

Probabilidad y Estadística

Clase 3

Variables aleatorias condicionadas

Motivación

Cuando tenemos diferentes variables, que se encuentran vinculadas, saber qué ocurrió con una variable nos da información extra sobre las otras.

Las variables condicionadas aparecen en el corazón de ML,

- Modelos de regresión lineal/logística
- Modelos de árboles
- Modelos de grafos, que se basan en probabilidades condicionales
- Estimación paramétrica (enfoque Bayesiano)
- NLP: por ejemplo análisis de sentimientos basado en frecuencia de aparición de palabras en un texto.

Recordemos

Probabilidad condicional:

$$\mathbb{P}(A \mid B) = \frac{\mathbb{P}(A \cap B)}{\mathbb{P}(B)}$$

Variables discretas

Sean X, Y dos v.a.d.

$p_{X,Y}(x, y)$: func. de probabilidad conjunta

$p_X(x)$: func. de probabilidad marginal de X

Función de probabilidad condicional de Y dado $X = x$

$$\begin{aligned} p_{Y|X=x}(y) &= \mathbb{P}(Y = y \mid X = x) \\ &= \frac{\mathbb{P}(Y=y, X=x)}{\mathbb{P}(X=x)} \\ &= \frac{p_{X,Y}(x, y)}{p_X(x)} \end{aligned}$$

¿Qué pasa si X e Y
son
independientes?

Variables Continuas

Sean X, Y dos v.a.c.

$f_{X,Y}(X,Y)$: func. de densidad conjunta

$f_X(X)$: func. de densidad marginal de X

Función de densidad condicional de Y dado $X = x$

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

¿Qué pasa si X e Y
son
independientes?

Ejercicio 1

La probabilidad de acertar a un blanco es $\frac{1}{5}$. Se realizan 10 tiros independientes y se cuenta la cantidad de aciertos. Sean X la cantidad de aciertos en los 10 tiros, e Y la cantidad de aciertos en el primer tiro. Hallar la distribución de $Y|X=x$.

Ejercicio 2

Sean X, Y dos v.a. conjuntamente uniformes en el triángulo de vértices $(0,0)$, $(2,2)$, $(0,2)$. Hallar la función de densidad de $Y|X=x$.

Factorización

Sean X, Y dos v.a.c.

$f_{X,Y}(x, y)$: func. de densidad conjunta

$f_X(x)$: func. de densidad marginal de X

$f_Y(y)$: func. de densidad marginal de Y

$$f_{Y|X=x}(y) = \frac{f_{X,Y}(x, y)}{f_X(x)} \implies f_{X,Y}(x, y) = f_{Y|X=x}(y) f_X(x) \\ = f_{X|Y=y}(x) f_Y(y)$$

Obs: si X, Y son independientes, $f_{X,Y}(x, y) = f_X(x) f_Y(y)$

Ejercicio 3

Sean X, Y dos v.a. con función de densidad conjunta:

$$f_{X,Y}(x, y) = \frac{e^{-x/2y}}{4y} \mathbf{1}\{0 < x, 1 < y < 3\}$$

Hallar la función de densidad de $X|Y=y$

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

Mezcla de v.a.

Sea M una v.a. discreta a valores $1, \dots, n$, con función de probabilidad $p_M(m)$, y sea X una v.a. tal que se conocen las distribuciones $X|M = m$, $m = 1, 2, \dots, n$. Luego, la distribución de X resulta

$$F_X(x) = \sum_{m=1}^n F_{X|M=m}(x)p_M(m)$$

Obs:

Si X es **v.a.d**: $p_X(x) = \sum_{m=1}^n p_{X|M=m}(x)p_M(m)$

Si X es **v.a.c** $f_X(x) = \sum_{m=1}^n f_{X|M=m}(x)p_M(m)$

Ejercicio 4

Para ir al trabajo Juan puede tomar el subte, o el tren, eligiendo viajar en tren el 60% de las veces. Si viaja en subte, el tiempo de viaje (en horas) es una v.a. con distribución $U(0.75, 1)$, mientras que si viaja en tren, se distribuye de manera uniforme en el intervalo $(0.8, 1.25)$.

1. Calcular la función de densidad del tiempo de viaje.

Bayes para mezclas

Sea M una v.a. discreta a valores $1, \dots, n$, con función de probabilidad $p_M(m)$, y sea X una v.a. continua tal que se conocen las distribuciones $f_{X|M=m}(x)$, $m = 1, 2, \dots, n$, la función de probabilidad de M dado que $X = x$ será:

$$p_{M|X=x}(m) = \frac{f_{X|M=m}(x)p_M(m)}{\sum_{m=1}^n f_{X|M=m}(x)p_M(m)}$$

Ejercicio 4

Para ir al trabajo Juan puede tomar el subte, o el tren, eligiendo viajar en tren el 60% de las veces. Si viaja en subte, el tiempo de viaje (en horas) es una v.a. con distribución $U(0.75, 1)$, mientras que si viaja en tren, se distribuye de manera uniforme en el intervalo $(0.8, 1.25)$.

