; **B**: ocorrem ao menos duas caras;
C: ocorrem no máximo duas caras.
Dos pares **(A,B)**, **(A,C)** e **(B,C)** quais são independentes?
 - Considerando que "c" representa cara e "k" coroa, temos:
 - $S = \{ccc, kkk, cck, ckc, kcc, ckk, kck, kkc\}$, $n = 8$
 - $A = \{ccc, kkk\}$, $B = \{cck, ckc, kcc, ccc\}$, $C = \{kkk, ckk, kck, kkc, kcc, ckc, cck\}$
 - $AB = \{ccc\}$, $AC = \{ccc\}$, $BC = \{cck, ckc, kcc\}$
 - $P(A) = 2/8 = 1/4$, $P(B) = 4/8 = 1/2$, $P(C) = 7/8$, $P(AB) = 1/8$, $P(AC) = 1/8$, $P(BC) = 3/8$
 - $P(A)P(B) = 1/4 * 1/2 = 1/8 = P(AB)$. Portanto, A e B são independentes
 - $P(A)P(C) = 1/4 * 7/8 = 7/32 \neq P(AC)$. Portanto, A e C não são independentes
 - $P(B)P(C) = 1/2 * 7/8 = 7/16 \neq P(BC)$. Portanto, B e C não são independentes

Variável Aleatória

- Uma v.a. \mathbf{X} é uma função que associa um número real $X(\zeta)$ a cada resultado ζ no espaço amostral S de um experimento aleatório
- Podemos ver $X(\cdot)$ como uma função que mapeia os pontos amostrais $\zeta_1, \zeta_2, \dots, \zeta_m$ em números reais x_1, x_2, \dots, x_n



Variáveis Aleatórias

- Ex. 15 (exemplo 2.1 da apostila Ynoguti):

Especifique o espaço amostral de um experimento que consiste em jogar uma moeda 3 vezes.

Solução. O espaço amostral para este experimento é

$$S = \{CCC, CCK, CKC, CKK, KCC, KCK, KKC, KKK\},$$

onde C corresponde a “cara” e K corresponde a “coroa”.

Seja X o número de caras em três jogadas da moeda. X associa a cada resultado ζ em S um número do conjunto $S_X = 0, 1, 2, 3$. A tabela abaixo lista os oito resultados de S e os valores de X correspondentes.

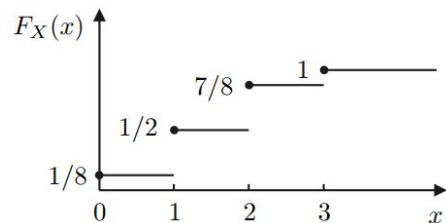
ζ	CCC	CCK	CKC	KCC	CKK	KCK	KKC	KKK
$X(\zeta)$	3	2	2	2	1	1	1	0

X é então uma v.a. que toma valores no conjunto $S_X = 0, 1, 2, 3$.

Tipos de Variáveis Aleatórias

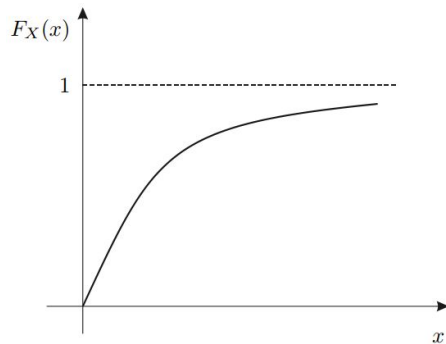
- Discretas:

- Tomam valores de um conjunto finito
- Aparecem geralmente em aplicações que envolvem contagens
- Gráficos que as representam geralmente são degraus
- São comumente representadas por **CDFs** e **PMFs**
- Cálculos geralmente envolvem somatórios



- Contínuas:

- Tomam valores de um conjunto infinito
- Gráficos que as representam geralmente são curvas contínuas
- São comumente representadas por **CDFs** e **PDFs**
- Cálculos geralmente envolvem integrais



