Formulas de Estadística Inferencial (`MAT302`)

Leonardo H. Añez Vladimirovna

21 de octubre de 2018

1. Variables Aleatorias

1.1. Definiciones

1.1.1. Discretas

Notación: $P(A), P(X = x), f(x)$.

1. $p(x) \geq 0; \forall x \in \mathbb{R}$
2. $\displaystyle\sum_{x_i \in Rec_x} p(x_i) = 1$
3. $\displaystyle\sum_{i=1}^{n} p(x_i) = 1$
4. $\displaystyle\sum_{i=1}^{\infty} p(x_i) = 1$

1.1.2. Continuas

Notación: $F(x), P(X \leq x)$.

1. $f(x) \geq 0; \forall x \in \mathbb{R}$
2. $\displaystyle\int_{-\infty}^{+\infty} f(x)dx = 1$
3. $P(a \leq x \leq b) = \displaystyle\int_{a}^{b} f(x)dx = 1$

1.2. Propiedades

1.2.1. Discreta

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

1.2.2. Continua

1. $0 \leq F(x) \leq 1, \forall x \in \mathbb{R}$
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. $P(a < X \leq b) = P(a \leq X \leq b) = P(a < X < b) = F(b) - F(a)$
9. $f(x) = \dfrac{dF(x)}{dx}$

1.3. Esperanza

1.3.1. V.A.s Discretas

$$E(x) = \mu = \mu_x = \sum_x x \cdot p(x)$$

X v.a. con función f:

$$E(g(x)) = \mu_{g(x)} = \sum_x g(x) \cdot f(x)$$

1.3.2. V.A.s Continua

$$E(x) = \int_{-\infty}^{+\infty} x f(x) dx$$

X v.a. con función f:

$$E(x) = \int_{-\infty}^{+\infty} g(x) \cdot f(x) dx$$

1.3.3. Propiedades

★ a y b constantes.

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. Varianza

1.4.1. V.A.s Discretas

$$\begin{aligned} V(x) = \sigma^2 &= E(x-\mu)^2 \\ &= \sum_x (x-\mu)^2 f(x) \end{aligned}$$

1.4.2. V.A.s Continua

$$\begin{aligned} V(x) = \sigma^2 &= E(x-\mu)^2 \\ &= \int_{-\infty}^{+\infty} (x-\mu)^2 f(x) dx \end{aligned}$$

1.4.3. Propiedades

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

1.5. Función de Probabilidad Conjunta

1.5.1. Función de Cuantía Conjunta (Discreta)

1. $P(x, y) = P(X = x, Y = y) \geq 0$
2. $\displaystyle\sum_x \sum_y P(x, y) = 1$
3. $P((x, y) \in A) = \sum_A \sum P(x, y)$

1.5.2. Función de Densidad Conjunta (Continua)

1. $f(x, y) \geq 0$
2. $\displaystyle\int_{-\infty}^{+\infty} \int_{-\infty}^{+\infty} f(x, y) dx dy = 1$
3. $\displaystyle P((x, y) \in A) = \int_A \int f(x, y) dx dy$

1.6. Distribuciones Marginales

1.6.1. Caso Discreto

- **Distribución Marginal de X:**

$$g(x) = \sum_y f(x, y)$$

- **Distribución Marginal de Y:**

$$h(y) = \sum_x f(x, y)$$

1.6.2. Caso Continuo

- **Distribución Marginal de X:**

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

- **Distribución Marginal de Y:**

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

1.7. Covarianza

1.7.1. Caso Discreto

$$\begin{aligned} Cov(x,y) = \sigma_{xy} &= E((x-\mu_x)(y-\mu_y)) \\ &= \sum_x \sum_y (x-\mu_x)(y-\mu_y) f(x,y) \end{aligned}$$

1.7.2. Caso Continuo

$$\begin{aligned} Cov(x,y) = \sigma_{xy} &= E((x-\mu_x)(y-\mu_y)) \\ &= \int_{-\infty}^{+\infty} \int_{-\infty}^{+\infty} (x-\mu_x)(y-\mu_y) f(x,y) dxdy \end{aligned}$$

1.8. Resultados Importantes

1. $E(x \pm y) = E(x) \pm E(y)$
2. $Cov(x,y) = E(x \cdot y) - E(x) \cdot E(y)$
3. $V(x \pm y) = V(x) + V(y) \pm 2Cov(x,y)$
4. $V(ax \pm by) = a^2 V(x) + b^2 V(y) \pm 2ab \cdot Cov(x,y)$
5. Si x y y son estadísticamente independientes:
   a) $E(x,y) = E(x) \cdot E(y)$
   b) $Cov(x,y) = 0$
   c) $V(x \pm y) = V(x) + V(y)$
   d) $V(ax \pm by) = a^2 V(x) + b^2 V(y)$
6. Si $x1, x2, x4, \ldots$ son variables aleatorias independientes 2 a 2:

$$V\left(\sum_{i=1}^{m} x_i\right) = \sum_{i=1}^{m} V(x_i)$$

2. Distribuciones

2.1. Distribuciones Discretas

2.1.1. Distribución de Bernoulli (Ber)

- Función de Cuantía

$$f(x) = p(x) = \begin{cases} p^x (1-p)^{1-x} & ; x = 0,1 \\ 0 & ; \text{otro caso} \end{cases}$$

