Institución Universitaria
Acreditada en Alta Calidad

Innovación Tecnológica con
Sentido Humano

Teoría de Probabilidad

Cristian Guarnizo-Lemus
cristianguarnizo@itm.edu.co

Maestria en Automatización y Control Industrial

Contenido

Definición

- Una variable aleatoria es una función cuyo dominio es el conjunto de salidas $\lambda \in S$, y cuyo rango es la recta real $\mathbb{R}$.
- Para cada salida $\lambda \in S$, la variable aleatoria asigna un número, $X(\lambda)$ tal que
  1. El conjunto $\{\lambda : X(\lambda) \leq x\}$ es un evento para todo $x \in \mathbb{R}$.
  2. Las probabilidades de los eventos $\{\lambda : X(\lambda) = -\infty\}$ y $\{\lambda : X(\lambda) = \infty\}$ es igual a cero, esto es
  $$P(X = \infty) = P(X = -\infty) = 0.$$
  3. La variable aleatoria X induce una medida de probabilidad sobre la recta real como sigue
  $$P(X = x) = P\{\lambda : X(\lambda) = x\}, P(X \leq x) = P\{\lambda : X(\lambda) \leq x\},$$
  $$P(x_1 < X \leq x_2) = P\{\lambda : x_1 < X(\lambda) \leq x_2\}.$$
  4. Para todo efecto práctico se puede asumir que una variable aleatoria es una función que mapea el espacio muestral a la recta real, $X : S \to \mathbb{R}$.

Contenido

Función de distribución

- La probabilidad $P(X \leq x)$ también se denota como $F_X(x)$, que se conoce como la función de distribución de la variable aleatoria X.
- La función de distribución tiene las siguientes propiedades
  1. $F_X(x = -\infty) = 0$.
  2. $F_X(x = \infty) = 1$.
  3. $F_X(x_1) \leq F_X(x_2)$ si $x_1 < x_2$.
  4. $P(x_1 < X \leq x_2) = F_X(x_2) - F_X(x_1)$.

Función de distribución conjunta

- La probabilidad $P(A \cap B)$ se definió anteriormente como la probabilidad de ocurrencia conjunta de los dos eventos A y B.
- Si el evento A es el evento $(X \leq x)$ y el evento B es el evento $(Y \leq y)$, la probabilidad conjunta se conoce como la *función de distribución conjunta* de las variables aleatorias X y Y,

$$F_{X,Y}(x,y) = P\left[(X \leq x) \cap (Y \leq y)\right].$$

- A partir de esta definición se derivan los siguientes resultados

$$F_{X,Y}(-\infty,-\infty) = 0, \quad F_{X,Y}(-\infty,y) = 0, \quad F_{X,Y}(\infty,y) = F_Y(y)$$
$$F_{X,Y}(x,-\infty) = 0, \quad F_{X,Y}(\infty,\infty) = 1, \quad F_{X,Y}(x,\infty) = F_X(x).$$

Contenido

Variables aleatorias discretas y continuas

- Una variable aleatoria puede ser discreta o continua.
- Una *variable aleatoria discreta* toma valores de un número contable de valores diferentes.
- Ejemplos incluyen el número de llamadas telefónicas que recibe una oficina en un intervalo finito de tiempo ó el puntaje de un estudiante en un examen.
- Una *variable aleatoria continua* puede asumir cualquier valor dentro de uno o más intervalos de la recta real.
- El tiempo exacto en que se escribe una llamada telefónica es un ejemplo de una variable aleatoria continua.

Contenido

Función de probabilidad de masa

- Una variable aleatoria discreta está caracterizada por un conjunto permitido de valores $x_1, x_2, \ldots, x_n$ junto con las probabilidades que la variable aleatoria tome esos valores.
- La probabilidad de $X = x_i$ se denota como $P(X = x_i)$ para $i = 1, \ldots, n$, y se conoce como la *función de probabilidad de masa*.

