Notas de Aulas - MI401

Probabilidade

Caio Gomes Alves

03/2025

Conteúdos

1 Prefácio **2**

2 Definições Básicas **3**

2.1 Modelo Probabilístico 3

2.2 Álgebras de Conjuntos 4

2.3 Axiomas de Kolmogorov 6

2.4 Propriedades da medida de probabilidade 6

2.5 Propriedades de probabilidade 8

2.6 Probabilidade Condicional e Independência 8

2.7 Fórmula de Poincaré e Teorema de Bayes 10

2.8 Exercícios 12

3 Variáveis Aleatórias **25**

1 Prefácio

Este “livro” consiste de notas de aulas da matéria MI401 - Probabilidade, do Programa de Mestrado em Estatística, do Instituto de Matemática, Estatística e Computação Científica (IMECC), da Universidade Estadual de Campinas - UNICAMP.

Os seus conteúdos são baseados nas notas tomadas durante as aulas e o livro “Probabilidade: um curso em nível intermediário”, do autor Barry R. James, 5ª edição.

2 Definições Básicas

2.1 Modelo Probabilístico

Suponha que é realizado um experimento "sob certas condições", sendo Ω o conjunto de resultados possíveis do experimento (também chamado de resultados elementares). Chamamos Ω de **espaço amostral do experimento**, com a representação axiomática sendo dada por: $\Omega = \{\omega : \omega \in \Omega\}$.

Example 2.1. Considere o lançamento de um dado honesto. Nesse caso, temos que $\Omega = \{1, 2, 3, 4, 5, 6\}$, em que cada $\{i\}$ é um evento elementar, sendo eles $\{1\}$,$\{2\}$,$\{3\}$,$\{4\}$,$\{5\}$ e $\{6\}$.

Temos então que eventos são coleções de pontos em Ω, por exemplo um evento $A = \{2, 4, 6\}$ (números pares no lançamento de um dado honesto). Assim, temos as seguintes suposições para eventos:

1. Todo resultado possível no experimento corresponde a um e somente um $\omega \in \Omega$;
2. Resultados diferentes correspondem a elementos diferentes em Ω.

Definition 2.1. Seja um espaço amostral Ω de um experimento. Todo subconjunto $A \subset \Omega$ é um evento. Ω é o evento certo e $\emptyset$ é o evento impossível. Além disso, $\omega \in \Omega \to \{\omega\}$ é um evento elementar.

Note-se que, dados A e B eventos, tais que $A \subset \Omega$ e $B \subset \Omega$, temos que:

- $A \cup B \to (\omega \in A \text{ e } \omega \notin B)$ ou $(\omega \notin A \text{ e } \omega \in B)$ ou $(\omega \in A \text{ e } \omega \in B)$;
- $A \cap B \to (\omega \in A \cup \omega \in B)$;
- $A^c \to (\omega \notin A)$;
- $A \subset B \to$ a ocorrência de A implica a ocorrência de B;
- $A \cap B = \emptyset \to$ os eventos A e B são mutuamente exclusivos.

No campo probabilístico, pensamos em atribuir probabilidades (leia-se chances) a eventos em Ω.

Definition 2.2 (Clássica)**.** A probabilidade de ocorrência de um evento A, denotada por $P(A)$ é dada por:

$$P(A) = \frac{\#(A)}{\#(\Omega)} = \frac{\text{n}^{\text{o}} \text{ de resultados favoráveis a } A}{\text{n}^{\text{o}} \text{ de resultados possíveis em } \Omega}$$

Onde # indica a cardinalidade de um conjunto (quantidade de elementos no conjunto).

Example 2.2. Seja $A = \{2, 4, 6\}$, os lançamentos pares em um dado honesto. Como $\Omega = \{1, \ldots, 6\}$, temos que:

$$P(A) = \frac{3}{6} = \frac{1}{2}$$

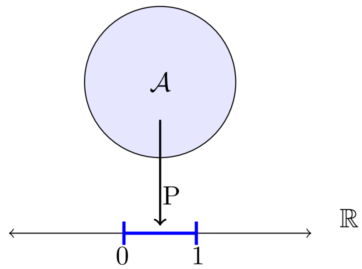
Note que o conjunto A pode ser descrito como a união dos eventos elementares, tais que $A = \{2\} \cup \{4\} \cup \{6\}$. Nesse caso, podemos ver que a probabilidade de A não muda, pois:

$$\begin{aligned} P(\{i\}) &= \frac{\#(\{i\})}{\#(\Omega)} = \frac{1}{6} \\ P(A) &= \frac{\#(\{2\}) + \#(\{4\}) + \#(\{6\})}{\#(\Omega)} = \frac{1+1+1}{6} = \frac{1}{2} \end{aligned}$$

Definition 2.3. Um evento A ao qual atribuímos uma probabilidade é um evento aleatório.

2.2 Álgebras de Conjuntos

Considere o conjunto de eventos em uma família $\mathcal{A}$ (subconjuntos de Ω), de tal modo que $P : A \to [0, 1]$. Uma representação gráfica da relação P pode ser dada por:



Definition 2.4. Seja Ω um conjunto não-vazio. Seja $\mathcal{A}$ uma classe de subconjuntos de Ω, ela será chamada de **"Álgebra de subconjuntos de Ω"**, caso respeite os seguintes axiomas:

- Ax_1 : $\Omega \in \mathcal{A}$, e definimos $P(\Omega) = 1$;
- Ax_2 : Se $A \in \mathcal{A} \Rightarrow A^c \in \mathcal{A}$, e definimos $P(A^c) = 1 - P(A)$;
- Ax_3 : Se $A \in \mathcal{A}, B \in \mathcal{A} \Rightarrow A \cup B \in \mathcal{A}$.

E por consequência desses axiomas, temos as seguintes extensões:

- Ax_4 : $\emptyset \in \mathcal{A}$;
- Ax_5 : Sejam $A_1, A_2, \ldots, A_n : A_i \in \mathcal{A} \forall i \Rightarrow \bigcup_{i=1}^n A_i \in \mathcal{A}$ e $\bigcap_{i=1}^n A_i \in \mathcal{A}$.

É fácil verificar a extensão de Ax_4 a partir de Ax_1 e Ax_2: Ax_1 define que $\Omega \in \mathcal{A}$, e por Ax_2 temos que $\Omega^c \in \mathcal{A}$, e por definição temos que $\Omega^c = \emptyset$, logo $\emptyset \in \mathcal{A}$. Também é interessante notar que, ainda por Ax_2, temos que $P(\emptyset) = 1 - P(\Omega)$, e por Ax_1 temos que $P(\Omega) = 1$, portanto $P(\emptyset) = 1 - 1 = 0$.

A extensão de Ax_5 é dada por indução e pelas Leis de De Morgan: Sejam $A_1, A_2 \in \mathcal{A}$. Temos pelo axioma Ax_3, que $A_1 \cup A_2 \in \mathcal{A}$, podendo assim definir o conjunto $B = A_1 \cup A_2$, sendo possível ver que $B \in \mathcal{A}$. Sejam ainda um conjunto $A_3 \in \mathcal{A}$, podemos ver que $B \cup A_3 \in \mathcal{A}$, e como $B = A_1 \cup A_2$, temos que $(A_1 \cup A_2) \cup A_3 \in \mathcal{A}$. Podemos proceder dessa forma para qualquer quantidade (enumerável) de conjuntos, de modo que $\bigcup_{i=1}^n A_i \in \mathcal{A}$. Pelas Leis de De Morgan, sabemos que:

$$\bigcap_{i=1}^{n} A_i = \left(\bigcup_{i=1}^{n} A_i^c \right)^c \tag{1}$$

E pela extenção indutiva em n do axioma Ax_2, temos que se $A_i^c \in \mathcal{A}, \forall i$, então $\bigcup_{i=1}^n A_i^c \in \mathcal{A}$. E como, se um conjunto pertence a $\mathcal{A}$ seu complementar deve pertencer também, e pelo resultado em (1), temos então que:

$$\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_i^c \right)^c = \left(\bigcap_{i=1}^{n} A_i \right) \in \mathcal{A} \tag{2}$$

Assim provamos o axioma A_5 como extensão indutiva dos axiomas anteriores, indicando que tanto a união quanto a interseção dos A_i pertencem à $\mathcal{A}$. Podemos também mostrar que a álgebra $\mathcal{A}$ é fechada também para a operação de diferença entre conjuntos: $A \in \mathcal{A}, B \in \mathcal{A}, A - B = A \cap B^c \in \mathcal{A}$.

Proof. Considerando que os conjuntos A e $B pertencem à $\mathcal{A}$, podemos utilizar o axioma Ax_2 para mostrar que $A^c \in \mathcal{A}$ e $B^c \in \mathcal{A}$. A partir disso, por meio do axioma Ax_5 temos que os seguintes conjuntos também pertencem à $\mathcal{A}$: $A \cup B, A \cup B^c, A^c \cup B, A^c \cup B^c, A \cap B, A \cap B^c, A^c \cap B, A^c \cap B^c$. E como temos que $A \cap B^c = A - B$, temos a prova de que $A - B \in \mathcal{A}$. Além disso, essa prova mostra que a diferença contrária ($B - A = A^c \cap B$) também pertence à algebra $\mathcal{A}$. $\square$

Ainda considerando os conjuntos A e B, existem cinco maneiras como esses conjuntos podem "interagir", e podemos mostrar que em todos os casos a diferença $A - B \in \mathcal{A}$:

- $A \not\subset B$ e $A \not\supset B$ e $A \cap B \neq \emptyset \Rightarrow A - B = A \cap B^c \in \mathcal{A}$;
- $A \not\subset B$ e $A \not\supset B$ e $A \cap B = \emptyset \Rightarrow A - B = A \in \mathcal{A}$;
- $A \supset B \Rightarrow A - B = A \cap B^c \in \mathcal{A}$;
- $A \subset B \Rightarrow A - B = \emptyset \in \mathcal{A}$;
- $A = B \Rightarrow A - B = \emptyset \in \mathcal{A}$.