Função de Distribuição Cumulativa

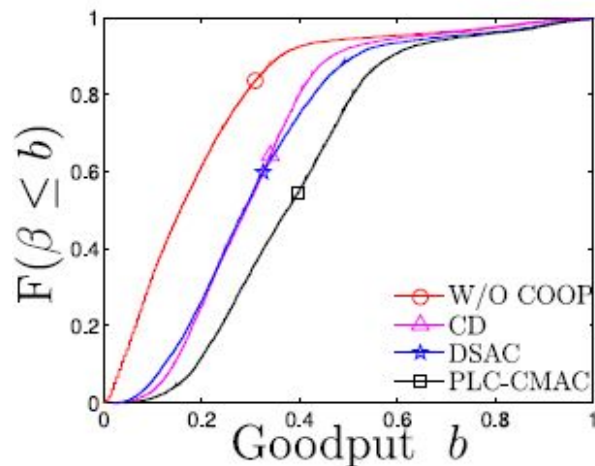
- Conhecida como CDF
- Válida para v.a. discreta ou contínua
- Mapeia um valor para uma probabilidade cujo resultado é menor ou igual a x_a

$$F_{x_a}(x_a) = P(X \leq x_a)$$

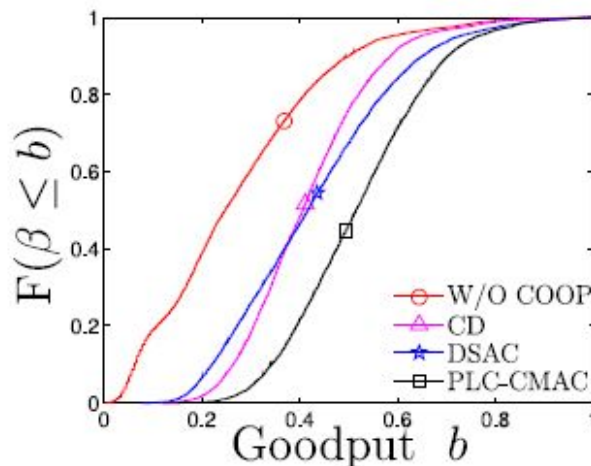
- Curvas crescentes
- Se $P(X \leq x_a) = a$, esse resultado é chamado de a -percentil ou quantil

Função de Distribuição Cumulativa

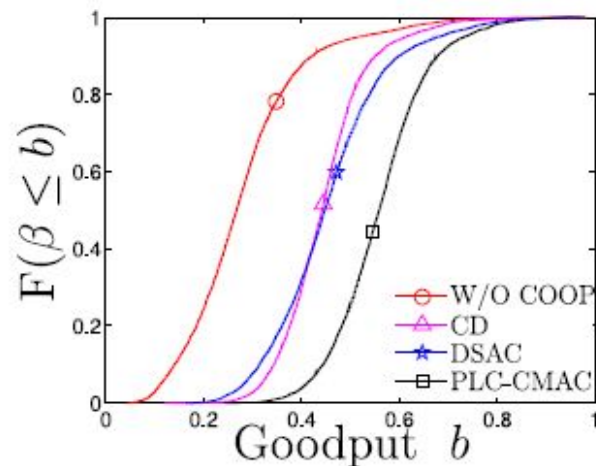
- Ex. 16:



(a) Cases #1 and #3 in
1.7-30 MHz.



(b) Cases #1 and #3 in
1.7-50 MHz.

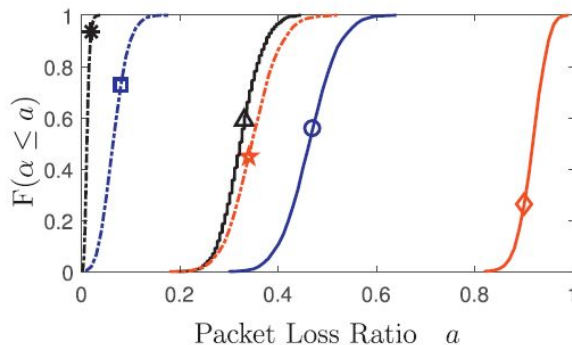


(c) Cases #1 and #3 in
1.7-100 MHz.