Propiedades de la función de probabilidad de masa

Las siguientes son algunas propiedades de la función de probabilidad de masa

1. $P(X = x_i) \geq 0, \ i = 1, \ldots, n.$
2. $\sum_{i=1}^{n} P(X = x_i) = 1.$
3. $P(X \leq x) = F_X(x) = \sum_{\forall x_j \leq x} P(X = x_i).$
4. $P(X = x_i) = \lim_{\substack{\epsilon \to 0 \\ \epsilon > 0}} [F_X(x_i) - F_x(x_i - \epsilon)]$

Propiedades de la función de probabilidad de masa

Ejemplo: Sea el experimento que consiste en lanzar dos monedas justas, y sea X el número de caras obtenidas. Entonces la función de probabilidad de masa (PMF) es

$$P(X = x_i) = \begin{cases} 1/4 & \text{if } x = 0 \text{ o } x = 2 \\ 1/2 & \text{if } x = 1 \\ 0 & \text{de otro modo} \end{cases}$$

Cual es la probabilidad que al menos una sea cara?

Dos variables aleatorias

- Considérese dos variables aleatorias X y Y que toman valores $x_1, x_2, \ldots, x_n$ y $y_1, y_2, \ldots, y_m$.

- Estas dos variables aleatorias pueden caracterizarse por una función de masa de probabilidad conjunta $P(X = x_i, Y = y_j)$ que da la probabilidad que $X = x_i$ y $Y = y_j$.

Funciones de masa de prob. conj., marg. y cond.

- **Conjunta**

$$P(X \leq x, Y \leq y) = \sum_{x_i \leq x} \sum_{y_j \leq y} P(X = x_i, Y = y_j).$$

- **Marginal**

$$P(X = x_i) = \sum_{j=1}^{m} P(X = x_i, Y = y_j).$$

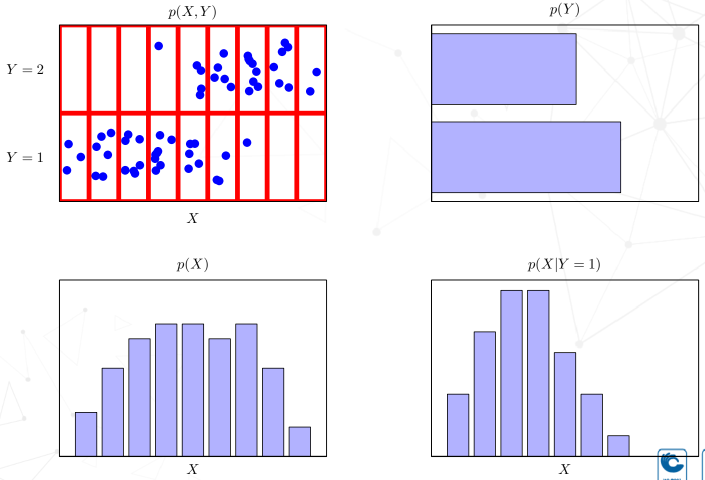
- **Condicional**

$$P(X = x_i | Y = y_j) = \frac{P(X = x_i, Y = y_j)}{P(Y = y_j)}, \text{ con } P(Y = y_j) \neq 0.$$

- **Teorema de Bayes**

$$P(X = x_i | Y = y_j) = \frac{P(Y = y_j | X = x_i) P(X = x_i)}{\sum_{i=1}^{n} P(Y = y_j | X = x_i) P(X = x_i)}.$$

Ejemplo de dos Variables Discretas



Independencia estadística

Dos variables aleatorias discretas son *independientes estadísticamente* si

$$P(X = x_i, Y = y_j) = P(X = x_i)P(Y = y_j), \; i = 1, \dots, n. \; j = 1, \dots, m.$$