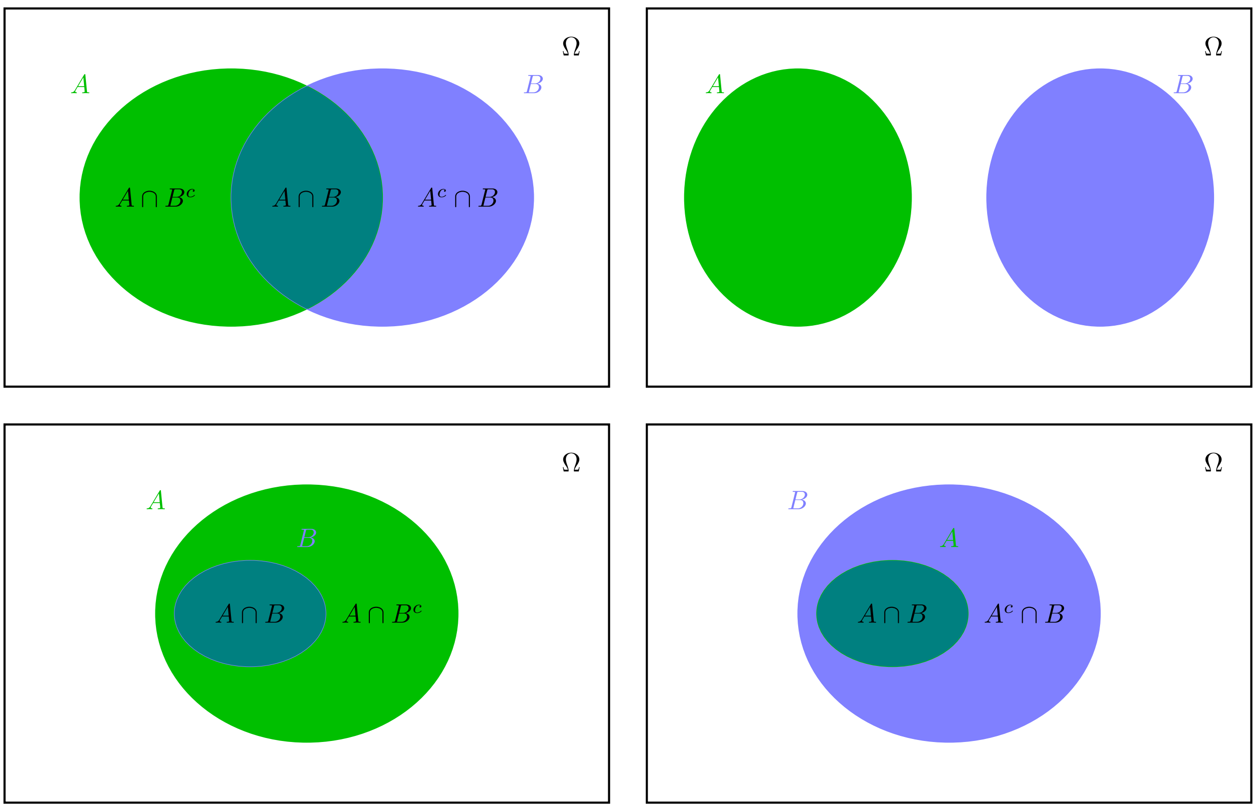


Figure 1: Diferentes relações entre A e B demonstradas por Diagramas de Venn. Note que em todos os casos, $A \cap B^c \in \mathcal{A}$ ou $A \cap B^c = \emptyset \in \mathcal{A}$ ou $A \cap B^c = A \in \mathcal{A}$

As representações por Diagramas de Venn apresentadas na figura 2.2 não é prova formal de que a álgebra $\mathcal{A}$ é fechada para a diferença, mas é um recurso visual que pode auxiliar no entendimento da relação entre os conjuntos.

Definition 2.5. Uma classe $\mathcal{A}$ de conjuntos/subconjuntos de $\Omega \neq \emptyset$, verificando os axiomas Ax_1, Ax_2 e Ax_3 é chamada de σ-álgebra de subconjuntos de Ω.

Note que uma σ-álgebra é sempre uma álgebra. Uma outra forma de construir σ-álgebras é partir de uma álgebra munida dos axiomas de Kolmogorov (Teorema de Carathéodory).

Proposition 2.1. *Seja $\mathcal{A}$ uma σ-álgebra de subconjuntos de Ω, se $A_1, A_2, \ldots,$ é uma coleção em $\mathcal{A} \Rightarrow \bigcap_{i=1}^{\infty} A_n \in \mathcal{A}$.*

Example 2.3. Seja $\Omega = \{1,2,3,4,5,6\}$ (o lançamento de um dado cúbico usual). A σ-álgebra usual é definida da seguinte forma e denotada por $\mathcal{P}(\Omega)$ (chamada de partes de Ω ou *powerset* de Ω):

$$\begin{aligned}\mathcal{A} = \{&\emptyset, \{1\}, \{2\}, \{3\}, \{4\}, \{5\}, \{6\},\\ &\{1,2\}, \{1,3\}, \{1,4\}, \{1,5\}, \{1,6\},\\ &\{2,3\}, \{2,4\}, \dots,\\ &\Omega\}\end{aligned}$$

Example 2.4. Definamos a σ-álgebra de Borel no intervalo $\Omega = [0,1]$. Uma possível definição seria:

$$\mathcal{A} = \text{ todos os subconjuntos de } [0,1] \text{ cujo cumprimento esteja bem definido}$$

Podemos, por exemplo, propor uma álgebra para o intervalo $[0,1]$ dada por:

$$\mathcal{A}_{\prime} = \{A \subset [0,1] : A \text{ é uma união finita de intervalos } \}$$

É possível encontrar um conjunto A tal que $A \notin \mathcal{A}$, por exemplo:

$$A = \left\{ \left(0, \frac{1}{2}\right) \cup \left(\frac{1}{2}, \frac{3}{4}\right) \cup \dots \cup \left(1 - \frac{1}{2^n}, 1 - \frac{1}{2^{n+1}}\right) \cup \dots \right\}$$

Podemos ver que, para qualquer n^* finito, $\lim_{n \to n^*} \left(1 - \frac{1}{2^{n+1}}\right) \neq 1$, de modo que o conjunto A não cobrirá completamente o intervalo $[0,1]$. Dessa forma, a σ-álgebra de Borel no intervalo $[0,1]$ (denotada $\mathcal{B}_{[0,1]}$) é definida como:

$$\mathcal{B}_{[0,1]} = \{A : A \subset [0,1] \text{ e } A \text{ é boreliano}\}$$

Onde boreliano denota que A é união enumerável (finita ou infinita) de intervalos em $[0,1]$

2.3 Axiomas de Kolmogorov

Seja $P : \mathcal{A} \to [0,1]$, com:

- $Ax_1(K) : P(A) \geq 0, \forall A \in \mathcal{A}$;
- $Ax_2(K) : P(\Omega) = 1$;
- $Ax_3(K)$: Se $A_1, A_2, \dots, A_n : A_i \in \mathcal{A} \forall i$ e $A_i \cap A_j = \emptyset \forall i,j \in \{1,2,\dots,n\}, i \neq j \Rightarrow P\left(\bigcup_{k=1}^{n} A_k\right) = \sum_{k=1}^{n} P(A_k)$.

Definition 2.6. Seja Ω um conjunto não-vazio, $\mathcal{A}$ uma σ-álgebra em Ω, com $P : \mathcal{A} \to [0,1]$, verificando os axiomas de Kolmogorov, então P é dita finitamente aditiva. Podemos assim, modificar o axioma $Ax_3(K)$ para:

- $Ax_3'(K)$: Se $A_1, A_2, \dots$ é uma sequência em $\mathcal{A}$ tal que $\forall i \neq j, A_i \cap A_j = \emptyset$, tem-se que $P\left(\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n\right) = \sum_{n=1}^{\infty} P(A_n)$. (*propriedade da σ-aditividade*)

Definition 2.7. P definida em uma σ-álgebra $\mathcal{A}$, satisfazendo os axiomas de Kolmogorov $(Ax_1(K), Ax_2(K), Ax_3'(K))$ é uma medida de probabilidade em $\mathcal{A}$, constituída pela terna $(\Omega, \mathcal{A}, P)$.

2.4 Propriedades da medida de probabilidade

Proposition 2.2 (Continuidades)**.**

1. *Seja $\{A_i\}_{i=1}^{\infty}$ uma sequência (crescente) de eventos tais que $A_1 \subseteq A_2 \subseteq A_3 \subseteq \dots$, e seja $A = \bigcup_{i=1}^{\infty} A_i$, então $P(A) = \lim_{i \to \infty} P(A_i)$.*
2. *Seja $\{B_i\}_{i=1}^{\infty}$ uma sequência (decrescente) de eventos tais que $B_1 \supseteq B_2 \supseteq B_3 \supseteq \dots$, e seja $B = \bigcap_{i=1}^{\infty} B_i$, então $P(B) = \lim_{i \to \infty} P(B_i)$.*

Proof.

