
Estatística: Aplicação ao Sensoriamento Remoto

SER 204 - ANO 2023

Teoria da amostragem

Camilo Daleles Rennó

camilo.renno@inpe.br

<http://www.dpi.inpe.br/~camilo/estatistica/>

Algumas Considerações...

É importante ter consciência de que dominar as técnicas estatísticas não é suficiente para garantir o sucesso de uma análise, ou seja, conseguir chegar a conclusões "interessantes".

De forma geral, para que as análises estatísticas sejam válidas, as amostras devem representar a população, ou seja, a menos que discrepâncias ocorram devido ao acaso, as amostras devem reproduzir as mesmas características da população considerando a variável estudada.

É fundamental que as amostras sejam obtidas por processos adequados de modo a evitar que erros grosseiros possam comprometer a análise dos dados.

Algumas Considerações...

Em muitos casos, é bastante tentador que as observações mais convenientes sejam as selecionadas para compor uma amostra ou então aplicar algum tipo de critério (ou julgamento) no momento dessa seleção.

Nesses casos, pode-se introduzir algum tipo de tendência que poderá causar uma super ou subestimativa dos parâmetros de interesse. A identificação (e descrição) desta tendência pode ser difícil (ou impossível) de ser feita após a coleta dessas amostras.

Algumas vezes, como na *Aprendizagem Ativa (Active Learning)*, há um propósito explícito na escolha da amostra com o objetivo de se escolher poucas amostras representativas da população.

No entanto, de modo geral, o ideal é que a seleção das amostras seja feito através de algum processo aleatório, de modo que qualquer elemento da população tenha igual chance de ser escolhido para compor a amostra.

Censo ou Amostragem?

Por que fazer **Censo**?

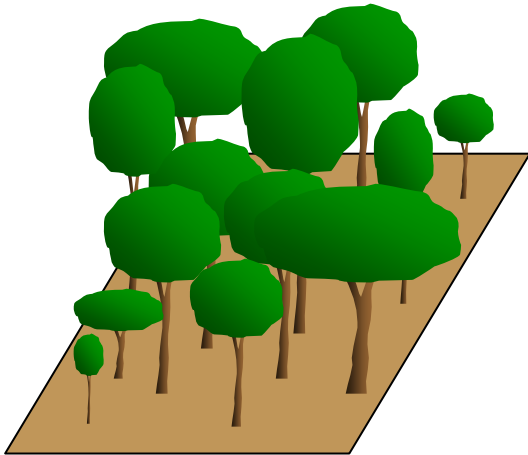
- a população é pequena ou amostragem "ideal" é quase tão grande quanto a população
- necessita-se de uma precisão completa (não é permitido nenhum erro)
- os dados de toda população já se encontram disponíveis

Por que fazer **Amostragem**?

- a população é infinita (ou muito grande)
- os custos de obtenção das medidas são elevados (análises muito caras)
- o tempo para caracterização da população é muito longo
- deseja-se aumentar a representatividade, amostrando-se diferentes populações
- necessita-se melhorar a precisão das medidas (mais cuidado na obtenção dos dados)
- a obtenção das medidas requer a destruição das amostras (p. ex: biomassa)

Amostragem

Toda amostragem requer **planejamento**



- a) O que quero caracterizar neste estudo?
algum parâmetro específico (média, variância, etc),
distribuição espacial e/ou variação temporal é importante?
- b) Qual é a unidade amostral apropriada para o estudo?
quem é o elemento da população (unidade amostral)?
- c) Como estas amostras devem ser coletadas?
há variabilidade espacial e temporal?
quais fatores podem influenciar nos resultados?
- d) Quantas amostras são necessárias?
qual é a precisão exigida?
quanto tempo e recurso disponho?

Unidade Amostral

A unidade amostral representa a menor entidade identificada na população e é considerada o objeto de estudo.

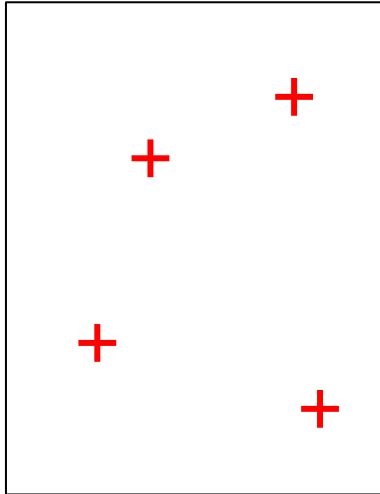
Ela constitui o elemento da população na qual são coletadas as medidas ou informações (qualitativas ou quantitativas) que serão analisadas.

Em estudos na área de Sensoriamento Remoto e Geoprocessamento, podem ser representados por:

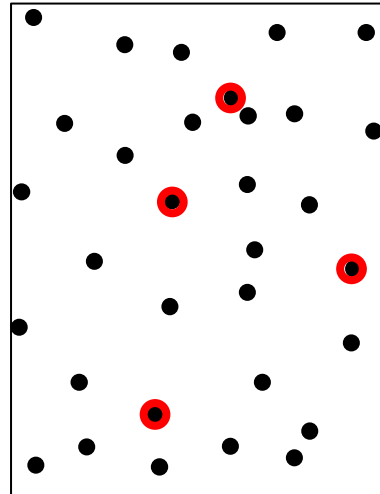
- pontos
- objetos (polígonos ou linhas)