Contenido

Uniforme y Bernoulli

- **Función probabilidad de masa uniforme.** Se dice que una variable aleatoria X sigue una función de probabilidad de masa uniforme cuando

$$P(X = x_i) = \frac{1}{n}, \quad i = 1, 2, 3, \ldots, n.$$

- **Función de probabilidad de masa para Bernoulli.**
  - Se emplea para modelar variables aleatorias binarias $X = \{0, 1\}$.
  - La función de probabilidad de masa esta dada como

$$P(X = 1) = p, \quad P(X = 0) = 1 - p.$$

Binomial

- **Función de probabilidad de masa binomial.**
  - Sea ρ la probabilidad de que un evento A ocurra, a partir de un experimento aleatorio E.
  - Si el experimento se repite n veces y las n salidas son independientes, sea X la variable aleatoria que representa el número de veces que A ocurre en las n repeticiones.
  - La probabilidad de que el evento A ocurra k veces está dada por la función de probabilidad de masa

$$P(X = k) = \binom{n}{k} \rho^k (1 - \rho)^{n-k}, \quad k = 0, 1, 2, \ldots, n.$$

donde $\binom{n}{k} = \frac{n!}{k!(n-k)!}$.

Poisson

- Sea emplea para modelar eventos como el número de llamadas telefónicas recibidas por una oficina y el número de electrones que emite un cátodo encandilado.
- El número de eventos en un intervalo de tiempo de longitud T sigue una función de probabilidad de masa de Poisson de la forma

$$P(X = k) = \frac{\lambda^k}{k!} e^{-\lambda},$$

donde $\lambda = \lambda' T$.

Multinomial

- Suponga un experimento aleatorio que se repite n veces.
- La salida de cada repetición del experimento corresponde a uno de k posibles eventos $A_1, A_2, \ldots, A_k$, mutuamente excluyentes y exhaustivos.
- Sea p_i la probabilidad de que la salida del experimento sea A_i.
- Asumamos que p_i permanece constante a lo largo de las n repeticiones.
- Sea X_i la variable aleatoria que indica el número de veces que el experimento termina en el evento A_i. Luego,

$$P(X_1 = x_1, X_2 = x_2, \ldots, X_k = x_k) = \frac{n!}{x_1!x_2!\ldots x_k!} p_1^{x_1} p_2^{x_2} \ldots p_k^{x_k},$$

donde $\sum x_i = n$, $\sum p_i = 1$ y cada x_i puede tomar cualquier valor entero entre 0 y n.

Contenido

Preliminares

- La descripción más detallada posible de una variable aleatoria está dada por su función de masa de probabilidad.

- En algunas ocasiones es mejor describir la variable aleatoria usando un conjunto de números característicos o de medidas, que son representativos de la función de masa de probabilidad.

- Esto números se conocen como *valores esperados* o *promedios estadísticos*.

Valor esperado y primeros momentos estadísticos

- El valor esperado o promedio de una función $g(X)$ de una variable aleatoria discreta X está definida como

$$E\{g(X)\} = \sum_{i=1}^{n} g(x_i)P(X = x_i).$$

- Dos valores esperados o momentos de la variable aleatoria X, que se usan con frecuencia en la práctica son su media μ_X y su varianza σ_X^2,

$$E\{X\} = \mu_X = \sum_{i=1}^{n} x_i P(X = x_i),$$

$$E\left\{(X - \mu_X)^2\right\} = \sigma_X^2 = \sum_{i=1}^{n} (x_i - \mu_X)^2 P(X = x_i).$$

- La raíz cuadrada de la varianza se conoce como la *desviación estándar*.

Valor esperado y primeros momentos estadísticos

- Ejemplo: Considere la función de masa de probabilidad de masa que se obtiene al lanzar dos monedas, donde en cada lanzamiento la probabilidad de obtener cara es 3/4:

$$P(X=k)=\begin{cases}(1/4)^2 & \text{if } k=0\\ 2\cdot(1/4)\cdot(3/4) & \text{if } k=1\\ (3/4)^2 & \text{if } k=2\end{cases}$$

  Calcular la media de la v.a. / Res: $3/2$.

- Ejercicio: calcular la varianza.