1. Note que, sendo $A_0 = \emptyset$, tem-se que $A = (A_1 - A_0) \cup (A_2 - A_1) \cup (A_3 - A_2) \cup \ldots$, ou seja, A é união disjunta de eventos $D_i = A_i - A_{i-1}$, de forma que $A_{i-1} \subseteq A_i \Rightarrow P(A_i) = P(A_{i-1}) + P(A_i - A_{i-1}) \Rightarrow P(A_i - A_{i-1}) = P(A_i) - P(A_{i-1})$. Logo, temos que:

$$
\begin{aligned}
A = \bigcup_{i=1}^{\infty} D_i \xRightarrow{Ax_3'(K)} P(A) &= \sum_{i=1}^{\infty} P(D_i) \\
&= \sum_{i=1}^{\infty} P(A_i - A_{i-1}) \\
&= \lim_{n\to\infty} \sum_{i=1}^{n} [P(A_i) - P(A_{i-1})] \\
&= \lim_{n\to\infty} \left[P(A_1) - \cancelto{0}{P(A_0)} + P(A_2) - P(A_1) + P(A_3) - P(A_2) + \ldots \right] \\
&= \lim_{n\to\infty} P(A_n)
\end{aligned}
$$

2. Note que, por De Morgan, $B = \bigcap_{i=1}^{n} B_i = (\bigcup_{i=1}^{n} B_i^c)^c$. Logo $P(\bigcap_{i=1}^{n} B_i) = 1 - P(\bigcup_{i=1}^{n} B_i^c)$. Seja $A = B_i^c$ de modo que:

$$
\begin{aligned}
B_1^c &= \Omega - B_1 = A_1 \\
B_2^c &= (B_1 - B_2) \cup (\Omega - B_1) = A_2 \\
&\vdots
\end{aligned}
$$

Assim $A_1 \subseteq A_2 \subseteq A_3 \subseteq \ldots$, e com isso $P(\bigcap_{i=1}^{n} B_i) = 1 - P(\bigcup_{i=1}^{n} B_i^c) = 1 - P(\bigcup_{i=1}^{n} A_i)$. Por outro lado, tem-se que $A = \bigcup_{i=1}^{\infty} A_i = \bigcup_{i=1}^{\infty} B_i^c \Rightarrow A^c = (\bigcup_{i=1}^{\infty} B_i^c)^c = \bigcap_{i=1}^{\infty} B_i = B$. Logo, temos que:

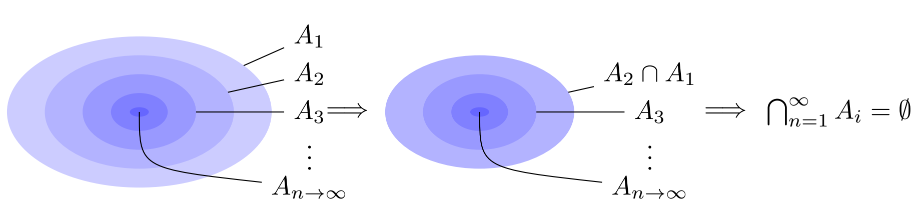
$$
P\left(\bigcap_{i=1}^{n} B_i \right) \xrightarrow[n\to\infty]{} (1 - P(A)) = P(A^c) = P(B)
$$

$\square$

Definition 2.8 (Continuidade no vazio)**.**

- $Ax_4(K)$: Se $\{A_n\}_{n\geq 1} \subseteq \mathcal{A}$ e $A_n \supseteq A_{n+1} \forall n$ e $\bigcap_{n+1}^{\infty} A_n \neq \emptyset$ então $P(A_n) \xrightarrow[n\to\infty]{} 0$

A prova dessa definição é dada pela segunda parte da prova da proposição 2.2. A representação visual é dada pelo seguinte diagrama:



Proposition 2.3. *Dados os axiomas $Ax_1(K), Ax_2(K), Ax_3(K)$, o axioma 4 é equivalente ao axioma $Ax_3'(K)$, ou seja, uma probabilidade finitamente aditiva é uma medida de probabilidade se e somente se é contínua no vazio.*

A prova de que a σ-aditividade implica o axioma 4 é consequência da prova da proposição anterior, dado que $\bigcap_{n=1}^{\infty} A_n = \emptyset$. Para demonstrar o contrário (que $Ax_1(K) + Ax_2(K) + Ax_3(K) + Ax_4(K) \to Ax_3'(K)$), tomemos uma sequência infinita de eventos $\{A_i\}_{i\geq 1}$ em $\mathcal{A} : A_i \cap A_j = \emptyset \; \forall i \neq j$. Devemos ver que $P(\bigcup_{n=1}^{\infty}) = \sum_{n=1}^{\infty} P(A_n)$. Seja $A = \bigcup_{n=1}^{\infty} A_n = (\bigcup_{n=1}^{k} A_n) \cup (\bigcup_{n=k+1}^{\infty} A_n)$. Tem-se que:

$$P(A) = P\left(\bigcup_{n=1}^{k} A_n\right) + P\left(\bigcup_{n=k+1}^{\infty} A_n\right) = \sum_{n=1}^{k} P(A_n) + P\left(\bigcup_{n=k+1}^{\infty} A_n\right)$$

Seja $B_k = \bigcup_{n=k+1}^{\infty} A_n$. Note que $B_k \downarrow \emptyset$ quando $k \to \infty$ de modo que $P(B_k) \xrightarrow[k\to\infty]{} 0$, logo:

$$\lim_{k\to\infty} \sum_{n=1}^{k} P(A_n) = \sum_{n=1}^{\infty} P(A_n)$$

Corollary 2.1. *Os seguintes sistemas são equivalentes:*

$$Ax_1(K), Ax_2(K), Ax_3'(K) \equiv Ax_1(K), Ax_2(K), Ax_3(K), Ax_4(K)$$

2.5 Propriedades de probabilidade

Seja P uma probabilidade em uma σ-álgebra $\mathcal{A}$. Suponhamos que todo A abaixo pertença à $\mathcal{A}$. Então as seguintes propriedades são consequências dos axiomas:

- **P1**: $P(A^c) = 1 - P(A)$;
- **P2**: $0 \leq P(A) \leq 1$;
- **P3**: $A_1 \subset A_2 \Rightarrow P(A_1) \leq P(A_2)$;
- **P4**: $P(\bigcup_{i=1}^{n} A_i) \leq \sum_{i=1}^{n} P(A_i)$;
- **P5**: $P(\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i) \leq \sum_{i=1}^{\infty} P(A_i)$;

Com essas propriedades, podemos então definir um modelo probabilístico. Sejam:

- **a**) Um espaço amostral: $\Omega \neq \emptyset$;
- **b**) Uma σ-álgebra em Ω: $\mathcal{A}$;
- **c**) Uma medida de probabilidade em $\mathcal{A}$: P.

Definition 2.9. Um espaço de probabilidade é uma terna $(\Omega, \mathcal{A}, P)$ seguindo **a**,**b** e **c**.

2.6 Probabilidade Condicional e Independência

Considere o seguinte experimento: um dado é lançado duas vezes e anota-se a dupla de resultados. Temos que:

$$\Omega = \{(i,j) : 1 \leq i \leq 6; 1 \leq j \leq 6; i, j, \in \mathbb{Z}\}$$

Sejam os seguintes eventos:

- $A =$ "*em cada lançamento o valor observado é* ≤ 2";
- $B =$ "*a soma dos resultados é igual a 4*".

$$A = \{(1,1), (1,2), (2,1), (2,2)\}$$
$$B = \{(1,3), (3,1), (2,2)\}$$

Já que $\#\Omega = |\Omega| = 36$, e pela equiprobabilidade dos eventos (considerando que os dados são honestos), temos que:

$$P(A) = \frac{|A|}{|\Omega|} = \frac{4}{36}$$
$$P(B) = \frac{|B|}{|\Omega|} = \frac{3}{36}$$

Além disso, $(A \cap B) = \{(2,2)\}; P(A \cap B) = 1/36$. Suponha que A ocorre com $P(A) > 0$, e que B é o evento de interesse. Assumindo a potencial ocorrência de A, qual é a probabilidade de B ocorrer. Nesse caso $P(B|A) = 1/4$.

Definition 2.10 (Probabilidade condicional)**.** Sejam A e B eventos em $\mathcal{A}$, com $P(A) > 0$. A probabilidade condicional $P(B|A)$ é definida como:

$$P(B|A) = \frac{P(A \cap B)}{P(A)} \tag{3}$$

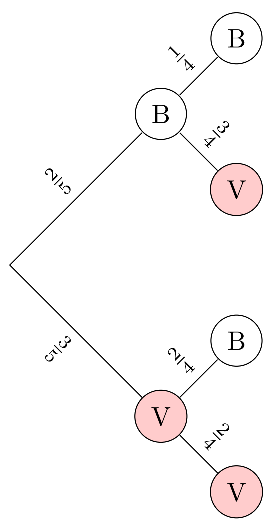
ou equivalentemente:

$$P(A \cap B) = P(B|A)P(A) \tag{4}$$

Example 2.5. Considere uma urna com 5 bolas, sendo 3 vermelhas e 2 brancas. O experimento consiste de 2 retiradas sucessivas de uma bola da urna (sem reposição). Considere os eventos $A_1 =$ *Cor da primeira bola* e $A_2 =$ *Cor da segunda bola*:

$$P(A_1 = B) = \frac{2}{5}\ ,\ P(A_1 = V) = \frac{3}{5}$$
$$P(A_2 = B|A_1 = B) = \frac{1}{4}\ ,\ P(A_2 = V|A_1 = B) = \frac{3}{4}$$
$$P(A_2 = B|A_1 = V) = \frac{2}{4}\ ,\ P(A_2 = V|A_1 = V) = \frac{2}{4}$$

Podemos visualizar esse experimento com os seguintes diagrama e tabela de probabilidades:



Resultados

A_1	A_2	$P(A_1)P(A_2|A_1)$
B	B	$2/5 \times 1/4 = 2/20$
B	V	$2/5 \times 3/4 = 6/20$
V	B	$3/5 \times 2/4 = 6/20$
V	V	$3/5 \times 2/4 = 6/20$

Definition 2.11 (Eventos independentes)**.**

- **a**) Os eventos A e B são independentes (denotados como $A \perp B$) se $P(A \cap B) = P(A)P(B)$;
- **b**) $\{A_i, i \in \mathbb{I}\}$ são independentes se $P\left(\bigcap_{i\in\mathcal{J}} A_i\right) = \prod_{i\in\mathcal{J}} P(A_i)$, $\forall$ subfamílias $\mathcal{J}$ de índices em $\mathbb{I}$.

Disso segue que, sendo A e B dois eventos, as seguintes propriedades são válidas:

1. Se $P(A) = 0 \Rightarrow P(A \cap B) = 0 \; \forall B$, ou seja, $A \perp B$;
2. Se $P(B) = 1 \Rightarrow P(A \cap B) = 0 \; \forall A$, ou seja, $A \perp B$;
3. A é independente dele mesmo se e somente se $P(A) = 0$ ou $P(A) = 1$;
4. $A \perp B \Rightarrow A \perp B^c, A^c \perp B, A^c \perp B^c$;
5. As seguintes proposições são equivalentes:
   - a) $(A \perp B) \Rightarrow P(B|A) = P(B)$ e $P(B|A^c) = P(B)$;
   - b) $P(B|A) = P(B) \Rightarrow A \perp B$;
   - c) $P(B|A^c) = P(B) \Rightarrow A \perp B$.