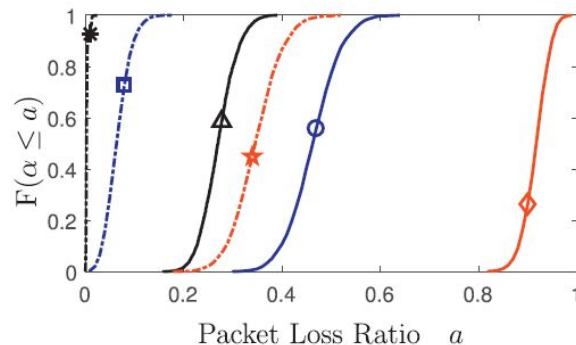
Função de Distribuição Cumulativa

- Ex. 17:

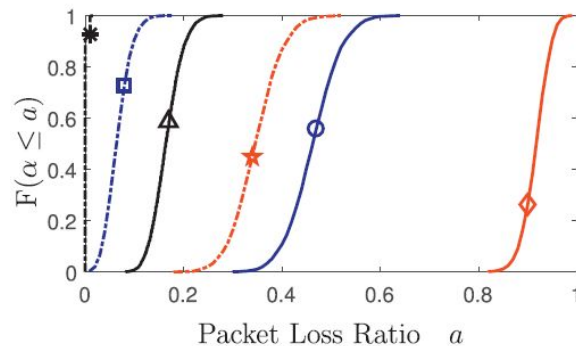
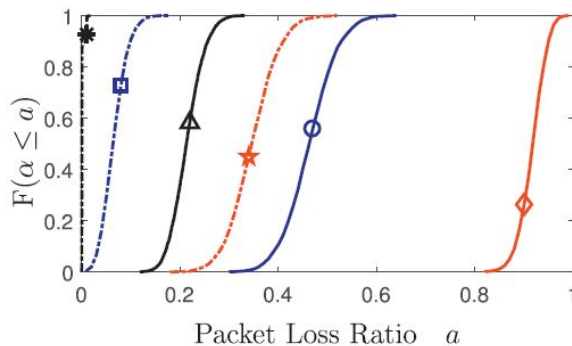
* OFDMA/EPLC-CMAC △ OFDM/EPLC-CMAC □ OFDMA/PLC-CMAC ○ OFDM/PLC-CMAC ★ OFDMA ◇ OFDM



(a) Correction capacity of 1 bit.

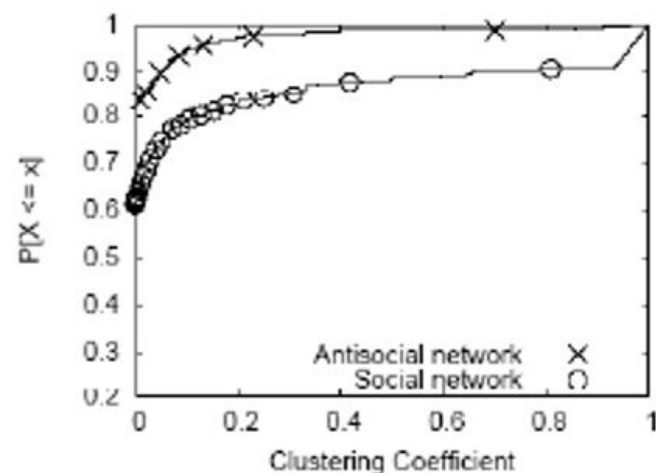
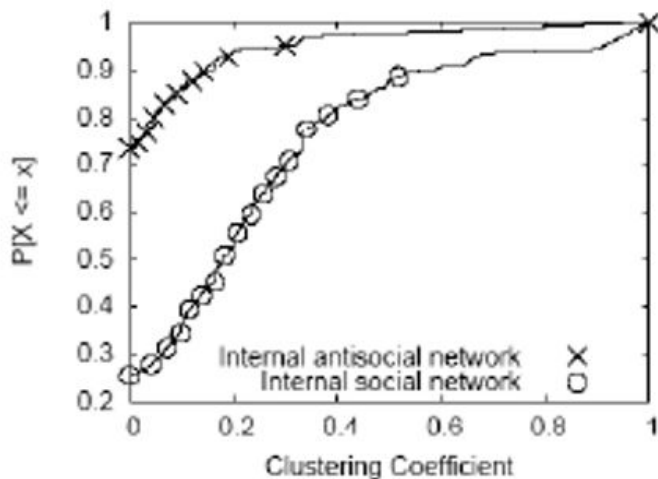


(b) Correction capacity of 2 bits.



