

LCE0216 - Introdução à Bioestatística Florestal

3. Variáveis aleatórias discretas

Profa. Dra. Clarice Garcia Borges Demétrio
Monitores: Giovana Fumes e Ricardo Klein

Escola Superior de Agricultura "Luiz de Queiroz"
Universidade de São Paulo

Piracicaba, 30 de Março de 2017

Maioria dos problemas $\Rightarrow$ Poucos modelos básicos



Verificar as suposições do modelo

Distribuição de Bernoulli

Distribuição de Bernoulli

Experimento: O departamento de Entomologia e Acarologia da ESALQ/USP realizou um experimento para verificar a eficácia de um novo controle de determinada praga. Um grupo de 30 insetos foram submetidos à nova substância e, depois de um determinado período, foram avaliados. Tomando-se ao acaso, um inseto do estudo, verifica-se se este está vivo ou morto.



Distribuição de Bernoulli

Variável aleatória X : mortalidade.

$x = 1$ se morreu

$x = 0$ se não morreu



Algumas pressuposições:

- É realizada apenas uma repetição do experimento;
- Apenas dois resultados possíveis: morreu ou não morreu.

Distribuição de Bernoulli

Evento $M = \{\text{O inseto morreu}\}$

$$P(M) = \pi \quad P(\bar{M}) = 1 - \pi.$$

Distribuição de probabilidade:

Resultados	x	$P(X = x)$
$\bar{M}$	0	$1 - \pi$
M	1	π
Total		$(1 - \pi) + \pi = 1$

Portanto, a variável aleatória X : mortalidade, tem distribuição de Bernoulli.

Distribuição de Bernoulli

A função de probabilidade de uma variável Bernoulli é dada por:

$$P(X = x) = \pi^x(1 - \pi)^{1-x}.$$

Logo,

$$P(X = 0) =$$

$$P(X = 1) =$$

Distribuição de Bernoulli

A função de probabilidade de uma variável Bernoulli é dada por:

$$P(X = x) = \pi^x(1 - \pi)^{1-x}.$$

Logo,

$$P(X = 0) = \pi^0(1 - \pi)^{1-0} = 1 - \pi$$

$$P(X = 1) = \pi^1(1 - \pi)^{1-1} = \pi$$

Distribuição de Bernoulli

Média

$$E(X) = \mu_X = \sum_{x=0}^1 xP(X=x) = 0 \times (1-\pi) + 1 \times \pi = \pi.$$

Variância

$$\text{Var}(X) = \sigma_X^2 = E(X^2) - [E(X)]^2 = \pi - \pi^2 = \pi(1-\pi)$$

Logo, o desvio padrão de uma variável aleatória com distribuição de Bernoulli é dado por:

$$\sigma_X = \sqrt{\pi(1-\pi)}.$$

Distribuição de Bernoulli

Exemplo: Um pesquisador diz que o tratamento das estacas com uma certa concentração de hormônio eleva a porcentagem esperada de enraizamento. 10 estacas foram tratadas e destas, 6 enraizaram. Escolhe-se ao acaso uma estaca. Seja $X =$ “a estaca enraizar”, verifique se é um ensaio de Bernoulli. Determinar a $P(X = x)$, calcular $E(X)$ e $Var(X)$.

Distribuição binomial

Experimento: Verificar se dois insetos submetidos à nova substância permaneceram vivos ou morreram.

Pressuposições:

- o fato de um inseto morrer, ou não, não tem influência no fato de o outro inseto morrer, ou não; ou seja, as mortes são **independentes**;
- a probabilidade dos insetos morrerem é a mesma, igual a π .
- só há dois resultados possível para cada inseto: morreu ou não morreu (ensaio de Bernoulli); e
- existem duas repetições.

Distribuição binomial

Variável aleatória X = número de insetos mortos.