Unidade Amostral

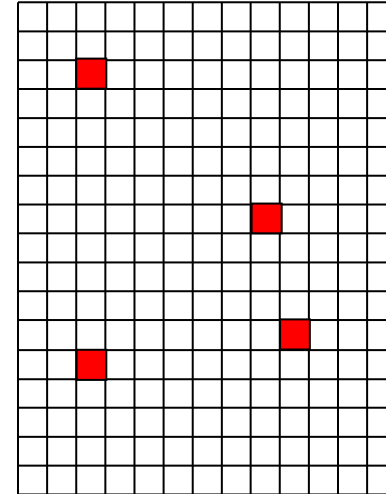
Pontos



posição no espaço
(p.ex. ponto num lago)



indivíduo da população
(p.ex. árvore numa floresta)

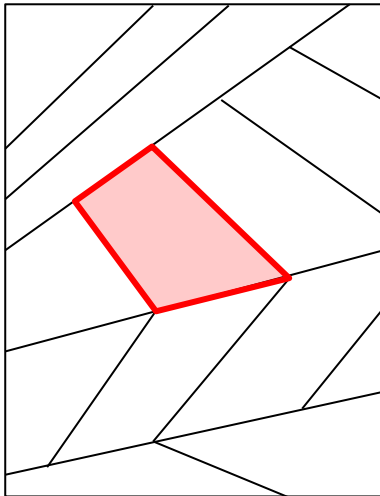


pixel da imagem ou grade

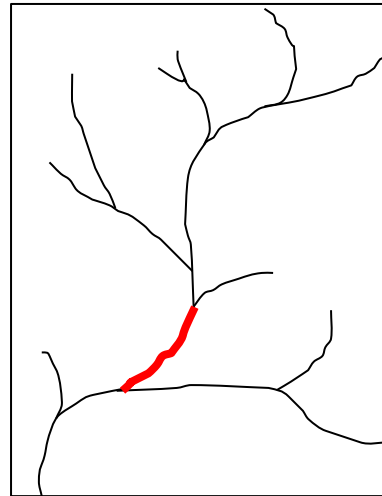
- sorteio aleatório é facilitado
- em coletas em campo, a localização precisa do ponto sorteado pode ser difícil
- pode induzir a erros em regiões heterogêneas

Unidade Amostral

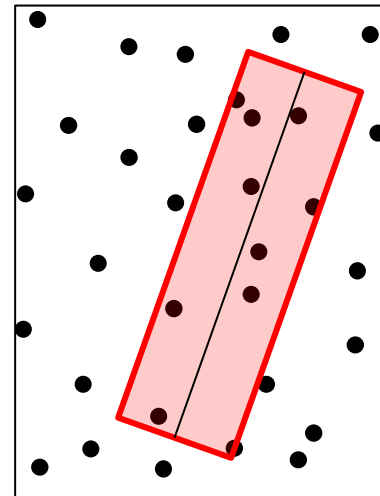
Objetos



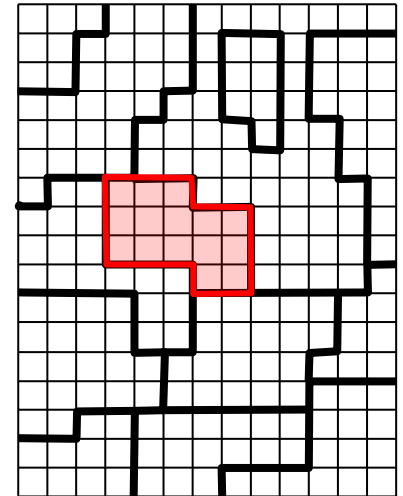
região no espaço
(p.ex. talhão agrícola)



linha
(p.ex. trecho de rio)



indivíduos da população
(p.ex. transecto)



segmento

- deve representar áreas homogêneas (deve-se evitar áreas de transição)
- em coletas de campo, minimiza problemas de posicionamento quando informação contextual é considerada
- mesmo podendo conter muitos valores medidos, deve ser contabilizado como apenas uma observação e portanto deve-se adotar uma medida representativa (total, média, mediana, etc)

Tipos de Amostragem

Como amostrar?

amostragem probabilística X não probabilística

Amostragem probabilística:

cada elemento da população tem uma probabilidade (não nula) de ser escolhido
em geral, todo elemento tem a mesma probabilidade de ser escolhido



Neste tipo de amostragem, todos os elementos devem ser previamente identificados e a escolha é feita por sorteio realizado posteriormente e de forma independente

Tipos de Amostragem

Como amostrar?

amostragem probabilística X não probabilística

Amostragem probabilística:

cada elemento da população tem uma probabilidade (não nula) de ser escolhido
em geral, todo elemento tem a mesma probabilidade de ser escolhido



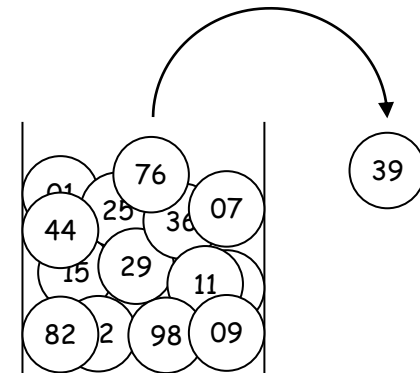
Tipos de Amostragem

Como amostrar?

amostragem probabilística X não probabilística

Amostragem probabilística:

cada elemento da população tem uma probabilidade (não nula) de ser escolhido
em geral, todo elemento tem a mesma probabilidade de ser escolhido



