ME-310 Probabilidade II

Lista 3

- 1. Seja X uma v.a. Exponencial com parâmetro λ . Calcule $E(X^2 \mid X < 2)$.
- **2.** A densidade conjunta das v.a. X e Y é dada por $f(x,y) = 2e^{-2x}/x$, se $x \ge 0$, $0 \le y \le x$ (e f(x,y) = 0, caso contrário). Calcule $\mathbb{E}(Y^3 \mid X)$.
- 3. Pedro se perdeu na mata e pode escolher uma das 3 trilhas. Se ele escolher a primeira trilha, ele vai caminhar por 2 horas e voltar ao mesmo lugar; se ele escolher a segunda, ele vai caminhar por 6 horas e sairá da mata; se ele escolher a terceira, ele vai caminhar por 4 horas, e voltar ao mesmo lugar. Seja X o tempo até Pedro sair da mata. Calcule $\mathbb{E} X$ se
- (a) Pedro sempre escolhe uma das trilhas ao acaso;
- (b) Pedro não pega o mesmo caminho errado duas vezes.
- **4.** Uma moeda viciada, com $\mathbf{P}(\text{cara}) = p$ é lançada até obter 3 caras seguidas. Calcule o número médio dos lançamentos necessários.
- 5. Suponha que X tem uma distribuição de Poisson com parâmetro λ , onde λ é uma v.a. Exponencial com parâmetro 1. Mostre que $\mathbf{P}(X=n)=(1/2)^{n+1}$.
- **6.** Numa gaveta tem 3 moedas. Seja $p_i = \mathbf{P}(\text{cara no lançamento da moeda} i)$. Suponha que $p_1 = 0.3$, $p_2 = 0.4$ e $p_3 = 0.5$. Uma moeda destas 3 é escolhida ao acaso e lançada 10 vezes. Seja N o número de caras. Calcule $\mathbf{P}(N=k)$, $k=0,\ldots,n$. Se depois de cada lançamento a moeda é colocada de volta (e para próximo lançamento escolhemos uma moeda ao acaso de novo) N terá distribuição binomial?
- 7. Sejam X e Y v.a. i.i.d. Geométricas com parâmetro p. Ache a distribuição condicional de X dado X+Y=n.

Dica:

Seja W o número de tentativas para obter r sucessos no total numa sequência de experimentos independentes com probabilidade de sucesso p em cada experimento. Então W tem distribuição binomial negativa com parâmetros r,p e

$$\mathbf{P}(W=n) = \binom{n-1}{r-1} p^r (1-p)^{n-r}, \quad n = r, r+1, \dots$$

8. Sejam X_1, X_2, \ldots v.a. independentes, com $\mathbb{E}X_i = \mu$ e $\mathrm{Var}\,X_i = \sigma^2$ para todo i. Seja $N \in \{0,1,\ldots\}$ uma v.a. independente dos X_i 's. Usando a fórmula para variância condicional, mostre que

$$\operatorname{Var}\left(\sum_{i=1}^{N} X_i\right) = \mathbb{E}N\sigma^2 + \mu^2 \operatorname{Var}N.$$

9. Mostre que

$$Cov(X, \mathbb{E}(Y \mid X)) = Cov(X, Y).$$

10. Suponha que se o pai tem altura x cm, então o filho, quando adulto, tem altura que é uma v.a. Normal com média x+1 e variância 4. Qual é a melhor estimativa para a altura do filho de um homem com altura 180 cm?

1

11. Mostre que $a = \mathbb{E}X$ minimiza $\mathbb{E}(X - a)^2$.

Probabilidade 2 - ME310 - Lista 3

September 15, 2012

Lembrando:

- 1. $\mathbf{E}(X) = \mathbf{E}(\mathbf{E}(X/T = t))$
- 2. $f_{X/Y}(x,y) = \frac{f_{X,Y}(x,y)}{f_Y(y)} = \frac{f_X(x)}{f_Y(y)} \cdot f_{Y/X}(x,y)$
- 3. Binomial Negativa: $X\sim BinNeg(r,p)$ então $P(X=n)=\left(\begin{array}{c}n-1\\r-1\end{array}\right)\cdot p^r\cdot (1-p)^{n-r},\, \forall n\geq r$
- 4. Variância em termos da Variância condicional (pg. 413 Ross) $Var(X) = \mathbf{E}(Var(X/Y)) + Var(\mathbf{E}(X/Y))$

1) Seja X uma v.a. Exponencial com parâmetro λ . Calcule $\mathbf{E}(X^2/X < 2)$.