- Ejemplo: Sea X una variable aleatoria y sea

$$Y = aX + b,$$

donde a y b son escalares conocidos. Entonces

$$E[Y] = aE[X] + b, \quad \mathrm{var}(Y) = a^2\,\mathrm{var}(X).$$

Valor esperado de dos variables aleatorias

- El valor esperado de una función de dos variables aleatorias se define como

$$E\{g(X,Y)\} = \sum_{i=1}^{n}\sum_{j=1}^{m} g(x_i, y_i)P(X = x_i, Y = y_j).$$

- Un valor esperado útil, que entrega una medida de la dependencia entre dos variables aleatorias X y Y es el coeficiente de correlación

$$\rho_{XY} = \frac{E\{(X-\mu_X)(Y-\mu_Y)\}}{\sigma_X\sigma_Y} = \frac{\sigma_{XY}}{\sigma_X\sigma_Y}.$$

Ortogonalidad de variables aleatorias

Se dice que dos variables aleatorias X y Y son ortogonales si

$$E\{XY\} = 0.$$

Valores esperados condicionales

- Las relaciones entre dos variables aleatorias se describen algunas veces a través de valores esperados condicionales.
- Los valores esperados condicionales se definen como

$$E\{g(X,Y)|Y=y_j\} = \sum_{i=1}^{n} g(x_i,y_i)P(X=x_i|Y=y_j),$$

$$E\{g(X,Y)|X=x_i\} = \sum_{j=1}^{m} g(x_i,y_i)P(Y=y_i|X=x_j).$$

- **Pregunta**. Verifique que $E\{g(X,Y)\} = E_X\{E_{Y|X}[g(X,Y)|X]\}$.
- Uno de los valores esperados condicionales más importantes es la media condicional definida como

$$E\{X|Y=y_j\} = \mu_{X|Y=y_j} = \sum_{i=1}^{n} x_i P(X=x_i|Y=y_j).$$

Contenido

Funciones de densidad de probabilidad

- Como se mencó anteriormente, una *variable aleatoria continua* puede tomar valores en un intervalo de la recta real.
- La ley de probabilidad para una variable aleatoria continua X se define en términos de la función de densidad de probabilidad (pdf) $f_X(x)$,

$$f_X(x) = \frac{\mathrm{d}\, F_X(x)}{\mathrm{d}\, x}.$$

Propiedades de una fdp

1. $f_X(x) \geq 0.$
2. $\int_{-\infty}^{\infty} f_X(x)\,\mathrm{d}\,x = 1.$
3. $P(X \leq a) = F_X(a) = \int_{-\infty}^{a} f_X(x)\,\mathrm{d}\,x.$
4. $P(a \leq x \leq b) = \int_{a}^{b} f_X(x)\,\mathrm{d}\,x.$

Dos variables aleatorias: pdf conjunta

- Si existen dos variables aleatorias X y Y, pueden caracterizarse con la pdf $f_{X,Y}(x, y)$.
- Si la función de distribución conjunta $F_{X,Y}(x, y)$ es continua y tiene derivadas parciales, la pdf conjunta se define como

$$f_{X,Y}(x, y) = \frac{\partial^2 F_{X,Y}(x, y)}{\partial x \partial y}.$$

- Igualmente se tien los siguientes resultados
  1. $F_{X,Y}(x, y) = \int_{-\infty}^{y} \int_{-\infty}^{x} f_{X,Y}(\alpha, \beta)\, \mathrm{d}\,\alpha\, \mathrm{d}\,\beta.$
  2. $\int_{-\infty}^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} f_{X,Y}(\alpha, \beta) = 1.$

Fdp marginal y fdp condicional

- Las funciones de densidad de probabilidad marginal están dadas como

$$f_X(x) = \int_{-\infty}^{\infty} f_{X,Y}(x,y)dy,$$

$$f_Y(y) = \int_{-\infty}^{\infty} f_{X,Y}(x,y)dx.$$

- Las funciones de densidad de probabilidad condicional se definen como

$$f_{X|Y}(x|y) \triangleq \frac{f_{X,Y}(x,y)}{f_Y(y)},$$

$$f_{Y|X}(y|x) \triangleq \frac{f_{X,Y}(x,y)}{f_X(x)}.$$

Teorema de Bayes e Independencia Estadística

- El teorema de Bayes para variables aleatorias continuas está dado como

$$f_{Y|X}(y|x) = \frac{f_{X|Y}(x|y)f_Y(y)}{\int_{-\infty}^{\infty} f_{X|Y}(x|y)f_Y(\lambda)\,\mathrm{d}\,\lambda}.$$

