

# PROBABILIDADE E ESTATÍSTICA

## AULA 2 – INTEGRAÇÃO E EXPECTATIVA

Luis A. F. Alvarez

8 de fevereiro de 2025

# INTEGRAL DE LEBESGUE

- Nesta aula, partiremos de um espaço de medida  $(\Omega, \Sigma, \mu)$  e definiremos, para uma função mensurável  $f : \Omega \mapsto \mathbb{R}$ , a integral de Lebesgue com respeito a  $\mu$ .
  - Como veremos, essa noção de integral *estende* a noção de integral de Riemann para uma classe mais ampla de funções e espaços subjacentes.
  - Esse conceito de integral será fundamental para a definição formal de esperança condicional.

# FUNÇÕES SIMPLES

- Seja  $(\Omega, \Sigma, \mu)$  um espaço de medida.
- Uma função  $f : \Omega \mapsto \mathbb{R} \cup \{-\infty, \infty\}$  é dita simples se existem  $k \in \mathbb{N}$  e  $E_1, E_2, \dots, E_k \in \Sigma$ ,  $a_1, \dots, a_k \in \mathbb{R} \cup \{-\infty, \infty\}$  tais que:

$$f(\omega) = \sum_{i=1}^k a_i \mathbf{1}_{E_i}(\omega), \quad \omega \in \Omega$$

onde  $\mathbf{1}_A(\omega) = \begin{cases} 1 & \text{se } \omega \in A \\ 0 & \text{se } \omega \notin A \end{cases}$  é a função indicadora do conjunto  $A$ .

- **Convenção:** se  $\mathbf{1}_{E_i}(\omega) = 0$  e  $a_i = \pm\infty$ , então  $\mathbf{1}_{E_i}(\omega)a_i = 0$
- Fácil ver que  $f$  é mensurável.
  - Também fácil ver que, sem perda de generalidade, podemos tomar os  $E_i$  como disjuntos.

# INTEGRAL DE LEBESGUE DE FUNÇÕES SIMPLES NÃO NEGATIVAS

- Seja  $f$  uma função simples **não negativa**. A integral de Lebesgue com respeito a  $\mu$ , denotada por  $\mu(f)$  ou  $\int f(\omega)\mu(d\omega)$  ou  $\int f d\mu$ , é definida por:

$$\int f(\omega)\mu(d\omega) := \sum_{i=1}^k a_i \mu(E_i).$$

- Fácil de ver que integral está bem-definida (para duas expressões distintas da função simples em termos de conjuntos finitos, expressão dará a mesma coisa).
- Integral será um elemento de  $[0, \infty]$

# INTEGRAL DE LEBESGUE DE FUNÇÕES MENSURÁVEIS NÃO NEGATIVAS

- Seja  $f : \Omega \mapsto [0, \infty]$  uma função mensurável não negativa. Definimos a integral de Lebesgue como:

$$\mu(f) := \sup(\mu(g) : g \text{ simples e não negativa, } g \leq f).$$

## LEMA

*Seja  $f \geq 0$  mensurável.*

- Se  $\mu(f) < \infty$ , então,  $\mu(\{\omega : f(\omega) = \infty\}) = 0$ .
- Se  $\mu(f) = 0$ , então  $\mu(\{\omega : f(\omega) > 0\}) = 0$ .
- Seja  $g \geq 0$  mensurável. Se  $\mu(\{\omega : g(\omega) \neq f(\omega)\}) = 0$ , então  $\mu(f) = \mu(g)$ .
- **Obs:** Quando uma afirmação é válida a não ser em um conjunto de pontos  $\omega$  de medida zero, dizemos que ela vale em  $\mu$ -quase todo ponto ( $\mu$ -q.t.p.).
  - Se  $\mu$  é medida de probabilidade, equivalente ao qualificador “quase certamente” visto em aula anterior.

## TEOREMA DA COVERGÊNCIA MONÓTONA

- Seja  $(f_n)_n$  uma sequência de funções mensuráveis. Dizemos que  $f_n$  converge a uma função  $f$  em  $\mu$ -quase todo ponto se  $\mu(\{\omega : f_n(\omega) \not\rightarrow f(\omega)\}) = 0$ .
  - Medida do evento em que não há convergência é zero.
- Como  $f$  é mensurável (por quê?), se  $f_n \geq 0$  para todo  $n$ , podemos nos perguntar se:

$$\int f_n d\mu \rightarrow \int f d\mu,$$

i.e. podemos passar o limite por “debaixo” da integral?