Tipos de Amostragem

Como amostrar?

amostragem probabilística X não probabilística

Amostragem não probabilística:

escolha a esmo (rotulagem inviável ou impossível)

populações muito grandes (ex: estudo sobre a variabilidade no DAP em talhões de reflorestamento de eucalipto)

populações dinâmicas (ex: estudo sobre qualidade de água num rio)

amostragem restrita aos elementos que se tem acesso (ex: estudo sobre ocorrência de focos de dengue em casas de veraneio)

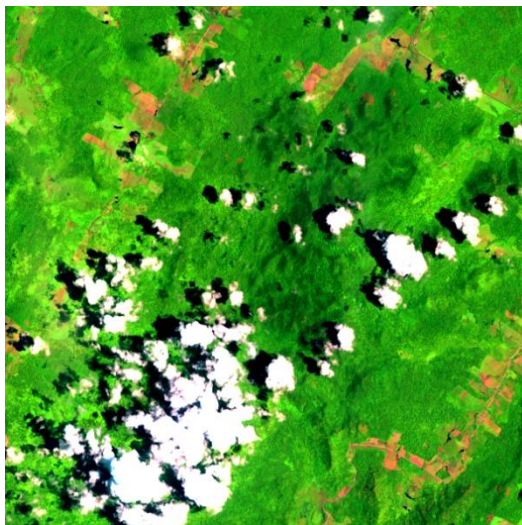
amostragem intencional ou por julgamento (ex: estudo sobre diversidade florística de plantas com DAP maior que 30cm dentro de um transecto)

voluntários (ex: estudo sobre a eficácia de uma nova vacina contra febre amarela)

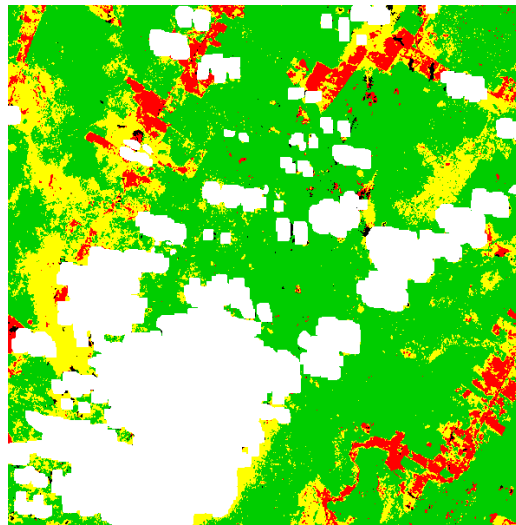
OBS: escolha a esmo é a abordagem que mais se assemelha à amostragem probabilística desde que se garanta que não haja nenhum tipo de influência na seleção das amostras

Tipos de Amostragem

Do ponto de vista estatístico, a amostragem probabilística é a ideal
Sempre que uma abordagem não probabilística for adotada, deve-se explicitá-la no trabalho de pesquisa



OLI/Landsat R6G5B4



Classificação



Numa análise sobre a qualidade da classificação, deve-se explicitar que as regiões marcadas como "Não Classificado" e "Não Observado" não serão consideradas na avaliação
Nesse caso, a amostragem não é tipicamente probabilística pois os pixels pertencentes a essas classes não podem ser sorteados (probabilidade nula)

Desenho amostral (*Sampling Design*)

O Desenho Amostral define como as amostras serão coletadas.

A escolha da melhor estratégia dependerá:

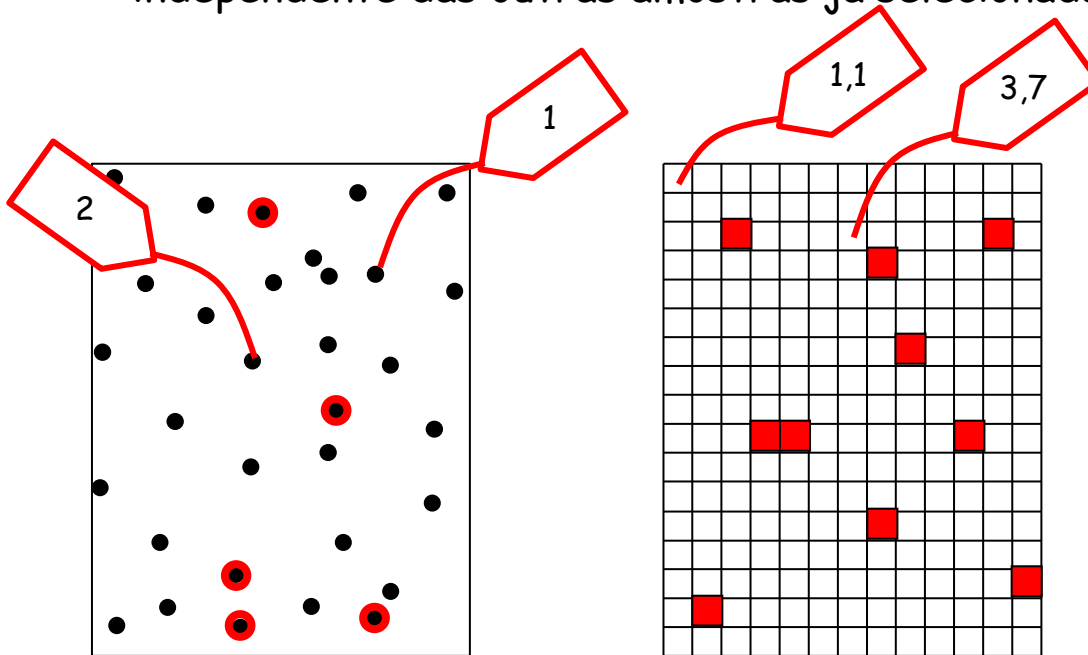
- da facilidade e praticidade de implementação
- dos custos para obtenção das amostras
- da heterogeneidade espacial dos dados (distribuição espacial)

Decisões chaves:

- usar abordagem simples ou sistemática?
- usar ou não uma amostragem estratificada?
- seleccionar amostras isoladas ou em conglomerados (*clusters*)?

