

Probabilità e Statistica

Angelo Gilio

Dip. Met. Mod. Mat. Univ. La Sapienza

gilio@dmmm.uniroma1.it

... Probability doesn't exist ... (Bruno de Finetti)

Informazioni

Tutoraggio su web

<https://www.dmmm.uniroma1.it/~gilio/stdinfo/>

cartella: esami-AT

file: Programma-Prob-Stat-AT-6crediti.doc

slides: AT-RM-lezioni1.pdf; AT-RM-lezioni2.pdf;
AT-RM-lezioni3.pdf; statisticadescrittiva.pdf

e-mail: gilio@dmmm.uniroma1.it

Ricevimento: da stabilire con gli studenti

Libro adottato: *Incertezza e Probabilità*,
Romano Scozzafava, Zanichelli, ed.2008.

Esercizi: *Training Autogeno in Probabilità*,
Joseph Toscano, Zanichelli, ed.2008.

Introduzione

Il calcolo delle probabilità si è sviluppato fra il XV e il XVI secolo, prevalentemente sulla base di studi e considerazioni teoriche riguardanti situazioni e problemi connessi ai giochi d'azzardo.

Prop. logiche, eventi, indicatori

L'analisi di situazioni e problemi reali spesso comporta l'esame di fatti e aspetti incerti, che potranno successivamente risultare veri o falsi.

I fatti incerti sono formalizzati (in modo non ambiguo) mediante *proposizioni logiche* o *eventi* che possono assumere il valore *Vero* (V) oppure *Falso* (F).

Evento certo, Ω : evento definito mediante una proposizione logica certamente vera.

Evento impossibile, \emptyset : evento definito mediante una proposizione logica certamente falsa.

Esempi:

Gli eventi si indicano di solito con le lettere maiuscole:
 A , B , ..., E , H , ...

Indicatore

$$|E| = \begin{cases} 1 & \text{se } E \text{ è vero,} \\ 0 & \text{se } E \text{ è falso.} \end{cases}$$

Nota: $|\Omega| = 1$, $|\emptyset| = 0$.

Relazioni e operazioni logiche

implicazione, uguaglianza, indipendenza logica, incompatibilità; negazione, unione, intersezione.

Negazione L'evento *contrario* o *negazione* di un evento E è l'evento che è vero quando E è falso ed è falso quando E è vero. L'evento contrario di E si indica con il simbolo E^c .

$$E^c = \begin{cases} \text{vero,} & \text{se } E \text{ è falso,} \\ \text{falso,} & \text{se } E \text{ è vero.} \end{cases}$$

Nota: $|E^c| = 1 - |E|$.

Implicazione. Un evento A implica un altro evento B se quando è vero A segue che è vero anche B .

In simboli: $A \implies B$ oppure $A \subseteq B$.

$A \implies B$ equivale alla disuguaglianza $|A| \leq |B|$.

Esempi:

Uguaglianza. Due eventi A e B si dicono uguali se ognuno dei due implica l'altro, cioè se $A \implies B$ e $B \implies A$.

Unione. L'*unione* o *somma* (logica) di due eventi A, B è l'evento che è vero quando almeno uno dei due eventi è vero ed è falso quando sia A che B sono falsi. Si indica con $A \vee B$ oppure $A \cup B$.

Proprietà:

- *associativa* : $(A \vee B) \vee C = A \vee (B \vee C) = A \vee B \vee C$;

- *commutativa* : $A \vee B = B \vee A$.

Osservazioni:

$A \vee \Omega = \Omega$; $A \vee \emptyset = A$; $A \vee A = A$; $A \vee A^c = \Omega$.

Intersezione

L'*intersezione* (logica) o *prodotto* (logico) di due eventi A, B è l'evento che è vero quando entrambi gli eventi sono veri ed è falso quando almeno uno dei due eventi A, B è falso.

L'evento intersezione di A, B si indica con $A \wedge B$, oppure $A \cap B$, o più semplicemente AB .

Proprietà:

- *associativa* : $(A \wedge B) \wedge C = A \wedge (B \wedge C) = A \wedge B \wedge C$.
- *commutativa* : $A \wedge B = B \wedge A$.

