



Plano Aula 15 e 16

Variáveis Aleatórias (V.A.)

- (... *continuação de probabilidade* ...)
- Geralmente denotadas por X, Y, Z, \dots
 - X letra **maiúscula** denota a v.a. *versus* x letra **minúscula** que denota um particular valor que a v.a. pode assumir;
 - discretas \times contínuas.

Definição **variável aleatória (v.a.)**: denominamos variável aleatória a função (ou regra) que transforma um espaço amostral qualquer, Ω , em um espaço amostral numérico, Ω_X , $X : \Omega \rightarrow \Omega_X$, que será um subconjunto dos números reais.

Exemplo 1: X : duração de vida de um tipo de lâmpada, $X \in (0, \infty)$.

Exemplo 2: X : PIB do Brasil, $X \in \mathbb{R}$.

Exemplo 3: X : número de avaliações positivas em uma pesquisa de avaliação do governo. $X \in \{0, 1, \dots, n\}$.

Exemplo 4: Y (consumo) e X (renda), \dots

Variáveis aleatórias discretas (capítulo 6, Livro Bussab e Morettin)

Definição **v.a. discreta**: quando o espaço amostral associado a uma *v.a.* assumir somente valores inteiros, finitos ou infinitos, $\Omega_X \subseteq \mathbb{Z}$, denominamos v.a. discreta.

(... **cont.**) **Exemplo 3:** E : observar o número de avaliações positivas, assumindo igual probabilidade de avaliação positiva (P) ou não (N) (... lançar uma moeda honesta 3 vezes...). Assim, $X : \Omega = \{(PPP), (PPN), (PNP), \dots (NNN)\} \rightarrow \Omega_X = \{0, 1, 2, 3\}$.

- Como representar distribuições de probabilidade? Por funções, visualmente por tabelas e gráficos, medidas resumo, \dots

1. Função (Massa) de Probabilidade (f.m.p)

Definição **função de probabilidade**: A função $p : \Omega_X \rightarrow [0, 1]$, dada por $p(x) = P(X = x)$, tal que $p(x) \geq 0$, para todo $x \in \Omega_X$, e $\sum_{x \in \Omega_X} p(x) = 1$, é denominada função (massa) de probabilidade.

2. Valor Médio (ou Esperança da Variável) e variância (seção 6.3, Livro Bussab e Morettin)

- Valor esperado/médio, esperança matemática ou simplesmente média - $E(X) = \sum_{x \in \Omega_X} x \times p(x)$;
- Variância - $V(X) = E\{[X - E(X)]^2\} = E(X^2) - [E(X)]^2 = \sum_{x \in \Omega_X} [x - E(X)]^2 \times p(x)$;
- Propriedades, (seção 6.4, Livro Bussab e Morettin)
 - $E(aX + b) = aE(X) + b$ (*porque?*);
 - $V(aX + b) = a^2V(X)$ (*?*).



3. Função de Distribuição (Acumulada) de Probabilidade (seção 6.5, Livro Bussab e Morettin)

Definição **função de distribuição**: a função $F : \Omega_X \rightarrow [0, 1]$ tal que $F(x) = P(X \leq x) = \sum_{\forall y \leq x} P(X = y) = \sum_{\forall y \leq x} p(y)$ é denominada função de distribuição (acumulada).

- Propriedades: $\lim_{x \rightarrow \infty} F(x) = 1$ e $\lim_{x \rightarrow -\infty} F(x) = 0$.
 - $P(a \leq X \leq b) = F(b) - F(a)$;
 - $F(x)$ existe para todos números reais, diferente da f.m.p..

Ler slides e ver vídeos da semana 8.

Fazer lista de exercícios 2-3.
