Apuntes de Probabilidad y Estadística II

Leonardo H. Añez Vladimirovna[1]

Universidad Autónoma Gabriél René Moreno,
Facultad de Ingeniería en Ciencias de la Computación y Telecomunicaciones,
Santa Cruz de la Sierra, Bolivia

14 de septiembre de 2018

[1]Correo Electrónico: `toborochi98@outlook.com`

Notas del Autor

Estos apuntes fueron realizados durante mis clases en la materia `MAT305 (Probabilidad y Estadística II)`, acompañados de referencias de libros, fuentes y código que use a lo largo del curso, en el período `I-2018` en la Facultad de Ingeniería en Ciencias de la Computación y Telecomunicaciones.

Para cualquier cambio, observación y/o sugerencia pueden enviarme un mensaje al siguiente correo:

`toborochi98@outlook.com`

Índice general

Capítulo 1

Variables Aleatorias

Una variable aleatoria x (desde ahora denotada por **v.a.**) es una función definida sobre el espacio muestral S con valores en $\mathbb{R}$ que a cada elemento de S (Punto muestral) hace corresponder un número real $x = X$.

$$x = X(w) \in Rec_X \subseteq \mathbb{R}$$

Gráficamente

Notación Conjuntista

$$X = \{(w, x)\ w \in S, x = X(w) \in \mathbb{R}\} \subseteq S \times \mathbb{R}$$

Donde:

- S: Conjunto Partida (Espacio Muestral).
- $\mathbb{R}$: Conjunto de llegada.
- w: Elemento de S (Punto Muestral).
- x: Valor de la **v.a.** X.
- Rec_X: Recorrido de X.
- X: Función **v.a.** (Conjunto de Pares Ordenados).

Notaciones

Las **v.a.** se denotan con letras mayúsculas tales como X, Y o Z, y los valores correspondientes con letras minúsculas.

1.1. Clasificación de Variables Aleatorias

- **Discreta:** Cuyo recorrido es un conjunto finito o infinito numerable de valores:

$$X \text{ es } \textbf{v.a.} \text{ discreta} \Rightarrow \begin{cases} \text{Conjunto Finito de Valores} \\ \text{Conjunto Infinito Numerable de Valores} \end{cases}$$

- **Contínua:** Es aquella cuyo recorrido es conjunto finito no numerable de valores, puede tomar cualquier valor en un intervalo o conjunto.

⧫ En general las **v.a.** *discretas* representan datos que provienen del *conteo* de número de elementos. Pueden ser número de titulados, número de estudiantes, etc. Mientras que las **v.a.** *contínuas* representan mediciones, como longitud, capacidad,etc.

1.2. Función de Probabilidad de una Variable Aleatoria

También llamada función de cuantía o función de masa de probabilidad de una **v.a.**.

Se denomina función de probabilidad de una **v.a.** discreta X a una función p o f, cuyo valor es $p(x)$ o $P(X = x)0$ ya que a cada valor distinto de la **v.a.** discreta X hace corresponder en un número entre los valores $[0, 1]$ que es su probabilidad, de ahí el nombre de función de cuantía o función de probabilidad. Estos valores satisfacen las siguientes condiciones:

1. $P(x) \geq 0 \quad ; \quad \forall x \in \mathbb{R}$
2. $\displaystyle\sum_{x_i \in Rec_X} p(x_i) = 1$
   - Si $Rec_X = \{x_1, x_2, \ldots, x_n\}$ entonces la condición **(II)** es: $\displaystyle\sum_{i=1}^{n} p(x_i) = 1$
   - Si $Rec_X = \{x_1, x_2, \ldots, x_n, \ldots\}$ entonces la condición **(II)** es: $\displaystyle\sum_{i=1}^{\infty} p(x_i) = 1$

Si A es un evento en el recorrido de la **v.a.** discreta X entonces la probabilidad de A es el número:

$$P(A) = \sum P(X = x) = \sum p(x)$$

Nota:

$$P(X = x) \begin{cases} p(x) \geq 0; & \forall x \in \mathbb{R} \\ f(x) \geq 0; & \forall x \in \mathbb{R} \end{cases}$$