Osservazioni:

$$A \wedge \Omega = A ; \quad A \wedge \emptyset = \emptyset ; \quad A \wedge A = A ; \quad A \wedge A^c = \emptyset .$$

Incompatibilità

Due eventi A, B si dicono *incompatibili* se non possono essere entrambi veri, cioè se $AB = \emptyset$.

La corrispondenza tra i valori logici di due eventi A, B e quelli di $A \wedge B$ e $A \vee B$ è riportata nella Tabella 1. Quella tra gli indicatori è riportata nella Tabella 2.

Tabella 1

A	B	AB	$A \vee B$
V	V	V	V
V	F	F	V
F	V	F	V
F	F	F	F

Tabella 2

$ A $	$ B $	$ AB $	$ A \vee B $
1	1	1	1
1	0	0	1
0	1	0	1
0	0	0	0

Proprietà degli indicatori:

$$|AB| = |A| \cdot |B| ; \quad |A \vee B| = |A| + |B| - |AB| ,$$

con $|A \vee B| = |A| + |B|$ nel caso in cui $AB = \emptyset$.

Altre proprietà:

$$AB \subseteq A \subseteq A \vee B, \quad (|AB| \leq |A| \leq |A \vee B|)$$

$$AB \subseteq B \subseteq A \vee B, \quad (|AB| \leq |B| \leq |A \vee B|)$$

Proprietà distributive :

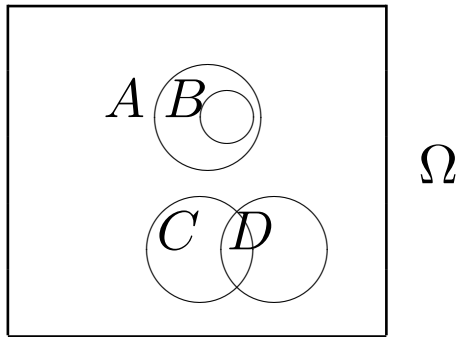
$$(A \vee B) \wedge C = AC \vee BC, \quad (A \wedge B) \vee C = (A \vee C) \wedge (B \vee C).$$

Formule di De Morgan :

$$(A \vee B)^c = A^c \wedge B^c ; \quad (A \wedge B)^c = A^c \vee B^c .$$

Diagrammi di Venn.

Consentono una rappresentazione geometrica degli eventi, utile per esaminare le relazioni e operazioni logiche.



Evento	Insieme
certo	universo
impossibile	vuoto
contrario	complementare
implicazione	inclusione
incompatibili	disgiunti
unione	unione
intersezione	intersezione

Partizioni finite dell'evento certo

$\{H_1, H_2, \dots, H_n\}$ è una partizione di Ω se:

1. $H_i H_j = \emptyset, \quad i \neq j;$
2. $H_1 \vee H_2 \vee \dots \vee H_n = \Omega.$

Equivalentemente:

$$|H_1| + |H_2| + \dots + |H_n| = 1. \quad (1)$$

Esempi:

Casi possibili o Costituenti.

Osserviamo che $\Omega \wedge \Omega = \Omega$ e che $E \vee E^c = \Omega, \forall E$.

Considerati degli eventi A, B, \dots , i *costituenti* si ottengono sviluppando l'espressione:

$$\begin{aligned} & (A \vee A^c) \wedge (B \vee B^c) \wedge \dots = \\ & = (AB \vee AB^c \vee A^cB \vee A^cB^c) \wedge \dots = \\ & = AB \dots \vee AB^c \dots \vee A^cB \dots \vee A^cB^c \dots \vee \dots . \end{aligned} \tag{2}$$

