

Plano Aula 26

Markus Stein

13 November 2019

...continuação TRV considerações finais

Distribuições discretas

- **Exemplo 1:** (*Equilíbrio de Hardy-Weinberg*) Seja $\mathbf{X} = (X_1, \dots, X_n)$ uma a. a. de $X \sim \text{Multinomial}(N, \pi_1, \pi_2, \pi_3)$. Use o TRV para testar $H_0 : \pi_1 = \pi_2 = \pi_3$.
- **Exemplo 2:** (*Tabelas $r \times c$*) Suponha que temos uma tabela de contingência $r \times c$ com n indivíduos independentemente selecionados, sendo n_{ij} o número de unidades classificadas na linha i e na coluna j , para todo $i = 1, \dots, r$ e $j = 1, \dots, c$. Seja π_{ij} a probabilidade de um indivíduo ser classificado na linha i e coluna j , tal que $\pi_{ij} \geq 0$ e $\sum_{i=1}^r \sum_{j=1}^c \pi_{ij} = 1$.
 - a. Encontre o TRV para testar $H_0 : \pi_{ij} = a_i b_j$, para algum $a_i > 0$ e $b_j > 0$ tais que $\sum_{i=1}^r a_i = 1$ e $\sum_{j=1}^c b_j = 1$, contra a alternativa $H_1 : \pi_{ij} \neq a_i b_j$ para pelo menos
 - b. Compare o teste do item (a) com o teste qui quadrado de independência, para testar se a variável da linha e da coluna são independentes.

Teste Exato de Fisher

- **Exemplo 3:** (*Tabela 2×2 restrita*) Seja $S_1 \sim \text{Binomial}(n_1, \pi_1)$ independente de $S_2 \sim \text{Binomial}(n_2, \pi_2)$. Para testar as hipóteses $H_0 : \pi_1 = \pi_2$ contra $H_1 : \pi_1 > \pi_2$:
 - a. Mostre que sob H_0 temos que $S = S_1 + S_2$ é estatística suficiente e $S_1 | S = s \sim \text{Hipergeométrica}(n_1 + n_2, n_1, s)$.
 - b. Calcule o valor p (condicional) para esse teste?
 - c. Compare com os valores p do TRV e do teste qui quadrado do exercício 5.

Testes Qui Quadrado

- Pearson e o teste *Goodness-of-fit*
- ajustamento (homogeneidade) \times independência

Testes Bayesianos

Leitura: Ler seções 8.2.2 e 8.3.5 do livro Casella e Berger.

Tarefa: Fazer lista 5 para entregar.

Teste qui quadrado

Exemplo - Bombas em Londres

- Foram observadas 535 bombas lançadas em 576 áreas. Média de $\bar{x} = 535/576 = 0.93$ bombas por área.
- As áreas serão classificadas pela variável X : n° de bombas em cada área.
- H_0 : “as bombas foram lançadas uniformemente?”
– Assumimos que sob H_0 $X \sim \text{Poisson}(0.93)$

Com os dados do problema, primeiramente vamos calcular o valor da estatística $X^2 = \sum_{j=1}^k \frac{(O_j - E_j)^2}{E_j}$ para os dados observados.

```
O <- c(229, 211, 93, 35, 7, 1) # num. OBS. areas com 0, 1, 2, 3, 4 e 5+ bombas
n <- sum(O) # num. de areas
k <- length(O) # num. de categorias
xbarra <- 535 / n # num. médio de bombas por area
E <- 576 * c(dpois(0:4, xbarra), 1 - ppois(4, xbarra)) # num. ESP. areas com ... bombas
```

O valor para os dados observados, temos que X^2 é igual a

```
## funcao para calcular a estatistica qui quadrado `X2`
X2 <- function(O) sum((O - E)^2 / E)
X2(O)
```

```
## [1] 1.17238
```

Agora geraremos amostras Monte Carlo (MC) sob H_0 e calcularemos a estatística X^2 para cada amostra.

```
## Geracao de possiveis amostras da `Poisson(xbarra)`
nsim <- 1000 # num. de simulacoes
amostrasMC <- replicate(nsim, rpois(n, xbarra)) # amostras simuladas
amostrasMC[amostrasMC > 5] <- 5 # valores > 5 virarao 5

## calculando a estatistica `X2` para todas as amostras MC geradas
# for(ii in 1:nsim) X2(table(factor(amostrasMC[,ii], 0:5)))
X2MC <- apply(amostrasMC, 2, function(xx) X2(table(factor(xx, 0:5))))
```

Com base nas 1000 amostras MC geradas agora construiremos o histograma dos X^2 gerados. A distribuição dos X^2 se assemelha a uma distribuição qui quadrado χ^2 ?

```
# histograma das estatisticas `X2`
par(mar=c(5, 4, 2, 2), cex=0.6)
hist(X2MC, main="", ylab="Proporção", xlab=expression(X^2), prob=TRUE)

# densidade teórica da dist. qui quadrado com k-1 g.l.
lines(X2MC[order(X2MC)], dchisq(X2MC[order(X2MC)], df=k-1), lwd=2, col="red")
```