- Resposta é verdadeira se a convergência for **monótona** em  $\mu$ -quase todo ponto, i.e.  $\mu(\{\omega : f_n(\omega) \uparrow f(\omega)\}^c) = 0$ .

### TEOREMA (CONVERGÊNCIA MONÓTONA)

*Seja  $(f_n)_n$  uma sequência de funções não negativas mensuráveis tais que  $f_n \uparrow f$  em  $\mu$ -quase todo ponto. Então.*

$$\mu(f_n) \uparrow \mu(f) \leq \infty$$

# CONSTRUINDO APROXIMAÇÃO MONOTÔNICAS

- Em alguns contextos, é interessante construir funções monotônicas que aproximam uma dada função não negativa  $f$ .
- Uma construção bastante comum é dada por  $f_n = s_n \circ f$ , onde  $s_n$  são funções escada da forma:

$$s_n(y) = \begin{cases} 0 & \text{se } y = 0 \\ \frac{(j-1)n}{2^n}, & \text{se } y \in \left( \frac{(j-1)n}{2^n}, \frac{jn}{2^n} \right], j \in \{1, \dots, 2^n\} \\ n, & \text{se } y > n \end{cases}$$

- Sequência é tal que  $f_n \uparrow f$ .

# INTEGRAL DE LEBESGUE NO CASO GERAL

- Seja  $f : \Omega \mapsto \mathbb{R} \cup \{\infty, -\infty\}$  uma função mensurável. Defina as partes positiva e negativa de  $f$  como:

$$f^+ = \max\{f, 0\}, \quad f^- = -\min\{f, 0\},$$

- Dizemos que  $f$  é **integrável** se  $\mu(|f|) = \mu(f^+) + \mu(f^-) < \infty$ . Nesse caso, a integral de  $f$  é definida como:

$$\mu(f) = \mu(f^+) - \mu(f^-)$$

- Vamos denotar por  $L^1(\Omega, \Sigma, \mu)$  o espaço de funções Lebesgue-integráveis.



# INTEGRAL DE LEBESGUE: PROPRIEDADES

## PROPOSIÇÃO

Sejam  $f, g \in L^1(\Omega, \Sigma, \mu)$  e  $\lambda \in \mathbb{R}$ . Temos que:

- 1 (Monotonicidade)  $f \leq g \implies \mu(f) \leq \mu(g)$
- 2 (Linearidade)  $f + \lambda g \in L^1(\Omega, \Sigma, \mu)$  e  $\mu(f + \lambda g) = \mu(f) + \lambda\mu(g)$ .

## PROPOSIÇÃO (TEOREMA DA CONVERGÊNCIA DOMINADA)

Seja  $(f_n)_n$  uma sequência de funções em  $L^1(\Omega, \Sigma, \mu)$ , tais que  $f_n \rightarrow f$  em  $\mu$ -q.t.p. Se existe  $g \geq 0$  mensurável tal que  $\mu(g) < \infty$  e:

$$|f_n(\omega)| \leq g(\omega) \forall n \in \mathbb{N}, \omega \in \Omega,$$

então  $f \in L^1(\Omega, \Sigma, \mu)$  e:

$$\mu(|f_n - f|) \rightarrow 0,$$

$$\mu(f_n) \rightarrow \mu(f)$$

# INTEGRAL DE LEBESGUE E INTEGRAL DE RIEMANN

- Considere o espaço  $([0, 1], \mathcal{B}[0, 1], \lambda)$ , com  $\lambda$  a medida de Lebesgue.
- Nesse espaço, podemos tanto calcular a integral de Lebesgue  $\int f(x)\lambda(dx)$  como a integral de Riemann:

$$\int_0^1 f(x)dx$$

- Qual a relação entre as duas integrais?

## PROPOSIÇÃO

*Seja  $f \geq 0$  uma função real com domínio em  $[0, 1]$  Riemann integrável. Então  $f$  é mensurável e  $\lambda(f) = \int_0^1 f(x)dx$ .*

- A recíproca do resultado acima nem sempre verdadeira. Por exemplo, a função

$$\mathbf{1}_{[0,1] \setminus \mathbb{Q}},$$

não é Riemann-integrável, embora  $\lambda(\mathbf{1}_{[0,1] \setminus \mathbb{Q}}) = 1$ .