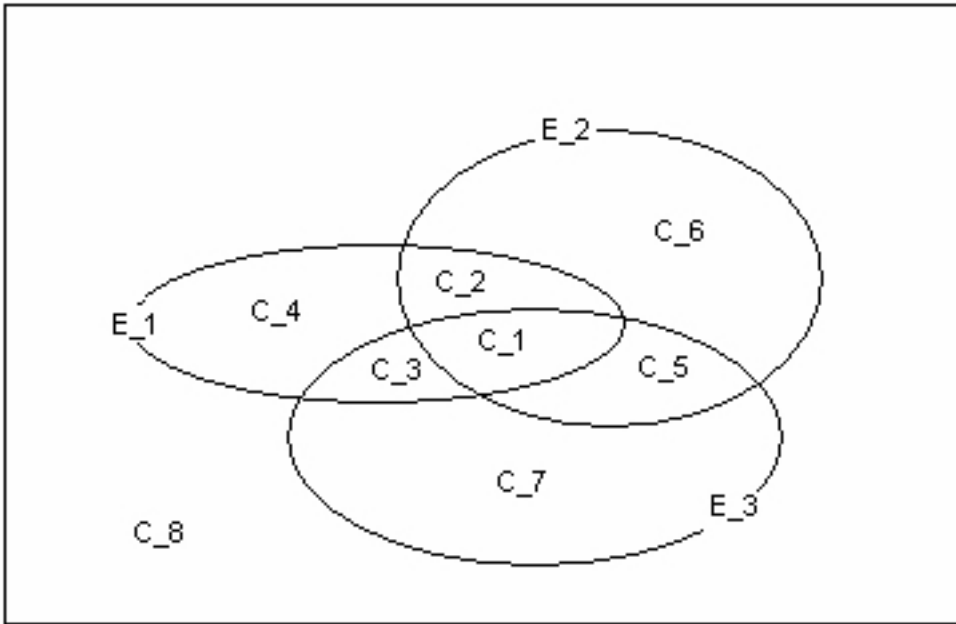
Eliminando le intersezioni impossibili, quelle rimanenti sono i casi possibili relativi agli eventi A, B, \dots .

In generale, data una famiglia $\mathcal{F}_n = \{E_1, \dots, E_n\}$, i *casi possibili* o *costituenti*, C_1, \dots, C_m , con $m \leq 2^n$, si ottengono sviluppando l'espressione

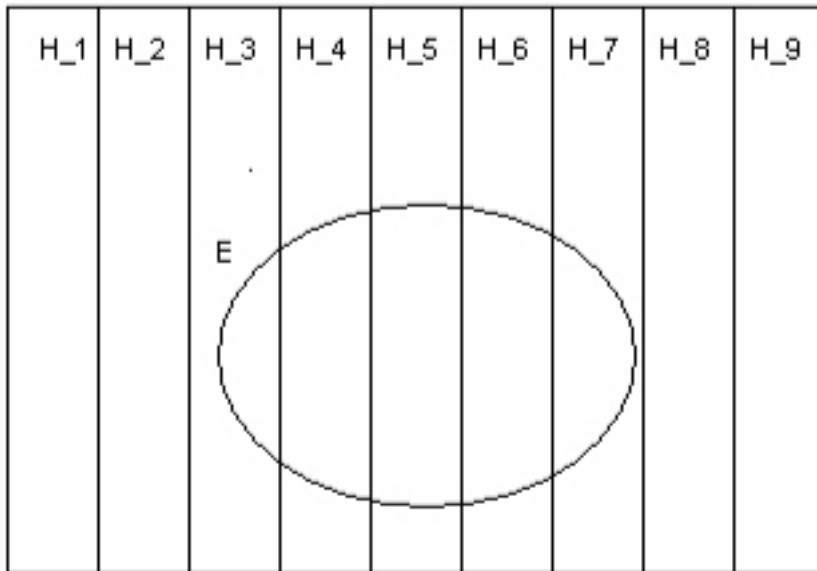
$$(E_1 \vee E_1^c) \wedge (E_2 \vee E_2^c) \wedge \dots \wedge (E_n \vee E_n^c) = C_1 \vee C_2 \vee \dots \vee C_m .$$

$$C_k = E_1^* E_2^* \dots E_n^*, \quad k = 1, 2, \dots, m \leq 2^n ,$$

dove $E_i^* = E_i$, oppure $E_i^* = E_i^c$.



Ω



Ω

Decomposizione di un evento. Dato un evento arbitrario E ed una partizione $\{H, H^c\}$, si ha:

$$E = E \wedge \Omega = E \wedge (H \vee H^c) = EH \vee EH^c . \quad (3)$$

Data una partizione $\{H_1, H_2, \dots, H_n\}$, si ha:

$$E = EH_1 \vee EH_2 \vee \dots \vee EH_n . \quad (4)$$

In molti casi, le formule (3) e (4) sono utili per calcolare la probabilità di E .