Resp. 1)

•
$$X \sim exp(\lambda) \implies f_X(x) = \lambda \cdot e^{-\lambda \cdot x} \cdot \mathbf{I}_{\{x>0\}}$$

• Seja
$$Y = \mathbf{I}_{\{X < 2\}} \implies f_Y(y = 1) = P(X < 2) = \int_{-\infty}^2 f_X(x) dx = 1 - e^{-2 \cdot \lambda}$$

• Lembrando:
$$f_{X/Y}(x,y) = \frac{f_{X,Y}(x,y)}{f_Y(y)} = \frac{f_X(x)}{f_Y(y)} \cdot f_{Y/X}(x,y)$$

- $f_{Y/X}(x,y) = \mathbf{I}_{\{x<2\}}$
- $\begin{array}{l} \bullet \ \ \mathbf{E}(X^2/X \leq 2) \ = \ \mathbf{E}(X^2/Y = 1) \ = \ \int_{-\infty}^{\infty} x^2 \cdot f_{X/Y}(x,y) dx \ = \ \int_{-\infty}^{\infty} x^2 \cdot \\ \frac{\lambda \cdot e^{-\lambda \cdot x} \cdot \mathbf{I}_{\{x \geq 0\}} \cdot \mathbf{I}_{\{x < 2\}}}{1 e^{-2 \cdot \lambda}} dx \ = \ \frac{\lambda}{1 e^{-2 \cdot \lambda}} \int_{-\infty}^{\infty} x^2 \cdot e^{-\lambda \cdot x} \cdot \mathbf{I}_{\{x \geq 0\}} \cdot \mathbf{I}_{\{x < 2\}} dx \ = \ \frac{\lambda}{1 e^{-2 \cdot \lambda}} (-x^2 \cdot e^{-\lambda \cdot x}) \cdot \\ \frac{e^{-\lambda \cdot x}}{\lambda^2} |_{x = 0}^{x = 2} + 2 \int_{0}^{2} x \cdot e^{-\lambda \cdot x} dx \ = \ \frac{\lambda}{1 e^{-2 \cdot \lambda}} \cdot \left(-4 \cdot \frac{e^{-4 \cdot \lambda}}{\lambda} + 2(-x \cdot \frac{e^{-\lambda \cdot x}}{\lambda^2} |_{x = 0}^{x = 2} + f^2 \cdot e^{-2 \cdot \lambda}) \right) \\ \int_{0}^{2} \frac{e^{-\lambda \cdot x}}{\lambda^2} dx \ = \ \frac{\lambda}{1 e^{-2 \cdot \lambda}} \cdot \left(-4 \cdot \frac{e^{-4 \cdot \lambda}}{\lambda} 4 \cdot \frac{e^{-2 \cdot \lambda}}{\lambda^2} 2 \cdot \frac{e^{-2 \cdot \lambda}}{\lambda^3} + \frac{2}{\lambda^3} \right) \end{aligned}$
- 2) A densidade conjunta das v.a. X e Y é dada por $f(x,y)=\frac{2\cdot e^{-2x}}{x}\cdot \mathbf{I}_{\{0\leq y\leq x\}}.$ Calcule $E(Y^3/X).$

Resp. 2

•
$$f(x) = \int_{-\infty}^{\infty} f(x,y) dy = \int_{-\infty}^{\infty} \frac{2 \cdot e^{-2x}}{x} \cdot \mathbf{I}_{\{0 \le y \le x\}} dy = \frac{2 \cdot e^{-2x}}{x} \cdot \int_{-\infty}^{\infty} \mathbf{I}_{\{0 \le y \le x\}} dy = \frac{2 \cdot e^{-2x}}{x} \cdot y|_{y=0}^{y=x} = 2 \cdot e^{-2x}$$

•
$$\mathbf{E}(Y^3/X = x) = \int_{-\infty}^{\infty} y^3 \cdot f_{Y/X}(x,y) dy = \int_{-\infty}^{\infty} y^3 \cdot \frac{f(x,y)}{f_X(y)} dy = \int_{-\infty}^{\infty} y^3 \cdot \frac{2 \cdot e^{-2x}}{x} \cdot \mathbf{I}_{\{0 \le y \le x\}} \cdot \frac{1}{2e^{-2x}} dy = \int_{0}^{x} \frac{y^3}{x} dy = \frac{y^4}{4 \cdot x} \Big|_{y=0}^{y=x} = \frac{x^3}{4}$$

- 3) Pedro se perdeu na mata e pode escolher uma das 3 trilhas. Se ele escolher a primeira trilha, ele vai caminhar por 2 horas e voltar ao mesmo lugar, se ele escolher a segunda, ele vai caminhar por 6 horas e sairá da mata, se ele escolher a terceira, ele vai caminhar por 4 horas e voltar ao mesmo lugar. Seja X o tempo até Pedro sair da mata. Calcule $\mathbf{E}(X)$ se
- a) Pedro sempre escolhe uma das trilhas ao acaso.