- Se dice que dos variables aleatorias X y Y son estadísticamente independientes si

$$f_{X,Y}(x,y) = f_X(x)f_Y(y).$$

Valores esperados

Los valores esperados de variables aleatorias continuas se definen como

$$E\{g(X,Y)\} = \int_{-\infty}^{\infty}\int_{-\infty}^{\infty} g(x,y) f_{X,Y}(x,y)\,\mathrm{d}\,x\,\mathrm{d}\,y,$$

$$\mu_x = E\{X\} = \int_{-\infty}^{\infty} x f_X(x)\,\mathrm{d}\,X,$$

$$\sigma_X^2 = E\{(X-\mu_X)^2\} = \int_{-\infty}^{\infty} (x-\mu_x)^2 f_X(x)\,\mathrm{d}\,x,$$

$$\sigma_{XY} = E\{(X-\mu_X)(Y-\mu_y)\},$$

$$\rho_{XY} = \frac{E\{(X-\mu_X)(Y-\mu_y)\}}{\sigma_X\sigma_Y},$$

$$E\{g(X,Y)|Y=y\} = \int_{-\infty}^{\infty} g(x,y) f_{X|Y}(x|y)\,\mathrm{d}\,x,$$

$$E\{g(X)h(y)\} = E\{g(X)\}E\{h(Y)\}.$$

Contenido

Fdp uniforme

Se dice que una variable aleatoria continua X sigue una función de densidad de probabilidad uniforme si

$$f_X(x) = \begin{cases} \frac{1}{b-a}, & a \leq x \leq b \\ 0, & \text{de otra manera} \end{cases}$$

Fdp Gaussiana I

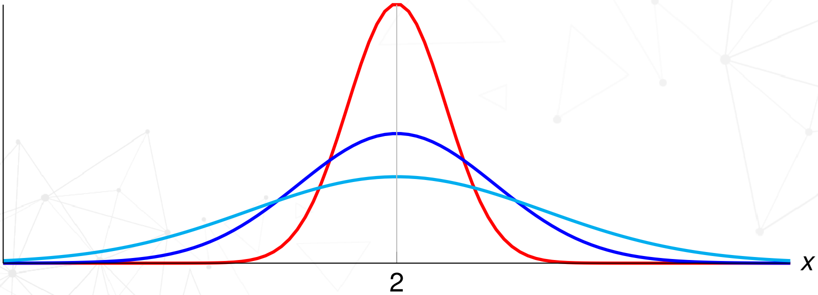
- La fdp Gaussiana está motivada en el *teorema del límite central*: una variable aleatoria determinada como la suma de un gran número de causas independientes tiende a tener una fdp Gaussiana.
- Bajo la presunción del teorema del límite central, la fdp Gaussiana se emplea para modelar el ruido eléctrico.
- La fdp Gaussiana tiene la forma

$$f_X(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma_X^2}} \exp\left\{-\frac{(x-\mu_X)^2}{2\sigma_X^2}\right\}.$$

- La familia de fdp Gaussianas está caracterizada sólo por dos parámetros μ_x y σ_X^2, que son la media y la varianza de la variable aleatoria X.
- En este curso, la fdp Gaussiana se denota como $f_X(x) = \mathcal{N}\left(x|\mu_X, \sigma_X^2\right)$ ó $X \sim \mathcal{N}(\mu_X, \sigma_X^2)$.

Fdp Gaussiana II

La media de las tres Gaussianas es $\mu_X = 2$, y las desviaciones estándar son $\sigma_X = 0.5$ (en rojo), $\sigma_X = 1$ (en azul) y $\sigma_X = 1.5$ (en cyan).