## DENSIDADE COM RESPEITO A UMA MEDIDA

- Seja  $(\Omega, \Sigma, \mu)$  um espaço de medida, e  $f \geq 0$  uma função mensurável.
- O conjunto de integrais:

$$\int_A f d\mu := \mu(f \mathbf{1}_A), A \in \Sigma$$

define uma medida sobre  $(\Omega, \Sigma)$  (verifique).

- Reciprocamente, se  $\Phi$  é uma medida sobre  $(\Omega, \Sigma)$ , dizemos que  $\Phi$  admite uma densidade com respeito a uma medida  $\mu$  sobre  $(\Omega, \Sigma)$  se existe  $g \geq 0$  mensurável tal que, para todo  $A \in \Sigma$ :

$$\Phi(A) = \int_A g d\mu$$

- Condição necessária e suficiente para existência de densidade é dada pelo teorema de Radon-Nikodyn.

### TEOREMA

*Seja  $(\Omega, \Sigma)$  um espaço mensurável, e  $\mu$  e  $\Phi$  duas medidas  $\sigma$ -finitas.  $\Phi$  admite uma densidade com respeito a  $\mu$  se, e somente se, para todo  $A \in \Sigma$ ,  $\mu(A) = 0 \implies \Phi(A) = 0$ .*

# DENSIDADE E UMA FÓRMULA PADRÃO

## LEMA

*Seja  $(\Omega, \Sigma)$  um espaço mensurável, e  $\mu$  e  $\Phi$  duas medidas. Se  $\Phi$  admite densidade  $g$  com respeito a  $\mu$ , então para qualquer  $h \in L^1(\Omega, \Sigma, \Phi)$ , temos que:*

$$\Phi(h) = \int h(\omega)g(\omega)\mu(d\omega)$$

- Fórmula acima nos permite calcular esperança diretamente da integral com respeito a  $\mu$ .
- **Demonstração:** primeiro verificamos a expressão para funções simples, depois para funções não negativas usando uma aproximação por funções-escada, e por fim estendemos para funções gerais.

## ESPERANÇA

- Seja  $(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$  espaço de probabilidade.
- Neste caso, damos à integral de Lebesgue o nome de expectativa ou esperança, denotando-a, para  $X \in L^1(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$  por:

$$\mathbb{E}[X] := \mathbb{P}(X)$$

- .
- Como uma medida de probabilidade é finita, um corolário imediato do teorema da convergência dominada é:

### COROLÁRIO (TEOREMA DA CONVERGÊNCIA LIMITADA)

*Seja  $(X_n)_n \in L^1(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})^{\mathbb{N}}$  tais que  $X_n \rightarrow X$  quase certamente. Se existe  $K > 0$  tal que:*

$$\mathbb{P}[\{\omega : |X_n(\omega)| \leq K, \forall n\}] = 1,$$

*então  $X \in L^1(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$  e:  $\mathbb{E}[X_n] \rightarrow \mathbb{E}[X]$*

## ESPERANÇA: DESIGUALDADES FUNDAMENTAIS

- No que segue, considere um espaço de probabilidade  $(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$ .

### LEMA (DESIGUALDADE DE MARKOV)

*Seja  $Z$  uma variável aleatória, e  $g : \mathbb{R} \mapsto [0, \infty]$  mensurável e não decrescente. Então, para todo  $c \in \mathbb{R}$ .*

$$\mathbb{P}[Z \geq c]g(c) \leq \mathbb{E}[g(Z)]$$

### LEMA (DESIGUALDADE DE JENSEN)

*Seja  $X$  uma variável aleatória, e  $c : C \mapsto \mathbb{R}$  uma função convexa onde  $C \subseteq \mathbb{R}$  é um conjunto aberto e convexo. Suponha que:*

$$\mathbb{E}[|X|] < \infty, \quad \mathbb{P}[X \in C] = 1, \quad \mathbb{E}[|c(X)|] < \infty,$$

*então  $\mathbb{E}[X] \in C$  e:*

$$c(\mathbb{E}[X]) \leq \mathbb{E}[c(X)].$$

## A NORMA $L^p$

- Fixe  $p \in [1, \infty]$ . Para uma variável aleatória  $X$ , nós definimos:

$$\|X\|_p = (\mathbb{E}[|X|^p])^{1/p}$$

- Denotamos por  $L^p(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$  o espaço de variáveis aleatórias  $X \in m(\Sigma)$  tais que  $\|X\|_p < \infty$ .
- É possível mostrar que esse espaço é linear normado, com  $\|\cdot\|_p$  definindo uma (semi)norma em  $L^p(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$ .
  - “Semi” vem do fato de que  $\|X\|_p = 0 \implies \mathbb{P}[X = 0] = 1$ , de modo que há múltiplas variáveis aleatórias com norma zero, embora todas-quase certamente iguais a zero.
    - Essa multiplicidade não é problemática.