Resp. a)

•
$$\mathbf{E}(x/T = 1) = \mathbf{E}(x) + 2$$

•
$$\mathbf{E}(x/T=2)=6$$

- $\mathbf{E}(x/T=3) = \mathbf{E}(x) + 4$
- $p(T=1) = p(T=2) = p(T=3) = \frac{1}{3}$
- $\mathbf{E}(x) = \mathbf{E}(\mathbf{E}(x/T=t)) = \sum_{t=1}^{t=3} \mathbf{E}(X/T=t) \cdot p(T=t) = \frac{1}{3} \cdot (\mathbf{E}(X/T=t) + \mathbf{E}(X/T=2) + \mathbf{E}(X/T=3)) = \frac{1}{3} \cdot (\mathbf{E}(x) + 2 + 6 + \mathbf{E}(x) + 4) \implies \mathbf{E}(x) = 12$
- b) Pedro não pega o mesmo caminho errado duas vezes.

Resp. b)

Vamos quebrar o problema em uma árvore de probabilidades

- $\mathbf{E}(X/T_1 = 2) = 6$
- $\mathbf{E}(X/T_1 = 3, T_2 = 2) = 10$
- $\mathbf{E}(X/T_1=1,T_2=2)=8$
- $\mathbf{E}(X/T_1 = 1, T_2 = 3, T_3 = 2) = 12$
- $\mathbf{E}(X/T_1 = 3, T_2 = 1, T_3 = 2) = 12$
- $\mathbf{E}(X/T_1 = 3, T_2 = 1) = \mathbf{E}(\mathbf{E}(X/T_1 = 3, T_2 = 1, T_3)) = 1 \cdot \mathbf{E}(X/T_1 = 3, T_2 = 1, T_3 = 2) = 12$
- $\mathbf{E}(X/T_1 = 1, T_2 = 3) = \mathbf{E}(\mathbf{E}(X/T_1 = 1, T_2 = 3, T_3)) = 1 \cdot \mathbf{E}(X/T_1 = 1, T_2 = 3, T_3 = 2) = 12$
- $\mathbf{E}(X/T_1=1)=\mathbf{E}(\mathbf{E}(X/T_1=1,T_2))=\frac{1}{2}\cdot(\mathbf{E}(X/T_1=1,T_2=2)+\mathbf{E}(X/T_1=1,T_2=3))=\frac{1}{2}\cdot(8+12)=10$
- $\mathbf{E}(X/T_1 = 3) = \mathbf{E}(\mathbf{E}(X/T_1 = 3, T_2)) = \frac{1}{2} \cdot (\mathbf{E}(X/T_1 = 3, T_2 = 1) + \mathbf{E}(X/T_1 = 3, T_2 = 2)) = \frac{1}{2} \cdot (12 + 10) = 11$
- $\mathbf{E}(X) = \mathbf{E}(\mathbf{E}(X/T)) = \frac{1}{3} \cdot (\mathbf{E}(X/T_1 = 1) + \mathbf{E}(X/T_1 = 2) + \mathbf{E}(X/T_1 = 3)) = \frac{1}{3} \cdot (10 + 6 + 11) = 9$
- 4) Uma moeda viciada, com P(cara) = p é lançada até obter 3 caras seguidas. Calcule o número médio dos lançamentos necessários.