Esempi:

Da un'urna contenente 5 palline bianche e 3 nere si effettuano 2 estrazioni senza restituzione. Sia A l'evento "la 1^a pallina estratta è bianca" e B l'evento "la 2^a pallina estratta è bianca". Calcolare, in relazione a ciascun evento, il rapporto tra il numero di casi favorevoli e il numero di casi possibili, confrontando i valori ottenuti per A e B .

Data una famiglia $\mathcal{F}_n = \{E_1, \dots, E_n\}$, siano C_1, C_2, \dots, C_m i relativi costituenti. Ogni evento E_i si

può scrivere come unione logica dei costituenti ad esso favorevoli.

$$\begin{aligned} E_i &= E_i \wedge \Omega = E_i \wedge (C_1 \vee C_2 \vee \cdots \vee C_m) = \\ &= E_i C_1 \vee E_i C_2 \vee \cdots \vee E_i C_m = \\ &= \bigvee_{h:C_h \subseteq E_i} (E_i C_h) \vee \bigvee_{h:C_h \not\subseteq E_i} (E_i C_h) = \\ &= \bigvee_{h:C_h \subseteq E_i} C_h. \end{aligned}$$

Esempio 1 Con riferimento a una data partita di calcio tra la *Roma* e l' *Inter*, si considerino gli eventi:

- *A* : la Roma a cinque minuti dal termine della gara è in vantaggio sull'Inter;
- *B* : la Roma vince la partita;
- *C* : la Roma a cinque minuti dal termine della gara è in svantaggio sull'Inter.

A e C sono incompatibili, quindi gli eventi ABC e AB^cC sono impossibili. Pertanto, i costituenti sono i seguenti:

- $C_1 = ABC^c$
la Roma a cinque minuti dal termine della gara è in vantaggio sull'Inter e vince la partita.
- $C_2 = A^cBC$
la Roma a cinque minuti dal termine della gara è in svantaggio sull'Inter e vince la partita.
- $C_3 = A^cBC^c$
a cinque minuti dal termine della gara le squadre sono in parità e la Roma vince la partita.
- $C_4 = AB^cC^c$
la Roma a cinque minuti dal termine della gara è in vantaggio sull'Inter e non vince la partita.
- $C_5 = A^cB^cC$
la Roma a cinque minuti dal termine della gara è in svantaggio sull'Inter e non vince la partita.

- $C_6 = A^c B^c C^c$
a cinque minuti dal termine della gara le squadre sono in parità e la Roma non vince la partita.

A, B, C si possono rappresentare nel modo seguente

$$\begin{aligned} A &= C_1 \vee C_4 = ABC^c \vee AB^c C^c, \\ B &= C_1 \vee C_2 \vee C_3 = ABC^c \vee A^c BC \vee A^c BC^c, \\ C &= C_2 \vee C_5 = A^c BC \vee A^c B^c C. \end{aligned}$$

Indipendenza logica.

Un evento A si dice *logicamente indipendente* da altri eventi B, C, \dots se, assegnando in tutti i modi possibili il valore logico (vero o falso) agli eventi B, C, \dots , l'evento A rimane incerto, potendo risultare sia vero che falso.

Se A non è logicamente indipendente da B, C, \dots si possono presentare vari tipi di dipendenza logica.

Data una famiglia $\mathcal{F} = \{E_1, E_2, \dots, E_n\}$, gli eventi di \mathcal{F} si dicono logicamente indipendenti se il numero m di costituenti è pari a 2^n .

Esempio 2 Estrazioni con restituzione da un'urna contenente 1 pallina bianca e 1 nera.

Gli eventi

E_i = la i -ma pallina estratta è bianca, $i = 1, \dots, 5$, sono logicamente indipendenti?

Esempio 3 Estrazioni senza restituzione da un'urna contenente 2 palline bianche e 3 nere.

Gli eventi E_1, E_2, E_3 sono logicamente indipendenti?

Ad esempio, se E_1, E_2 sono entrambi veri (cioè le prime due palline estratte sono *bianche*), cosa si può dire della terza pallina e quindi del valore logico di E_3 ?