Theorem 2.1 (Teorema das Probabilidades Totais)**.**

1. *Dados A e B eventos em $\mathcal{F}$:*

$$P(A) = P(A|B)P(B) + P(A|B^c)P(B^c)$$

2. *No geral, se $B_1, B_2, \ldots, B_n$ é uma partição de Ω, então:*

$$P(A) = \sum_{i=1}^{n} P(A|B_i)P(B_i) \tag{5}$$

Demonstração: Note que $A = (A \cap B) \cup (A \cap B^c)$ e $(B \cap B^c) = \emptyset$ e $(B \cup B^c) = \Omega$. Além disso, $(A \cap B) \cap (A \cap B^c) = \emptyset$, logo $P(A) = P(A \cap B) + P(A \cap B^c)$. Como, por definição, $P(A|B) = P(A \cap B)/P(B)$ e $P(A|B^c) = P(A \cap B^c)/P(B^c)$, temos que:

$$P(A) = P(A|B)P(B) + P(A|B^c)P(B^c)$$

Para o caso geral, temos que $\{B_i\}_{i=1}^n$, $(B_i \cap B_j) = \emptyset \; \forall i, j$ e $\bigcup_{i=1}^n B_i = \Omega$. Logo:

$$\begin{aligned} A &= (A \cap B_1) \cup (A \cap B_2) \cup \ldots \cup (A \cap B_n) \\ &\Downarrow \text{ Pela } \sigma\text{-aditividade} \\ P(A) &= \sum_{i=1}^{n} P(A \cap B_i) \end{aligned}$$

E como $P(A|B_i) = P(A \cap B_i) \; P(B_i)$:

$$P(A) = \sum_{i=1}^{n} P(A|B_i)P(B_i)$$

2.7 Fórmula de Poincaré e Teorema de Bayes

Theorem 2.2 (Fórmula de Poincaré)**.** *Seja $\{A_i\}_{i \geq 1} \subseteq \mathcal{F}$. Então:*

$$\begin{aligned} P\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_n\right) = &\sum_{i=1}^{n} P(A_i) - \sum_{1 \leq i_1 < i_2 \leq n} P(A_{i_1} \cap A_{i_2}) + \sum_{1 \leq i_1 < i_2 < i_3 \leq n} P(A_{i_1} \cap A_{i_2} \cap A_{i_3}) - \ldots \\ &+ (-1)^{n+1} P(A_1 \cap A_2 \cap \ldots \cap A_n) \end{aligned} \tag{6}$$

A demonstração da fórmula (6) é dada no exercício 2.10.

Theorem 2.3 (Teorema de Bayes)**.** *Seja $\{B_i\}_{i=1}^n$ uma partição de Ω e A um evento em $\mathcal{F}$, temos que:*

$$P(B_i|A) = \frac{P(A|B_i)P(B_i)}{\sum_{j=1}^{n} P(A|B_j)P(B_j)} \tag{7}$$

O denominador de (7) é derivado do teorema das probabilidades totais, visto que $\{B_i\}_{i=1}^n$ é uma partição de Ω.

Lemma 2.1. *Sejam $A_1, A_2, \ldots, A_n$ eventos em $\mathcal{F}$, logo:*

$$P\left(\bigcap_{i=1}^{n} A_i\right) = P(A_1)P(A_2|A_1)P(A_3|A_1 \cap A_2)\ldots P(A_n|A_1 \cap A_2 \cap \ldots \cap A_{n-1})$$

Proof. Suponha a validade do lema anterior. Logo, seja $D = (\bigcap_{i=1}^n A_i)$:

$$\begin{aligned}
P(A_1 \cap \ldots \cap A_n \cap A_{n+1}) &= P(D \cap A_{n+1}) \\
&= P(D)P(A_{n+1}|D) \\
&= P(A_1)P(A_2|A_1)\ldots P(A_n|A_1 \cap \ldots \cap A_{n-1})P(A_{n+1}|A_1 \cap \ldots \cap A_n)
\end{aligned}$$

□

2.8 Exercícios

Exercise 2.1 (BJ1)**.** Sejam A, B e C eventos aleatórios. Identifique as seguintes equações e frases, casando cada equação expressa na notação de conjuntos com a correspondente frase na linguagem de eventos:

$A \cap B \cap C = A \cup B \cup C$	A e "B ou C" são incpmpatíveis.
$A \cap B \cap C = A$	Os eventos A,B e C são idênticos.
$A \cup B \cup C = A$	A ocorrência de A implica a de "B e C".
$(A \cup B \cup C) - (B \cup C) = A$	A ocorrência de A decorre de "B ou C".

Exercise 2.2 (BJ2)**.** A partir dos axiomas, prove a propriedade $P5$:

$$P\left(\bigcup_{n=i}^{\infty} A_n\right) \leq \sum_{n=1}^{\infty} P(A_n)$$

Proof. Consideremos uma prova por indução para $n \to \infty$:
Para $n = 2$:

$$P(A_1 \cup A_2) = P(A_1) + P(A_1^c \cap A_2)$$

Considerando que $(A_1^c \cap A_2) \subset A_2$ e o fato de que $(A_1) \cap (A_1^c \cap A_2) = \emptyset$, temos pela propriedade $P3$ que $P(A_1^c \cap A_2) \leq P(A_2)$, de modo que:

$$\begin{aligned} P(A_1 \cup A_2) &= P(A_1) + P(A_1^c \cap A_2) \leq P(A_2) \\ &\leq P(A_1) + P(A_2) \\ &\leq \sum_{i=1}^{2} P(A_i) \end{aligned}$$

De modo semelhante, podemos fazer para n:

$$\begin{aligned} P\left(\bigcup_{i=i}^{n} A_i\right) &= P(A_1) + P(A_1^c \cap A_2) + \dots \\ &\leq P(A_1) + P(A_2) + \dots \\ &\leq \sum_{i=1}^{n} P(A_i) \end{aligned}$$

Consideremos então uma sequência de eventos $A_i^*, \forall i \in \{n+1, n+2, \dots\}$, disjuntos de A_i. Denotemos ainda $A = (\bigcup_{i=1}^{n} A_i) \cup \left(\bigcup_{i=n+1}^{\infty} A_i\right)$. Pela aditividade infinita (ou ainda pela σ-aditividade), temos que:

$$P\left(\bigcup_{n=i}^{\infty} A_n\right) \leq \sum_{i=1}^{n} P(A_i) + P\left(\bigcup_{i=n+1}^{\infty} A_i\right)$$

Que por serem disjuntos, pelo axioma Ax_4 tem que $\left(\bigcup_{i=n+1}^{\infty} A_i\right) \downarrow \emptyset$, de modo que $P\left(\bigcup_{i=n+1}^{\infty} A_i\right) \to 0$. Logo, tem-se que:

$$P\left(\bigcup_{n=i}^{\infty} A_n\right) \leq \sum_{n=1}^{\infty} P(A_n)$$

□

Exercise 2.3 (BJ3)**.** Sejam $A_1, A_2, \dots$ eventos aleatórios. Mostre que:

a) $P\left(\bigcap_{k=1}^{n} A_k\right) \geq 1 - \sum_{k=1}^{n} P(A_k^c)$

Proof. Por De Morgan temos que $\bigcap_{k=1}^{n} A_k = \left(\bigcup_{k=1}^{n} A_k^c\right)^c$, de modo que:

$$
\begin{aligned}
P\left(\bigcap_{k=1}^{n} A_k\right) &= P\left(\bigcup_{k=1}^{n} A_k^c\right)^c \\
&= 1 - P\left(\bigcup_{k=1}^{n} A_k^c\right) \xRightarrow{\text{Por P4}} P\left(\bigcup_{k=1}^{n} A_k^c\right) \leq \sum_{k=1}^{n} P\left(A_k^c\right) \\
&\geq 1 - \sum_{k=1}^{n} P\left(A_k^c\right)
\end{aligned}
$$

□

b) Se $P(A_k) \geq 1 - \epsilon$ para $k = 1, 2, \ldots, n$, então $P(\bigcap_{k=1}^{n} A_k) \geq 1 - n\epsilon$

Proof. É fácil ver que:

$$P(A_k) \geq 1 - \epsilon \Rightarrow P(A_k^c) \leq 1 - (1 - \epsilon) = \epsilon$$

E de modo semelhante ao que foi feito na questão anterior (utilizando De Morgan), temos que:

$$
\begin{aligned}
P\left(\bigcap_{k=1}^{n} A_k\right) = P\left(\bigcup_{k=1}^{n} A_k^c\right)^c &= 1 - P\left(\bigcup_{k=1}^{n} A_k^c\right) \\
&\geq 1 - \sum_{k=1}^{n} P\left(A_k^c\right) \\
&\geq 1 - \sum_{k=1}^{n} \epsilon \\
&\geq 1 - n\epsilon
\end{aligned}
$$

□

c) $P\left(\bigcap_{k=1}^{\infty} A_k\right) \geq 1 - \sum_{k=1}^{\infty} P(A_k^c)$

Proof. De maneira semelhante ao que foi visto na prova da letra **a**, temos que:

$$
\begin{aligned}
P\left(\bigcap_{k=1}^{\infty} A_k\right) &= P\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} A_k^c\right)^c \\
&= 1 - P\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} A_k^c\right) \xRightarrow{\text{Por P5}} P\left(\bigcup_{k=1}^{n} A_k^c\right) \leq \sum_{k=1}^{\infty} P\left(A_k^c\right) \\
&\geq 1 - \sum_{k=1}^{\infty} P\left(A_k^c\right)
\end{aligned}
$$

Para ver a demonstração da propriedade $P5$, vide exercício 2.2. □

Exercise 2.4 (BJ4)**.** Demonstre as seguintes propriedades:

a) Se $P(A_n) = 0$ para $n = 1, 2, \ldots$, então $P\left(\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n\right) = 0$.