Resultado	Probabilidade	x
MM	$\pi\pi$	2
$M\bar{M}$	$\pi(1 - \pi)$	1
$\bar{M}M$	$(1 - \pi)\pi$	1
$\bar{M}\bar{M}$	$(1 - \pi)(1 - \pi)$	0
Total	1	

Distribuição binomial

Variável aleatória X = número de insetos mortos.

Resultado	Probabilidade	x
MM	$\pi\pi$	2
$M\bar{M}$	$\pi(1 - \pi)$	1
$\bar{M}M$	$(1 - \pi)\pi$	1
$\bar{M}\bar{M}$	$(1 - \pi)(1 - \pi)$	0
Total	1	

Distribuição de probabilidades

x_i	$P(X = x)$
0	$(1 - \pi)^2$
1	$2\pi(1 - \pi)$
2	π^2
Total	1

Distribuição binomial

Generalizando...

A probabilidade de x insetos morrerem e, portanto, $n - x$ insetos permanecerem vivos, nesta sequência,

$$\underbrace{M, M, \dots, M}_x, \underbrace{\bar{M}, \bar{M}, \dots, \bar{M}}_{n-x}$$

é dada por:

$$\pi^x (1 - \pi)^{n-x}.$$

Outras sequências podem ocorrer com a mesma probabilidade, tais como:

$$M, M, M \dots, \bar{M}, \bar{M}, M, \bar{M}, \dots, \bar{M} \quad \text{ou} \quad M, M, M \dots, \bar{M}, M, \bar{M}, \bar{M}, \dots, \bar{M}.$$

Existem

$$\binom{n}{x} = \frac{n!}{x!(n-x)!}$$

de tais sequências.

Generalizando...

Logo,

$$P(X = x) = \binom{n}{x} \pi^x (1 - \pi)^{n-x}, \quad \text{para } x = 0, 1, 2, \dots, n.$$

Observações:

- a denominação binomial decorre do fato de os coeficientes $\binom{n}{x}$ serem exatamente os coeficientes do desenvolvimento binomial dos termos $(a + b)^n$;
- o cálculo dos coeficientes, para n e x grandes, é difícil de ser realizado.

Notação: $X \sim B(n; \pi)$.

Distribuição binomial

Pressuposições:

- Existem n repetições ou provas idênticas do experimento;
- Só há dois tipos de resultados possíveis em cada repetição;
- As probabilidades π de sucesso e $(1 - \pi)$ de fracasso permanecem constantes em todas as repetições;
- Os resultados das repetições são independentes uns dos outros.

Distribuição binomial

$$P(X = x) = \binom{n}{x} \pi^x (1 - \pi)^{n-x}, \quad \text{para } x = 0, 1, 2, \dots, n.$$

Média

$$\mu_X = E(X) = n\pi.$$

Variância

$$\sigma_X^2 = \text{Var}(X) = n\pi(1 - \pi)$$

Distribuição binomial

Um lote de *Eucaliptus saligna* com uma proporção de 5% de sementes híbridas (*E. saligna* $\times$ *E. cloeziana*) foi utilizado para a implantação de uma floresta. Se dez árvores desta floresta forem selecionadas ao acaso, qual a probabilidade de

- (a) nenhuma delas ser híbrido;
- (b) pelo menos uma delas ser híbrido;
- (c) todas elas serem híbridos.
- (d) Seja Y o número de sementes híbridas em 10 sementes. Calcule $E(Y)$ e $\text{Var}(Y)$.

Distribuição binomial

Exercício: Seja X a variável aleatória número de plantas com mutação em um total de n plantas irradiadas e $p = 0,0001$ a probabilidade de uma planta irradiada apresentar mutação. Calcular:

- (a) a probabilidade de não aparecer plantas com mutação em um total de 1000 plantas irradiadas;
- (b) a probabilidade de aparecer ao menos uma planta com mutação em 1000 plantas irradiadas;
- (c) a probabilidade de não aparecer planta com mutação em 2000 plantas irradiadas;
- (d) a probabilidade de aparecer pelo menos duas plantas com mutação em 2000 plantas irradiadas;
- (e) o número médio esperado de plantas com mutação em 2000 plantas irradiadas;
- (f) a variância esperada do número de plantas com mutação em 2000 plantas irradiadas;
- (g) o número mínimo de plantas que devemos irradiar de modo que a probabilidade de aparecer ao menos uma planta com mutação seja maior ou igual a 0,90.