Amostragem Aleatória Simples

Nesta abordagem, a escolha de uma amostra é feita de modo totalmente independente das outras amostras já selecionadas



etapas:

- rotular cada elemento com um código único
- sortear aleatoriamente n códigos (usando-se geradores de números aleatórios)
- identificar os elementos com os códigos selecionados

OBS: método simples

rotulação dos elementos pode ser dispendiosa

pressupõe população homogênea

não garante representatividade pois alguns

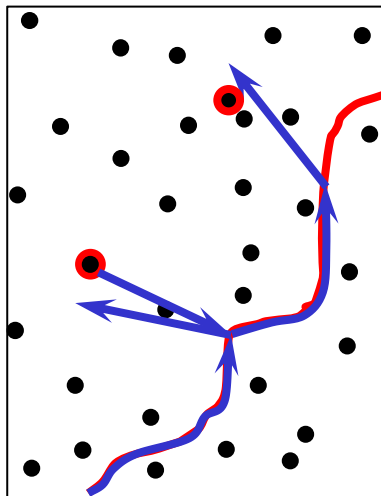
grupos (mais raros) podem não ser sorteados

Amostragem Aleatória Simples

Em trabalhos de campo, muitas vezes não é possível fazer a identificação prévia dos elementos

Nesse caso, é usual fazer a **escolha a esmo** dos elementos amostrados usando artifícios que garantam a escolha imparcial

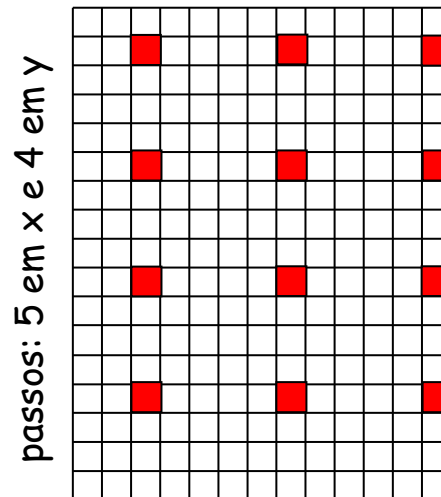
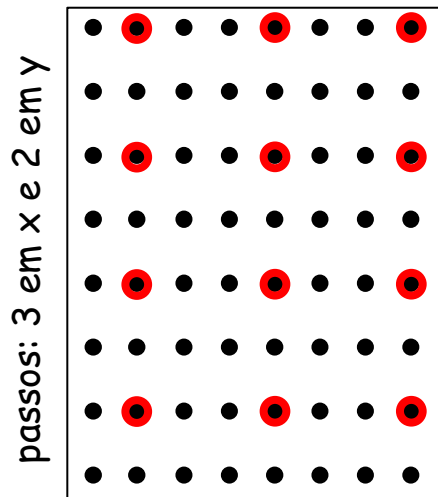
Exemplo: numa floresta, deseja-se amostrar 10 árvores



- numa trilha, caminha-se **x metros**
- caminha-se **y metros** numa determinada **direção**
- escolhe-se a árvore mais próxima
- faz-se as medições necessárias
- retorna-se ao ponto inicial
- repete-se o procedimento até selecionar-se as 10 árvores

Amostragem Sistemática

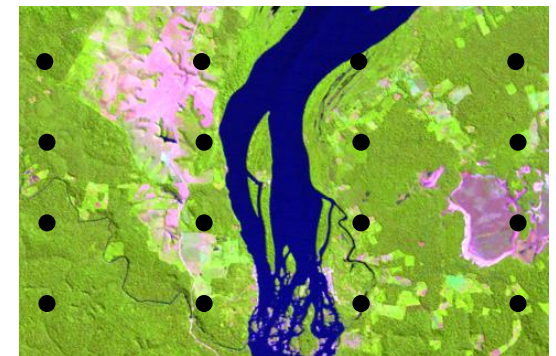
Se os elementos da população já se encontram ordenados segundo algum critério, pode-se selecionar um elemento qualquer e escolher um "passo" que definirá qual será o próximo elemento escolhido.



etapas:

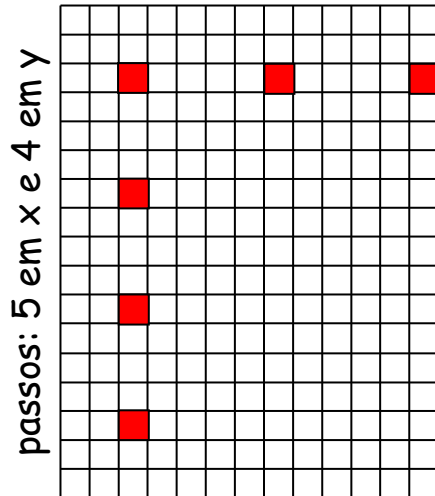
- definir o passo (ou os passos em x e em y)
- escolher aleatoriamente um elemento
- com base nesse elemento, identificar os demais elementos de acordo com o passo pré-definido

OBS: amostra-se uniformemente todo o espaço
pode-se não conseguir o valor exato de amostras pretendidas
desaconselhado para ordenações periódicas ou com feições dispostas na horizontal e/ou vertical



Amostragem Sistemática Não Alinhada

A ideia é semelhante da amostragem sistemática mas, nesse caso, tenta-se aleatorizar os passos de modo a desalinhair as amostras sorteadas.