Proof. Utilizando a propriedade $P5$, temos que:

$$\begin{aligned}
P\left(\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n\right) &\leq \sum_{n=1}^{\infty} P(A_n) \\
&\leq \sum_{n=1}^{\infty} 0 \\
&\leq 0 \\
&\Big\downarrow \text{Por } P2 \\
P\left(\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n\right) &= 0
\end{aligned}$$

$\square$

b) Se $P(A_n) = 1$ para $n = 1, 2, \ldots$, então $P\left(\bigcap_{n=1}^{\infty} A_n\right) = 1$.

Proof. Levando em consideração que se $P(A_n) = 1 \Rightarrow P(A_n^c) = 0$ (pela propriedade $P1$), utilizando De Morgan e a prova da letra **c** do exercício 2.3, temos que:

$$\begin{aligned}
P\left(\bigcap_{n=1}^{\infty} A_n\right) &\geq 1 - \sum_{n=1}^{\infty} P(A_n^c) \\
&\geq 1 - \sum_{n=1}^{\infty} 0 \\
&\geq 1 - 0 \\
&\geq 1 \\
&\Big\downarrow \text{Por } P2 \\
P\left(\bigcap_{n=1}^{\infty} A_n\right) &= 1
\end{aligned}$$

$\square$

Exercise 2.5 (BJ6)**.** Seja Ω um conjunto não-vazio.

a) Prove: se $\mathcal{A}$ e $\mathcal{B}$ são σ-álgebras de subconjuntos de Ω, então $(\mathcal{A} \cap \mathcal{B})$ também é uma σ-álgebra.

Proof. Para que $\mathcal{A} \cap \mathcal{B}$ seja uma σ-álgebra, é necessário que cumpram-se os axiomas Ax_1, Ax_2 e Ax_3:

- Ax_1: Sabemos que $\Omega \in \mathcal{A}$ e $\Omega \in \mathcal{B}$, logo sabemos que $\Omega \in (\mathcal{A} \cap \mathcal{B})$;
- Ax_2: Seja um evento $E \in (\mathcal{A} \cap \mathcal{B})$, sabemos então que $E \in \mathcal{A}$ e $E \in \mathcal{B}$, logo $E^c \in \mathcal{A}$ e $E^c \in \mathcal{B}$, portanto $E^c \in (\mathcal{A} \cap \mathcal{B})$;
- Ax_3: Sejam dois eventos, $E_1 \in (\mathcal{A} \cap \mathcal{B})$ e $E_2 \in (\mathcal{A} \cap \mathcal{B})$. Com isso, temos que $E_1, E_2 \in \mathcal{A}$ e $E_1, E_2 \in \mathcal{B}$, portanto $(E_1 \cup E_2) \in \mathcal{A}$ e $E_1 \cup E_2 \in \mathcal{B}$, logo $(E_1 \cup E_2) \in (\mathcal{A} \cap \mathcal{B})$.

Como os três axiomas foram cumpridos, temos que $(\mathcal{A} \cap \mathcal{B})$ é uma σ-álgebra. $\square$

b) Generalize o item (a): se $\mathcal{A}_i, i \in \mathcal{I}$, são σ-álgebras de partes de Ω, onde $\mathcal{I}$ é um conjunto não-vazio de índices, então $\bigcap_{i \in \mathcal{I}} \mathcal{A}_i$ também é uma σ-álgebra.

Proof. Como anteriormente, temos que mostrar que $\bigcap_{i \in \mathcal{I}} \mathcal{A}_i$ cumpre os axiomas Ax_1, Ax_2 e Ax_3:

- Ax_1: Sabemos que $\Omega \in \mathcal{A}_i, \ \forall i \in \mathcal{I}$, logo sabemos que $\Omega \in \bigcap_{i\in\mathcal{I}} \mathcal{A}_i$;
- Ax_2: Seja um evento $E \in \bigcap_{i\in\mathcal{I}} \mathcal{A}_i$, sabemos então que $E \in \mathcal{A}_i, \ \forall i \in \mathcal{I}$, logo $E^c \in \mathcal{A}_i, \ \forall i \in \mathcal{A}$, portanto $E^c \in \bigcap_{i\in\mathcal{I}} \mathcal{A}_i$;
- Ax_3: Sejam dois eventos, $E_1 \in \bigcap_{i\in\mathcal{I}} \mathcal{A}_i$ e $E_2 \in \bigcap_{i\in\mathcal{I}} \mathcal{A}_i$. Com isso, temos que $E_1, E_2 \in \mathcal{A}_i, \ \forall i \in \mathcal{I}$, portanto $(E_1 \cup E_2) \in \mathcal{A}_i, \ \forall i \in \mathcal{I}$, logo $(E_1 \cup E_2) \in \bigcap_{i\in\mathcal{I}} \mathcal{A}_i$.

Vemos portanto que, por cumprir os axiomas Ax_1, Ax_2 e Ax_3, $\bigcap_{i\in\mathcal{I}} \mathcal{A}_i$ é também uma σ-álgebra. □

c) Seja $\mathbb{C}$ uma classe de subconjuntos de Ω. Mostre que existe *pelo menos uma* σ-álgebra que contém $\mathbb{C}$.

Proof. É fácil ver que a maior classe de subconjuntos de Ω é o conjunto das partes de Ω, denotado como $\mathcal{P}(\Omega)$ (definido no exemplo 2.3). Assim, temos que $\mathbb{C} \subseteq \mathcal{P}(\Omega)$, de modo que, pelo menos a σ-álgebra formada por $\mathcal{P}(\Omega)$ contém $\mathbb{C}$. □

d) Visando a plena utilização dos itens (b) e (c), como você definiria "a menor σ-álgebra contendo $\mathbb{C}$", onde $\mathcal{C}$ é uma classe de subconjuntos de Ω?

Proof. Considere que temos σ-álgebras de partes de Ω, $\mathcal{A}_i$ com $i \in \mathbb{I}$ (sendo $\mathbb{I}$ um conjunto não-vazio de índices), tais que $\mathbb{C} \in \mathcal{A}_i : \ \forall i \in \mathbb{I}$. Assim, sabemos que algum dos $\mathcal{A}_i$ é a menor σ-álgebra que contém $\mathbb{C}$, de modo que $\bigcap_{i\in\mathbb{I}} A_i$ será a menor σ-álgebra que contém $\mathbb{C}$. □

Exercise 2.6 (BJ9)**.** Uma caixa contém $2n$ sorvetes, n do sabor A e n do sabor B. De um grupo de $2n$ pessoas, $a < n$ preferem o sabor A, $b < n$ o sabor B e $2n - (a + b)$ não tem preferência. Demonstre: se os sorvetes são distribuídos ao acaso, a probabilidade de que a preferência de todas as pessoas seja respeitada é de $\binom{2n-a-b}{n-a}/\binom{2n}{n}$.

Proof. Sabendo que a ordem de entrega dos n sorvetes de cada sabor, para as $2n$ pessoas não importa, temos que a quantidade possível de entregas diferentes é:

$$|\Omega| = \binom{2n}{n}$$

Considere que o evento R indica o caso em que todos tiveram sua preferência respeitada. Podemos ver que:

$$P(R) = \frac{|R|}{|\Omega|} = \frac{|R|}{\binom{2n}{n}}$$

Para que R ocorra, é necessário que as a pessoas que preferem A recebam esse sabor, bem como as b pessoas que preferem B. Dessa forma, temos que distribuir os $2n - (a + b)$ sorvetes restantes para as pessoas que não tem preferência. Assim, primeiramente temos os $n - a$ sorvetes do sabor A que não foram alocados, de forma que:

$$\binom{2n-a-b}{n-a} = \frac{(2n-a-b)!}{(2n-a-b-n+a)!(n-a)!} = \frac{(2n-a-b)!}{(n-b)!(n-a)!} \tag{8}$$

E podemos mostrar que, caso fossemos alocar os $n - b$ sorvetes do sabor B para as $2n - (a + b)$ pessoas sem preferência, teríamos:

$$\binom{2n-a-b}{n-b} = \frac{(2n-a-b)!}{(2n-a-b-n+b)!(n-b)!} = \frac{(2n-a-b)!}{(n-a)!(n-b)!} \tag{9}$$

Como (8) e (8) são iguais, podemos ver que a alocação dos sorvetes restantes não depende de qual sabor já foi alocado. Assim, temos que $|R| = \binom{2n-a-b}{n-a} = \binom{2n-a-b}{n-b}$, portanto:

$$P(R) = \frac{|R|}{|\Omega|} = \frac{\binom{2n-a-b}{n-a}}{\binom{2n}{n}}$$

□

Exercise 2.7 (BJ10)**.** Suponhamos que dez cartas estejam numeradas de 1 até 10. Das dez cartas, retira-se uma de cada vez, ao acaso e sem reposição, até retirar-se o primeiro número par. Conta-se o número de retiradas necessárias. Exiba um bom modelo probabilístico para esse experimento.

