

Tarea 2

Miguel Torres Eric Giovanni

17 de octubre de 2018

1. Suponga que un experimento consiste en escoger un número al azar dentro del intervalo $0,1$. Para cada resultado w del experimento se expresa a este número en su expansión decimal $w = 0.a_1a_2a_3\dots$ en donde $a_i \in 0, 1, \dots, 9, i = 1, 2, \dots$. Para cada una de las siguientes variables aleatorias determine si ésta es discreta o continua y en cualquier caso el conjunto de valores que puede tomar:

a) $X(w) = a_1$

b) $Y(w) = 0,0a_1a_2a_3\dots$

2. Comprueba que las siguientes funciones son de probabilidad:

a) $f(x) = \begin{cases} \frac{x-1}{2^x} & \text{si } x = 1, 2, \dots \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$

b) $f(x) = \begin{cases} \frac{(1-p)p^{x-1}}{1-p^n} & \text{si } x = 1, \dots, n (0 < p < 1) \\ \text{constante } 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$

c) $f(x) = \begin{cases} \frac{\frac{1}{2}}{\sqrt{x}} & \text{si } 0 < x < 1 \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$

d) $f(x) = \begin{cases} \frac{3(1-|x|)^2}{2} & \text{si } -1 < x < 1 \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$

3. Determina si la función $f(x)$ puede ser una función de densidad. En caso afirmativo, encuentra el valor de la constante c .

$$f(x) = \begin{cases} c(2x - x^3) & \text{si } 0 < x < 2 \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$$

$$f(x) = \begin{cases} c(2x - x^2) & \text{si } 0 < x < 2 \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$$

4. Una moneda equilibrada se lanza repetidamente hasta obtener un mismo resultado por tercera ocasión, no necesariamente de manera consecutiva. Encuentra la función de probabilidad de la variable aleatoria que registra el número de lanzamientos necesarios hasta obtener el resultado mencionado.

$$S_x = 3, 4, 5, \mathbb{P}(\text{aguila}) = \frac{1}{2}, \mathbb{P}(\text{sol}) = \frac{1}{2}$$

$$f(x) = \begin{cases} 1 & \text{con probabilidad } \frac{1}{2} \\ 0 & \text{con probabilidad } \frac{1}{2} \end{cases}$$

Solución

$$f(x) = \left(\frac{1}{2}\right)^x \left(\frac{1}{2}\right)^{1-x} \mathbb{I}_{0,1}(x)$$

5. Muestra que la siguiente función es de probabilidad y encuentra la correspondiente función de distribución y grafica ambas funciones.

$$f(x) = \begin{cases} 4e^{-4x} & \text{si } x > 0 \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$$

6. Sea X una variable aleatoria continua con función de densidad

$$f(x) = \begin{cases} \frac{1}{x^2} & \text{si } x \geq 0 \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$$

a) Grafica $f(x)$ y comprueba que es función de densidad

b) Encuentra y grafica la función de distribución de X .

c) Encuentra y grafica la función de distribución de la variable $Y = e^{-x}$

7. Calcula la esperanza de las siguientes variables aleatorias con función de probabilidad:

$$\text{a) } f(x) = \begin{cases} \frac{2x}{n(n+1)} & \text{si } x = 1, 2, \dots, n \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$$

$$\text{b) } f(x) = \begin{cases} \frac{x}{4} e^{\frac{x}{2}} & \text{si } x > 2 \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$$

8. a) Demuestra las siguientes fórmulas

i. Sea X una variable aleatoria discreta con función de distribución $F(X)$, con esperanza finita y posibles valores dentro del conjunto $0, 1, 2, \dots$, entonces $E(X) = \sum_x 0^\infty (1 - F(x))$

ii. Sea X una variable aleatoria continua con función de distribución $F(X)$, con esperanza finita y posibles valores en el intervalo $[0, \infty)$, entonces $E(X) = \int_0^\infty (1 - F(x))$

b) Usando el ejercicio anterior, encuentra la esperanza de X cuando ésta tiene función de distribución:

$$\text{i. } F(x) = \begin{cases} 1 - \left(\frac{1}{2}\right)^k & \text{si } k \leq x < k+1; k = 1, 2, \dots \\ 0 & \text{si } x < 1 \end{cases}$$

$$\text{ii. } F(x) = \begin{cases} 1 - e^{-x} & \text{si } x > 0 \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$$

9. Demuestra o proporciona un contraejemplo:

a) Si $E(X) = 0$ entonces $X = 0$

b) Si $E(X) = E(Y)$ entonces $X = Y$

10. El ladrón de Bagdad ha sido colocado en una prisión en donde hay tres puertas. Una de las puertas conduce a un túnel que requiere de un día de travesía y que lo regresa a la misma prisión. Otra de las puertas lo conduce a otro túnel, aun más largo, que lo regresa nuevamente a la prisión, pero después de 3 días de recorrido. Finalmente, la tercera puerta lo conduce a la libertad inmediatamente. Suponga que el ladrón escoge al azar cada una de estas puertas, una por una, hasta quedar libre. Encuentre el número promedio de días que le toma al ladrón quedar en libertad.