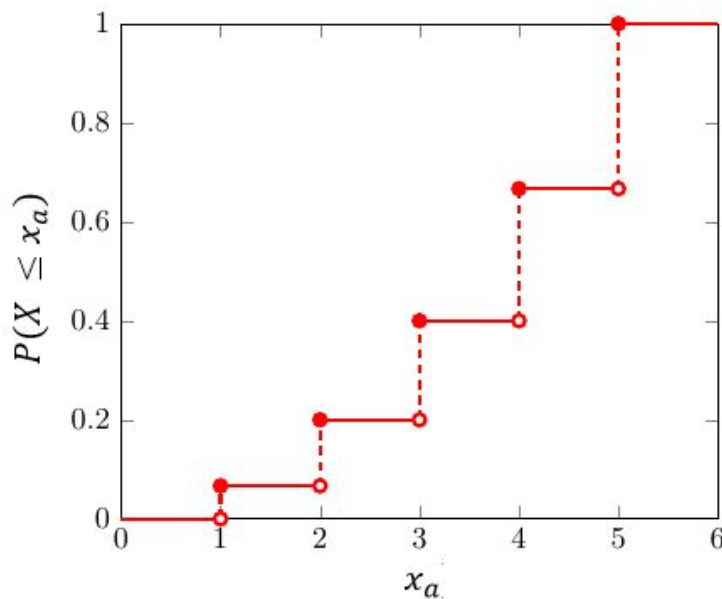
Função de Distribuição Cumulativa

- Ex. 18: *Clustering coefficient* é a probabilidade na qual dois vizinhos de um dado nó de uma rede são, também, vizinhos entre si. Vamos encontrar alguns percentis e entender como comparar as curvas. Essa v.a. é discreta ou contínua?



Função de Distribuição Cumulativa

- Exemplo de uma CDF de v.a. discreta



Função Densidade de Probabilidade

- Conhecida como PDF
- Válida para v.a. contínua
- Derivada da CDF contínua

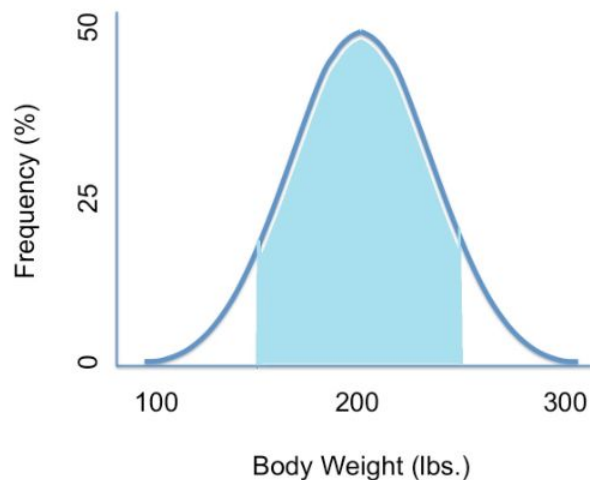
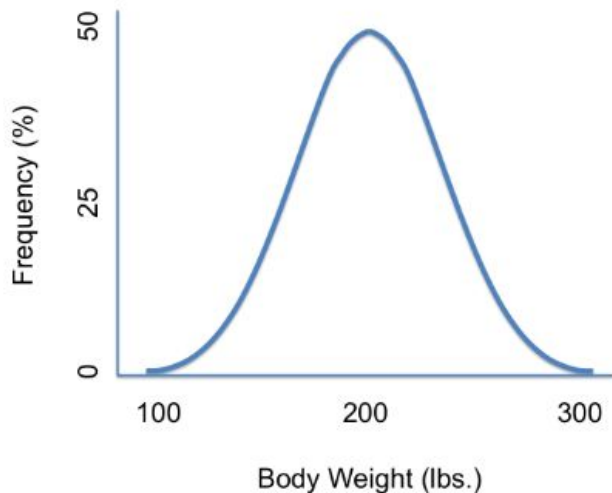
$$f(x) = \frac{dF(x)}{dx}, \quad f(x) \geq 0$$