Proof. Dada essa formulação, temos que 5 cartas são pares e 5 são ímpares. Assim, considere o evento $\{Y_k \ : 1 \leq k \leq 6; k \in \mathbb{Z}\}$ em que k indica que a k-ésima retirada contém a primeira carta par. Assim, por exemplo, Y_1 indica o evento em que a primeira carta retirada é par, Y_2 o evento em que a segunda carta retirada é par, e assim por diante.
O nosso espaço amostral é (visto que o número da carta não importa, apenas se é $P =$ "par" ou $I =$ "ímpar"):

$$\Omega = \{(P), (I, P), (I, I, P), (I, I, I, P), (I, I, I, I, P), (I, I, I, I, I, P)\}$$

É fácil ver que não é possível ter $\{Y_k : k \geq 7\}$, já que as cartas são retiradas sem reposição. Podemos facilmente calcular as probabilidades de cada evento em Ω, como segue:

$$\begin{aligned}
P(Y_1) &= \frac{5}{10} = \frac{1}{2} \\
P(Y_2) &= \frac{5}{10} \cdot \frac{5}{9} = \frac{5}{18} \\
P(Y_3) &= \frac{5}{10} \cdot \frac{4}{9} \cdot \frac{5}{8} = \frac{5}{36} \\
P(Y_4) &= \frac{5}{10} \cdot \frac{4}{9} \cdot \frac{3}{8} \cdot \frac{5}{7} = \frac{5}{84} \\
P(Y_5) &= \frac{5}{10} \cdot \frac{4}{9} \cdot \frac{3}{8} \cdot \frac{2}{7} \cdot \frac{5}{6} = \frac{5}{252} \\
P(Y_6) &= \frac{5}{10} \cdot \frac{4}{9} \cdot \frac{3}{8} \cdot \frac{2}{7} \cdot \frac{1}{6} \cdot \frac{5}{5} = \frac{1}{252}
\end{aligned}$$

Podemos ver que $\sum_{k=1}^{6} P(Y_k) = 1$, e além disso, podemos denotar as probabilidades a partir da seguinte função:

$$P(Y_k) = \frac{5}{11 - k} \cdot \prod_{n=1}^{k-1} \frac{6 - n}{11 - n} \tag{10}$$

A segunda parcela da equação (10) é válida para $k \geq 2$, pois ela representa as $k - 1$ cartas ímpares retiradas antes da primeira carta par, caso que só ocorre caso $k \geq 2$. □

Exercise 2.8 (BJ11)**.** Para cada um dos seguintes experimentos, descreva um espaço de probabilidade que sirva de modelo:

a) Seleciona-se um ponto, ao acaso, do quadrado unitário

$$\{(x, y) : 0 \leq x \leq 1, 0 \leq y \leq 1\}$$

Proof. Temos que:

$$\Omega = \{(x, y) \in [0, 1] \times [0, 1] \subset \mathbb{R}^2\}$$

Pela continuidade no vazio, é necessário que a probabilidade de ocorrência de um determinado ponto ser igual a zero, de modo que uma medida de probabilidade possível é por meio de intervalos. Considerando que $x \sim U(0, 1)$ e $y \sim U(0, 1)$ (ou seja, x e y são uniformemente distribuídos), podemos encontrar a probabilidade de $(x, y) \in \mathbb{I}$, com $\mathbb{I}$ sendo um intervalo no cartesiano $[0, 1] \times [0, 1] \in \mathbb{R}^2$, por meio da distribuição de probabilidade conjunta de x e y. □

b) Retiram-se cartas sucessivamente de um baralho de 52 cartas, ao acaso e *com* reposição, até retirar-se o primeiro rei. Registra-se o número total de retiradas.

Proof. Considere que $\{Y : Y \in \{1, 2, \dots\}\}$ indica a quantidade de retiradas necessárias até o primeiro rei. O espaço amostral é dado diretamente: $\Omega = \{1, 2, 3, \dots\}$. Temos que, para cada retirada, a probabilidade da carta ser um rei é $4/52 = 1/13$ (considerando que temos 4 reis no baralho), e a probabilidade de não ser é de $48/52 = 12/13$. Assim, a probabilidade de que a primeira retirada seja um rei é de:

$$P(Y = 1) = \frac{1}{13}$$

Caso isso não ocorra, a probabilidade de que o primeiro rei ocorra na segunda retirada é de:

$$P(Y = 2) = \frac{12}{13} \cdot \frac{1}{13}$$

É possível verificar que, para todo $n \in \mathcal{N}$ a probabilidade de que o primeiro rei ocorra na retirada n é de:

$$P(Y = n) = \left(\frac{12}{13}\right)^{n-1} \cdot \left(\frac{1}{13}\right)$$

Esse modelo de probabilidade é denotado modelo geométrico. □

c) Quinze bolas são retiradas, ao acaso e *com* reposição, de uma urna contendo 5 bolas vermelhas, 9 bolas pretas e uma bola branca. Observa-se o número que ocorre cada cor.

Proof. Sejam os eventos V, P e B o número de vezes que as retiradas foram de bolas vermelhas, pretas e brancas, respectivamente. É necessário (pela definição do modelo) que $V + P + B = 15$, mas consideremos o caso em que o número de retiradas seja n. Assim, para $n = 1$, o espaço amostral Ω é:

$$\Omega = \{(V), (P), (B)\}$$

E as probabilidades de cada evento são:

$$P(V = 1) = \frac{5}{15}$$
$$P(P = 1) = \frac{9}{15}$$
$$P(B = 1) = \frac{1}{15}$$

Para $n = 2$ bolas retiradas, temos que o espaço amostral é:

$$\begin{aligned}\Omega = \{&(V, V), (V, P), (V, B),\\ &(P, V), (P, P), (P, B),\\ &(B, V), (B, P), (B, B)\}\end{aligned}$$

E as probabilidades de cada evento são:

$$\begin{aligned}P(V, V) &= \frac{5}{15} \cdot \frac{5}{15}; P(V, P) = \frac{5}{15} \cdot \frac{9}{15}; P(V, B) = \frac{5}{15} \cdot \frac{1}{15};\\ P(P, V) &= \frac{9}{15} \cdot \frac{5}{15}; P(P, P) = \frac{9}{15} \cdot \frac{9}{15}; P(P, B) = \frac{9}{15} \cdot \frac{1}{15};\\ P(B, V) &= \frac{1}{15} \cdot \frac{5}{15}; P(B, P) = \frac{1}{15} \cdot \frac{9}{15}; P(B, B) = \frac{1}{15} \cdot \frac{1}{15}\end{aligned}$$

Aqui é possível ver o padrão que surge para esse problema. Temos que os eventos V, P, B formam uma permutação (com repetição) da quantidade de bolas retiradas. A fórmula para a permutação com repetição de n elementos, em que cada um aparece $k_1, k_2, \ldots k_j$ vezes é dada por:

$$P_n^{k_1,k_2,\ldots,k_j} = \frac{n!}{k_1! \cdot k_2! \cdot \cdots \cdot k_j!}$$

Assim, podemos considerar que cada evento irá aparecer uma quantidade $V = v, P = p, B = b$ de vezes, com a seguinte probabilidade:

$$P(V = v, P = p, B = b) = \frac{15!}{v!p!b!} \cdot \left(\frac{5}{15}\right)^v \cdot \left(\frac{9}{15}\right)^p \cdot \left(\frac{1}{15}\right)^b \text{ ; com } v + p + b = 15$$

Caso seja necessário, podemos ainda generalizar para uma quantidade $n : 1 \leq n \leq 15$ de retiradas:

$$P(V = v, P = p, B = b) = \frac{n!}{v!p!b!} \cdot \left(\frac{5}{15}\right)^v \cdot \left(\frac{9}{15}\right)^p \cdot \left(\frac{1}{15}\right)^b \text{ ; com } v + p + b = n$$

Em que verifica-se facilmente que é válido para os casos em que $n = 1$ e $n = 2$ demonstrados anteriormente. □

d) O experimento (**c**) é realizado *sem* reposição.

Proof. Como temos 15 bolas que serão retiradas *sem* reposição, o único evento possível após as 15 serem retiradas é:

$$\Omega = \{(V = 5, P = 9, B = 1)\}$$

E a probabilidade de isso ocorrer é 1 (visto que é o único evento no espaço amostral). Caso consideremos uma quantidade de retiradas $n < 15$, temos que o modelo de probabilidade é diferente. Consideremos que $V + P + B = n$ e que a quantidade de vezes que cada cor aparece é v, p e b, respectivamente. Então, como a ordem com que as cores são retiradas não importa, a probabilidade de aparecer uma quantidade de bolas de cada cor é dada por:

$$P(V = v, P = p, B = b) = \frac{\binom{5}{v}\binom{9}{p}\binom{1}{b}}{\binom{15}{n}}, \quad v + p + b = n$$

Esse modelo de probabilidade é chamado de multinomial hipergeométrico, e é uma generalização do modelo hipergeométrico para mais de duas classes (como é o caso). □

Exercise 2.9 (BJ12)**.** Retiram-se 4 cartas, ao acaso, de um baralho de 52 cartas. Registra-se o número de reis na amostra. Exiba um bom modelo probabilístico para este experimento se:

a) As retiradas são feitas *sem* reposição.

Proof. Considerando que em um baralho usual tem 52 cartas, e que a ordem com que cada uma das 4 cartas retiradas da amostra não importa (apenas importa a quantidade de reis na amostra), a quantidade total de amostras possíveis é $\binom{52}{4}$.
Como temos 4 reis no baralho, isso implica que há 48 cartas que são "não-reis". Dessa forma, se na amostra forem coletados k reis, serão coletados também $4 - k$ "não-reis", com os k reis podendo aparecer de $\binom{4}{k}$ maneiras diferentes (não importa qual o rei foi registrado) e os $4 - k$ "não-reis" podem aparecer de $\binom{48}{4-k}$ maneiras diferentes.
Assim, seja K o evento registrar k reis na amostra, a probabilidade $P(K = k)$ é dada por:

$$P(K = k) = \frac{\binom{4}{k}\binom{48}{4-k}}{\binom{52}{4}} \tag{11}$$

Esse modelo é chamado de hipergeométrico, que vale quando sabemos a quantidades de sucessos totais na população, e queremos contar a quantidade de sucessos coletados em uma amostra finita da população (que também deve ser finita). □

b) As retiradas são feitas *com* reposição.

Proof. Se as retiradas são feitas com reposição, a probabilidade de registrar um rei em cada retirada é de $4/52$ e a probabilidade de registrar um "não-rei" é de $48/52$. Como a ordem das retiradas não importa, podemos ver que em uma amostra de tamanho 4, os k reis podem aparecer de $\binom{4}{k}$ maneiras diferentes. Além disso, podemos ver que, como irão aparecer k reis na amostra, consequentemente irão aparecer $4-k$ "não-reis".
Assim, seja K o evento registrar k reis na amostra, a probabilidade $P(K=k)$ é dada por:

$$P(K=k) = \binom{4}{k}\left(\frac{4}{52}\right)^k\left(\frac{48}{52}\right)^{4-k} \tag{12}$$

Esse modelo é chamado de binomial, e vale quando queremos encontrar a probabilidade de ocorrer k sucessos em uma amostra de tamanho n, dado que a probabilidade de cada sucesso é fixa. □

c) Determine em que caso, (a) ou (b), é mais provável obter 4 reis.