La función de probabilidad de una **v.a.** discreta X se puede expresar por:

- **Un Conjunto:**

$$p = \{(x, P(X))/x \in D_p\}$$

- **Una Tabla:**

x_i	x_1	x_2	$\ldots$	x_n
$p(x_i)$	$p(x_1)$	$p(x_2)$	$\ldots$	$p(x_n)$

- **Una Gráfica:**

1.3. Función de Distribución Acumulada (FDA)

El valor de la **FDA** de una **v.a.** discreta X, que es $F(x)$, viene dada por la sumatoria de las probabilidades, desde un valor mínimo t hasta un valor específico x; esto es:

$$F(x) = P(X \leq x) = \sum_{t \leq x} P(t), \quad \forall x \in \mathbb{R}$$

1.3.1. Representación Gráfica

Valores $F(x)$ aumentan en *saltos*, presentando entonces la forma de una escalera:

1.3.2. Caso Continuo

Función de Densidad

f es función densidad, si $f(x)$ cumple las siguientes condiciones:

(I) $f(x) \geq 0; \quad \forall x \in \mathbb{R}$

(II) $\displaystyle\int_{-\infty}^{\infty} f(x)dx = 1$

(III) $\displaystyle p(a \leq x \leq b) = \int_a^b f(x)dx$

FDA

$$F(x) = P(X \leq x) = \int_{-\infty}^{x} f(x)dx$$

1.3.3. Propiedades de la FDA

Caso Discreto

1. $0 \leq F(x) \leq 1; \quad \forall x \in \mathbb{R}$
2. $F(-\infty) = 0$
3. $F(+\infty) = 1$
4. $P(X \leq a) = F(a)$
5. $P(X > a) = 1 - P(X < a) = 1 - F(a)$
6. $P(X < a) = \begin{cases} F(a-1), \text{si } a \in \mathbb{Z} \\ F([\![a]\!]), \text{si } a \notin \mathbb{Z} \end{cases}$
7. $P(X \leq -a) = 1 - P(X \leq a) = 1 - F(a)$
8. $P(a < X \leq b) = F(b) - F(a)$
9. $P(a \leq X \leq b) = F(b) - F(a) + P(X = x)$
10. $P(a < X < b) = F(b) - F(a) - P(X = b)$
11. $P(X = x_i) = F(x_i) - F(x_{i-1})$

Caso Continuo

1. $0 \leq F(x) \leq 1; \quad \forall x \in \mathbb{R}$
2. $F(-\infty) = 0$
3. $F(+\infty) = 1$
4. $P(X \leq a) = P(X < a) = F(a)$
5. $P(X > a) = 1 - P(X \leq a) = 1 - F(a)$
6. $P(X \geq a) = 1 - P(X < a) = 1 - F(a)$
7. $P(X \leq -a) = 1 - P(X \leq a) = 1 - F(a)$
8. $P(a < X \leq b) = P(a \leq X \leq b) = P(a < X < b)$
9. $f(x) = \dfrac{dF(x)}{dx}$

1.4. Esperanza Matemática

Sea X una **v.a.** con función de probabilidad f definida por $f(x)$. La *esperanza matemática* de X, denotada por $E(x), \mu$ ó μ_x; está dada por:

$$E(x) = \mu = \mu_x = \begin{cases} \displaystyle\sum_x x \cdot p(x), \text{ Si } X \text{ es } \textbf{v.a.} \text{ Discreta} \\ \displaystyle\int_{-\infty}^{+\infty} x \cdot f(x)dx, \text{ Si } X \text{ es } \textbf{v.a.} \text{ Continua} \end{cases}$$

Propiedades

1. $E(a) = a$
2. $E(x \pm a) = E(x) \pm a$
3. $E(ax) = aE(x)$
4. $E(ax \pm b) = aE(x) \pm b$

1.4.1. Varianza

Notaciones: $V(x), \sigma^2, \sigma_x^2$

$$V(x) = \sigma^2 = \begin{cases} E[x-\mu]^2 = \sum_x (x-\mu)^2 f(x); \text{ Si } X \text{ es } \textbf{v.a.} \text{ Discreta} \\ E[x-\mu]^2 = \int_{-\infty}^{+\infty} (x-\mu)^2 f(x)dx; \text{Si } X \text{ es } \textbf{v.a.} \text{ Continua} \end{cases}$$

