Risposte Foglio1

Giulia Coucorde, Andrea Cacioli, Lorenzo Dentis 914833

8 novembre 2022

1 Esercizio 1

Sia X una v.a che assume il valore 1 con probabilità p e $(-N)$ con probabilità $1-p$. Qui N è una v.a. di Poisson di parametro λ

$$X = \begin{cases} 1 & p \\ -N & 1-p \end{cases} \tag{1}$$

$$N \sim Pois(\lambda)$$

1.a

Determinare il valore di λ per cui $\mathbb{E}(X) = 0$.
Per il teorema dell'attesa totale, $\mathbb{E}[X] = \sum_{i=1}^{n} \mathbb{E}[X|A_i]P(A_i)$ con $A_1, ..., A_n$ eventi a due a due disgiunti che formano una partizione di E, possiamo affermare che

$$\begin{aligned} \mathbb{E}[X] =& P(X=1) * E[1|X=1] + P(X=-N) * \mathbb{E}[-N|X=-N] = \\ =& p + (1-p) * \mathbb{E}[-N] = \\ & \textit{essendo } N \sim \textit{Poisson}(\lambda) \textit{ vale } \mathbb{E}[N] = \lambda \\ =& p - \lambda(1-p) \end{aligned}$$

$$\lambda = \frac{p}{1-p}$$

1.b

Calcolare $Var(X)$. Usando la definizione di varianza, $Var(X) = \mathbb{E}[X^2] - \mathbb{E}[X]^2$ ed il valore dell'attesa calcolato in sezione 1.a, scriviamo:

$$Var(X) = E[X^2] - [p - \lambda(1-p)]^2 \tag{2}$$

Analogmantente al punto precedente si può calcolare $\mathbb{E}[X^2]$

$$\begin{aligned} \mathbb{E}[X^2] &= p * \mathbb{E}[1^2] + (1-p)\mathbb{E}[(-N)^2] = \\ &= p + (1-p)(\lambda + \lambda^2) = p + \lambda + \lambda^2 - p\lambda - p\lambda^2 = \\ &= p(1 - \lambda - \lambda^2) + \lambda(1+\lambda) \end{aligned}$$

Sostituendo nella equazione(2)

$$Var(X) = p(1 - \lambda - \lambda^2) + \lambda(1+\lambda) - (p - \lambda(1-p))^2$$

1.c

Sia $\{X_i\}i = 1, 2, ...$ una successione di v.a. distribuite come X e sia $Y = \sum_{i=1}^{M}$, con M v.a. di Poisson di parametro β, indipendente dalle X_i. Determinare $\mathbb{E}(Y)$.

$Y = \sum_{i=1}^{M} X_i$
$M \sim Pois(\beta)$.
Chiamiamo $\mathbb{E}(X_i) = p - \lambda + \lambda p = \mu$
$\mathbb{E}(Y) = \sum_{m=1}^{\infty} \mathbb{E}[Y|M = m]P(M = m)$

Data $M \sim Pois(\beta)$ allora $P(M = m) = \frac{\beta^m}{m!}e^{-\beta}$.
Invece

$$\mathbb{E}[Y|M = m] = \mathbb{E}[\sum_{i=1}^{m}] = \textit{ per linearità}$$
$$= \sum_{i=1}^{m} \mathbb{E}[X_i] = m\mu$$

Quindi

$$\begin{aligned}
\mathbb{E}[y] &= \sum_{m=1}^{\infty} m\mu \qquad \frac{\beta^m}{m!}e^{-\beta} = \\
&= e^{-\beta}\mu \sum_{m=1}^{\infty} m\frac{\beta^m}{m!} = \\
&= e^{-\beta}\mu \sum_{m=1}^{\infty} \frac{\beta^m}{(m-1)!} = \\
&= \textit{ semplificando con Wolfram Alpha } = \\
&= \beta\mu
\end{aligned}$$

Questo esercizio poteva essere alternativamente risolto utilizzando il *teorema della doppia attesa* e quindi ponendo $\mathbb{E}(Y) = \mathbb{E}[\sum_{i=1}^{N} X_i] = \mathbb{E}[\mathbb{E}[\sum_{i=1}^{N} X_i|N]]$. Condizionando su N e svolgendo i calcoli analogamente a quanto fatto in classe saremmo giunti alla seguente uguaglianza:

$$\mathbb{E}[Y] = \mathbb{E}[\sum_{i=1}^{N} X_i] = \mathbb{E}[N] * \mathbb{E}[X] = \beta\mu$$