Se invece E_1 è vero ed E_2 è falso, cosa si può dire di E_3 ?

L'evento E_5 è *logicamente dipendente* da E_1, \dots, E_4 ?

(Se si suppone noto il risultato delle prime quattro estrazioni, il risultato della quinta è incerto?)

Criterio classico e proprietà della probabilità

In molti problemi aleatori, per ragioni di simmetria o di mancanza di informazioni sul fenomeno studiato, i casi *possibili* sono giudicati **ugualmente possibili**.

In tali situazioni, per valutare il grado di attendibilità di un evento, è del tutto naturale basarsi sul *numero di casi favorevoli* ad esso.

Definizione 1 (Classica) Considerato un esperimento aleatorio con m casi possibili, giudicati ugualmente *possibili*, ed un evento E con r casi *favorevoli*, la probabilità $P(E)$ di E è uguale al rapporto $\frac{r}{m}$.

$$P(E) = \frac{\# \text{ casi favorevoli}}{\# \text{ casi possibili}}$$

Esempio (*lancio di 2 dadi*). Indichiamo con X, Y il risultato dei due dadi e con $Z = X + Y$ il totale.

I casi possibili (le coppie (x, y)) sono $6 \times 6 = 36$;

$$P(Z = 3) = \frac{2}{36} = \frac{1}{18},$$

in quanto le coppie favorevoli sono due : $(1, 2), (2, 1)$.

$$P(X > Y) = \frac{15}{36} = \frac{5}{12},$$

6 coppie favorevoli all'evento $(X = Y)$ e delle restanti 30 quelle favorevoli all'evento $(X > Y)$ sono 15.

Proprietà fondamentali della probabilità

Utilizzando la Definizione (1) si possono dimostrare le seguenti proprietà di base (*assiomi*) della probabilità.

- **P1.** $P(E) \geq 0$, per ogni evento E ;
(il numero r di casi favorevoli è non negativo e quindi $\frac{r}{m} \geq 0$)
- **P2.** $P(\Omega) = 1$;
(per l'evento certo Ω , si ha $r = m$ e quindi $\frac{r}{m} = 1$)
- **P3.** se $AB = \emptyset$, allora $P(A \vee B) = P(A) + P(B)$
(*proprietà additiva*).
Dim. di **P3**.

Da $AB = \emptyset$, segue $r_{AB} = 0$ e quindi

$$r_{A \vee B} = r_A + r_B - r_{AB} = r_A + r_B.$$

Pertanto

$$P(A \vee B) = \frac{r_A + r_B}{m} = \frac{r_A}{m} + \frac{r_B}{m} = P(A) + P(B).$$

In particolare, nel caso $B = A^c$, applicando **P2** e **P3** e osservando che $r_{A^c} = m - r_A$ si ottiene

$$P(A^c) = 1 - P(A). \quad (5)$$

Se $AB = \emptyset$, ponendo $C = (A \vee B)^c$, si ha

$$P(C) = 1 - P(A \vee B) = 1 - P(A) - P(B), \quad (6)$$

e quindi per la partizione $\{A, B, C\}$ vale

$$P(A) + P(B) + P(C) = 1. \quad (7)$$

Se E_1, \dots, E_n sono a due a due incompatibili, si ha:

$$\begin{aligned} P(E_1 \vee \dots \vee E_n) &= P(E_1 \vee \dots \vee E_{n-1}) + P(E_n) = \\ P(E_1 \vee \dots \vee E_{n-2}) + P(E_{n-1}) + P(E_n) &= \\ \dots &= P(E_1) + P(E_2) + \dots + P(E_n) . \end{aligned} \tag{8}$$

Se $\{E_1, \dots, E_n\}$ è una partizione di Ω , si ha:

$$P(E_1) + P(E_2) + \dots + P(E_n) = 1 . \tag{9}$$

Proprietà di monotonia. Se $A \subseteq B$, si ha

$$B = A \vee A^c B, \quad A \wedge A^c B = \emptyset,$$

e da **P1**, **P3** segue

$$P(B) = P(A) + P(A^c B) \geq P(A) . \tag{10}$$

Probabilità di $A \vee B$ in generale.

