

Proabilidade e Estatística

Exercícios sobre Convergência Estocástica

Exercício 1 Considere o espaço de probabilidade $(\{0, 1\}, 2^{\{0,1\}}, \mathbb{P})$, com $\mathbb{P}[\{0\}] = 1/2$. Considere a sequência de variáveis aleatórias $X_n = \mathbf{1}_{\{1\}}$ para todo $n \in \mathbb{N}$ e $X = \mathbf{1}_{\{0\}}$. Mostre que $X_n \xrightarrow{d} X$, mas que não há convergência em probabilidade de X_n a X .

Exercício 2 Considere o espaço de probabilidade $([0, 1], \mathcal{B}[0, 1], \lambda)$, com λ a medida uniforme. Considere a sequência de variáveis aleatórias:

$$\begin{aligned} X_1 &= \mathbf{1}_{[0,1]} \\ X_2 &= \mathbf{1}_{[0,1]} + \mathbf{1}_{[0,1/2]} \\ X_3 &= \mathbf{1}_{[0,1]} + \mathbf{1}_{[1/2,1]} \\ X_4 &= \mathbf{1}_{[0,1]} + \mathbf{1}_{[0,1/3]} \\ X_5 &= \mathbf{1}_{[0,1]} + \mathbf{1}_{[1/3,2/3]} \\ X_6 &= \mathbf{1}_{[0,1]} + \mathbf{1}_{[2/3,1]} \\ X_7 &= \mathbf{1}_{[0,1]} + \mathbf{1}_{[0,1/4]} \\ &\vdots \end{aligned}$$

a Mostre que, para todo $\omega \in [0, 1]$, a sequência $(X_n(\omega))_{n \in \mathbb{N}}$ **não converge**. Conclua que X_n não converge quase certamente.

b Mostre que $X_n \xrightarrow{p} X_1$.

Exercício 3 Seja X_n uma sequência de variáveis aleatórias, que converge em distribuição a uma variável aleatória X . Mostre que, se a função distribuição F_X de X é contínua, então:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \sup_{s \in (-\infty, \infty)} |F_{X_n}(s) - F_X(s)| = 0.$$

Dica: considere $k \in \mathbb{N}$ e use continuidade para encontrar pontos s_1, s_2, \dots, s_k tais que $F_X(s_j) = \frac{j}{k+1}$. Use esses pontos para limitar por cima o supremo.

Exercício 4 No que segue, sejam X_n e Y_n duas sequências de variáveis aleatórias definidas num mesmo espaço de probabilidade, e a_n e b_n duas sequências de números reais. Mostre que:

1. $X_n = O_P(1)$ se e somente se existe uma sequência de números reais $\epsilon_n \uparrow \infty$ tais que $\lim_{n \rightarrow \infty} \mathbb{P}[|X_n| > \epsilon_n] = 0$.
2. Se $X_n = O_P(a_n)$ e $a_n \downarrow 0$, então $Y_n = o_P(1)$.

3. Se $X_n = o_P(a_n)$, então $Y_n = O_P(a_n)$.
4. Se $X_n = O_P(a_n)$ e $Y_n = O_P(b_n)$ então $X_n Y_n = O_P(a_n b_n)$. e $X_n Y_n = O_P(\max\{a_n, b_n\})$.
5. Se, para $r > 0$, $\mathbb{E}[|X_n|^r] < \infty$ para todo $n \in \mathbb{N}$ então $X_n = O_P(\|X_n\|_r)$.
Dica: use a desigualdade de Markov.

Exercício 5 Sejam X_1, X_2, \dots, X_n duas variáveis aleatórias definidas num mesmo espaço de probabilidade. Mostre que essas variáveis aleatórias são independentes se, e somente se, definindo o vetor aleatório $\mathbf{X} = (X_1, X_2, \dots, X_n)'$, a função característica de \mathbf{X} satisfaz:

$$\phi_{\mathbf{X}}(s) = \prod_{i=1}^n \phi_{X_i}(s_i), \quad \forall s \in \mathbb{R}^n.$$

Exercício 6 Sejam $\mathbf{X} = (X_1, X_2, \dots, X_n)'$ um vetor de variáveis aleatórias definidas no mesmo espaço de probabilidade. Dizemos que \mathbf{X} segue distribuição normal com média $\boldsymbol{\mu} \in \mathbb{R}^n$ e matriz de variância-covariância $\Sigma \in \{A \in \mathbb{R}^{n \times n} : A \text{ positiva semidefinida}\}$, denotado por $\mathbf{X} \sim \mathcal{N}(\boldsymbol{\mu}, \Sigma)$ se a medida induzida $\mathbb{P}_{\mathbf{X}}$ admite densidade (com respeito à medida de Lebesgue em \mathbb{R}^n) dada por:

$$f(s) = \frac{1}{(2\pi)^{n/2} \sqrt{\det(\Sigma)}} \exp\left(-\frac{1}{2}(s - \boldsymbol{\mu})' \Sigma (s - \boldsymbol{\mu})\right).$$

Nesse caso, é possível mostrar que $\mathbb{E}[X_j] = \boldsymbol{\mu}_j$ e $\Sigma_{i,j} = \mathbb{C}(\mathbf{X}_i, \mathbf{X}_j)$ para todo $i, j = 1, \dots, n$.

- a Mostre que X_1, \dots, X_n são independentes se, e somente se, $\mathbb{C}(\mathbf{X}_i, \mathbf{X}_j) = 0$ para $i \neq j$. *Dica:* a função característica de \mathbf{X} é $s \mapsto \exp(\boldsymbol{\mu}' s + (1/2)s' \Sigma s)$.
- b A equivalência anterior também é verdadeira pra qualquer distribuição não normal?

Exercício 7 Seja $\mathbf{X}_1, \mathbf{X}_2, \dots$ uma sequência de vetores aleatórios k -dimensionais iid com $\mathbb{V}[\mathbf{X}_{1,l}] < \infty$, para $l = 1, \dots, k$. Denote por $\boldsymbol{\mu} \in \mathbb{R}^k$ o vetor com j -ésima entrada dada por $\boldsymbol{\mu}_j = \mathbb{E}[\mathbf{X}_{1,j}]$ e Σ a matriz $k \times k$ com entrada (i, j) dada por $\Sigma_{i,j} = \mathbb{C}(\mathbf{X}_{1,i}, \mathbf{X}_{1,j})$ Use o dispositivo de Crámer-Wold para mostrar que, quando $n \rightarrow \infty$:

$$\frac{1}{\sqrt{n}} \sum_{j=1}^n (\mathbf{X}_j - \boldsymbol{\mu}) \xrightarrow{d} \mathcal{N}(\mathbf{0}, \Sigma)$$