2 Esercizio 2

Alla stazione di partenza di un treno salgono K persone, con K v.a. distribuita secondo Poisson, di parametro $\lambda = 100$. Il treno effettua un'unica fermata prima dell'arrivo a destinazione. Alla fermata ogni persona scende, con uguale probabilità p.

$$K \sim Pois(100) \qquad\qquad X \sim Binom(K, p)$$

$$f_K(k) = \frac{\lambda^k}{k!}e^{-\lambda} \qquad\qquad f_X(x) = \binom{k}{x} p^x (1-p)^{k-x}$$

$$\mathbb{E}(k) = \lambda = 100 \qquad\qquad \mathbb{E}(X) = kp$$

Creiamo inoltre una nuova v.a. $Z = K - X$ che conta il numero di persone rimaste sul treno.

2.a

Se nessun nuovo passeggero sale alla fermata intermedia, determinare la probabilità che il treno arrivi alla stazione di destinazione finale con almeno 90 passeggeri.

Si sta cercando $P(Z \geq 90)$.

$$\begin{aligned}
f_Z(z) = &\sum_{k=0}^{\infty} \underbrace{P(k - X = z | K = k)}_{\binom{k}{k-z}p^{k-z}(1-p)^z} \underbrace{P(K = k)}_{\frac{\lambda^k}{k!}e^{-\lambda}} = \\
&= \sum_{k=0}^{\infty} \frac{k!}{(k-z)!z!} p^{k-z} (1-p)^z \frac{\lambda^k}{k!} e^{-\lambda} = \\
&= \textit{portando fuori dalla sommatoria i termini non correlati a } k = \\
&= \frac{e^{-\lambda}(1-p)^z}{z!} \sum_{k=0}^{\infty} \frac{k!}{(k-z)!} p^{k-z} \frac{\lambda^k}{k!} = \frac{e^{-\lambda}(1-p)^z}{z!} \sum_{k=0}^{\infty} \frac{p^{k-z}\lambda^k}{(k-z)!} = \\
&= \textit{moltiplicando e dividendo } \lambda^{k-z} = \\
&= \frac{e^{-\lambda}(1-p)^z}{z!} \sum_{k=0}^{\infty} \frac{p^{k-z}\lambda^k}{(k-z)!} * \lambda^{k-z}\lambda^{z-k} = \\
&= \frac{e^{-\lambda}(1-p)^z\lambda^z}{z!} \sum_{k=0}^{\infty} \frac{p^{k-z}\lambda^k\lambda^{k-z}}{(k-z)!\lambda^k} = \\
&= \frac{e^{-\lambda}(1-p)^z\lambda^z}{z!} \underbrace{\sum_{k=0}^{\infty} \frac{(p\lambda)^{k-z}}{(k-z)!}}_{e^{p\lambda}} = \\
&= \frac{e^{p\lambda}e^{-\lambda}(1-p)^z\lambda^z}{z!} = e^{p\lambda-\lambda}\frac{(\lambda-\lambda p)^z}{z!} = Pois(\lambda - \lambda p)
\end{aligned}$$

Quindi $F_Z(z) = \sum_{i=0}^{z} f_Z(i) = P(Z < z)$.

$$P(Z \geq 90) = 1 - P(Z < 90) = 1 - f_Z(89)$$

2.b

Se nessun nuovo passeggero sale alla fermata intermedia, determinare il numero medio di passeggeri presenti all'arrivo alla destinazione finale.

Ricordiamo $\mathbb{E}[k] = k = 100$.

$$\begin{aligned}
\mathbb{E}[Z] &= [def]\mathbb{E}[K - X] = \mathbb{E}[K] - \mathbb{E}[X] \ \textit{per linearità dell'attesa} \\
&= 100 - \sum_{k=1}^{\infty} \mathbb{E}[X|K = k] f_K(k) = \ \textit{data } X \sim Binom(k, p) = \\
&= 100 - \sum_{k=1}^{\infty} \mathbb{E}[kp] f_K(k) = \ \textit{essendo } k \textit{ e } p \textit{ due costanti} = \\
&= 100 - \sum_{k=1}^{\infty} kp f_K(k) = 100 - p \sum_{k=1}^{\infty} k f_K(k) =
\end{aligned}$$

Per definizione di attesa $\sum_{k=1}^{\infty} k f_K(k) = \mathbb{E}[k] = \lambda = 100$

$$\mathbb{E}[Z] = 100 - 100p$$

2.c

Si supponga che alla fermata intermedia salga un numero M di passeggeri, con M v.a. indipendente da K, v.a. di Poisson di parametro $\beta = 50$. Si determini il numero medio di passeggeri che arriva alla destinazione finale.