- Útil para determinar intervalos de probabilidades

$$\begin{aligned} P(x_1 < x \leq x_2) &= F(x_2) - F(x_1) \\ &= \int_{x_1}^{x_2} f(x) dx \end{aligned}$$

Função Densidade de Probabilidade

- Ex. 19: Como faríamos para calcular a probabilidade de pessoas pesarem entre 150 lbs e 250 lbs? (curiosidade: 1 lbs ~ 0,45 kg)
 - Primeiro, temos que colher a amostra, obter a curva da PDF ou derivar a curva da CDF
 - A probabilidade de um intervalo é dada pela área desse intervalo sob a curva (integral)

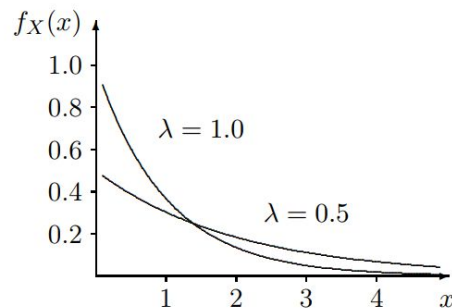


Função Densidade de Probabilidade

- Ex. 20: Vejamos a PDF e a CDF da distribuição exponencial

PDF

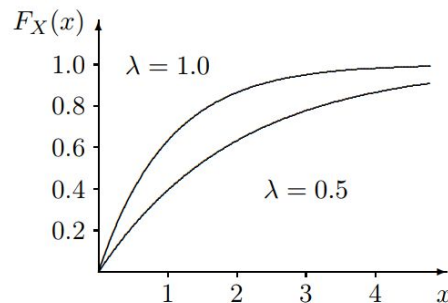
$$f_X(x) = \begin{cases} \lambda e^{-\lambda x} & x \geq 0 \text{ e } \lambda > 0 \\ 0 & \text{caso contrário} \end{cases}$$



$$F_X(x) = \int_0^x \lambda e^{-\lambda y} dy = \lambda \frac{e^{-\lambda y}}{-\lambda} \Big|_0^x = -1(e^{-\lambda x} - e^0) \Rightarrow$$

CDF

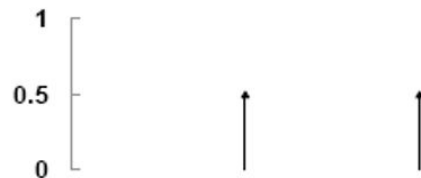
$$F_X(x) = \begin{cases} 1 - e^{-\lambda x} & x \geq 0, \lambda > 0 \\ 0 & \text{caso contrário} \end{cases}$$



Função Massa de Probabilidade

- Conhecida como PMF
- Válida para v.a. discreta
- Associa cada valor de uma v.a. (eixo x) a uma probabilidade (eixo y)
- Geralmente representada por um gráfico de barras ou similares

Jogada de moeda:



Tamanho típico de uma turma de Pós:



AAG01: Tarefa em Dupla (parte 1)

- Implementar funções que plotam CDFs e PMFs a partir de **amostras discretas e contínuas** passadas como parâmetro de entrada
- Regras:
 1. A tarefa deverá ser realizada **obrigatoriamente no Jupyter** com os uso de:
 - a. Blocos de Markdowns com comandos de LaTeX
 - b. Blocos de código
 - c. Blocos com resultados gráficos no ambiente do Jupyter
 - d. Gráficos gerados devem ser interpretados e explicados em Markdown
 2. Não são permitidos comandos prontos além dos comandos básicos do python
 3. Parâmetros de entrada devem ser cuidadosamente escolhidos e especificados para cada tipo de curva (e.g., tempos de processamento, pontuação esportiva, resultados de artigos)
 4. Os formatos de entrega devem ser .pdf e .ipynb (código fonte+markdowns)
 5. Caso usem arquivos de amostras, favor anexá-los também
 6. Data de entrega: começo da próxima aula

AAG01: Tarefa em Dupla (parte 2)

- Repetir a parte 1 com os mesmos parâmetros de entrada, mas usando funções prontas de bibliotecas python para curvas empíricas
- **ATENÇÃO: Diferente da parte 1, plotar também a PDF (além da CDF e PMF) com as funções prontas das bibliotecas**