Estadística en Física Experimental Verano 2019)

Guía de Problemas N° 5 | Propagación de Errores

1. En un experimento se mide un observable que está descripto por la variable aleatoria X, cuya distribución de probabilidad tiene esperanza μ y varianza σ^2. Se realizan N repeticiones del mismo experimento, obteniendo N mediciones $\{x_i\}$.
   (a) Muestre que el error del promedio $\bar{X} = \sum_i X_i/N$ es: $\sigma_{\bar{X}} = \sigma/\sqrt{N}$, si las mediciones son independientes.
   (b) Discuta la diferencia entre el error de cada medición σ y el error del promedio $\sigma_{\bar{X}}$.
   (c) Ahora las N mediciones están completamente correlacionadas, es decir: $\rho = 1$, o lo que es lo mismo $\mathrm{Cov}(X_i, X_j) = \sqrt{\mathrm{Var}(X_i)}\sqrt{\mathrm{Var}(X_j)}$, para todo $1 \leq i, j \leq N$. ¿Cuánto vale el error del promedio? [Rta: $\sigma_{\bar{X}} = \sigma$]

2. Muestre que si una magnitud Y se obtiene como:
   (a) sumas y restas de magnitudes independientes X_i, entonces el *error absoluto* de Y es la suma en cuadratura de los errores de los X_i.
   (b) productos y divisiones de magnitudes independientes X_i, entonces el *error relativo* de Y es la suma en cuadratura de los errores relativos de X_i.

   Aclaración: la *suma en cuadratura* de a y b es: $c = \sqrt{a^2 + b^2}$, que suele notarse como: $c = a \oplus b$.

   Comentario: muestre que si en lugar de sumar en cuadratura se hace la *suma aritmética* el error queda *sobreestimado*.

3. Se hace girar la varilla del ejercicio 5 de la guía 3 y se mide el ángulo obteniendo Θ=1.10 $\pm$ 0.03 rad.
   (a) ¿Cuánto vale el error de Y=tan Θ según la fórmula de propagación?
   (b) Alguien a ojímetro dice que Θ=1.1 $\pm$ 0.5 rad. ¿Vale usar la fórmula usual de propagación del error para la variable Y en este caso? Si tiene dudas dibuje Y vs Θ y mire cuánto vale $Y(1.1 + 0.5)$. ¿Qué límites tiene la ley de propagación?

4. ¿Puede utilizar la fórmula de propagación para encontrar el error de $Z = X/Y$, con X e Y, normales $N(0, 1)$ independientes? ¿Por qué? ¿Cuánto vale la varianza de la distribución de Cauchy?

5. Un experimento se propone determinar los brillos máximo y mínimo, B_{max} y B_{min}, de una estrella variable con un detector que cuenta fotones. El procedimiento consiste en medir el brillo de la estrella más el cielo, F, y luego el de una región del cielo libre de estrellas, C, para descontar la contribución del mismo. El brillo B de la estrella se obtiene entonces como

   $$B = \frac{1}{\epsilon}\left(\frac{F}{t_F} - \frac{C}{t_C}\right)$$

   donde t_F y t_C son los tiempos de medición en segundos para la estrella más cielo y para el cielo, respectivamente, y ϵ es la eficiencia del detector.
   (a) Un astrónomo realiza las tres mediciones, brillo mínimo y máximo de la estrella y brillo del cielo, cada una durante un tiempo de $t = 10\,min$, resultando $F_{max} = 2384$, $F_{min} = 992$ y $C = 69$. El detector utilizado tiene una eficiencia de $\epsilon = 0.1$, con un error sistemático de 6%. Calcule los resultados de B_{max} y B_{min} a publicar, con su matriz de error. [Rta: $B_{max} = 38.58$, $B_{min} = 15.38$, $\mathrm{Var}(B_{max}) = 6.0406$, $\mathrm{Var}(B_{min}) = 1.1467$, $\mathrm{Cov}(B_{max}, B_{min}) = 2.1559$]
   (b) Obtenga el factor de correlación entre B_{max} y B_{min} y dibuje la correspondiente elipse de covarianza, utilizando los resultados de los últimos ejercicios de la guía 4. [Rta: 0.8192]
   (c) Un astrofísico teórico ha desarrollado un modelo estelar, el cual predice una relación de la forma B_{max}=$(B_{min})^\alpha$, con $\alpha^{\text{modelo}} = 1.4$. Determine si dicha teoría es consistente con las observaciones experimentales publicadas por el astrónomo en el ítem a. Muestre que sus conclusiones respecto al acuerdo teoría-experimento ($\Delta\alpha \equiv |\alpha^{\text{modelo}} - \alpha^{\text{exp}}|$) son distintas si en la propagación de errores se olvida de incluir el término de correlación. [Rta: $\Delta\alpha = 3.2\,\sigma_\alpha^{(\text{con correlación})}$ y $\Delta\alpha = 1.5\,\sigma_\alpha^{(\text{sin correlación})}$]

6. La constante de Planck según NIST es $h = (6.62606957 \pm 0.00000029) \times 10^{-34}$ J s, o escrito en una notación más concisa $h = 6.62606957(29) \times 10^{-34}$ J s.
   (a) ¿Por qué en general se reporta la medición usando una o dos cifras significativas del error?
   (b) Un regla aparentemente críptica se describe en el Particle Data Group :

   > "... if the three highest order digits of the error lie between 100 and 354, we round to two significant digits. If they lie between 355 and 949, we round to one significant digit. Finally, if they lie between 950 and 999, we round up to 1000 and keep two significant digits. In all cases, the central value is given with a precision that matches that of the error."