Dati due eventi compatibili A e B , si ha

$$A \vee B = A \vee A^c B, \quad P(A \vee B) = P(A) + P(A^c B),$$

$$B = AB \vee A^c B, \quad P(A^c B) = P(B) - P(AB),$$

e quindi

$$P(A \vee B) = P(A) + P(B) - P(AB). \quad (11)$$

Iterando la formula (11), per l'unione di tre eventi arbitrari A, B, C si ottiene

$$\begin{aligned} P(A \vee B \vee C) &= \dots = \\ &= P(A) + P(B) + P(C) + \\ &\quad - P(AB) - P(AC) - P(BC) + P(ABC), \end{aligned}$$

equivalente (cfr. *De Morgan*) anche alla formula

$$P(A \vee B \vee C) = 1 - P(A^c B^c C^c). \quad (12)$$

Paradosso del Cavalier De Méré

Esempio 4 Si effettuano 4 lanci di un dado, A : "esce almeno una volta la faccia 6".

Si effettuano 24 lanci di una coppia di dadi, B : esce almeno una volta la coppia (6,6).

Si racconta che (nel 1654) il Cavalier De Méré (accanito giocatore di azzardo) valutasse ugualmente probabili A e B sulla base del seguente ragionamento

nel primo esperimento in ognuno dei 4 lanci la faccia 6 ha probabilità $\frac{1}{6}$ e quindi

$$P(A) = \frac{1}{6} + \frac{1}{6} + \frac{1}{6} + \frac{1}{6} = \frac{2}{3}.$$

Nel secondo esperimento in ognuno dei 24 lanci la coppia (6,6) ha probabilità $\frac{1}{36}$ e quindi

$$P(B) = \frac{1}{36} + \dots + \frac{1}{36} = \frac{24}{36} = \frac{2}{3} = P(A).$$

Negli esperimenti pratici ... per uno dei due eventi la frequenza di successo leggermente superiore a quella dell'altro.

Il problema venne sottoposto a Blaise Pascal.

... se i lanci nel primo esperimento fossero più di 6, ad esempio 7, si avrebbe

$$P(A) = \frac{1}{6} + \dots + \frac{1}{6} = \frac{7}{6} > 1 ,$$

il che è assurdo.

Soluzione. $P(A) = 1 - P(A^c) = 1 - \frac{5^4}{6^4} \simeq 0.51$

$P(B) = 1 - P(B^c) = 1 - \frac{35^{24}}{36^{24}} \simeq 0.49.$

Quindi si ha $P(A) > P(B).$

Aspetti critici della definizione classica

1) Scelta appropriata dei casi da giudicare ugualmente possibili.

Esempio 5 Un esperimento aleatorio consiste in due lanci di una moneta.

E : in almeno un lancio esce Testa.

Casi possibili:

C_1 : esce Testa al primo lancio (e l'esperimento termina);

C_2 : esce Croce al primo lancio e Testa al secondo lancio;

C_3 : esce Croce in entrambi i lanci.

C_1 e C_2 sono favorevoli ad E .

Allora ... $P(E) = \frac{2}{3}$? (Non ragionevole!)

Non è ragionevole giudicare i tre casi ugualmente possibili.

Infatti, $P(E_1) = \frac{1}{2}$ (se Testa o Croce al primo lancio si giudicano ugualmente possibili).

... inoltre, l'unione logica di E_2 ed E_3 coincide con l'evento *Croce al primo lancio*, che ha probabilità $\frac{1}{2}$,

... pertanto, $P(E_2) = P(E_3) = \frac{1}{4}$.

... quindi una valutazione più adeguata è $P(E) = \frac{3}{4}$.

Tale valutazione si ottiene direttamente considerando come casi (ugualmente) possibili i seguenti quattro, i

primi tre dei quali sono quelli favorevoli ad E :

1. esce Testa in entrambi i lanci;
2. esce Testa al primo lancio e Croce al secondo lancio;
3. esce Croce al primo lancio e Testa al secondo lancio;
4. esce Croce in entrambi i lanci.

2) La Definizione 1 non è applicabile sempre.

Esempio 6 Se uno studente sostiene un esame vi sono due casi possibili (lo studente può essere promosso o bocciato) ... nessuno, però, concluderebbe che la probabilità di essere promosso è $\frac{1}{2}$.