Proof. Substituindo os valores de k em (11) e (12) para 4, podemos calcular as probabilidades em cada caso. Assim:

$$\begin{aligned} P(K=k) &= \frac{\binom{4}{4}\binom{48}{0}}{\binom{52}{4}} \approx 3.7\times 10^{-6} \\ P(K=k) &= \binom{4}{4}\left(\frac{4}{52}\right)^4\left(\frac{48}{52}\right)^0 \approx 3.5\times 10^{-5} \end{aligned}$$

De modo que é possível ver que no caso com reposição a probabilidade de encontrar 4 reis é maior. □

Exercise 2.10 (BJ13)**.**

a) Sejam A, B e C eventos aleatórios em um espaço de probabilidade $(\Omega, \mathcal{A}, P)$. Mostre que

$$P(A\cup B) = P(A) + P(B) - P(A\cap B)$$

e

$$P(A\cup B\cup C) = P(A) + P(B) + P(C) - P(A\cap B) - P(A\cap C) - P(B\cap C) + P(A\cap B\cap C)$$

Proof. Podemos escrever os eventos A e B como as seguintes uniões de eventos disjuntos:

$$\begin{aligned} A &= (A\cap B)\cup(A\cap B^c) \\ B &= (A\cap B)\cup(A^c\cap B) \end{aligned}$$

Utilizando a propriedade da aditividade finita $(P3)$, temos que:

$$\begin{aligned} P(A) = P(A\cap B) + P(A\cap B^c) &\Rightarrow P(A\cap B^c) = P(A) - P(A\cap B) \\ P(B) = P(A\cap B) + P(A^c\cap B) &\Rightarrow P(A^c\cap B) = P(B) - P(A\cap B) \end{aligned} \tag{13}$$

Além disso, podemos escrever o evento $(A\cup B)$ como a seguinte união disjunta de eventos:

$$(A\cup B) = (A\cap B^c)\cup(A^c\cap B)\cup(A\cap B)$$

Por fim, utilizando os resultados de (13) e a aditividade finita, temos que:

$$
\begin{aligned}
P(A \cup B) &= P(A \cap B^c) + P(A^c \cap B) + P(A \cap B) \\
&= P(A) - P(A \cap B) + P(B) - P(A \cap B) + P(A \cap B) \\
&= P(A) + P(B) - P(A \cap B)
\end{aligned}
$$

Para a segunda expressão, podemos levar em consideração que os conjuntos A, B e C podem ser escritos como uniões de eventos disjuntos da seguinte forma:

$$
\begin{aligned}
A &= (A \cap B^c \cap C^c) \cup (A \cap B \cap C^c) \cup (A \cap B^c \cap C) \cup (A \cap B \cap C) \\
B &= (A^c \cap B \cap C^c) \cup (A \cap B \cap C^c) \cup (A^c \cap B \cap C) \cup (A \cap B \cap C) \\
C &= (A^c \cap B^c \cap C) \cup (A^c \cap B \cap C) \cup (A \cap B^c \cap C) \cup (A \cap B \cap C)
\end{aligned}
$$

Nos utilizando novamente da aditividade finita, temos que:

$$
\begin{aligned}
P(A) &= P(A \cap B^c \cap C^c) + P(A \cap B \cap C^c) + P(A \cap B^c \cap C) + P(A \cap B \cap C) \\
P(B) &= P(A^c \cap B \cap C^c) + P(A \cap B \cap C^c) + P(A^c \cap B \cap C) + P(A \cap B \cap C) \\
P(C) &= P(A^c \cap B^c \cap C) + P(A^c \cap B \cap C) + P(A \cap B^c \cap C) + P(A \cap B \cap C)
\end{aligned}
$$

De maneira similar ao que fizemos na demonstração anterior, podemos isolar as probabilidades à direita, como por exemplo:

$$
P(A \cap B \cap C^c) = P(A) - P(A \cap B^c \cap C^c) - P(A \cap B^c \cap C) - P(A \cap B \cap C) \tag{14}
$$

Mas vale notar que, por serem eventos disjuntos:

$$
P(A \cap B^c \cap C^c) + P(A \cap B^c \cap C) = P(A - B) = P(A \cap B^c) = P(A) - P(A \cap B)
$$

De modo que a equação (14) pode ser reescrita como:

$$
\begin{aligned}
P(A \cap B \cap C^c) &= P(A) - P(A) + P(A \cap B) - P(A \cap B \cap C) \\
&= P(A \cap B) - P(A \cap B \cap C)
\end{aligned}
$$

Assim, podemos denotar as seguintes probabilidades:

$$
\begin{aligned}
P(A \cap B \cap C^c) &= P(A \cap B) - P(A \cap B \cap C) \\
P(A \cap B^c \cap C) &= P(A \cap C) - P(A \cap B \cap C) \\
P(A^c \cap B \cap C) &= P(B \cap C) - P(A \cap B \cap C)
\end{aligned} \tag{15}
$$

Utilizando os resultados de (15), podemos isolar as outras probabilidades, tais como:

$$
\begin{aligned}
P(A \cap B^c \cap C^c) &= P(A) - P(A \cap B \cap C^c) - P(A \cap B^c \cap C) - P(A \cap B \cap C) \\
&= P(A) - P(A \cap B) + P(A \cap B \cap C) - P(A \cap C) + P(A \cap B \cap C) - P(A \cap B \cap C) \\
&= P(A) - P(A \cap B) - P(A \cap C) + P(A \cap B \cap C)
\end{aligned}
$$

De modo que podemos denotar as seguintes probabilidades:

$$
\begin{aligned}
P(A \cap B^c \cap C^c) &= P(A) - P(A \cap B) - P(A \cap C) + P(A \cap B \cap C) \\
P(A^c \cap B \cap C^c) &= P(B) - P(A \cap B) - P(B \cap C) + P(A \cap B \cap C) \\
P(A^c \cap B^c \cap C) &= P(C) - P(A \cap C) - P(B \cap C) + P(A \cap B \cap C)
\end{aligned} \tag{16}
$$

O evento $(A \cup B \cup C)$ pode ser escrito como a seguinte união de eventos disjuntos (de fácil verificação que são disjuntos dois a dois):

$$\begin{aligned}(A \cup B \cup C) =&(A \cap B \cap C^c) \cup (A \cap B^c \cap C) \cup (A^c \cap B \cap C) \cup \\ &(A \cap B^c \cap C^c) \cup (A^c \cap B \cap C^c) \cup (A^c \cap B^c \cap C) \cup \\ &(A \cap B \cap C)\end{aligned} \tag{17}$$

Por fim, valendo-se da aditividade finita e substituindo em (17) os resultados obtidos em (15) e (16), temos que:

$$\begin{aligned}P(A \cup B \cup C) =&P(A \cap B \cap C^c) + P(A \cap B^c \cap C) + P(A^c \cap B \cap C) + P(A \cap B^c \cap C^c) + \\ &P(A^c \cap B \cap C^c) + P(A^c \cap B^c \cap C) + P(A \cap B \cap C) \\ =&P(A \cap B) - P(A \cap B \cap C) + P(A \cap C) - P(A \cap B \cap C) + P(B \cap C) - P(A \cap B \cap C) + \\ &P(A) - P(A \cap B) - P(A \cap C) + P(B) - P(A \cap B) - P(B \cap C) + P(C) - P(A \cap C) - \\ &P(B \cap C) + P(A \cap B \cap C) \\ =&P(A) + P(B) + P(C) - P(A \cap B) - P(A \cap C) - P(B \cap C) + P(A \cap B \cap C)\end{aligned}$$

□

b) Enuncie a generalização do item **(a)** para o caso da união de n eventos aleatórios.

Proof. Podemos ver que as demonstrações anteriores podem ser escritas como:

$$\begin{aligned}P\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_n\right) =&\sum_{i=1}^{n} P(A_i) - \sum_{1 \le i_1 < i_2 \le n} P(A_{i_1} \cap A_{i_2}) + \sum_{1 \le i_1 < i_2 < i_3 \le n} P(A_{i_1} \cap A_{i_2} \cap A_{i_3}) - \dots \\ &+ (-1)^{k-1} \sum_{1 \le i_1 < \cdots < i_k \le n} P(A_{i_1} \cap \cdots \cap A_{i_k})\end{aligned} \tag{18}$$

Esse é chamado de princípio de inclusão-exclusão. □

c) Prove as seguintes *desigualdades de Bonferroni*:

$$(i)\ \sum_{i=1}^{n} P(A_i) - \sum_{1 \le i < j \le n} P(A_i \cap A_j) \le P\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_n\right) \le \sum_{i=1}^{n} P(A_i) - \sum_{1 \le i < j \le n} P(A_i \cap A_j) + \sum_{1 \le i < j < k \le n} P(A_i \cap A_j \cap A_k)$$

Proof. Podemos demonstrar a primeira desigualdade utilizando a equação (18):

$$\begin{aligned}\sum_{i=1}^{n} P(A_i) - \sum_{1 \le i < j \le n} P(A_i \cap A_j) \le&P\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_n\right) \\ 0 \le&P\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_n\right) - \left(\sum_{i=1}^{n} P(A_i) - \sum_{1 \le i < j \le n} P(A_i \cap A_j\right) \\ 0 \le&\sum_{1 \le i < j < k \le n} P(A_i \cap A_j \cap A_k) - \sum_{1 \le i < j < k < l \le n} P(A_i \cap A_j \cap A_k \cap A_l) + \dots \\ &+ (-1)^{k-1} \sum_{1 \le i_1 < \cdots < i_k \le n} P(A_{i_1} \cap \cdots \cap A_{i_k})\end{aligned} \tag{19}$$