## NORMAS $L_p$ : PROPRIEDADES ÚTEIS

- Abaixo, elencamos algumas propriedades úteis das normas  $L_p$ .

### LEMA

1. (Monotonicidade) Sejam  $1 \leq p \leq q$ . Se  $X \in L^q(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$ , então  $X \in L^p(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$  e  $\|X\|_p \leq \|X\|_q$ .
2. (Cauchy-Schwarz) sejam  $X, Y \in L^2(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$ . Então  $X \cdot Y \in L^1(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$  e :

$$|\mathbb{E}[XY]| \leq \mathbb{E}[|XY|] \leq \|X\|_2 \|Y\|_2.$$

3. (Hölder) Seja  $1 \leq p \leq q \leq \infty$ ,  $\frac{1}{p} + \frac{1}{q} = 1$ . Sejam  $X \in L^p(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$  e  $Y \in L^q(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$ . Então  $X \cdot Y \in L^1(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$  e:

$$|\mathbb{E}[XY]| \leq \mathbb{E}[|XY|] \leq \|X\|_p \|Y\|_q.$$

4. (Minkowski) Seja  $p \geq 1$ , e  $X, Y \in L^p(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$ , então:

$$\|X + Y\|_p \leq \|X\|_p + \|Y\|_p$$

- Cauchy-Schwarz é caso particular de Hölder.
- Minkowski garante desigualdade triangular (e que  $\|\cdot\|_p$  é norma)



# ESPERANÇA CONDICIONAL

- Seja  $(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$  um espaço de probabilidade,  $Y$  uma variável aleatória, e  $\mathcal{G} \subseteq \Sigma$  uma sub- $\sigma$ -álgebra de  $\Sigma$ .
- Tome  $Y \in L^1(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$ .
- Definimos a esperança condicional de  $Y$  com respeito a  $\mathcal{G}$ , denotada por  $\mathbb{E}[Y|\mathcal{G}]$  como a **variável aleatória**  $\mathbb{E}[Y|\mathcal{G}] \in L^1(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$   **$\mathcal{G}$ -mensurável** que satisfaz, para todo  $A \in \mathcal{G}$ :

$$\mathbb{E}[\mathbb{E}[Y|\mathcal{G}]\mathbf{1}_A] = \mathbb{E}[Y\mathbf{1}_A]$$

- Fácil mostrar que esperança condicional está unicamente definida, a não por eventos de probabilidade zero.
  - Uma variável aleatória que satisfaz as condições acima é conhecida como *versão* da esperança condicional.
  - Sejam  $Z_1$  e  $Z_2$  duas versões de  $\mathbb{E}[Y|\mathcal{G}]$ , então  $\{\omega : Z_1(\omega) > Z_2(\omega)\} \in \mathcal{G}$  e pela definição da esperança condicional  $Z_2 \geq Z_1$  q.c.

# EXISTÊNCIA DA ESPERANÇA CONDICIONAL

- No slide anterior, definimos a esperança condicional e verificamos que, caso exista, ela é única.
  - No entanto, cabe a pergunta: será que existe uma variável aleatória que satisfaz as condições requeridas?
  - Resposta é **afirmativa**, e dada por um teorema devido a Komogorov.
- Além disso, note que, pelo resultado visto em aula anterior, quando  $\mathcal{G} = \sigma(X_1, \dots, X_n)$ , a esperança condicional  $\mathbb{E}[Y|\sigma(X_1, \dots, X_n)] = f(X_1, \dots, X_n)$  para alguma  $f$   $\mathcal{B}(\mathbb{R}^n)$ -mensurável.
  - Essa  $f$  é conhecida como **função de expectativa condicional**.
  - Nesses casos, costumo usar a notação  $\mathbb{E}[Y|X_1, \dots, X_n]$  para  $\mathbb{E}[Y|\sigma(X_1, \dots, X_n)]$
- **Interpretação da esperança condicional:**  $\mathcal{G}$  é o conjunto informacional do agente (após sorteio de  $\omega \in \Omega$  pela natureza, agente observa se  $\omega \in E$  é verdade ou não, para todo  $E \in \mathcal{G}$ ).
  - $\omega \mapsto \mathbb{E}[Y|\mathcal{G}]$  é a melhor previsão do agente sobre  $Y$  após o sorteio, em termos de minimização do erro quadrático médio, dado o conhecimento de  $\mathcal{G}$  (exercício da lista).