... per la valutazione delle probabilità occorrono quindi metodi generali e solo in casi particolari ci si può basare sulla Definizione 1.

3) Circolarità.

Il termine *ugualmente possibili* utilizzato nella “Definizione Classica” non può significare altro che *ugualmente probabili* e quindi ... il concetto di probabilità viene definito mediante se stesso.

Impostazione frequentista

N prove indipendenti e ripetute nelle stesse condizioni;

f_N = frequenza relativa di "successo" sulle N prove, per un dato evento E ;

$$P(E) = \lim_{N \rightarrow +\infty} f_N .$$

Critiche.

- 1) Le frequenze non costituiscono una successione numerica data mediante una legge, ma sono dei numeri rilevati sperimentalmente. Il concetto di limite utilizzato non è quello rigoroso dell'analisi.
- 2) (applicabilità) si deve prendere in considerazione una successione di prove fatte nelle stesse condizioni. Non è sempre possibile.
- 3) (circolarità) il concetto di indipendenza ha un significato probabilistico.

In conclusione, la definizione classica e la definizione frequentista si possono utilizzare solo come *criteri*

operativi di valutazione, utili in certi casi, e non per *definire* la probabilità.

Impostazione soggettiva della probabilità

I precedenti criteri di valutazione possono essere comunque integrati in una impostazione più generale: la teoria *soggettiva*, sviluppata intorno al 1930 dal matematico italiano Bruno de Finetti.

Nell'impostazione soggettiva, ... sono rigorosamente distinti gli aspetti *oggettivi*, concernenti gli eventi, da quelli *soggettivi*, concernenti le valutazioni probabilistiche (*logica del certo* e *logica del probabile*).

Capita spesso di prendere parte a discussioni accese in cui delle persone esprimono opinioni e valutazioni differenti sulla maggiore o minore attendibilità di fatti incerti in confronto ad altri.

La diversità di valutazioni ... risiede nel fatto che le persone hanno un'esperienza e uno *stato di informazione* differenti fra di loro.

Esempio 7 Estrazioni con restituzione da un'urna di *composizione incognita* contenente palline bianche e nere. Si vuole valutare la probabilità p di estrarre una pallina bianca alla 1001-ma estrazione.

Se non si conosce il risultato delle precedenti 1000 estrazioni può essere naturale valutare $p = \frac{1}{2}$.

Se si sa che 900 volte la pallina estratta è stata bianca, in mancanza di altre informazioni, si può essere indotti a valutare $p \simeq \frac{9}{10}$.

Il diverso atteggiamento ... è dovuto a un diverso *grado di fiducia* nel verificarsi dell'evento considerato.

... l'informazione di cui si è in possesso e il modo in cui si elabora tale informazione giocano un ruolo essenziale nella valutazione delle probabilità.

... nell'impostazione soggettiva tale aspetto viene riconosciuto esplicitamente ...

Definizione 2 Dato un evento E , la probabilità $P(E) = p$ dell'evento E , secondo un dato individuo in un certo stato di informazione, è la *misura numerica* del suo grado di fiducia nel verificarsi di E .

Criterio operativo di misura + condizione di coerenza:

Criterio della scommessa

$P(E) = p$ rappresenta *il prezzo che un individuo ritiene equo pagare per ricevere*

1 *se si verifica* E
0 *se non si verifica* E .

Più in generale, se $S \in \mathbb{R}$, $S \neq 0$, l'individuo deve essere disposto a pagare pS per ricevere

S *se si verifica* E
0 *altrimenti.*

Condizione di coerenza:

L'individuo deve essere coerente, cioè le sue valutazioni di probabilità per uno o più eventi non devono essere tali da comportare a priori una perdita certa.

Se indichiamo con \mathcal{G} il guadagno aleatorio, si ha

$$\begin{aligned}\mathcal{G} &= S|E| - pS = S(|E| - p) = \\ &= \begin{cases} S(1 - p), & E \text{ vero} \\ -pS, & E \text{ falso.} \end{cases} \end{aligned}$$

In generale, dati $\mathcal{F}_n = \{E_1, \dots, E_n\}$ e $\mathcal{P}_n = (p_1, \dots, p_n)$, con $p_i = P(E_i)$, $i = 1, \dots, n$, si ha

$$\mathcal{G} = \dots = \sum_{i=1}^n S_i(|E_i| - p_i),$$

con S_1, \dots, S_n numeri reali arbitrari (non tutti nulli).