Fdp Gaussiana III

- En algunas aplicaciones resulta necesario calcular la probabilidad

$$P(X > a) = \int_{a}^{\infty} \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma_X^2}} \exp\left\{-\frac{(x-\mu_X)^2}{2\sigma_X^2}\right\} \mathrm{d}\, x.$$

- Haciendo un cambio de variable $z = (x - \mu_X)/\sigma_X$, la integral anterior se reduce a

$$P(X > a) = \int_{(a-\mu_X)/\sigma_X}^{\infty} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp\left\{-\frac{z^2}{2}\right\}.$$

Fdp Gaussiana III

- Esta integral no puede resolverse analíticamente. Se expresa en términos de la función $Q(y)$ definida como

$$Q(y) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{y}^{\infty} \exp\left\{-\frac{z^2}{2}\right\} \mathrm{d}\, z, \quad y > 0.$$

La función $Q(y)$ se puede calcular a través de la relación

$$Q(y) = \frac{1}{2} \operatorname{erfc}\left(\frac{y}{\sqrt{2}}\right),$$

donde $\operatorname{erfc}(x)$ es la función de error complementaria.

Otras funciones de densidad de probabilidad continua

- **Gamma** (prior conjugado para la varianza de una Gaussiana o la media de una Poisson).
- **Beta** (prior conjugada para los parámetros de una binomial).
- **Dirichlet** (prior conjugada para los parámetros de una multinomial).
- **Exponencial** (se usa para modelar el tiempo de espera de un próximo evento en un proceso de Poisson)
- **Weibull** (se usa para modelar tiempos de fallas en análisis de confiabilidad).

Contenido

Función de distribución de vectores aleatorios

- Un **vector aleatorio** es un vector cuyos elementos individuales son variables aleatorias.
- La ley de probabilidad para un vector de variables aleatorias se especifica en términos de función de distribución conjunta

$$F_{X_1,X_2,\ldots,X_m}(x_1, x_2, \ldots, x_m) = P[(X_1 \leq x_1), (X_2 \leq x_2), \ldots, (X_m \leq x_m)].$$

- También se puede especificar en términos de la función de probabilidad de masa (para variables discretas) o en términos de la función de densidad de probabilidad (para variables continuas).
- En lo que sigue se analiza el caso de vectores de variables aleatorias continuas.

Fdp conjunta y marginal

- La fdp conjunta de un vector aleatorio de m dimensiones es la derivada parcial de la función de distribución

$$f_{X_1,X_2,\dots,X_m} = \frac{\partial^m F_{X_1,X_2,\dots,X_m}(x_1, x_2, \dots, x_m)}{\partial x_1 \partial x_2 \dots \partial x_m}$$

- La fdp de una de las variables aleatorias X_1 , para $1 \leq i \leq m$ se obtiene integrando con respecto a todas las otras variables aleatorias $X_j \neq X_i$. Por ejemplo, para X_1

$$f_{X_1}(x_1) = \int_{-\infty}^{\infty} \dots \int_{-\infty}^{\infty} f_{X_1,\dots,X_m}(x_1, \dots, x_m)\, \mathrm{d}\, x_2 \dots \mathrm{d}\, x_m$$

- Si se quiere la fdp conjunta de (X_i, X_j), se marginaliza integrando con respecto a X_k para $k \neq i$ y $k \neq j$. Por ejemplo, la fdp conjunta (X_1, X_2)

$$f_{X_1,X_2}(x_1, x_2) = \int_{-\infty}^{\infty} \dots \int_{-\infty}^{\infty} f_{X_1,\dots,X_m}(x_1, \dots, x_m)\, \mathrm{d}\, x_3 \dots \mathrm{d}\, x_m.$$

Fdp condicional

- La fdp condicional de un subconjunto de variables aleatorias del vector aleatorio dado otro subconjunto de variables del mismo vector.
- Ejemplos de fdp condicionales son

$$f_{X_1,X_2,X_3|X_4}(x_1,x_2,x_3|x_4) = \frac{f_{X_1,X_2,X_3,X_4}(x_1,x_2,x_3,x_4)}{f_{X_4}(x_4)}$$

$$f_{X_1,X_2|X_3,X_4}(x_1,x_2|x_3,x_4) = \frac{f_{X_1,X_2,X_3,X_4}(x_1,x_2,x_3,x_4)}{f_{X_3,X_4}(x_3,x_4)}$$

Valores esperados

- Los valores esperados se calculan usando múltiples integrales.
- Por ejemplo,

$$E\{g(x_1,\dots,x_m)\} = \int_{-\infty}^{\infty} \dots \int_{-\infty}^{\infty} g(x_1,\dots,x_m) f_{X_1,\dots,X_m}(x_1,\dots,x_m)\,\mathrm{d}\,x_1 \dots \mathrm{d}\,x_m.$$

- Igualmente, los valores esperados condicionales se calculan usando funciones de densidad de probabilidad condicionales.

