

Tarea 6 - Análisis de datos
Giovanni Gamaliel López Padilla

Problema 1

Verifica que la información mutua está bien definida. Es decir

$$I(X, Y) = I(Y, X)$$

Problema 2

Sea $\mathbf{X}=(X_1, X_2, X_3) \sim \mathcal{N}(\mu, \Sigma)$ con

$$\mu^T = (2, -3, 1) \quad \Sigma = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 1 & 3 & 2 \\ 1 & 2 & 2 \end{pmatrix}$$

a) Encuentra la distribución de $X_1 + X_2 - X_3$.

Sea $X_i \sim \mathcal{N}(\mu_i, \Sigma_{ii})$, entonces se tiene que:

$$Y = \sum_{i=1}^3 a_i X_i$$

la cual es una combinación lineal de X_1, X_2, X_3 donde $a = \{1, 1, -1\}$. Entonces $Y \sim N(EY, Var(Y))$. Calculando EY , se tiene lo siguiente:

$$\begin{aligned} EY &= E(X_1 + X_2 - X_3) \\ &= EX_1 + EX_2 - EX_3 \\ &= 2 - 3 - 1 \\ EY &= -2 \end{aligned}$$

Calculando $Var(Y)$ se tiene lo siguiente:

$$\begin{aligned} Var(Y) &= Var(X_1 + X_2 - X_3) \\ &= Var(X_1) + Var(X_2) + (-1)^2 Var(X_3) + 2Cov(X_1, X_2) + 2Cov(X_2, -X_3) + 2Cov(X_1, -X_3) \end{aligned}$$

b) Calcula $EX_1|X_2=2$

c) Encuentra un vector \mathbf{v} tal que X_2 y $X_2 - \mathbf{v}^T \begin{pmatrix} X_1 \\ X_3 \end{pmatrix}$ sean independientes.

Problema 3

Supongamos que se quiere estimar el número promedio μ de amigos que alguien tiene en Facebook. Se toma una muestra de personas y ellos eligen al azar algunos de sus amigos en Facebook. Se calcula el promedio del número de amigos que estos amigos tienen. Aunque suponemos independencia, argumenta que en general se va a sobrestimar μ de esta manera.

Problema 6

Sea X una variable aleatoria que toma valores en $\{1, 2, 4\}$. Define $\theta = (\theta_1, \theta_2, \theta_3)$ donde $\theta_i = P(X = i)$. Supongamos que tenemos una muestra con n_i observaciones igual a i , $i=1,2,3$. Calcula $l(\theta)$ y el estimador de máxima verosimilitud.

Problema 7

Considera el siguiente método para estimar el tamaño (N) de una población de animales de un especie particular. Primero se capturan M animales, los marcan y son puestos de nuevo en libertad. Un tiempo más tarde se capturan animales hasta encontrar un animal marcado. Sea X el número total de animales capturados (X incluye el animal marcado). Después se dejan todos los animales en libertad. Se repite lo anterior de tal forma que se obtenga una muestra $\{x_1, x_2, \dots, x_n\}$ de X (así este procedimiento puede tardar bastante). Puedes suponer que en cada momento la probabilidad de capturar un animal marcado es siempre igual (así se supone que N es mucho mayor que M).

a) Demuestre que:

$$P(X = x) = \frac{M}{N} \left(1 - \frac{M}{N}\right)^{x-1}, \quad x = 1, 2, \dots$$

b) Demuestra que:

$$\hat{\Theta}_n = \frac{M}{N} \sum_{i=1}^n X_i$$

es el estimador de Máximo verosimilitud. ¿Está insesgado? ¿Qué puedes decir si $n \rightarrow \infty$?