$$\text{11. Sea } f(x) = \begin{cases} 6x(1-x) & \text{si } 0 < x < 1 \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$$

a) Calcula la media y la varianza de la variable aleatoria X con distribución $f(x)$

Solución

$$\text{Media} = E(x) = \int_0^1 x(6x - 6x^2)dx = \int_0^1 6x^2 dx - \int_0^1 6x^3 dx = \left. \frac{6x^3}{3} \right|_0^1 - \left. \frac{6x^4}{4} \right|_0^1 = 2 - \frac{3}{2} = \frac{1}{2}$$

b) Encuentra el n -ésimo momento de la variable aleatoria X con distribución $f(x)$

Solución

$$Var(x) = E(x^2) - E^2(x)$$

$$E(x^2) = \int_0^1 x^2(6x - 6x^2)dx = \int_0^1 (6x^3 - 6x^4)dx = \left(\frac{3x^4}{2} - \frac{6x^5}{5}\right)\Big|_0^1 = \frac{3}{2} - \frac{6}{5} = \frac{3}{10}$$

$$Var(x) = \frac{3}{10} - \frac{1}{4} = \frac{1}{20}$$

c) Encuentra su función generadora de momentos

Solución

$$M(t) = E(e^{tx}) = \int_0^1 e^{tx}(6x - 6x^2)dx = \int_0^1 6xe^{tx}dx - \int_0^1 6x^2e^{tx}dx = -6 \int_0^1 x^2e^{tx}dx + 6 \int_0^1 xe^{tx}dx$$

Integrando por partes, tenemos que:

$$M(t) = \frac{6(e^t(t-2)+t+2)}{t^3}$$

12. Demuestra o proporciona un contraejemplo:

a) $Var(E(X)) = E(X)$

b) $E(Var(x)) = Var(X)$

13. Encuentra la función generadora de momentos de X y, a partir de ella, calcula la media y la varianza de X

a) $f(x) = \begin{cases} \frac{1}{2^x} & \text{si } x = 1, 2, \dots \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$

b) $f(x) = \begin{cases} e^{-x} & \text{si } x > 0 \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$

14. Una póliza de seguro grupal cubre los reclamos médicos de los empleados de una pequeña empresa. El valor, V , de las reclamaciones hechas en un año se describe por $V = 100,000$ donde Y es una variable aleatoria con f.d.p $f(y) = \begin{cases} k(1-y)^4 & \text{si } 0 < y < 1 \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$ donde k es una constante. ¿Cuál es la probabilidad de que V exceda 40,000 dado que V excede 10,000?

$$k \int_0^1 (1-y)^4 = k \int_0^1 (y^4 - 4y^3 + 6y^2 - 4y + 1)dy = k \left[\frac{y^5}{5} - y^4 + 2y^3 - 2y^2 + y \right]_0^1 = k\left(\frac{1}{5} - 1 + 2 - 2 + 1\right) = k\left(\frac{1}{5}\right),$$

luego:

$$\frac{k}{5} = 1$$

$$k = 5$$

15. Una compañía de seguros asegura una gran cantidad de viviendas. Se supone que el valor asegurado X de una vivienda seleccionada al azar, tiene la siguiente f.d.p.

$$f(x) = \begin{cases} 3x^{-4} & \text{si } x > 1 \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$$

Dada que una casa seleccionada al azar está asegurada por al menos 1.5, ¿Cuál es la probabilidad de que esté asegurado por menos de 2?

Solución

$$\mathbb{P}(-1.5 \leq x < 2) = \int_{1.5}^2 3x^{-4}dx = 3\left(\frac{x^{-3}}{-3}\right)\Big|_{1.5}^2 = 3\left(\frac{37}{648}\right) = \frac{111}{648} = 0.1712$$

$$\therefore 17.12\%$$

16. La pérdida debida a un incendio en un edificio comercial está modelada por la variable aleatoria X con f.d.p.

$$f(x) = \begin{cases} 0,005(20-x) & \text{si } 0 < x < 20 \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$$

Dado que una pérdida de incendio excede de 8. ¿Cuál es la probabilidad de que exceda 16?

Solución

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(x > 8) &= \int_8^{20} (0,005)(20-x)dx = (0,005) \left(20x - \frac{x^2}{2} \right) \Big|_8^{20} = (20(20) - \frac{20^2}{2}) - (20(8) - \frac{8^2}{2}) \\ &= 0,005(200 - 128) = 0,005(72) = ,36 \\ \mathbb{P}(x > 16) &= \int_{16}^{20} (0,005)(20-x)dx = (0,005) \left(20x - \frac{x^2}{2} \right) \Big|_{16}^{20} = (20(20) - \frac{20^2}{2}) - (20(16) - \frac{16^2}{2}) \\ &= 0,04 \end{aligned}$$

17. La vida útil de un aparato tiene una distribución continua en el intervalo $(0, 40)$ con f.d.p

$$f(x) = (10+x)^{-2}$$

Calcula la probabilidad de que la vida útil del aparato sea menor a 6.