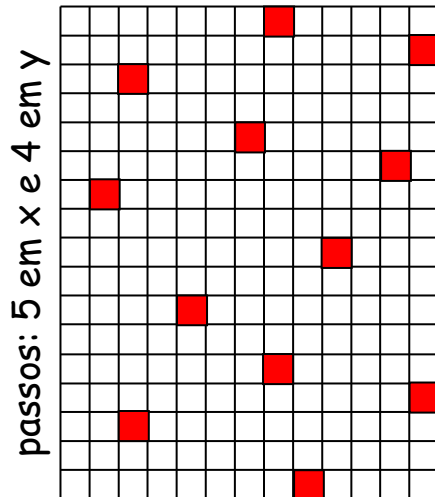


etapas:

- definir o passo (ou os passos em x e em y)
- escolher aleatoriamente um elemento
- com base nesse elemento, identificar os elementos da mesma linha e mesma coluna de acordo com o passo pré-definido

Amostragem Sistemática Não Alinhada

A ideia é semelhante da amostragem sistemática mas, nesse caso, tenta-se aleatorizar os passos de modo a desalinhar as amostras sorteadas.

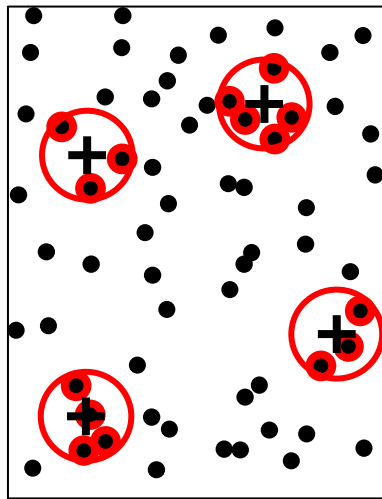


etapas:

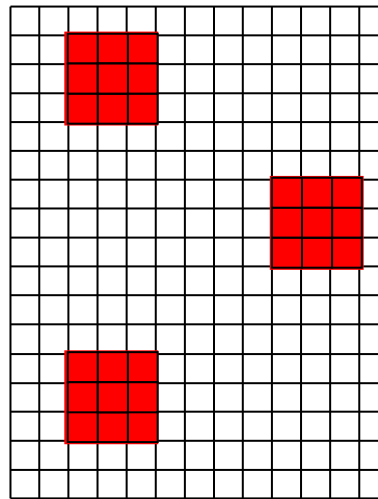
- definir o passo (ou os passos em x e em y)
- escolher aleatoriamente um elemento
- com base nesse elemento, identificar os elementos da mesma linha e mesma coluna de acordo com o passo pré-definido
- desalinhar aleatoriamente esses elementos
- utilizar esses novos posicionamentos para identificar os demais elementos

Amostragem em Conglomerados (*Cluster*)

Nesta abordagem, a amostra é formada por um grupo de elementos próximos (cluster)



raio r



janela 3x3

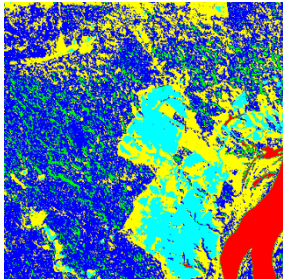
etapas:

- definir critério de proximidade (raio ou janela)
- sortear aleatoriamente n posições
- identificar os elementos que atendam o critério de proximidade

OBS: simplifica a coleta de dados das amostras
cada elemento do conglomerado constitui uma unidade amostral
diminui os custos da amostragem
pode reduzir a precisão na estimação devido a autocorrelação espacial

Amostragem Estratificada

A estratificação é a divisão da área de estudo em regiões segundo algum critério (mapas pré-existentes ou regiões geográficas)



Mas para que estratificar?

- os estratos representam regiões de interesse no estudo
p.ex., estimar a área desmatada por Estado ou município
- deseja-se melhorar a precisão nas estimativas obtidas em cada estrato
como quanto maior heterogeneidade, maior incerteza na estimativa. Pode-se
assim concentrar a amostragens nos estratos com maior variabilidade
- deseja-se aumentar a representatividade da amostra coletada na área de estudo
estratos raros podem não estar representados adequadamente numa
amostragem totalmente aleatória

Dentro de cada estrato, pode-se adotar a Amostragem Aleatória Simples, Sistemática ou Sistemática Não-Alinhada. Além disso, pode-se inclusive selecionar elementos em conglomerados

Tamanho de Amostra

Quanto amostrar?

depende:

da variabilidade original dos dados (maior variância \Rightarrow maior n)

da precisão requerida no trabalho (maior precisão \Rightarrow maior n)

do tempo disponível (menor o tempo \Rightarrow menor n)

do custo da amostragem (maior o custo \Rightarrow menor n)

