Guía de ejercicios

1 Guía 1

1. (a) ¿Cuál es la probabilidad de obtener exactamente 3 cecas en 10 tiradas de una moneda balanceada?

   (b) ¿Cuál es la probabilidad de obtener al menos 3 cecas en 10 tiradas de una moneda cargada donde la probabilidad de ceca es 0.4?

   (c) Una moneda cargada con probabilidad de ceca 0.4 es arrojada al aire. El resultado es cara. ¿Cuál es la probabilidad de obtener al menos 3 cecas en las próximas 10 tiradas?

   (d) Simular los items anteriores en Octave usando: i) una distribución uniforme con la función `rand` para simular el proceso Bernoulli; ii) las funciones `binopdf,binocdf` para calcular la probabilidad binomial (Octave statistics package).

2. En una competencia se tienen 3 puertas de las cuales se debe elegir una. Dos puertas tienen la foto de un chancho y la tercera tiene la foto de un automóvil. Si el participante acierta la puerta del automóvil, lo gana. En caso contrario, no gana nada. Una vez que el participante elige una puerta, aún con todas las puerta cerradas, el organizador de la competencia - que sabe en qué puerta se encuentra la foto del automóvil - abre una de las tres puertas que tiene la foto de un chancho. ¿Qué le conviene hacer al participante, cambiar su elección o no? Justificar usando probabilidad a priori y probabilidad condicional.

3. Sean X, Y dos v.a. i.i.d. $U[0, 1]$. Encontrar la expresión de la función de densidad de probabilidad conjunta.

   (a) ¿Cuál es la probabilidad de que $X > 0.7$ y $Y < 0.4$ simultáneamente?

   (b) ¿Cuál es el percentil 40 de X, i.e. x_{40} ?

   (c) Simular en Octave escribiendo la pdf conjunta o usando funciones de Octave `rand,unifpdf,unifcdf`

   (d) Graficar la cdf en función de x, y

4. SeanX, Y dos v.a. i.i.d. $\mathcal{N}(0,1)$. Encontrar la expresión de la función de densidad de probabilidad conjunta.
   (a) ¿Cuál es la probabilidad de que $X > 0.7$ y $Y < 0.4$ simultáneamente?
   (b) Simular en Octave escribiendo la pdf conjunta o usando funciones de Octave `mvnrnd,mvnpdf,mvncdf`
   (c) Graficar la cdf en función de x, y

2 Guía 2

Para todos los ejercicios de esta guía, simular las transformaciones y verificar los resultados obtenidos.

2.1 Método de la transformada inversa

1. Sea F una función de distribución de la forma:
$$F(x) = 1 - e^{-\sqrt{t/60}}\mathbf{I}\{t > 0\}$$
   Hallar una función h tal que
$$X = h(U) \sim F, \text{ con } U \sim \mathcal{U}(0,1)$$

2. Se arroja un dado equilibrado dos veces, sean X e Y los resultados de cada tiro, respectivamente. Hallar la función de probabilidad de $W = X + Y$. Sugerencia: hacer una tabla con los valores posibles de X e Y analizar que ocurre con W en cada caso.

2.2 Transformación de variables

1. Sea $X \sim \mathcal{N}(0,1)$. Hallar la función de densidad de $Y = X^2$. Identificar a que variable corresponde (nos va a ser de mucha utilidad en algunas clases!).
2. Sean $X_1, \ldots X_n$ variables aleatorias i.i.d (independientes e idénticamente distribuidas) con distribución exponencial de parámetro λ. Hallar la distribución de $Y = \min(X_1, \ldots, X_n)$. *Sugerencia: usar el método de sucesos equivalentes y pensar qué significa que* $\min(X_1, \ldots X_n) > y$.
3. Sean X e Y dos variables aleatorias independientes con distribución exponencial de parámetro λ. Hallar la función de densidad conjunta de $V = X + Y$ y $W = X/Y$. ¿Qué puede decir al respecto?
4. (Extra) Sean X e Y dos variables independientes, cada una con distribución uniforme en el intervalo (0,1). Hallar la función de densidad conjunta de $U = \min(X, Y)$ y $V = \max(X, Y)$. *Sugerencia: este ejercicio se puede encarar por el método de sucesos equivalentes o por el método del Jacobiano generalizado.