# ESPERANÇA CONDICIONAL: PROPRIEDADES BÁSICAS

No que segue, tome  $X \in \mathcal{L}^1(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$ , e  $\mathcal{F}$  e  $\mathcal{G}$  sub- $\sigma$ -álgebras de  $\Sigma$ .

## LEMA

1. **Preservação da Esperança:** Se  $Y$  é qualquer versão de  $\mathbb{E}(X \mid \mathcal{G})$ , então  $\mathbb{E}(Y) = \mathbb{E}(X)$ .
2. **Mensurabilidade:** Se  $X$  é  $\mathcal{G}$ -mensurável, então  $\mathbb{E}(X \mid \mathcal{G}) = X$  quase certamente.
3. **Linearidade:** Sejam  $X_1, X_2 \in L^1$ ,  $a_1, a_2 \in \mathbb{R}$ :

$$\mathbb{E}(a_1 X_1 + a_2 X_2 \mid \mathcal{G}) = a_1 \mathbb{E}(X_1 \mid \mathcal{G}) + a_2 \mathbb{E}(X_2 \mid \mathcal{G}), \quad \text{quase certamente.}$$

4. **Positividade:** Se  $X \geq 0$ , então  $\mathbb{E}(X \mid \mathcal{G}) \geq 0$ , quase certamente.
5. **Convergência Monótona:** Se  $0 \leq X_n \uparrow X$ , então  $\mathbb{E}(X_n \mid \mathcal{G}) \uparrow \mathbb{E}(X \mid \mathcal{G})$ , quase certamente.
6. **Convergência Dominada:** Se  $|X_n(\omega)| \leq V(\omega)$  para todo  $n$ ,  $\mathbb{E}[V] < \infty$ , e  $X_n \rightarrow X$  quase certamente, então

$$\mathbb{E}(X_n \mid \mathcal{G}) \rightarrow \mathbb{E}(X \mid \mathcal{G}), \quad \text{quase certamente.}$$

# ESPERANÇA CONDICIONAL: PROPRIEDADES BÁSICAS

No que segue, tome  $X \in \mathcal{L}^1(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$ , e  $\mathcal{F}$  e  $\mathcal{G}$  sub- $\sigma$ -álgebras de  $\Sigma$ .

## LEMA

**7 Desigualdade de Jensen:** Se  $\phi : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$  é convexa e  $\mathbb{E}|\phi(X)| < \infty$ , então

$$\mathbb{E}[\phi(X) \mid \mathcal{G}] \geq \phi(\mathbb{E}[X \mid \mathcal{G}]), \quad \text{quase certamente.}$$

**8 Propriedade da Torre:** Se  $\mathcal{H}$  é uma sub- $\sigma$ -álgebra de  $\mathcal{G}$ , então

$$\mathbb{E}[\mathbb{E}(X \mid \mathcal{G}) \mid \mathcal{H}] = \mathbb{E}(X \mid \mathcal{H}), \quad \text{quase certamente.}$$

**9 'Extraindo o que é Conhecido':** Se  $Z$  é  $\mathcal{G}$ -mensurável e limitada, então

$$\mathbb{E}[ZX \mid \mathcal{G}] = Z\mathbb{E}[X \mid \mathcal{G}], \quad \text{quase certamente.}$$

(resultado também vale se  $X \in L^p$  e  $Z \in L^q$ , com  $p, q \geq 1$  e  $\frac{1}{p} + \frac{1}{q} = 1$ ).