Medias y covarianzas

- Dos momentos estadísticos de importancia en vectores aleatorios son las medias y las covarianzas.
- La media está dada como

$$\mu_{X_i} = E\{X_i\}.$$

- Las covarianzas están dadas como

$$\sigma_{X_iX_j} = E\{X_iX_j\} - \mu_{X_i}\mu_{X_j}.$$

Notación

- La ley de probabilidad para vectores aleatorios puede especificarse de manera concisa usando notación vectorial.
- Supóngase un conjunto de m variables aleatorias $X_1, X_2, \ldots, X_m$.
- Estas variables aleatorias pueden representarse como un vector columna de dimensiones $m \times 1$,

$$\mathbf{X} = \begin{bmatrix} X_1 \\ X_2 \\ \vdots \\ X_m \end{bmatrix}$$

- Un valor específico de $\mathbf{X}$ se denota como $\mathbf{x}^\top = (x_1, x_2, \ldots, x_m)$.

Fdp con notación vectorial

- Con notación vectorial, la probabilidad conjunta está dada como

$$f_{\mathbf{X}}(\mathbf{x}) = f_{X_1,\ldots,X_m}(x_1,\ldots,x_m).$$

- El vector de medias se define como

$$\mu_{\mathbf{X}} = E\{\mathbf{X}\} = \begin{bmatrix} E\{X_1\} \\ E\{X_2\} \\ \vdots \\ E\{X_m\} \end{bmatrix}$$

- La matriz de covarianza está definida como

$$\Sigma_{\mathbf{X}} = E\{\mathbf{X}\mathbf{X}^\top\} = \begin{bmatrix} \sigma_{X_1X_1} & \sigma_{X_1X_2} & \cdots & \sigma_{X_1X_m} \\ \sigma_{X_2X_1} & \sigma_{X_2X_2} & \cdots & \sigma_{X_2X_m} \\ \vdots & \cdots & \cdots & \vdots \\ \sigma_{X_mX_1} & \sigma_{X_mX_2} & \cdots & \sigma_{X_mX_m} \end{bmatrix}$$

Correlación e Independencia

- Se dice que dos componentes del vector aleatorio no están correlacionadas si $\sigma_{X_i X_j} = \sigma_{ij} = 0$.
- Se dice que los componentes del vector aleatorio son independientes si

$$f_{\mathbf{X}}(\mathbf{x}) = \prod_{i=1}^{m} f_{X_i}(x_i)$$

- Otra notación para la fdp de un vector aleatorio es $p(\mathbf{x})$.

Contenido

Fdp Gaussiana multivariada

Se dice que un vector aleatorio X es Gaussiano multivariado si su fdp sigue la forma

$$f_{\mathbf{X}}(\mathbf{x}) = \frac{1}{(2\pi)^{m/2}|\Sigma_{\mathbf{X}}|^{1/2}} \exp\left[-\frac{1}{2}(\mathbf{x}-\mu_{\mathbf{x}})^{\top}\Sigma_{\mathbf{X}}^{-1}(\mathbf{x}-\mu_{\mathbf{x}})\right]$$

donde $\mu_{\mathbf{X}}$ es el vector de medias, $\Sigma_{\mathbf{X}}$ es la matriz de covarianza, $|\Sigma_{\mathbf{X}}|$ es el determinante de $\Sigma_{\mathbf{X}}$ y $\Sigma_{\mathbf{X}}^{-1}$ es la matriz inversa de $\Sigma_{\mathbf{X}}$.
Una notación alternativa para la fdp Gaussiana multivariada es la siguiente,

$$p(\mathbf{x}) = \mathcal{N}\left(\mathbf{x}|\mu_{\mathbf{x}}, \Sigma_{\mathbf{X}}\right).$$

