

## Probabilidade 2 - ME310 - Lista 2

September 14, 2015

### Lembrando:

1. Estatística de ordem, pg 328 Ross:  $f_{x_j}(x) = \frac{n!}{(n-j)!(j-1)!} \cdot F(x)^{j-1} \cdot (1 - F(x))^{n-j} \cdot f(x)$
2. Distribuição de probabilidade conjunta de funções de variáveis aleatórias, pg. 330 Ross:  $f_{Y_1, Y_1}(y_1, y_2) = f_{X_1, X_1}(x_1, x_2) \cdot |\mathbf{J}(x_1, x_2)|^{-1}$
3. Covariância:  $Cov(X, Y) = \mathbf{E}((X - \mathbf{E}(X)) \cdot (Y - \mathbf{E}(Y))) = \mathbf{E}(X \cdot Y) - \mathbf{E}(X) \cdot \mathbf{E}(Y)$
4. Variância:  $Var(X) = \mathbf{E}((X - \mathbf{E}(X))^2) = \mathbf{E}(X^2) - \mathbf{E}(X)^2$

1. Uma máquina funciona enquanto pelo menos 3 das 5 turbinas funcionam. Se cada turbina funciona um tempo aleatório com densidade  $x \cdot e^{-x}$ ,  $x > 0$ , independentemente das outras, calcule a distribuição de tempo de funcionamento da máquina. Dica: estatísticas de ordem.

Resp. 1)

da equação 1, sabemos que  $f_{x_j}(x) = \frac{n!}{(n-j)!(j-1)!} \cdot F(x)^{j-1} \cdot (1-F(x))^{n-j} \cdot f(x)$ , se três turbinas funcionam então o avião funciona, como  $x_1 < x_2 < x_3 < x_4 < x_5$ , basta calcularmos a probabilidade da turbina  $x_3$  estar funcionando (se ela não estiver, o avião não estará).

para isso, temos  $n = 5, j = 3$   
 $f_{X_3}(T) = \frac{5!}{2!2!} \cdot F_X(T)^2 \cdot (1 - F_X(T))^2 \cdot f(T) = 30 \cdot (1 - (1+T)e^{-T})^2 \cdot ((1+T)e^{-T})^2 \cdot T \cdot e^{-T}$

2. Considere uma amostra de tamanho 5 da distribuição  $Uniforme(0, 1)$ . Ache a probabilidade de que a mediana está no intervalo  $(\frac{1}{4}, \frac{3}{4})$ .

Resp. 2)

De novo, usamos estatística de ordem.

Nesse caso, temos que lembrar que a mediana amostral é o elemento  $x+1$  em uma amostra de  $2 \cdot x + 1$  elementos, nesse caso  $x = 2$ , então temos que calcular a distribuição do terceiro elemento:

Usando a equação 1 temos:

$$f_{x_3}(x) = \frac{5!}{(5-3)!(3-1)!} \cdot F(x)^{3-1} \cdot (1-F(x))^{5-3} \cdot f(x) = 30 \cdot x^2 \cdot (1-x)^2 \cdot \mathbf{I}_{x \in (0,1)}$$

Para calcular a probabilidade de estar no intervalo  $(\frac{1}{4}, \frac{3}{4})$  fazemos:

$$P(\frac{1}{4} \leq X_3 \leq \frac{3}{4}) = \int_{1/4}^{3/4} 30 \cdot x^2 \cdot (1-x)^2 dx = \int_{1/4}^{3/4} 30 \cdot (x^2 - 2 \cdot x^3 + x^4) dx = 30 \cdot (\frac{x^3}{3} - \frac{x^4}{2} + \frac{x^5}{5}) \Big|_{x=1/4}^{x=3/4} = 0,0265$$

3. A densidade conjunta das v.a.  $X$  e  $Y$  é dada por  $f(x, y) = \frac{1}{x^2 \cdot y^2} \cdot \mathbf{I}_{\{x \geq 1, y \geq 1\}}$ . Calcule a densidade conjunta das variáveis  $U = XY$  e  $V = X/Y$ .