Resp. 4) Seja Cara = C, Coroa = K

- P(C) = p
- $\mathbf{E}(X/L_1 = K) = \mathbf{E}(X) + 1$
- $\mathbf{E}(X/L_1 = C, L_2 = K) = \mathbf{E}(X) + 2$

- $\mathbf{E}(X/L_1 = C, L_2 = C, L_3 = C) = 3$
- $\mathbf{E}(X/L_1 = C, L_2 = C, L_3 = K) = \mathbf{E}(X) + 3$
- $\mathbf{E}(X/L_1 = C, L_2 = C) = \mathbf{E}(\mathbf{E}(X/L_1 = C, L_2 = C, L_3)) = p \cdot \mathbf{E}(X/L_1 = C, L_2 = C, L_3 = C) + (1-p) \cdot \mathbf{E}(X/L_1 = C, L_2 = C, L_3 = K) = p \cdot 3 + (1-p) \cdot (\mathbf{E}(x) + 3)$
- $\mathbf{E}(X/L_1 = C) = \mathbf{E}(\mathbf{E}(X/L_1 = C, L_2)) = p \cdot \mathbf{E}(X/L_1 = C, L_2 = C) + (1 p) \cdot \mathbf{E}(X/L_1 = C, L_2 = K) = p \cdot (p \cdot 3 + (1 p) \cdot (\mathbf{E}(X) + 3)) + (1 p) \cdot (\mathbf{E}(X) + 2)$
- $\mathbf{E}(X) = \mathbf{E}(\mathbf{E}(X/L_1)) = p \cdot \mathbf{E}(X/L_1 = C) + (1-p) \cdot \mathbf{E}(X/L_1 = K) = p \cdot (p \cdot p \cdot 3 + (1-p) \cdot (\mathbf{E}(X) + 3)) + (1-p) \cdot (\mathbf{E}(X) + 2)) + (1-p) \cdot (\mathbf{E}(X) + 1) = 3 \cdot p^2 p^3 \cdot \mathbf{E}(X) + p 2 \cdot p^2 + \mathbf{E}(X) + 1 \implies p^3 \cdot \mathbf{E}(X) = p^2 + p + 1 \implies \mathbf{E}(X) = \frac{p^2 + p + 1}{p^3}$
- 5) Suponha que X tem uma distribuição de Poisson com parâmetro λ , onde λ é uma v.a. Exponencial com parâmetro 1. Mostre que $P(X=n)=(\frac{1}{2})^{n+1}$.

Resp. 5)

- $X \sim Poisson(\lambda); \lambda \sim Exp(1)$
- $f_{\lambda}(h) = e^{-h}$
- $f_{X/\lambda}(n,h) = \frac{f_{X,\lambda}(n,h)}{f_{\lambda}(h)} \implies f_{X,\lambda}(n,h) = f_{X/\lambda}(n,h) \cdot f_{\lambda}(\lambda)$
- $f_{X/\lambda}(n,h) = P(X = n/\lambda = h) = e^{-h} \cdot \frac{h^n}{n!} \cdot \mathbf{I}_{\{y \ge 0\}}$
- $\begin{array}{l} \bullet \ P(X=n) = \mathbf{E}(P(X=n,\lambda=h)) = \int_{-\infty}^{\infty} f(n,h) dh = \int_{-\infty}^{\infty} f_{X/\lambda}(n,h) \cdot \\ f_{\lambda}(h) dh = \int_{0}^{\infty} e^{-h} \cdot \frac{h^{n}}{n!} \cdot e^{-h} dh = \frac{1}{n!} \cdot (h^{n} \cdot \frac{e^{-2h}}{-2}|_{h=0}^{h=\infty} + \int_{0}^{\infty} n \cdot \frac{e^{-2h}}{2} \cdot \\ h^{n-1} dh) \stackrel{partes,partes...nX}{=} \frac{1}{n!} \cdot \int_{0}^{\infty} n! \cdot \frac{e^{-2h}}{2^{n}} \cdot y^{0} dh = \int_{0}^{\infty} \frac{e^{-2h}}{2^{n}} dh = -\frac{e^{-2h}}{2^{n+1}}|_{h=0}^{h=\infty} = \frac{1}{2^{n+1}} \end{array}$
- 6) Numa gaveta tem 3 moedas. Seja $p_i = P(carano \, lançamento \, da \, moeda \, i)$. Suponha que $p_1 = 0.3, \, p_2 = 0.4$ e $p_3 = 0.5$. Uma moeda destas 3 é escolhida ao acaso e lançada 10 vezes. Seja N o número de caras (C).
- a) Calcule P(N = k), $k = 0, \ldots, n$.