E como $(A_{i_1} \cap \dots \cap A_{i_n}) \subseteq (A_{i_1} \cap \dots \cap A_{i_{n-1}}) \Rightarrow P((A_{i_1} \cap \dots \cap A_{i_n})) \leq P((A_{i_1} \cap \dots \cap A_{i_{n-1}}))$, temos que a expressão (19) é maior que 0. Para a segunda desigualdade, vamos nos valer do mesmo princípio:

$$\begin{aligned}
P\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_n\right) &\leq \sum_{i=1}^{n} P(A_i) - \sum_{1\leq i<j\leq n} P(A_i \cap A_j) + \sum_{1\leq i<j<k\leq n} P(A_i \cap A_j \cap A_k) \\
0 &\leq \sum_{i=1}^{n} P(A_i) - \sum_{1\leq i<j\leq n} P(A_i \cap A_j) + \sum_{1\leq i<j<k\leq n} P(A_i \cap A_j \cap A_k) - \left(P\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_n\right)\right) \\
0 &\leq \sum_{1\leq i<j<k<l\leq n} P(A_i \cap A_j \cap A_k \cap A_l) - \ldots - (-1)^{k-1} \sum_{1\leq i_1<\dots<i_k\leq n} P(A_{i_1} \cap \dots \cap A_{i_k})
\end{aligned} \tag{20}$$

E da mesma forma que antes, é possível ver que a última expressão em (20) é maior que 0. □

(ii) Se k é ímpar, $k \leq n$, então:

$$\begin{aligned}
P\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_i\right) \leq \sum_{i=1}^{n} P(A_n) &- \sum_{1\leq i_1<i_2\leq n} P(A_{i_1} \cap A_{i_2}) + \ldots \\
&+ (-1)^{k-1} \sum_{1\leq i_1<\dots<i_k\leq n} P(A_{i_1} \cap \dots \cap A_{i_k});
\end{aligned}$$

se k é par, $k \leq n$, vale $\geq$ nesta última desigualdade.

Proof. Como $k \leq n$, podemos separar a desigualdade em dois casos:

1. $k = n$;
2. $k < n$;

No primeiro caso é fácil ver que a expressão se iguala à generalização para a união dada em (18). Para o segundo caso, temos que:

$$\begin{aligned}
P\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_i\right) =& \sum_{i=1}^{n} P(A_i) - \sum_{1\leq i_1<i_2\leq n} P(A_{i_1} \cap A_{i_2}) + \ldots \\
&+\ (-1)^{k-1} \underbrace{\sum_{1\leq i_1<\dots<i_{k-1}<i_k} P(A_{i_1} \cap \dots \cap A_{i_k})}_{\text{Termo k}}\ +\ (-1)^{k} \underbrace{\sum_{1\leq i_1<\dots<i_k<i_{k+1}} P(A_{i_1} \cap \dots \cap A_{i_{k+1}})}_{\text{Termo k+1}}\ + \ldots
\end{aligned}$$

Como k é ímpar, o termo k será positivo e o termo $k+1$ será negativo. Assim, se subtrairmos os $k+j,\ j \in \{1, \ldots, n-k\}$ termos de ambos os lados, teremos:

$$\begin{aligned}
P\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_i\right) - \left((-1)^{k} \sum_{1\leq i_1<\dots<i_k<i_{k+1}} P(A_{i_1} \cap \dots \cap A_{i_{k+1}}) + \ldots\right) =& \sum_{i=1}^{n} P(A_i) - \sum_{1\leq i_1<i_2\leq n} P(A_{i_1} \cap A_{i_2}) + \ldots \\
&+ (-1)^{k-1} \sum_{1\leq i_1<\dots<i_{k-1}<i_k} P(A_{i_1} \cap \dots \cap A_{i_k})
\end{aligned}$$

E podemos ver que:

$$P\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_i\right) - \left((-1)^{k} \sum_{1\leq i_1<\dots<i_k<i_{k+1}} P(A_{i_1} \cap \dots \cap A_{i_{k+1}}) + \ldots\right) \geq P\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_i\right)$$

De modo que:

$$P\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_i\right) \leq \sum_{i=1}^{n} P(A_n) - \sum_{1\leq i_1<i_2\leq n} P(A_{i_1}\cap A_{i_2}) + \dots$$
$$+ (-1)^{k-1} \sum_{1\leq i_1<\cdots<i_{k-1}<i_k} P(A_{i_1}\cap\cdots\cap A_{i_k})$$

Se k for par, o termo k será negativo e o termo $k+1$ será positivo, de modo que a desigualdade anterior se inverte, ao fazer a subtração dos $k+j,\ j\in\{1,\dots,n-k\}$ termos na igualdade. □

Exercise 2.11 (BJ15)**.** Suponha que n cartas numeradas de 1 até n sejam embaralhadas e retiradas uma por uma, sem reposição, até todas as cartas serem retiradas. Qual a probabilidade de que para pelo menos uma carta, o número da carta coincida com o número da retirada?

Proof. Seja A_i o evento em que o número da carta i coincidiu com o número da retirada. Podemos ver que, o caso em que para pelo menos uma delas coincida é equivalente a $\bigcup_{i=1}^{n} A_i$. Dessa maneira, podemos ver que a probabilidade de isso ocorrer é:

$$P\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_i\right) = \sum_{i=1}^{n} P(A_n) - \sum_{1\leq i_1<i_2\leq n} P(A_{i_1}\cap A_{i_2}) + \dots$$
$$+ (-1)^{k-1} \sum_{1\leq i_1<\cdots<i_k\leq n} P(A_{i_1}\cap\cdots\cap A_{i_k});$$

O primeiro termo pode ser demonstrado como sendo:

$$\sum_{i=1}^{n} P(A_n) = P(A_1)+P(A_2)+\cdots+P(A_n) = \sum_{i=1}^{n}\frac{1}{n} = 1$$

Para o termo de intercessão dois a dois, temos que a probabilidade de que o número na primeira carta ser igual a o número da retirada é de $1/n$, e o da segunda carta o ser é de $1/(n-1)$, e como temos $\binom{n}{2}$ combinações diferentes de retiradas, temos que a probabilidade do segundo termo é:

$$\sum_{1\leq i_1<i_2\leq n} P(A_{i_1}\cap A_{i_2}) = P(A_1\cap A_2)+P(A_1\cap A_3)+\cdots+P(A_{n-1}\cap A_n)$$
$$= \frac{\binom{n}{2}}{n\cdot(n-1)} = \frac{n!}{(n-2)!2!}\cdot\frac{1}{n\cdot(n-1)} = \frac{n!}{n!2!} = \frac{1}{2!}$$

Assim, podemos ver que para qualquer termo teremos:

$$\sum_{1\leq i_1<\cdots<i_k\leq n} P(A_{i_1}\cap\cdots\cap A_{i_k}) = \frac{1}{k!}$$

De modo que a probabilidade da união dos eventos se resume à série:

$$P\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_i\right) = \frac{1}{1!}-\frac{1}{2!}+\frac{1}{3!}-\cdots+(-1)^{k-1}\frac{1}{k!}$$

□

Exercise 2.12 (BJ16)**.** Seja $(\Omega,\mathcal{A},P)$ um espaço de probabilidade e suponha que todos os conjuntos abaixo pertençam a $\mathcal{A}$. Prove:

a) Se os A_n são disjuntos e $P(B|A_n) \geq c$ para todo n, então $P(B|\bigcup_{n=1}^{k} A_n) \geq c$ (pode supor $P(A_n) > 0$ para todo n).

Proof. Sabemos que $A_i \cap A_j = \emptyset$, $\forall i, j$. Dito isso, podemos ver que a seguinte relação é válida:

$$P(B|A_n) = \frac{P(A_n \cap B)}{P(A_n)} \geq c$$

$$P(A_n \cap B) \geq cP(A_n) \tag{21}$$

Além disso, podemos desenvolver $P(B|\bigcup_{n=1}^{k} A_n)$ da seguinte forma:

$$P\left(B \,\middle|\, \bigcup_{n=1}^{k} A_n\right) = \frac{P\left(B \cap (A_1 \cup A_2 \cdots \cap A_k)\right)}{P\left(\bigcup_{n=1}^{k} A_n\right)}$$

$$= \frac{P\left((A_1 \cap B) \cup (A_2 \cap B) \cup \cdots \cup (A_k \cap B)\right)}{\sum_{n=1}^{k} P(A_n)}$$

$$P\left(B \,\middle|\, \bigcup_{n=1}^{k} A_n\right) = \frac{\sum_{n=1}^{k} P(A_n \cap B)}{\sum_{n=1}^{k} P(A_n)} \tag{22}$$

O denominador de (22) é simplesmente o somatório das probabilidades dos A_n's pelo fato de que eles são disjuntos (definidos no enunciado da questão). Agora, considerando que a relação (21) é válida para todos os A_n's, vamos somar todas as probabilidades para os $n \in \{1, 2, \ldots, k\}$:

$$P(A_1 \cap B) + P(A_2 \cap B) + \cdots + P(A_k \cap B) \geq cP(A_1) + cP(A_2) + \cdots + cP(A_k)$$
$$\sum_{n=1}^{k} P(A_n \cap B) \geq \sum_{n=1}^{k} cP(A_n)$$
$$\sum_{n=1}^{k} P(A_n \cap B) \geq c \sum_{n=1}^{k} P(A_n)$$
$$\frac{\sum_{n=1}^{k} P(A_n \cap B)}{\sum_{n=1}^{k} P(A_n)} \geq c$$

$$P\left(B \,\middle|\, \bigcup_{n=1}^{k} A_n\right) \geq c$$

□

3 Variáveis Aleatórias

Example 3.1. Considere um experimento em que uma moeda é lançada duas vezes. Seja X = total de caras nos dois lançamentos. Denotemos o evento cara como H e coroa como T. Logo:

Espaço Amostral (Ω)	X
HT	1
TH	1
HH	2
TT	0

Logo, $X : \mathcal{F} \to \mathbb{R}$. Vale também que, $\forall x$ valor na imagem de X, $X^{-1}(x) \in \mathcal{F}$. Por exemplo:

$$x = 1 \Rightarrow X^{-1}(1) = \{HT, TH\}$$
$$x = 2 \Rightarrow X^{-1}(2) = \{HH\}$$
$$x = 0 \Rightarrow X^{-1}(0) = \{TT\}$$