**10 Papel da Independência:** Se  $\mathcal{H}$  é independente de  $\sigma(X, \mathcal{G})$ , então

$$\mathbb{E}[X \mid \sigma(\mathcal{G}, \mathcal{H})] = \mathbb{E}(X \mid \mathcal{G}), \quad \text{quase certamente.}$$

Em particular, se  $X$  é independente de  $\mathcal{H}$ , então

$$\mathbb{E}(X \mid \mathcal{H}) = \mathbb{E}(X), \quad \text{quase certamente.}$$

# PROBABILIDADE CONDICIONAL

- Seja  $(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$  um espaço de probabilidade,  $A \in \Sigma$  um evento e  $\mathcal{G} \subseteq \Sigma$  uma sub- $\sigma$ -álgebra de  $\Sigma$ . Definimos a **probabilidade condicional** de  $A$  dado  $\mathcal{G}$  como:

$$\mathbb{P}[A|\mathcal{G}] = \mathbb{E}[\mathbf{1}_A|\mathcal{G}]$$

- Uma função  $p : \Sigma \times \Omega \mapsto [0, 1]$  é dita uma **probabilidade condicional regular** dado  $\mathcal{G}$  se:
  1.  $\forall A \in \Sigma, \omega \mapsto p(A, \omega)$  é uma versão de  $\mathbb{P}[A|\mathcal{G}]$ .
  2.  $\forall \omega \in \Omega, A \mapsto p(A, \omega)$  é uma lei de probabilidade sobre  $(\Omega, \Sigma)$ .
- Probabilidades condicionais regulares nem sempre existem, embora, para espaços bem-comportados como os estudados em Estatística, elas existam na maioria dos casos.

# PROBABILIDADE CONDICIONAL REGULAR E UMA FÓRMULA PARA A ESPERANÇA CONDICIONAL

## LEMA

*Seja  $(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$  um espaço de probabilidade, e  $\mathcal{G} \subseteq \Sigma$  uma sub- $\sigma$ -álgebra de  $\Sigma$ . Se existe uma probabilidade condicional regular dado  $\mathcal{G}$ ,  $p : \Sigma \times \Omega \mapsto [0, 1]$ , então, para qualquer variável aleatória  $Y$  integrável, a função:*

$$f(\omega) = \int Y(s)p(ds, \omega),$$

*define uma versão de  $\mathbb{E}[Y|\mathcal{G}]$ .*

- Se probabilidade condicional regular existe, esperança condicional pode ser calculada usando probabilidades condicionais.
- Demonstração: primeiro verificar para funções simples, depois aproximar para funções não negativas, depois considerar o caso geral.

# MEDIDA PRODUTO

- Sejam  $(\Omega_1, \Sigma_1, \mathbb{P}_1)$  e  $(\Omega_2, \Sigma_2, \mathbb{P}_2)$  dois espaços de probabilidade.
- A  $\sigma$ -álgebra **produto**, denotada por  $\Sigma_1 \otimes \Sigma_2$ , é a  $\sigma$ -álgebra em  $\Omega_1 \times \Omega_2$  gerada pelos conjuntos da forma  $B_1 \times B_2$ , com  $B_1 \in \Sigma_1$  e  $B_2 \in \Sigma_2$ .
- A medida produto, denotada por  $\mathbb{P}_1 \otimes \mathbb{P}_2$  é a medida caracterizada pelas probabilidades:

$$\mathbb{P}_1 \otimes \mathbb{P}_2[B_1 \times B_2] = \mathbb{P}_1[B_1]\mathbb{P}_2[B_2], \quad \forall B_1 \in \Sigma_1, B_2 \in \Sigma_2.$$

(note o paralelismo com o conceito de independência; estamos definindo um novo espaço de probabilidade em que os experimentos 1 e 2 ocorrem de forma independente).

# TEOREMA DE FUBINI

- Seja  $f \in L^1(\Omega_1 \times \Omega_2, \Sigma_1 \otimes \Sigma_2, \mathbb{P}_1 \otimes \mathbb{P}_2)$ . Uma pergunta que podemos ter é se podemos calcular a esperança:

$$\int f d\mathbb{P}_1 \otimes \mathbb{P}_2,$$

de forma sequencial, isto é se:

$$\begin{aligned} \int f d\mathbb{P}_1 \otimes \mathbb{P}_2 &= \int \left( \int f(\omega_1, \omega_2) \mathbb{P}_1[d\omega_1] \right) \mathbb{P}_2[d\omega_2] = \\ &\int \left( \int f(\omega_1, \omega_2) \mathbb{P}_2[d\omega_2] \right) \mathbb{P}_1[d\omega_1] \end{aligned}$$

- Resposta é **afirmativa**, e dada pelo **Teorema de Fubini**.
  - Teorema adicionalmente garante que podemos “trocar” as integrais.
  - Teorema vale para expectativas e, mais genericamente, integrais de medidas  $\sigma$ -finitas.