Resp. 6)

• seja N='número de caras' e M='qual das moedas está sendo jogada (i=1,2,3)'

•
$$P(N = k/M = i) = \binom{10}{k} \cdot p_i^k \cdot (1 - p_i)^{10-k}$$

•
$$P(N=k) = \mathbf{E}(P(N=k/M)) = \frac{1}{3} \cdot \sum_{i=1}^{i=3} {10 \choose k} \cdot p_i^k \cdot (1-p_i)^{10-k}$$

- b) Se depois de cada lançamento a moeda é colocada de volta (e para próximo lançamento escolhemos uma moeda ao acaso de novo) N terá distribuição binomial?
 - Seja X_i ='i-ésimo lançamento'
 - $P(X_i = C) = \mathbf{E}(P(X_i = C/M)) = \frac{1}{3} \cdot (0.3 + 0.4 + 0.5) = 0.4$
 - Dessa forma, podemos considerar que cada lançamento é uma variável aleatória com probabilidade $p_i = 0.4$, dessa forma $N \sim Bin(10, 0.4)$
- 7) Sejam X e Y v.a. i.i.d. Geométricas com parâmetro p. Ache a distribuição condicional de X dado X+Y=n.

Dica: Seja W o número de tentativas para obter r sucessos no total numa sequência de experimentos independentes com probabilidade de sucesso p em cada experimento. Então W tem distribuição binomial negativa com parâmetros r, p e P(W=n)=

$$\binom{n-1}{r-1} \cdot p^r \cdot (1-p)^{n-r}, \ n = r, r+1, \dots$$

Resp. 7)

- A definição de uma binomial negativa: Tentativas independentes com mesma probabilidade de sucesso p. A probabilidade de acumular r acertos em n tentativas é: $P(X=n) = \binom{n-1}{r-1} \cdot p^r \cdot (1-p)^{n-r}$
- $X, Y \sim Geometrica(p)$ então $P(X = n) = P(Y = n) = (1 p)^{n-1} \cdot p$
- P(X+Y=n)=P(W=n), 'duas sequências de experimentos independentes para acumular 2 sucessos (Geométricas=chance de acertar exatamente na i-ésima jogada=1 sucesso) com exatamente n tentativas'

$$\bullet \ P(X/X+Y=n) = \frac{P(X=x,X+Y=n)}{P(X+Y=n)} = \frac{P(X=x,Y=n-x)}{P(X+Y=n)} \stackrel{indep}{=} \frac{P(X=x) \cdot P(Y=n-x)}{P(X+Y=n)} = \frac{(1-p)^{x-1} \cdot p \cdot (1-p)^{n-x-1} \cdot p}{P(W=n)} = \frac{(1-p)^{x-1} \cdot p \cdot (1-p)^{n-x-1} \cdot p}{\left(\begin{array}{c} n-1 \\ 2-1 \end{array}\right) \cdot p^2 \cdot (1-p)^{n-2}} = \frac{1}{n-1} \cdot \mathbf{I}_{\{x \in \mathbb{N}\}}$$

8) Sejam X1, X2, . . . v.a. independentes, com $\mathbf{E}(X_i) = \mu$ e $Var(X_i) = \sigma^2$ para todo i. Seja uma v.a. independente dos X_i 's. Usando a fórmula para variância condicional, mostre que: $Var(\sum_{i=1}^{i=N} X_i) = \sigma^2 \mathbf{E}(N) + \mu^2 Var(N)$

Resp. 8)