Distribuição de Poisson

A distribuição de Poisson

é largamente utilizada quando desejamos contar número de ocorrências de um evento de interesse, por unidade de tempo, comprimento, área ou volume. A unidade de medida deve ser estabelecida de tal modo que o valor esperado das contagens seja baixo (inferior a 10).

Distribuição de Poisson

Exemplos:

- número de indivíduos por quadrante de 1 m^2 ;
- número de colônias de bactérias por $0,01 \text{ mm}^2$ de uma dada cultura, observado em uma plaqueta de laboratório;
- número de defeitos em 1000 m de tecido;
- número de acidentes em uma esquina movimentada e bem sinalizada, por dia;
- número de partículas radioativas emitidas numa unidade de tempo: e número de micronúcleos/1000 células.

Importante: Estudo de dinâmica de populações e de entomologia.

Distribuição de Poisson

Função de probabilidades

A função de probabilidades de uma variável aleatória X com distribuição de Poisson com parâmetro λ é dada por:

$$P(x) = P(X = x) = \frac{e^{-\lambda} \lambda^x}{x!}, \quad x = 0, 1, 2, 3, \dots,$$

em que λ é igual ao número de ocorrências do evento de interesse por unidade de tempo, distância, área, ...

Notação: $X \sim P(\lambda)$.

Distribuição de Poisson

Média

A esperança de uma variável aleatória X com distribuição de Poisson com parâmetro λ é dada por:

$$\mu_X = E(X) = \lambda.$$

Variância

A variância de uma variável aleatória X com distribuição de Poisson com parâmetro λ é dada por:

$$\sigma_X^2 = \text{Var}(X) = \lambda.$$

Distribuição de Poisson

Exemplo: A emissão de partículas radioativas tem sido modelada por meio de uma distribuição de Poisson, com o valor do parâmetro dependendo da fonte utilizada. Suponha que o número de partículas alfa, emitidas por minuto, seja uma variável aleatória seguindo o modelo de Poisson com parâmetro 5, isto é, a taxa média de ocorrência é de 5 emissões a cada minuto. Calcule a probabilidade de haver mais de duas emissões em um minuto.

Exemplo: Sabe-se que numa certa rede de computadores ocorre em média uma queda por semana. Um pesquisador deseja realizar um trabalho envolvendo simulação em que são necessários 2 dias consecutivos sem haver queda na rede. Supondo o modelo de Poisson, calcular a probabilidade dele não conseguir realizar a simulação.

A distribuição de Poisson, $P(\lambda)$, com $\lambda = n\pi$ é uma boa aproximação à distribuição binomial $B(n, \pi)$, quando π for pequeno e n for bastante grande, tal que $n\pi \leq 10$.

Exemplo: Seja X a variável número de plantas com mutação em um total de n plantas irradiadas e $\pi = 0,0001$ a probabilidade de uma planta irradiada apresentar mutação. Calcular, usando a distribuição de Poisson como uma aproximação à binomial:

- (a) a probabilidade de não aparecer planta com mutação em 1000 plantas irradiadas;
- (b) a probabilidade de aparecer ao menos uma planta com mutação em 1000 plantas irradiadas;
- (c) a probabilidade de não aparecer plantas com mutação em 2000 irradiadas;
- (d) a probabilidade de aparecer ao menos duas plantas com mutação em 2000 plantas irradiadas;
- (e) o número médio esperado de plantas com mutação em 2000 plantas irradiadas;
- (f) a variância esperada do número de plantas com mutação em 2000 plantas irradiadas;
- (g) o número mínimo de plantas que devem ser irradiadas de modo que a probabilidade de aparecer ao menos uma planta com mutação seja maior ou igual a 0,90.