Resp. 3)

$$f_{U,V}(U, V) = f_{X,Y}(x, y) \cdot |\mathbf{J}(x, y)|^{-1}$$

$$\bullet \mathbf{J}(x, y) = \begin{vmatrix} y & x \\ 1/y & -x/y^2 \end{vmatrix} = -\frac{x}{y} - \frac{x}{y} = -2 \cdot \frac{x}{y}$$

$$\bullet f_{U,V}(U, V) = \frac{\frac{1}{x^2 \cdot y^2} \cdot \mathbf{I}_{\{x \geq 1, y \geq 1\}}}{\left| -2 \cdot \frac{x}{y} \right|} = \frac{\frac{1}{x^2 \cdot y^2} \cdot \mathbf{I}_{\{x \geq 1, y \geq 1\}}}{2 \cdot \frac{x}{y}} = \frac{y}{2x} \cdot \frac{1}{x^2 y^2} \cdot \mathbf{I}_{\{x \geq 1, y \geq 1\}} = \frac{1}{2VU^2} \cdot \mathbf{I}_{\{U \geq 1, V > 0\}}$$

4. Sejam X e Y v.a. i.i.d. *Uniformes*(0, 1). Calcule a densidade conjunta de

a)  $U = X + Y$ ,  $V = X/Y$

Resp. a)  $f_X(a) = f_Y(a) = 1 \cdot \mathbf{I}_{\{a \in (0,1)\}}$

$$\bullet \mathbf{J}(x, y) = \begin{vmatrix} 1 & 1 \\ 1/y & -x/y^2 \end{vmatrix} = -\frac{x}{y^2} - \frac{1}{y}$$

$$\bullet f_{U,V}(u, v) = \frac{1 \cdot \mathbf{I}_{\{x \geq 1, y \geq 1\}}}{\left| -\frac{x}{y^2} - \frac{1}{y} \right|} = \frac{1 \cdot \mathbf{I}_{\{x \geq 1, y \geq 1\}}}{\frac{x}{y^2} + \frac{1}{y}} = \frac{1 \cdot \mathbf{I}_{\{x \geq 1, y \geq 1\}}}{\frac{x+y}{y^2}} = \frac{\left(\frac{u}{1+v}\right)^2 \cdot \mathbf{I}_{\{x \geq 1, y \geq 1\}}}{u} = \frac{u \cdot \mathbf{I}_{\{2 \geq u \geq 0, v > 0\}}}{(1+v)^2}$$

b)  $U = X$ ,  $V = X/Y$ .

$$\bullet \mathbf{J}(x, y) = \begin{vmatrix} 1 & 0 \\ 1/y & -x/y^2 \end{vmatrix} = -\frac{x}{y^2}$$

$$\bullet f_{U,V}(u, v) = \frac{1 \cdot \mathbf{I}_{\{x \geq 1, y \geq 1\}}}{\left| -\frac{x}{y^2} \right|} = \frac{1 \cdot \mathbf{I}_{\{x \geq 1, y \geq 1\}}}{\frac{x}{y^2}} = \frac{u}{v^2} \cdot \mathbf{I}_{\{u \geq 0, v > 0\}}$$

5. Sejam X e Y v.a. independentes *Uniformes*(0, 1). Mostre que para qualquer  $\alpha > 0$ :  $\mathbf{E}(|X - Y|^\alpha) = \frac{2}{(\alpha+1)(\alpha+2)}$

Resp. 5)

$$\begin{aligned} \mathbf{E}(|X - Y|^\alpha) &= \int \int_{x \in (0,1), y \in (0,1)} |x - y|^\alpha dx dy = \int \int_{x < y} (y - x)^\alpha dx dy + \int \int_{x > y} (x - y)^\alpha dx dy \\ &= \int_0^1 \int_0^y (y - x)^\alpha dx dy + \int_0^1 \int_0^x (x - y)^\alpha dy dx = \\ &= \int_0^1 (-1) \cdot \frac{(y-x)^{\alpha+1}}{\alpha+1} \Big|_{x=0}^{x=y} dy + \int_0^1 (-1) \cdot \frac{(x-y)^{\alpha+1}}{\alpha+1} \Big|_{y=0}^{y=x} dx = \int_0^1 \frac{y^{\alpha+1}}{\alpha+1} dy + \int_0^1 \frac{x^{\alpha+1}}{\alpha+1} dx = \\ &= \frac{2}{(\alpha+1)(\alpha+2)} \end{aligned}$$

6) N bolas (numeradas de 1 até N) são distribuídas em N urnas (também numeradas de 1 até N) de forma que para cada i a bola i vai para uma das urnas 1, . . . , i com probabilidade 1/i (independentemente das outras bolas). Calcule

a) o número esperado das urnas vazias

Resp. a)

Seja  $P(X_j = i) = \frac{1}{i}$  a probabilidade da j-ésima bola cair em uma urna específica i, então a probabilidade da j-ésima bola não cair na urna i é  $P(X_j \neq i) = 1 - \frac{1}{i}$ .