   Con intenciones de entender su motivación se propone:
   i. Aplicar la regla a los números comprendidos entre 100 y 999.
   ii. Evaluar la precisión de cada resultado luego de aplicar la regla.
   iii. Observar si alguna cantidad de interés se ve acotada por la aplicación de esta regla.

7. En un artículo se reporta que el promedio de un observable A tiene este valor: $\bar{A} \pm \sigma_A^{\text{est}} \pm \sigma_A^{\text{sist}}$, donde σ_A^{est} y σ_A^{sist} son los errores estadístico y sistemático.
   (a) ¿Cuánto debería valer la incerteza total: σ_A?
   (b) ¿Qué resultado esperaría leer si el experimento se repite en el futuro realizando el doble de mediciones? Expresarlo en función de $\bar{A}$, σ_A^{est} y de σ_A^{sist}.
   (c) ¿Podría haber hecho el cálculo anterior si originalmente se hubiera publicado solo la incerteza total: $\bar{A} \pm \sigma_A$?

8. Considere N mediciones (x_i, y_i), donde los y_i son independientes y todos con el mismo error σ, ésto es, $\text{Cov}(Y_i, Y_j) = \delta_{ij}\sigma^2$, donde δ_{ij} es la delta de Kronecker. En este caso los x_i son números sin error (no son variables aleatorias). Los parámetros de la recta $y{=}a_1 + a_2 x$ que mejor ajusta los datos surgen de minimizar la suma $S_N{=}\sum_i^N [y_i - (a_1 + a_2 x_i)]^2$, obteniéndose la conocida fórmula de cuadrados mínimos

$$\begin{cases} \hat{a}_1 = \left(\sum x_i^2 \sum y_i - \sum x_i \sum x_i y_i\right)/\Delta \\ \hat{a}_2 = \left(N \sum x_i y_i - \sum x_i \sum y_i\right)/\Delta \end{cases} \qquad \text{con} \quad \Delta = N\sum x_i^2 - \left(\sum x_i\right)^2 \tag{1}$$

   (a) Usando la fórmula de propagación de errores muestre que la matriz de covarianza de los parámetros de la recta es

$$\text{Cov}(\hat{a}_1, \hat{a}_2) = \frac{\sigma^2}{\Delta}\begin{pmatrix} \sum x_i^2 & -\sum x_i \\ -\sum x_i & N \end{pmatrix} \tag{2}$$

   (b) Analice intuitivamente por qué la correlación es negativa si el promedio de los datos está del lado positivo de la abscisa, positiva en el caso contrario, y por qué la pendiente y la ordenada al origen no están correlacionadas si $\sum x_i = 0$.
   Ayuda: puede ser útil usar que la recta ajustada $y = \hat{a}_1 + \hat{a}_2 x$, pasa por el punto $(\bar{x}, \bar{y})$.
   (c) Encuentre, con su error, los parámetros de la recta que mejor ajusta los siguientes datos, con $\sigma = 0.3$. Grafique los datos, con su error, y la recta obtenida para $0 \leq x \leq 5$. [Rta: $\hat{a}_1{=}1.452 \pm 0.721$ y $\hat{a}_2{=}0.799 \pm 0.286$]

X	2.00	2.10	2.20	2.30	2.40	2.50	2.60	2.70	2.80	2.90	3.00
Y	2.78	3.29	3.29	3.33	3.23	3.69	3.46	3.87	3.62	3.40	3.99

   (d) A partir de esta recta prediga, con su error, el valor esperado y_a para un cierto x_a. No olvide usar la matriz de covarianza completa. Grafique $y_a(x_a)$, y agréguelo al gráfico anterior en forma de banda de error. Encuentre qué valor de x_a minimiza el error de y_a, e interprete la magnitud de este valor mínimo. Discuta por qué el error aumenta para valores de x_a alejados de la región donde se hicieron las mediciones.
   (e) Grafique la banda de error que obtiene si ignora el término de correlación en la propagación de errores y discuta por qué ésta es claramente errónea.

9. Verifique los resultados analíticos obtenidos en el ítem 8d escribiendo un programa que realice la siguiente simulación numérica:
   I. para cada x_i genere al azar un y_i de la distribución gaussiana $\text{N}(\hat{a}_1{+}\hat{a}_2 x_i,\, \sigma)$.
   II. ajuste una recta a los (x_i, y_i) generados, y prediga el valor y_a para $x_a = 0.5$.

   Repita 1000 veces los pasos I.–II., construyendo un histograma con los valores de y_a, y dibuje sobre éste la gaussiana con el valor esperado y el error de y_a calculado teoricamente en 8d.