Em geral, é calculado com base no parâmetro que se deseja estimar e leva em

consideração as **incertezas inerentes** a esta estimação:

a) variação "natural" dos dados (variância populacional)

b) erros de estimativa

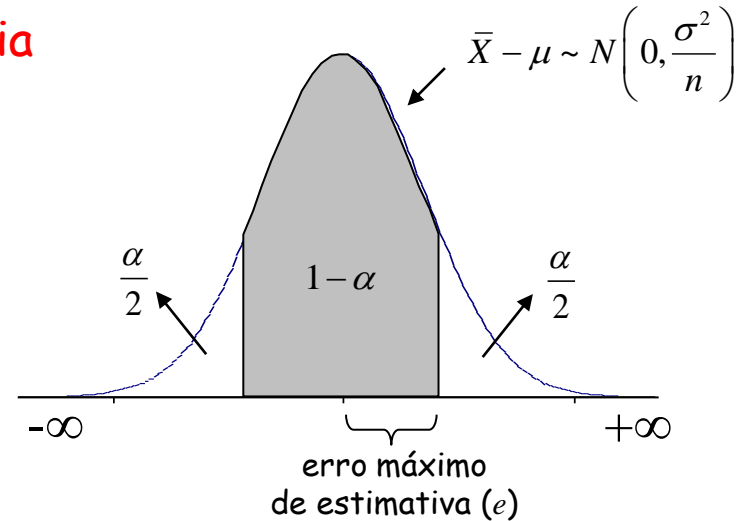
Tamanho da Amostra

$$\bar{X} - \mu \sim N\left(0, \frac{\sigma^2}{n}\right)$$

Média

$$P\left(-z_{\alpha/2} \frac{\sigma}{\sqrt{n}} < \bar{X} - \mu < z_{\alpha/2} \frac{\sigma}{\sqrt{n}}\right) = 1 - \alpha$$

$$e = z_{\alpha/2} \frac{\sigma}{\sqrt{n}} \Rightarrow n = \frac{(z_{\alpha/2})^2 \sigma^2}{e^2}$$



- A variância populacional deve ser conhecida
- Pode-se estimar a variância populacional através de uma "pré-amostragem" nesse caso, o tamanho da amostra é aquele que for viável (tempo, custo, etc) se o tamanho estimado for maior que o utilizado na pré-amostragem, complementa-se a amostragem, reestima-se a variância e recalcula-se o tamanho da amostra até atingir o tamanho ideal

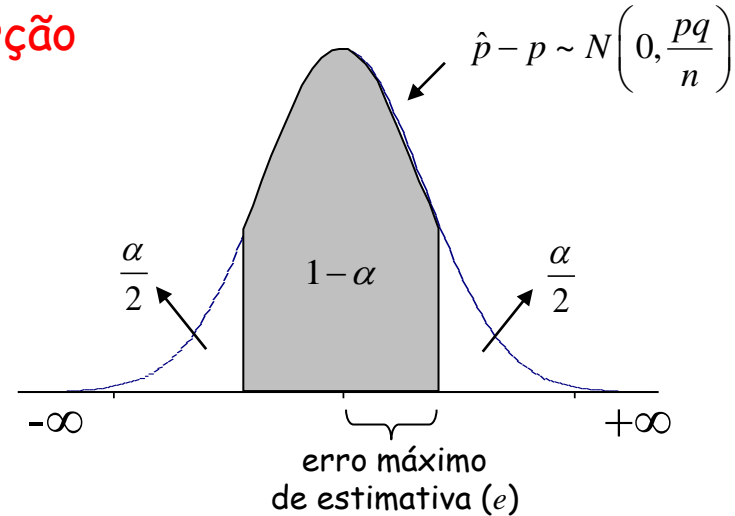
Tamanho da Amostra

Proporção

$$\hat{p} - p \sim N\left(0, \frac{pq}{n}\right)$$

$$P\left(-z_{\alpha/2} \sqrt{\frac{pq}{n}} < \hat{p} - p < z_{\alpha/2} \sqrt{\frac{pq}{n}}\right) = 1 - \alpha$$

$$e = z_{\alpha/2} \sqrt{\frac{pq}{n}} \Rightarrow n = \frac{(z_{\alpha/2})^2 pq}{e^2}$$



- Necessita-se conhecer o parâmetro p que se quer estimar!
- Pode-se estimar p através de uma "pré-amostragem"
- Pode-se adotar o valor de $p = 0,5$ que representa o "pior caso"

$$p = 0,5 \rightarrow \text{máx } \text{Var}(\hat{p}) \rightarrow \text{máx } n$$

Tamanho da Amostra

Correção para populações finitas

(quando a amostra representa mais que 5% da população)

$$n' = \frac{n}{1 + \frac{n-1}{N}}$$

n = tamanho de amostra sem correção

N = tamanho da população

n' = tamanho de amostra corrigido

Para média:
$$n' = \frac{N\sigma^2(z_{\alpha/2})^2}{(N-1)e^2 + \sigma^2(z_{\alpha/2})^2}$$

Para proporção:
$$n' = \frac{Npq(z_{\alpha/2})^2}{(N-1)e^2 + pq(z_{\alpha/2})^2}$$

Tamanho da Amostra

Exemplo: Deseja-se estimar a exatidão de um mapa de modo que o valor estimado não ultrapasse em 8% a exatidão verdadeira (para mais ou para menos), utilizando-se um nível de confiança de 95%. Suponha que a exatidão verdadeira é de 80%.

$$n = \frac{(z_{\alpha/2})^2 pq}{e^2}$$

$$n = \frac{1,96^2 0,80 0,20}{0,08^2} = 96,04 \quad n = 96$$

No pior caso (maior variância), a exatidão verdadeira seria de 50%.

$$n = \frac{1,96^2 0,50 0,50}{0,08^2} = 150,06 \quad n = 150$$

Tamanho da Amostra

Na **Amostragem Estratificada**, como distribuir as amostras em cada estrato?