Considere o evento  $Y_i = \begin{cases} 1 & \text{se urna } i \text{ está vazia} \\ 0 & \text{caso contrário} \end{cases}$ , e considere o evento  $U =$

$\sum_{i=1}^N Y_i$ , “quantidade de urnas vazias”

$\mathbf{E}(Y_i) = P(Urna_i = 0) = P(X_1 \neq i, X_2 \neq i, X_3 \neq i, X_4 \neq i, \dots) = \prod_{j=i}^N (1 - \frac{1}{j})$

$\mathbf{E}(U) = \mathbf{E}(\sum_{i=1}^N Y_i) = \sum_{i=1}^N \mathbf{E}(Y_i) = \sum_{i=1}^N \prod_{j=i}^N (1 - \frac{1}{j})$

b) a probabilidade de que nenhuma urna está vázia.

Resp. b)

Observe que para que isso ocorra, cada bola deve estar em exatamente uma urna.

Mas para que isso ocorra, a i-ésima bola deve estar na urna i, pois a bola 1 só pode estar na urna 1, com isso, a bola 2 que poderia estar na urna 1 ou na urna 2 fica restrita apenas à urna 2, assim por diante. Logo:

$P(X_N = N, X_{N-1} = N-1, \dots, X_1 = 1) = \prod_{j=1}^N (\frac{1}{j})$

7) Se  $\mathbf{E}(X) = 1$  e  $Var(X) = 2$ , calcule  $\mathbf{E}((2+X)^2)$  e  $Var(1+3X)$

Resp. a)

$$\bullet Var(X) = 2 = \mathbf{E}(X^2) - \mathbf{E}(X)^2 \implies \mathbf{E}(X^2) = \mathbf{E}(X)^2 + 2 = 3$$

$$\bullet \mathbf{E}((2+X)^2) = \mathbf{E}(4 + 4X + X^2) = \mathbf{E}(4) + 4\mathbf{E}(X) + \mathbf{E}(X^2)$$

Logo  $\mathbf{E}((2+X)^2) = 4 + 4 \cdot 1 + 3 = 11$

Resp. b)

Logo  $Var(1+3X) = \mathbf{E}((1+3X)^2) - \mathbf{E}((1+3X))^2 = \mathbf{E}(1+6X+9X^2) - \mathbf{E}(1+3X)^2 = \mathbf{E}(1) + 6\mathbf{E}(X) + 9\mathbf{E}(X^2) - \mathbf{E}(1+3X)^2 = 34 - (\mathbf{E}(1) + 3\mathbf{E}(X))^2 = 34 - (1 + 3 \cdot 1)^2 = 18$

8) Dois dados são lançados. Seja  $X$  a soma dos resultados, e  $Y$  a diferença (mas não o valor absoluto da diferença) entre os resultados no primeiro e no segundo dados. Calcule  $\text{Cov}(X, Y)$ .

Resp. 8)

- $\text{Cov}(X, Y) = \mathbf{E}((X - \mathbf{E}(X)) \cdot (Y - \mathbf{E}(Y)))$
- $A \sim U(1, 6)$ , discreta
- $B \sim U(1, 6)$ , discreta
- $X = A + B$
- $Y = A - B$

Com isso:  $\text{Cov}(X, Y) = \mathbf{E}((A + B - \mathbf{E}(A + B)) \cdot (A - B - \mathbf{E}(A - B))) = \mathbf{E}((A + B) \cdot (A - B) - (A + B) \cdot 0 - 7 \cdot (A - B) + 7 \cdot 0) = \mathbf{E}(A^2 - B^2 - 7 \cdot (A - B)) = \mathbf{E}(A^2) - \mathbf{E}(B^2) = 0$

9) A densidade conjunta das v.a.  $X$  e  $Y$  é dada por  $f(x, y) = \frac{1}{y} \cdot e^{-(y + \frac{x}{y})} \cdot \mathbf{I}_{\{x > 0, y > 0\}}$ . Calcule  $\text{Cov}(X, Y)$ .