1. Calcular la función de densidad del tiempo de viaje.
2. Calcular la probabilidad de que haya viajado en subte si un cierto día tardó exactamente 0.9 hs.

Normal multivariada: dist. condicionales

$$\text{Sea } \mathbf{X} = [X_1, X_2]^T \sim \mathcal{N}(\boldsymbol{\mu}, \Sigma)$$

$$X_1|X_2 = x_2 \sim \mathcal{N}\left(\mu_1 + \frac{\text{cov}(X_1, X_2)}{\sigma_2^2}(x_2 - \mu_2), \left(1 - \frac{\text{cov}(X_1, X_2)^2}{\sigma_1^2 \sigma_2^2}\right)\sigma_1^2\right)$$

$$X_2|X_1 = x_1 \sim \mathcal{N}\left(\mu_2 + \frac{\text{cov}(X_1, X_2)}{\sigma_1^2}(x_1 - \mu_1), \left(1 - \frac{\text{cov}(X_1, X_2)^2}{\sigma_1^2 \sigma_2^2}\right)\sigma_2^2\right)$$

Esperanza condicional

Motivación

En dónde podemos aplicar la esperanza condicional?

- ⊙ Regresión: se usa para predecir el valor de la variable objetivo, dado un conjunto de variables condicionales (observaciones)
- ⊙ Reinforcement learning: usamos la esperanza condicional para estimar la recompensa esperada al tomar una acción en un estado dado. Esta estimación se usa para guiar al agente en la toma de decisiones
- ⊙ Detección de anomalías: se usa para predecir el valor esperado de una variable basado en sus valores previos (y otras variables). Si el valor actual se desvía mucho, puede indicar una anomalía
- ⊙ Sistemas de recomendación: se usa para predecir la preferencia del usuario por cierto contenido o servicio, por ejemplo en técnicas de collaborative filtering models

Función de regresión

Def: Sean X, Y dos v.a. **discretas**, se llama **función de regresión** a

$$\varphi(x) = \mathbb{E}[Y|X = x] = \sum_{y \in R_y} y p_{Y|X=x}(y), \quad \forall x \in R_X$$

Def: Sean X, Y dos v.a. **continuas**, se llama **función de regresión** a

$$\varphi(x) = \mathbb{E}[Y|X = x] = \int_{y \in R_y} y f_{Y|X=x}(y), \quad \forall x \in R_X$$

Observar que es función de x

Ejercicio 5

Continuando con los ejercicios anteriores calcular la función de regresión de $X|Y=y$ o $Y|X=x$ según corresponda:

1. La probabilidad de acertar a un blanco es $\frac{1}{5}$. Se realizan 10 tiros independientes y se cuenta la cantidad de aciertos. Sean X la cantidad de aciertos en los 10 tiros, e Y la cantidad de aciertos en el primer tiro. Hallar la distribución de $X|Y=y$ y $Y|X=x$.
2. Sean X, Y dos v.a. conjuntamente uniformes en el triángulo de vértices $(0,0)$, $(2,2)$, $(0,2)$. Hallar la función de densidad de $Y|X=x$.
3. Sean X, Y dos v.a. con función de densidad conjunta

$$f_{X,Y}(x,y) = \frac{e^{-x/2y}}{4y} \mathbf{1}\{0 < x, 1 < y < 3\}$$

Hallar la función de densidad de $X|Y=y$

Esperanza condicional

Def: La variable aleatoria **esperanza condicional de Y dada X** se define como

$$\mathbb{E}[Y|X] = \varphi(X).$$

Además $\varphi(X)$ satisface que $\mathbb{E}[(Y - \varphi(X)) t(X)] = 0$ para toda función medible $t : R_X \rightarrow \mathbb{R}$, tal que $\mathbb{E}[t(X)] < \infty$.

$\mathbb{E}[Y|X]$ es el **mejor predictor** de Y basado en X (i.e. es la **proyección ortogonal** de Y en el espacio de funciones de X)

Propiedades

1. $\mathbb{E}[Y] = \mathbb{E}[\mathbb{E}[Y|X]]$
2. $\mathbb{E}[r(X)s(Y)|X] = r(X)\mathbb{E}[s(Y)|X]$, para r, s tal que $r(X)s(X)$, $r(X)$ y $s(Y)$ tienen esperanza finita
3. $\mathbb{E}[aY_1 + bY_2|X] = a\mathbb{E}[Y_1|X] + b\mathbb{E}[Y_2|X]$
4. $\mathbb{E}[Y|X] = \mathbb{E}[Y]$ si X y Y son independientes

Ejercicio 6

1. Siguiendo con los ejercicios anteriores calcular la esperanza condicional de $X|Y$ o de $Y|X$ según corresponda.
2. Para el último ejemplo, calcular $E[X]$.