Fdp Gaussiana multivariada II

Suponga que $\mathbf{X}$ es un vector aleatorio que sigue una fdp Gaussiana. Si se particiona el vector de variables aleatorias $\mathbf{X}$ de la siguiente forma

$$\mathbf{X} = \begin{bmatrix} \mathbf{X}_1 \\ \mathbf{X}_2 \end{bmatrix}, \quad \mathbf{X}_1 = \begin{bmatrix} X_1 \\ X_2 \\ \vdots \\ X_k \end{bmatrix}, \quad \mathbf{X}_2 = \begin{bmatrix} X_{k+1} \\ X_{k+2} \\ \vdots \\ X_m \end{bmatrix}$$

y

$$\mu_{\mathbf{X}} = \begin{bmatrix} \mu_{\mathbf{X}_1} \\ \mu_{\mathbf{X}_2} \end{bmatrix}, \Sigma_{\mathbf{X}} = \begin{bmatrix} \Sigma_{11} & \Sigma_{12} \\ \Sigma_{21} & \Sigma_{22} \end{bmatrix},$$

donde $\mu_{\mathbf{X}_i} = E\{\mathbf{X}_i\}$ y $\Sigma_{ij} = E\{\mathbf{X}_i\mathbf{X}_j^\top\} - \mu_{\mathbf{X}_i}\mu_{\mathbf{X}_j}$, luego $\mathbf{X}_1$ sigue una fdp Gaussiana multivariada de k dimensiones con media $\mu_{\mathbf{X}_1}$ y la matriz de covarianza Σ_{11}.

Fdp Gaussiana multivariada III

- Si $\Sigma_{\mathbf{X}}$ es una matriz diagonal, esto es,

$$\Sigma_{\mathbf{X}} = \begin{bmatrix} \sigma_1^2 & 0 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & \sigma_2^2 & 0 & \dots & 0 \\ \vdots & & \vdots & & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & \dots & \sigma_m^2 \end{bmatrix},$$

  luego las componentes de $\mathbf{X}$ son independientes (en el caso Gaussiano, la no correlación implica independencia, lo cual no es necesariamente cierto para otras fdps).
- Si $A \in \mathbb{R}^{k\times m}$ es una matriz de rango k, luego $\mathbf{Y} = \mathbf{AX}$ sigue una fdp Gaussiana de dimensión k con momentos

$$\mu_{\mathbf{Y}} = \mathbf{A}\mu_{\mathbf{X}},$$
$$\Sigma_{\mathbf{Y}} = \mathbf{A}\Sigma_{\mathbf{X}}\mathbf{A}^\top.$$

Fdp Gaussiana multivariada IV

- Empleando la partición del vector $\mathbf{X}$ como se vió anteriormente, la fdp condicional de $\mathbf{X}_1$ dado $\mathbf{X}_2 = \mathbf{x}_2$ es una Gaussiana multivariada con los siguientes momentos

$$\mu_{\mathbf{x}_1|\mathbf{x}_2} = E\{\mathbf{X}_1|\mathbf{X}_2 = \mathbf{x}_2\} = \mu_{\mathbf{x}_1} + \Sigma_{12}\Sigma_{22}^{-1}(\mathbf{x}_2 - \mu_{\mathbf{x}_2}),$$

$$\Sigma_{\mathbf{x}_1|\mathbf{x}_2} = \Sigma_{11} - \Sigma_{12}\Sigma_{22}^{-1}\Sigma_{21}.$$

- Las propiedades anteriores indican que la fdp condicional, la fdp marginal y las transformaciones lineales derivadas de una fdp Gaussiana multivariada conducen a fdp Gaussianas multivariadas.

Referencias

- Basado en las presentaciones del Prof. Mauricio A. Álvarez, del curso “Procesos Estocásticos”.
- S. Shamugan. “ Random Signals: Detection, Estimation and Data Analysis”, 1988.