$M \sim Pois(\beta)$ con $\beta = 50$ quindi $\mathbb{E}(M) = 50$.
Supponendo che ogni passeggero salito alla fermata intermedia non scenda immediatamente $\mathbb{E}[Z + M] = \mathbb{E}[Z] + E[M]$. Dalla sezione 2.b conosciamo $\mathbb{E}[Z] = 100 - 100p$, quindi:

$$\mathbb{E}[Z + M] = 100 - 100p + 50 = 150 - 100p$$

3 Esercizio 3

3.a

Dimostriamo che

$$\mathbb{E}[X|X] + \mathbb{E}[Y|Y] = X + Y$$

Si noti che per ogni v.a. Z si ha per definizione:

$$\mathbb{E}[Z|Z] = \begin{cases} \mathbb{E}[Z|Z = z_1] & P(Z = z_1) \\ \mathbb{E}[Z|Z = z_2] & P(Z = z_2) \\ \vdots & \\ \mathbb{E}[Z|Z = z_n] & P(Z = z_n) \end{cases}$$

Ma siccome:

$$\mathbb{E}[Z|Z = z_1] = \mathbb{E}[z_1] = z_1$$

Il sistema precedente si puó riscrivere come:

$$\mathbb{E}[Z|Z] = \begin{cases} z_1 & P(Z = z_1) \\ z_2 & P(Z = z_2) \\ \vdots & \\ z_n & P(Z = z_n) \end{cases}$$

Questa é la definizione di Z, pertanto siccome questo vale per tutte le v.a., vale anche per X e Y.
Quindi vero.

3.b

Dimostriamo
$$\mathbb{E}[X+Y||X|=x] \neq x+Y$$
Siccome l'attesa della somma é la somma delle attese (Linearitá dell'attesa condizionata):

$$\mathbb{E}[X+Y||X|=x] = \mathbb{E}[X||X|=x] + \mathbb{E}[Y||X|=x]$$

La prima attesa puó essere riscritta nel seguente modo separando i due casi possibili del valore assoluto:

$$\mathbb{E}[X||X|=x] = x\frac{P(X=x)}{P(X=x)+P(X=-x)} - x\frac{P(X=-x)}{P(X=x)+P(X=-x)} =$$

$$= x\frac{f_X(x)-f_X(-x)}{f_X(x)+f_X(-x)}$$
Siccome é quindi ovvio che tale risultato é diverso da x, vorremmo capire sotto quali ipotesi vale che
$$x = x\frac{f_X(x)-f_X(-x)}{f_X(x)+f_X(-x)}$$
Svolgendo gli opportuni calcoli, si arriva trova che

$$\forall x<0 \quad f_X(x)=0$$

Sotto queste ipotesi, occorre solamente supporre che

$$\mathbb{E}[Y||X|=x] = Y$$

Questo é vero se X e Y sono indipendenti e $Y=\mathbb{E}[Y]$
Inoltre $Y=\mathbb{E}[Y]$ avviene sempre se per qualche k

$$Y = \begin{cases} k & p=1 \end{cases}$$

Quindi falso in generale.
Ma

$$\mathbb{E}[X+Y||X|=x] = x+Y \iff \begin{cases} \text{X e Y sono Indipendenti} \\ \forall x<0 \quad f_X(x)=0 \\ Y \text{ degenere} \end{cases}$$

3.c

Dimostriamo che

$$\mathbb{E}[X||X|] \neq \mathbb{E}[X|X]$$

Come visto al punto 3.a, $\mathbb{E}[X|X] = X$, inoltre:

$$\mathbb{E}[X||X|] = \begin{cases} \mathbb{E}[X||X| = x_1] & P(|X| = x_1) \\ \mathbb{E}[X||X| = x_2] & P(|X| = x_2) \\ \vdots & \\ \mathbb{E}[X||X| = x_n] & P(|X| = x_n) \end{cases}$$

Tuttavia, come visto al punto 3.b,

$$\mathbb{E}[X||X| = x] = x\frac{f_X(x) - f_X(-x)}{f_X(x) + f_X(-x)}$$

Inoltre

$$P(|X| = x) \neq P(X = x)$$

Quindi falso.
Per fare in modo che questa relazione diventi vera, dovremmo trovarci sotto le stesse ipotesi dell'esercizio precedente:

$$\mathbb{E}[X||X|] = \mathbb{E}[X|X] \iff \forall x < 0 \quad f_X(x) = 0$$

4 Esercizio 4