

1 Aplicando a Teoria dos Conjuntos em Probabilidade

A probabilidade é baseada em um experimento repetitivo que consiste em um procedimento e observações. Um *resultado* é uma observação. Um *evento* é um conjunto de resultados.

Resultado: Um **resultado** de um *experimento* é qualquer observação possível desse experimento. Segundo a noção de que os experimentos são distinguíveis entre si definimos um conjunto universal de todos os resultados possíveis.

Espaço Amostral S : O **espaço amostral** S de um *experimento* é o conjunto mais minucioso, mutuamente exclusivo, coletivamente completo de todos os resultados possíveis.

Evento: Um **evento** é um conjunto dos resultados de um *experimento*.

Conjunto das partes de S : $\mathbb{P}(S)$ conjunto de todos os subconjuntos de S . Ex: $S = \{1, 2, 3\}$

- $\{1, 2\}$ é um subconjunto de S
- $\{1\}$ é um subconjunto de S
- $\{3\}$ é um subconjunto de S
- $\{\emptyset\}$ é um subconjunto de S
- ...

Obs: Note $\emptyset = \{\cdot\}$ **entretanto** $\{\emptyset\} \neq \emptyset$

2 Axiomas de Probabilidade

Uma medida de probabilidade $P[\cdot]$ é uma função que mapeia eventos no espaço amostral a números reais tais que:

1. Para qualquer evento \mathbb{E} , $P[\mathbb{E}] \geq 0$
2. $P[S] = 1$
3. Para qualquer coleção contável A_1, A_2, \dots de eventos mutuamente exclusivos:
 $P[A_1 \cup A_2 \cup \dots] = P[A_1] + P[A_2] + \dots$

Toda a teoria de probabilidade é baseada nesses três axiomas. Os axiomas 1 e 2 estabelecem a probabilidade como um número entre 0 e 1. O axioma 3 mostra que **para conjuntos disjuntos** a união de conjuntos corresponde a soma das probabilidades.

2.1 Teoremas e Consequências dos Axiomas

2.1.1 $P(\emptyset) = 0$

Usando o axioma 3 note que:

$$P(\emptyset \cup \emptyset \cup \emptyset \cup \dots) = \sum_{i=1}^{\infty} P(\emptyset), \text{ pois } \emptyset \cap \emptyset = \emptyset$$

$$P(\emptyset) = \sum_{i=1}^{\infty} P(\emptyset) \text{ só converge se } P(\emptyset) = 0$$

$$2.1.2 \quad P(A \cap \overline{B}) = P(A) - P(A \cap B) \quad \forall A, B \in \mathbb{E}$$

Manuseando a equação para mostrar que $P(A \cap \overline{B}) + P(A \cap B) = P(A)$. Primeiramente:

$$\begin{aligned} (A \cap \overline{B}) \cap (A \cap B) &= \emptyset, \text{ da álgebra Booleana: } A(\overline{B} + B) = (\overline{A}B + AB) \\ (\overline{A}B + AB) \cap (A \cap B) &= A \cap (\overline{B} \cup B) = A \cap S = A \\ P(A \cap \overline{B}) &= P(A) - P(A \cap B) \end{aligned}$$

$$2.1.3 \quad P(\overline{A}) = 1 - P(A)$$

Utilizando os Axiomas 3 e 2 fazemos:

$$\begin{aligned} S &= A \cup \overline{A} \\ 1 &= P(A) + P(\overline{A}) \\ P(\overline{A}) &= 1 - P(A) \end{aligned}$$

$$2.1.4 \quad P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A \cap B) \quad \forall A, B \in \mathbb{E}$$

Notamos que $A \cap \overline{B}$ e B são disjuntos e tem união $A \cup B$. Então:

$$P(A \cup B) = P(B) + P(A \cap \overline{B}) \quad (1)$$

Em seguida, notamos que $A \cap \overline{B}$ e $A \cap B$ são disjuntos e tem união A . Então:

$$P(A) = P(A \cap B) + P(A \cap \overline{B}) \quad (2)$$

Subtraindo 2 de 1, obtemos:

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

$$2.1.5 \quad 0 \leq P(A) \leq 1, \quad \forall A \in \mathbb{E}$$

Como qualquer evento $A \subseteq S$, $P(A) \leq P(S)$ então $P(A) \leq 1$. O limite inferior deve ser zero fazendo com que: $0 \leq P(A) \leq 1$.