5. (Extra) Sean $X \sim \mathcal{P}(\lambda)$ y $Y \sim \mathcal{P}(\mu)$ dos variables aleatorias independientes con distribución de Poisson. Probar utilizando la función generadora de momentos que $W = X + Y \sim \mathcal{P}(\lambda + \mu)$

3 Guía 3

3.1 Variables condicionadas

1. En un cierto día, una fábrica produjo 100 televisores, cada uno de los cuales está fallado con una probabilidad de 0.1. Antes de salir al mercado, cada televisor es sometido a ciertas pruebas, de forma tal que si estaba fallado, la falla se detecta con probabilidad 0.8. Sean X la cantidad de televisores fallados e Y la cantidad de televisores con fallas detectadas. Hallar la función de probabilidad de $Y|X = x$.

2. Sean $X \sim \mathcal{P}(\lambda)$ y $Y \sim \mathcal{P}(\mu)$ dos variables independientes. Hallar la distribución de $X|(X+Y) = m$. *Sugerencia: usar el resultado del ejercicio 5. de Transformaciones de variables.*

3. Sean X e Y dos variables con función de densidad conjunta $f_{X,Y}(x, y) = \frac{5}{8\pi} e^{-\frac{25}{32}(x^2 - \frac{6}{5}xy + y^2)}$. Hallar la función de densidad condicional de Y dada $X = x$. *Sugerencia: Qué distribución (conjunta) tienen X e Y?*

4. La velocidad del viento (X) y el promedio de ozono en la atmósfera (Y), son dos variables aleatorias con función de densidad conjunta

   $f_{X,Y}(x, y) = \lambda e^{-\lambda x} \mu e^{-\mu x} y^{-(1+\mu)} I\{x > 0, y > e^{-x}\}$

   Motivación del ejercicio

5. (Mezcla) En un sistema electrónico se debe determinar si se ha enviado señal o no. Se transmite señal ($S = 1$) con probabilidad 0.6. Además, por fabricación, el medio introduce un ruido (N) con distribución normal de media nula y varianza 0.8, independiente de lo que se , de forma tal que se recibe $X = S + N$, con $S = \{0, 1\}$. Hallar la probabilidad de haber enviado una señal sabiendo que se recibió $X = 0.7532$.

3.2 Esperanza condicional

1. Calcular la recta de regresión y esperanza condicional de Y dada X, para las variables de los ejercicios 1, 2 y 3 de la guía 3.1

2. Sean X, Y dos variables aleatorias tales que $X \sim \mathcal{U}(0, 10)$, e $Y|X = x \sim \mathcal{E}\left(\frac{1}{2+3x}\right)$. Hallar la varianza de Y.

4 Guía 4

4.1 Estimador de máxima verosimilitud

1. Una moneda tiene una probabilidad de cara p, $p = \{2/5; 4/5\}$. En 10 lanzamientos de la moneda se observaron exactamente 3 caras. Estimar por máxima
   verosimilitud la probabilidad de que en otros tres lanzamientos se observe exactamente una cara.

2. Sea $\underline{X} = (X_1, \ldots, X_n)$ una muestra aleatoria de una variable X con distribución normal de media μ y varianza σ^2 desconocidas.

   (a) A partir del teorema de factorización encuentre el estadístico para $\theta = [\mu, \sigma^2]$.

   (b) Hallar el estimador de máxima verosimilitud para ambos parámetros.

   (c) Simular n realizaciones de una variable con distribución normal de media 5 y desvío 3, para $n = 10, 100, 1000, 10000$ y evaluar $\hat{\mu}$ y $\hat{\sigma}^2$. Qué puede concluir?

1. Hallar el estimador de máxima verosimilitud para la media de una variable con distribución exponencial.

4.2 Estimación de densidades

1. Cargar los datos del archivo 'winequality-red.csv'. Realizar un histograma con los datos de la columna 'density'.

2. Superponer al histograma la densidad estimada por kernel, utilizando un kernel Gaussiano.

3. Simular 1600 realizaciones de una normal. Utilizar como parámetros la media y desvío estándar muestrales de la columna 'density'. Graficar el histograma y la densidad estimada por kernel y comparar con los puntos 1 y 2. ¿Qué puede decir respecto de la variable 'density'?