Solución

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(x < 6) &= \int_0^6 (10+x)^{-2}dx, \text{ Hagamos cambio de variable} \\ u &= 10+x, \text{ y } du = dx, \text{ entonces los limites quedan como 10 y 16, entonces} \\ \mathbb{P}(x < 6) &= \int_{10}^{16} \frac{1}{u^2} du = \left(\frac{-1}{u} \right) \Big|_{10}^{16} = \frac{3}{80} \end{aligned}$$

18. Sea X variable aleatoria con f.d.p $f(x) = \begin{cases} 1,4e^{-2x} + 0,9e^{-3x} & \text{si } x > 0 \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$: calcula $E(X)$

Solución

$$E(X) = \int_0^{\infty} x(1,4e^{-2x} + 0,9e^{-3x})dx = e^{-3x}(e^{5x}(.7x - ,35) - ,3x - ,1) \Big|_0^{\infty} = 0 - 1(1(0 - ,35) + ,1) = \frac{9}{20}$$

19. Sea X una variable aleatoria continua con f.d.p. $f(x) = \begin{cases} \frac{1}{9}x(4-x) & \text{si } 0 < x < 3 \\ 0 & \text{e.o.c} \end{cases}$: ¿Cuál es la moda de X ?

Derivamos la funcion de densidad de probabilidad, tenemos que:

$$f'(x) = \frac{4}{9} - \frac{2x}{9}, \text{ igualamos a cero para obtener el máximo}$$

$$\frac{4}{9} - \frac{2x}{9} = 0$$

$$\frac{2x}{9} = \frac{4}{9}$$

$$x = 2$$

Evaluamos antes y después en la original para ver que sea máximo.

$$f(1) = \frac{1}{9}(3) = \frac{3}{9}$$

$$f(4) = \frac{4}{9}(0) = 0$$

∴ Es máximo

20. En la siguiente tabla se muestra una distribución de probabilidad de los tamaños de reclamación para una póliza de seguros de autos.

Tamaño de la reclamación	20	30	40	50	60	70	80
Probabilidad	.15	.1	.05	.2	.1	.1	.3

¿Qué porcentaje de las reclamaciones se encuentran dentro de una desviación estándar del tamaño promedio de la reclamación?

Solución

Desviación estándar: $\sqrt{\frac{\sum (|x - \bar{x}|)}{n}}$

21. Un actuario determina que el tamaño de la reclamación para una determinada clase de accidente es una variable aleatoria X , con función generadora de momentos $M_x(t) = \frac{1}{(1-2500t)^4}$; determina la desviación estándar del tamaño de la reclamación para esta clase de accidentes.

Solución

$$M'_x(t) = \frac{-4(\frac{d}{dt}(1-2500t))}{(1-2500t)^5} = \frac{-4}{(1-2500t)^5} - 2500 \frac{d}{dt} = \frac{10000}{(1-2500t)^5}, \text{ ahora evaluemos en } t = 0$$

$$M'_x(t) = \frac{10000}{1^5} = 10000$$

Ahora calculemos el segundo momento

$$M''_x(t) = 10000 \frac{d}{dt} \left(\frac{1}{(1-2500t)^5} \right) = 10000 \left(\frac{-5 \frac{d}{dt}(1-2500t)}{(1-2500t)^6} \right) = \frac{-50000(\frac{d}{dt}(1-2500t))}{(1-2500t)^6} = \frac{125000000}{(1-2500t)^6} = 5000$$

Ahora calculemos la varianza de x :

$$Var(x) = E(x^2) - E^2(x) = 125000000 - 10000^2 = 25000000$$

Y tenemos que la desviación estándar es: $\sqrt{Var(x)} = \sqrt{25000000} = 5000$

22. La función generadora de momentos de la variable aleatoria X está dada por $M_x(t) = \frac{1}{(1+t)}$, encuentra el tercer momento de X sobre el punto $x = 2$

23. Una variable aleatoria tiene la siguiente función de distribución.

$$F(x) = \begin{cases} 0 & \text{para } x < 1 \\ \frac{x^2-2x+2}{2} & 1 \leq x < 2 \\ 1 & \text{para } x \geq 2 \end{cases}$$

Encuentra la varianza de X .

24. El monto de la pérdida X , para una póliza de seguro médico tiene una función de distribución

$$F(x) = \begin{cases} 0 & \text{para } x < 0 \\ \frac{1}{9}(2x^2 - \frac{x^3}{3}) & \text{para } 0 \leq x \leq 3 \\ 1 & \text{para } x > 3 \end{cases}$$

Calcula la moda de la distribución.

25. La variable aleatoria X tiene f.d.p. $f(x) = ce^{-|x|}$ para $-\infty < x < \infty$. Encuentra la varianza de X .