Resp. 9)

- $\text{Cov}(X, Y) = \mathbf{E}(X \cdot Y) - \mathbf{E}(X) \cdot \mathbf{E}(Y)$
- $\mathbf{E}(X \cdot Y) = \int_0^\infty \int_0^\infty \frac{xy}{y} \cdot e^{-(y + \frac{x}{y})} dx dy = \int_0^\infty \int_0^\infty x \cdot e^{-(y + \frac{x}{y})} dx dy = \int_0^\infty (-\frac{x+y}{y}) \cdot e^{-\frac{x+y}{y}} \Big|_{x=0}^{x=\infty} dy = \int_0^\infty e^{-y} dy = 1$
- $\mathbf{E}(X) = \int_0^\infty \int_0^\infty \frac{x}{y} \cdot e^{-(y + \frac{x}{y})} dx dy = \int_0^\infty (-(x + y) \cdot e^{-\frac{x+y}{y}} \Big|_{x=0}^{x=\infty}) dy = \int_0^\infty (-y) \cdot e^{-y} dy = 0$
- Como  $\mathbf{E}(Y) < \infty$ , então nem precisamos calculá-lo, pois  $\mathbf{E}(X) \cdot \mathbf{E}(Y) = 0 \cdot \mathbf{E}(Y) = 0$ , com isso a solução é  $\text{Cov}(X, Y) = 1 - 0 = 1$

10) Seja  $X \sim U(-\pi, \pi)$ , e considere v.a.  $Y = \text{sen}(X)$ ,  $Z = \text{cos}(X)$ .

a) As v.a.  $Y, Z$  são independentes?

Resp. a)

- Não, observe que dado  $Y$ , podemos calcular  $X$  ( $X = \arcsen(Y)$ ) e dado  $X$  podemos determinar  $Z$ , logo dado  $Y$  podemos determinar  $Z$  ( $Z$  depende de  $Y$ ). O mesmo raciocínio vale para  $Y$  em função de  $Z$

b) Calcule  $\mathbf{E}(Y)$

\*) Aqui eu não estou usando a média do jeito usual com densidade da variável, estou fazendo a média de seno em torno do círculo trigonométrico,  $2 \cdot \pi$  é a área do círculo e a integral é a soma dos valores possíveis. Se fosse feito usando a definição formal de esperança e a densidade de y, o resultado seria o mesmo

Resp. b)

$$\bullet \mathbf{E}(Y) = \int_{-\pi}^{\pi} \frac{1}{2\pi} \cdot \text{sen}(x) dx = -\frac{1}{2\pi} \cdot \cos(x) \Big|_{x=-\pi}^{x=\pi} = \frac{-(-1) - (-(-1))}{2 \cdot \pi} = 0$$

c) Calcule  $\mathbf{E}(Z)$

\*) Aqui eu não estou usando a média do jeito usual com densidade da variável, estou fazendo a média de cosseno em torno do círculo trigonométrico,  $2 \cdot \pi$  é a área do círculo e a integral é a soma dos valores possíveis. Se fosse feito usando a definição formal de esperança e a densidade de z, o resultado seria o mesmo

Resp. c)

$$\bullet \mathbf{E}(Z) = \int_{-\pi}^{\pi} \frac{1}{2\pi} \cdot \cos(x) dx = -\frac{1}{2\pi} \cdot \text{sen}(x) \Big|_{x=-\pi}^{x=\pi} = 0 - 0 = 0$$

d)  $\text{Cov}(Y, Z)$

\*) Aqui eu não estou usando a média do jeito usual com densidade conjunta, estou fazendo a média de  $\text{Sen}(x) \cdot \text{Cosseno}(x)$  em torno do círculo trigonométrico,  $2 \cdot \pi$  é a área do círculo e a integral é a soma dos valores possíveis. Observe que nesse caso, não teríamos como calcular a esperança do jeito usual, pois não temos a densidade conjunta de Y,Z e elas não são independentes.

$$\bullet E(YZ) = \int_{-\pi}^{\pi} \frac{1}{2\pi} \cdot \text{sen}(x) \cdot \cos(x) dx = -\frac{1}{2} \cdot \cos(x)^2 \Big|_{x=-\pi}^{x=\pi} = 0$$

$$\bullet \text{Cov}(Y, Z) = \mathbf{E}(XY) - \mathbf{E}(X) \cdot \mathbf{E}(Z) = 0 - 0 \cdot 0 = 0$$

Conclusão, elas são variáveis dependentes com Covariância 0.

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

ou diretamente no repositório do github:

*[https : //github.com/eric-lobes/Probabilidade2](https://github.com/eric-lobes/Probabilidade2)*

Bons estudos,  
Eric.