Suponha que precisamos selecionar n amostras de uma população de tamanho N e que esta população está dividida em L estratos com N_1, N_2, \dots, N_L elementos.

$$n_i = \frac{n}{L}$$

todos iguais

$$n_i = n \frac{N_i}{N}$$

proporcionais a N_i

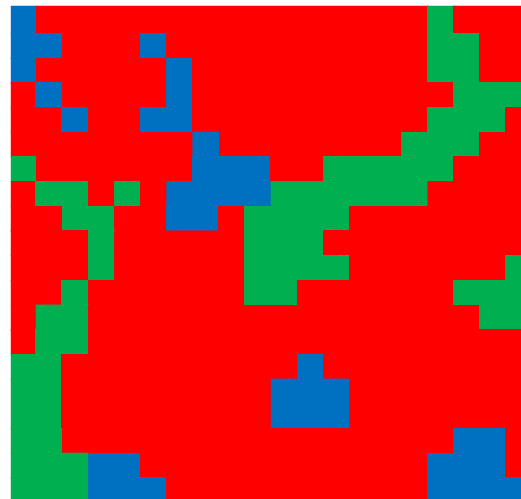
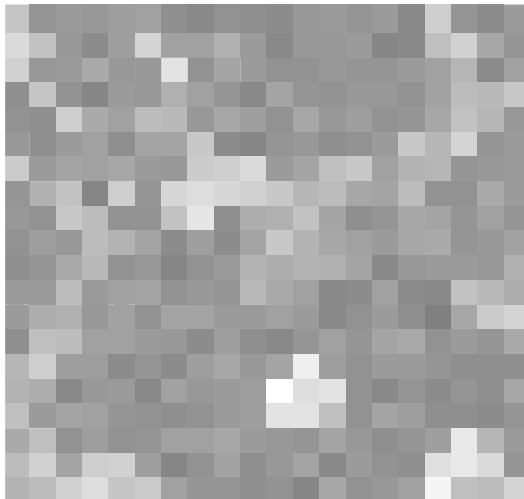
$$n_i = n \frac{N_i s_i}{\sum_{i=1}^L N_i s_i}$$

tamanho ótimo
(considera a variabilidade)

O modo como as amostras são distribuídas entre os estratos têm forte impacto na estimativa de parâmetros globais (que representam toda a população) mas permite maior controle da representatividade e precisão de cada estrato.

Qual impacto da amostragem estratificada?

Suponha que queremos determinar a média da região abaixo considerando-se que não teríamos como acessar todos os valores mas somente uma amostra. Suponha ainda que tenhamos um mapa que poderia ser utilizado para estratificar as amostras. Qual a vantagem de se dividir as amostras entre os diferentes estratos?






Aleatória Simples

X

Aleatória Estratificada

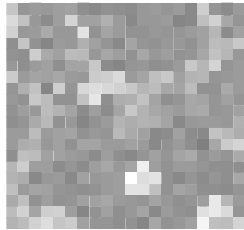
Tamanhos de amostras:

Total	11	20	50	100
	7	14	36	72
	2	4	9	18
	2	2	5	10

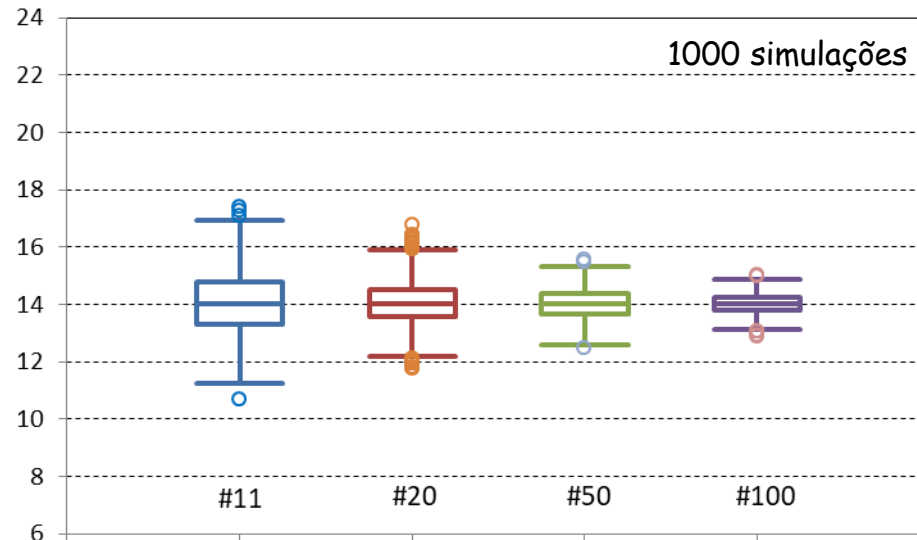
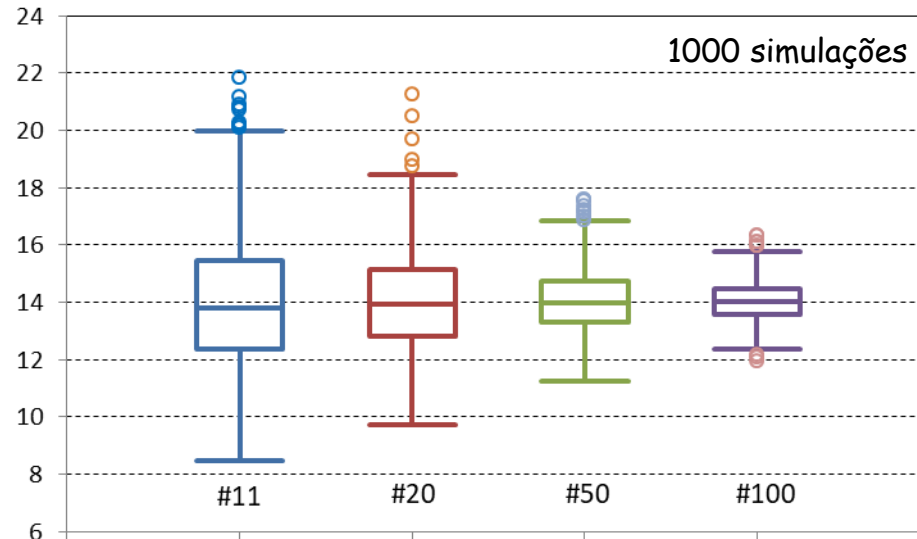
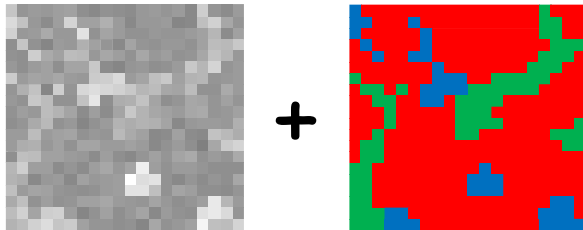
*proporcional por estrato