- Función Acumulada

$$F(x) = P(X = x) = \begin{cases} 0 & ; x < 0 \\ q = 1-p & ; 0 \le x < 1 \\ 1 & ; x \ge 1 \end{cases}$$

$$X \sim Ber(x;p) \Rightarrow \begin{cases} E(x) = \mu = p \\ V(x) = \sigma^2 = p \cdot q \\ D(x) = \sigma = \sqrt{p \cdot q} \end{cases}$$

2.1.2. Distribución Binomial (b)

- Función de Cuantía

$$f(x) = p(x) = \begin{cases} \binom{n}{x} p^x \cdot q^{n-x} & ; x = 0,1,2,\ldots,n \\ 0 & ; \text{otro caso} \end{cases}$$

- Función Acumulada

$$F(x) = P(X = x) = \begin{cases} 0 & ; x < 0 \\ \displaystyle\sum_{k=0}^{[\![x]\!]} \binom{n}{k} p^k q^{n-k} & ; 0 \le x < n \\ 1 & ; x \ge 1 \end{cases}$$

$$X \sim b(x;n,p) \Rightarrow \begin{cases} E(x) = \mu = p \\ V(x) = \sigma^2 = npq \\ D(x) = \sigma = \sqrt{npq} \end{cases}$$

★ Manejo de la Tabla:

1. $\begin{pmatrix} p \leq 0{,}50 \\ n \leq 20 \end{pmatrix} \Rightarrow b(x;n,p) = B(x;n,p) - B(x-1;n,p)$

2. $\begin{pmatrix} p > 0{,}50 \\ n \leq 20 \end{pmatrix} \Rightarrow \begin{cases} \textbf{(i)}\ b(x;n,p) = B(n-x;n,1-p) - B(n-x-1;n,1-p) \\ \textbf{(ii)}\ b(x;n,p) = b(n-x,n,1-p) \text{ luego (i)} \\ \textbf{(iii)}\ B(x;n,p) = 1 - B(n-x;n,1-p) \end{cases}$

2.1.3. Distribución de Poisson $(Poisson)$

- Función de Cuantía

$$f(x) = p(x) = \begin{cases} \dfrac{e^{-\lambda} \cdot \lambda^x}{x!} & ; x = 0, 1, 2, \ldots \\ 0 & ; \text{otro caso} \end{cases}$$

- Función Acumulada

$$F(x) = P(X = x) = \begin{cases} 0 & ; x < 0 \\ \displaystyle\sum_{x=0}^{[\![x]\!]} \dfrac{e^{-\lambda} \cdot \lambda^x}{x!} & ; x \geq 0 \end{cases}$$

$$X \sim Poisson(x;\lambda) \Rightarrow \begin{cases} E(x) = \mu = \lambda = np \\ V(x) = \sigma^2 = \lambda = np \\ D(x) = \sigma = \sqrt{np} \end{cases}$$

2.2. Distribuciones Continuas

2.2.1. Distribución Uniforme o Regular (U)

- Función de Cuantía

$$f(x) = p(x) = \begin{cases} \dfrac{1}{b-a} & ; a \leq x \leq b \\ 0 & ; \text{otro caso} \end{cases}$$

- Función Acumulada

$$F(x) = \begin{cases} 0 & ; x < a \\ \displaystyle\int_{-\infty}^{x} \dfrac{1}{b-a} dx = \dfrac{x-a}{b-a} & ; a \leq x < b \\ 1 & ; x \geq b \end{cases}$$

$$X \sim U(x;a,b) \Rightarrow \begin{cases} E(x) = \mu = \dfrac{a+b}{2} \\ \\ V(x) = \sigma^2 = \dfrac{(b-a)^2}{12} \\ \\ D(x) = \sigma = \dfrac{(b-a)\sqrt{3}}{6} \end{cases}$$

2.2.2. Distribución Exponencial (exp)

- Función de Cuantía

$$f(x) = p(x) = \begin{cases} \lambda \cdot e^{-\lambda x} & ; x \geq 0 \\ 0 & ; \text{otro caso} \end{cases}$$

- Función Acumulada

$$F(x) = \begin{cases} 0 & ; x < 0 \\ \displaystyle\int_{-\infty}^{x} \lambda \cdot e^{-\lambda x} dt = 1 - e^{-\lambda x} & ; x \geq 0 \end{cases}$$

$$X \sim exp(x;\lambda) \Rightarrow \begin{cases} E(x) = \mu = \dfrac{1}{\lambda} \\ \\ V(x) = \sigma^2 = \dfrac{1}{\lambda^2} \\ \\ D(x) = \sigma = \dfrac{1}{\lambda} \end{cases}$$

★ Propiedad Amnésica

$$P(X > s + t/x > s) = P(X > t)$$

2.2.3. Distribución Normal (N)

- Función de Cuantía

$$f(x) = N(x;\mu,\sigma^2) = \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{1}{2}(\frac{x-\mu}{\sigma})^2}; x \in \mathbb{R}$$

- Función Acumulada

$$F(x) = \int_{-\infty}^{x} \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{1}{2}(\frac{t-\mu}{\sigma})^2} dt$$

2.2.4. Distribución Chi-Cuadrado (χ^2)

3. Misceláneo

3.1. Interpolación

$\phi(z)$	z
a	x
b	$?$
c	y

$$\rightarrow \quad \frac{a-c}{b-c} = \frac{x-y}{?-y}$$