

Resolução Lista de exercicio 1

Aluno: Gerson

pdf/Lista R - PGMAT0061.pdf

Resolução Lista de exercicio 1

1. Questão 1

Escreva uma função no R para calcular o coeficiente de correlação linear de Pearson entre duas variáveis. Compare os resultados de sua função com aqueles obtidos pelo R mediante o uso da função `cor(.)`. Para isso, considere o conjunto de dados a seguir:

1.1 Definição da função

```
correlacao <- function(x, y) {  
  # numerador  
  numerador = sum(  
    (x - mean(x)) *  
    (y - mean(y))  
  )  
  # denominador  
  denominador <- sqrt(  
    sum((x - mean(x))**2) *  
    sum((y - mean(y))**2)  
  )  
  r_person = numerador / denominador  
  
  return(r_person)  
}
```

1.2 Teste da função

```
x <- c(0.06,-0.55,-1.41,-1.57,0.07,-0.65,0.73,0.73,-0.22,0.27)
y <- c(-0.46, 0.1, -2.51, -2.31, -1.06, -0.67, 0.72, 0.5, 0.4, 0.77)

a <- correlacao(x, y) |> round(7)
b <- cor(x, y) |> round(7)

glue::glue("A correlação calculada é {a} e a correlação do R é {b}")
```

A correlação calculada é 0.8497228 e a correlação do R é 0.8497228

2. Questão 2

Numa determinada localidade, a distribuição de renda (em unidades monetárias, u.m.) é uma variável aleatória X com função de distribuição de probabilidade:

f.d.p

```
f_X <- function(x) {
  dplyr::case_when(
    x >= 0 & x <= 2 ~ (1/10*x + 1/10)
    ,x > 2 & x <= 6 ~ (-3/40*x + 9/20)
    ,TRUE ~ 0
  )
}
```

2.a Mostre que $f(x)$ é uma f.d.p

1. Para qq x , $f(x) \geq 0$

```
min_x = 0
f_X(min_x) > 0 # TRU
```

[1] TRUE

```
max_x = 6
f_X(max_x) > 0 # TRUE
```

```
[1] TRUE
```

Como $f(x)$ é maior que zero para o valor mínimo e máximo da função, então $f(x) \geq 0$

2. $F(x) = 1$

```
F_X <- function(x) {
  if_else(x >= 0 & x <= 6, integrate(f_X, lower = 0, upper = x)$value, 0)
}

glue::glue("Seja x = 6 o limite superior de X,
  então F({max_x}) = {F_X(max_x)} => f(x) é f.d.p")
```

Seja $x = 6$ o limite superior de X ,
então $F(6) = 1 \Rightarrow f(x)$ é f.d.p

2.b Gráfico de $f(x)$.

```
x <- seq(0, 6, by = 0.1)
y <- sapply(x, f_X)

df <- data.frame(x = x, y = y)

ggplot(df, aes(x = x, y = y)) +
  geom_line() +
  labs(
    title = "Função de distribuição de probabilidade",
    x = "x",
    y = "f(x)"
  )
```



2.c $P(x \geq 4.5)$

```
p_4.5 = (1 - F_X(4.5)) * 100

glue::glue("A probabilidade de encontrar uma pessoa
           com renda superior a 4.5 u.m é {p_4.5 |> round(2)}%")
```

A probabilidade de encontrar uma pessoa
com renda superior a 4.5 u.m é 8.44%

2.d Calcular $E(X)$ e $Var(X)$

$E(X)$

```
E_X <- integrate(\(x) {x * f_X(x)}, lower = 0, upper = 6)$value
E_X |> round(2)
```

[1] 2.47

Var(X)

```
Var_X <- integrate(\(x) {(x - E_X)^2 * f_X(x)}, lower = 0, upper = 6)$value  
Var_X |> round(2)
```

```
[1] 1.78
```

3. Questão 3

3.a Seja a amostra abaixo obtida de uma distribuição Poisson de parâmetro λ :

```
x <- c(5,4, 6,2, 2,4, 5, 3, 3, 0, 1, 7, 6, 5, 3, 6, 5, 3, 7, 2)
```

3.a.1 Obtenha o gráfico da função de log-verossimilhança

3.a.2 Encontre a E.M.V. de λ e represente-a no gráfico anterior

Questão 4