- $W = \sum_{i=1}^{i=N} X_i$
- $\mathbf{E}(X_i) = \mu$
- $Var(X_i) = \sigma^2$
- $\mathbf{E}(W/N) = \mathbf{E}(\sum_{i=1}^{i=k} X_i/N = k) = \sum_{i=1}^{i=N} \mathbf{E}(X_i) = N \cdot \mu$, pg.414 Ross
- $Var(W/N) = Var(\sum_{i=1}^{i=k} X_i/N = k) = \sum_{i=1}^{i=N} Var(X_i) = N \cdot \sigma^2$, pg.414 Ross
- $Var(W) = \mathbf{E}(Var(W/N)) + Var(\mathbf{E}(W/N)) = \mathbf{E}(N) \cdot \sigma^2 + Var(N) \cdot \mu^2$
- 9) Mostre que Cov(X, E(Y/X)) = Cov(X, Y). Resp. 9)
 - $Cov(X,Y) = \mathbf{E}((X \mathbf{E}(X)) \cdot (Y \mathbf{E}(Y)))$, pg. 385 Ross
 - $W = \mathbf{E}(Y/X)$
 - $$\begin{split} \bullet & \quad Cov(X,W) = \mathbf{E}((X-\mathbf{E}(W))\cdot (W-\mathbf{E}(W))) = \mathbf{E}(XW-X\mathbf{E}(W) \\ \mathbf{E}(X)W+\mathbf{E}(X)\mathbf{E}(W)) = \mathbf{E}(XW)-\mathbf{E}(X\mathbf{E}(W))-\mathbf{E}(\mathbf{E}(X)W)+\mathbf{E}(X)\mathbf{E}(W) = \\ \mathbf{E}(XW)-\mathbf{E}(X\mathbf{E}(W)) = \mathbf{E}(X\mathbf{E}(Y/X))-\mathbf{E}(X)\mathbf{E}(Y) = \int_{-\infty}^{\infty}x\cdot\mathbf{E}(Y/X)\cdot \\ f_X(x)dx-\mathbf{E}(X)\mathbf{E}(Y) = \int_{-\infty}^{\infty}x\cdot\int_{-\infty}^{\infty}y\cdot f_{Y/X}(x,y)dy\cdot f_X(x)dx-\mathbf{E}(X)\mathbf{E}(Y) = \\ \int_{-\infty}^{\infty}x\cdot\int_{-\infty}^{\infty}y\cdot\frac{f_{X,Y}(x,y)}{f_X(x)}dy\cdot f_X(x)dx-\mathbf{E}(X)\mathbf{E}(Y) = \int_{-\infty}^{\infty}\int_{-\infty}^{\infty}x\cdot y\cdot y\cdot \\ f_{X,Y}(x,y)dxdy-\mathbf{E}(X)\mathbf{E}(Y) = \mathbf{E}(XY)-\mathbf{E}(X)\mathbf{E}(Y) = Cov(X,Y) \end{split}$$
- 10) Suponha que se o pai tem altura x cm, então o filho, quando adulto, tem altura que é uma v.a. Normal com média x+1 e variância 4. Qual é a melhor estimativa para a altura do filho de um homem com altura 180 cm?

Resp. 10)

• $F \sim N(181, 4)$

- A melhor estimativa para o filho é $\mathbf{E}(F)=181$, outra forma de ver isso, é procurarmos pelo ponto máximo de $f_F(a)=\frac{1}{\sqrt{2\cdot\pi\sigma^2}}\cdot e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}$, ou seja, tal que $\frac{df_F(a)}{dx}=0$ e $\frac{d^2f_F(a)}{dx^2}<0$, mas $\frac{df_F(a)}{dx}=\frac{1}{\sqrt{2\cdot\pi\sigma^2}}\cdot e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}\cdot \left(-\frac{(x-\mu)}{\sigma^2}\right)=0$ $\Longrightarrow x=\mu=181$ e $\frac{d^2f_F(a)}{dx^2}=k\cdot \left(e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}\cdot \left(-\frac{(x-\mu)}{\sigma^2}\right)\cdot \left(-\frac{(x-\mu)}{\sigma^2}\right)+e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}\cdot \left(-\frac{1}{\sigma^2}\right)\right)<0$ se $x=\mu$
- 11) Mostre que $a=\mathbf{E}(X)$ minimiza $\mathbf{E}((X-a)^2)$ Resp. 11) Basta mostrar que $\frac{d\mathbf{E}((X-a)^2)}{dx}=0$ e $\frac{d^2\mathbf{E}((X-a)^2)}{dx^2}>0$ se $a=\mathbf{E}(X)$
 - Considere $\frac{d\mathbf{E}((X-a)^2)}{dx}$ mas pela propriedade linear da esperança, ao aplicar um operador linear temos $\frac{d\mathbf{E}((X-a)^2)}{dx} = \mathbf{E}(\frac{d(X-a)^2}{dx}) = \mathbf{E}(2(X-a)) = 2\mathbf{E}(X) 2\mathbf{E}(a) = 0$ se $a = \mathbf{E}(X)$ e além disso, $\frac{d^2\mathbf{E}((X-a)^2)}{dx^2} = \mathbf{E}(\frac{d^2(X-a)^2}{dx^2}) = \mathbf{E}(2X) = 2\mathbf{E}(X) > 0$ se $a = \mathbf{E}(X)$. Com isso mostramos que este é ponto de mínimo

Este solucionário foi feito para a disciplina ME310 - 2Sem 2012. Caso encontre algum erro, por favor peça alteração informando o erro em nosso grupo de discussão:

https://groups.google.com/forum/?fromgroups#!forum/me310-2s-2012

 $Bons\ estudos,$

Eric.