Qual impacto da amostragem estratificada?

Aleatória Simples



Aleatória Estratificada



Amostras de Treinamento, Validação e Teste

Numa classificação ou numa modelagem em geral, as amostras são utilizadas para estimar os parâmetros ou para criar as regras usadas pelo classificador/modelo. Como estes ajustes visam minimizar erros, a utilização desse mesmo conjunto amostral para avaliar os resultados do classificador/modelo sempre resultará numa superestimação dos índices de desempenho.

Dessa forma, é comum se reservar parte das amostras de modo a avaliar os resultados de forma independente, gerando índices de desempenho não enviesados (nesse caso, superestimados).

Usualmente, o conjunto amostral total deve ser dividido em 3 partes excludentes:

- Treinamento
- Validação
- Teste

Os termos "validação" e "teste" podem ter seu significado trocado dependendo da literatura consultada ou então constituírem um único grupo

Amostras de Treinamento, Validação e Teste

- **Treinamento** - amostras usadas na fase de aprendizagem ou treinamento do classificador e/ou modelo

Classificador Maxver Gaussiano - estimar vetor de médias e matriz de covariância

Classificador Random Forest - gerar cada árvore de decisão

Modelo de regressão - gerar estimativas dos coeficientes do modelo

- **Validação** - amostras usadas para avaliar o modelo buscando ajustar os hiperparâmetros

Classificador por regiões - definir parâmetros da segmentação

Classificador Random Forest - definir número de árvores (ntree) e/ou número de atributos utilizados em cada nó (mtry)

Modelo de Regressão - definir o tipo de relação (linear, exponencial, polinomial, etc)

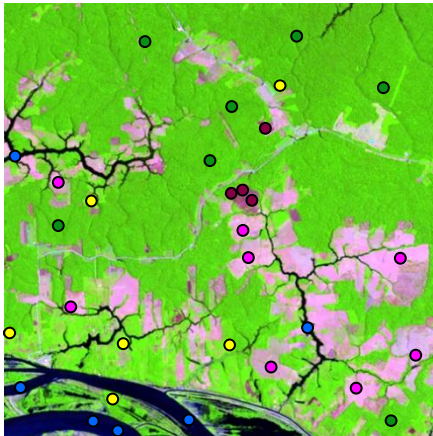
- **Teste** - amostras usadas para fazer a avaliação ou testar o desempenho final da classificação e/ou modelo

Amostras de Treinamento, Validação e Teste

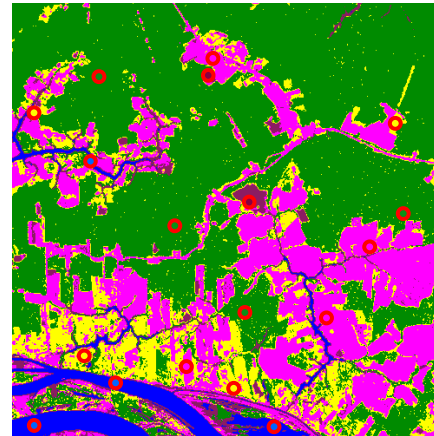
Na prática, a definição das amostras que formarão esses grupos pode ser feita a partir de um único conjunto amostral ou então podem ser coletadas em fases diferentes do processo de classificação/modelagem.

Por exemplo, se o objetivo for avaliar uma classificação única, pode-se

- dividir as amostras coletadas em treinamento e teste, ou
- usar todas as amostras para treinamento e após a obtenção da classificação final, coletar novos pontos que serão avaliados por terceiros de forma totalmente independente.



○ treinamento



○ teste