Propiedades

1. $V(x) \geq 0$
2. $V(a) = 0$
3. $V(ax) = aV(x)$
4. $V(ax \pm b) = a^2 V(x)$
5. $V(x) = E(x^2) - [E(x)]^2$

1.5. Función de Probabilidad Conjunta

1.5.1. Función de Cuantía Conjunta

$$P(X = x, Y = y) = f(x, y) = p(x, y)$$

es el valor de una función de cuantía conjunta de la **v.a.'s** X y Y si:

(I) $f(x, y) = p(x, y) \geq 0$ Para cualquier (x, y) de su dominio.

(II) $\sum_x \sum_y f(x, y) = 1$

(III) $P((x, y) \in A) = \sum_A \sum f(x, y)$ Para cualquier región A del plano XY.

1.5.2. Función de Densidad Conjunta

$$P(X = x, Y = y) = f(x, y) = p(x, y)$$

es el valor de una función de cuantía conjunta de la **v.a.'s** X y Y si:

(I) $f(x, y) = p(x, y) \geq 0$ Para cualquier (x, y) de su dominio.

(II) $\int_{-\infty}^{+\infty} \int_{-\infty}^{+\infty} f(x, y)\, dx\, dy = 1$

(III) $P((x, y) \in A) = \iint_A f(x, y)\, dx\, dy$ Para cualquier región A del plano XY.

1.6. Distribuciones Marginales

Sean X y Y **v.a.** con función de probabilidad conjunta definida por $f(x,y)$. La distribución marginal está dada por:

$$\text{Caso Discreto: } \begin{cases} \text{Distribución Marginal X: } g(x) = \sum_y f(x,y) \\ \\ \text{Distribución Marginal Y: } h(y) = \sum_x f(x,y) \end{cases}$$

$$\text{Caso Continuo: } \begin{cases} \text{Distribución Marginal X: } g(x) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x,y)\,dy \\ \\ \text{Distribución Marginal Y: } h(y) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x,y)\,dx \end{cases}$$

1.6.1. Independencia Estadística de las v.a. X y Y

Sean X y Y **v.a.** discretas o contínuas con función de probabilidad conjunta definida por $f(x,y)$ y distribuciones marginales $g(x)$ y $h(y)$, respectivamente. Se dice que las **v.a.** X y Y serán estadísticamente independientes ssi:

$$f(x,y) = g(x)h(y)$$

Para cualquier (x,y) dentro de sus recorridos.

1.6.2. Esperanza Matemática

Sean X y Y **v.a.** con función de probabilidad definida por $f(x,y)$. La media o esperanza matemática de $g(x,y)$ está dada por:

$$\text{Caso Discreto: } E(g(x,y)) = \mu_{g(x,y)} = \sum_x \sum_y g(x,y) \cdot f(x,y)$$

$$\text{Caso Contínuo: } E(g(x,y)) = \mu_{g(x,y)} = \int_{-\infty}^{+\infty} \int_{-\infty}^{+\infty} g(x,y) \cdot f(x,y)\,dx\,dy$$

1.6.3. Covarianza

Mide el grado de relación o asociación de dos variables.

1.6.4. Resultado Importantes

1. $E(x \pm y) = E(x) \pm E(y)$
2. $Cov(x,y) = E(x \cdot y) - E(x)E(y)$
3. $V(x \pm y) = V(x) + V(y) \pm 2Cov(x,y)$
4. $V(ax \pm by) = a^2V(x) + b^2V(y) \pm 2abCov(x,y)$
5. Si X y Y son estadísticamente independientes entonces:
   a) $E(x,y) = E(x)E(y)$
   b) $Cov(x,y) = 0$
   c) $V(x \pm y) = V(x) + V(y)$
   d) $V(ax \pm by) = a^2V(x) + b^2V(y)$

Capítulo 2

Modelos de Distribución de Probabilidad