Definizione 3 La valutazione \mathcal{P}_n si dice *coerente* se, per ogni S_1, \dots, S_n , risulta

$$\text{Min } \mathcal{G} \cdot \text{Max } \mathcal{G} \leq 0 .$$

Proprietà fondamentali della probabilità

- **P1.** $P(E) \geq 0$, per ogni evento E ;
- **P2.** $P(\Omega) = 1$;
- **P3.** se $AB = \emptyset$, allora $P(A \vee B) = P(A) + P(B)$.

In relazione alla valutazione $P(E) = p$ si ha

$$\mathcal{G} = \begin{cases} S(1 - p), & \text{E vero} \\ -pS, & \text{E falso,} \end{cases}$$

... la condizione di coerenza diventa ...

$$S(1 - p)(-pS) = -p(1 - p)S^2 \leq 0,$$

da cui segue ... $0 \leq p \leq 1$. (Proprietà **P1**).

In particolare, se $E = \Omega$, si ha

$$\text{Min } \mathcal{G} = \text{Max } \mathcal{G} = \mathcal{G} = S(1 - p)$$

e quindi ... $\mathcal{G} = 0$, per ogni S , ... da cui si ottiene $P(\Omega) = 1$. (Proprietà **P2**).

Proprietà additiva (**P3**).

Data una partizione di Ω , $\{H_1, \dots, H_n\}$, con $P(H_1) = p_1, \dots, P(H_n) = p_n$, si ha

$$\mathcal{G} = S_1(|H_1| - p_1) + \dots + S_n(|H_n| - p_n).$$

Osservando che $|H_1| + \dots + |H_n| = 1$ e scegliendo $S_1 = \dots = S_n = S$ si ottiene

$$\text{Min } \mathcal{G} = \text{Max } \mathcal{G} = \mathcal{G} = \dots = S[1 - (p_1 + \dots + p_n)],$$

e quindi ... dev'essere $\mathcal{G} = 0$.

Allora, segue $p_1 + \dots + p_n = 1$, ovvero

$$P(H_1) + \dots + P(H_n) = 1. \quad (13)$$

Dim. della proprietà additiva:

dati A e B incompatibili e considerata la partizione $\{A \vee B, (A \vee B)^c\}$, deve valere

$$P(A \vee B) + P[(A \vee B)^c] = 1 .$$

D'altra parte, per la partizione $\{A, B, (A \vee B)^c\}$ deve valere

$$P(A) + P(B) + P[(A \vee B)^c] = 1 ,$$

e quindi:

$$P(A \vee B) = P(A) + P(B) . \quad (14)$$

Dati n eventi E_1, \dots, E_n , a due a due incompatibili, si ha

$$P(E_1 \vee \dots \vee E_n) = P(E_1) + \dots + P(E_n) . \quad (15)$$

Condizioni sulla probabilità dell'Unione. Dati due eventi A e B e due valutazioni di probabilità $P(A)$ e $P(B)$, consideriamo l'evento unione $A \vee B$. Dalla proprietà di monotonia segue che

$$P(A) \leq P(A \vee B), \quad P(B) \leq P(A \vee B), \quad (16)$$

quindi

$$P(A \vee B) \geq \max \{P(A), P(B)\}. \quad (17)$$

Osservando, inoltre, che $P(A \vee B) \leq 1$ e che

$$P(A \vee B) = P(A) + P(B) - P(AB) \leq P(A) + P(B),$$

segue

$$P(A \vee B) \leq \min \{1, P(A) + P(B)\}. \quad (18)$$

La (17) e la (18), assegnati $P(A)$ e $P(B)$, stabiliscono delle limitazioni per $P(A \vee B)$.

Osservazione 1 (*criterio classico di valutazione*)

Se in un dato esperimento aleatorio si hanno m casi possibili C_1, \dots, C_m giudicati *ugualmente probabili*, poichè

$$P(C_1) + \dots + P(C_m) = 1,$$

segue

$$P(C_k) = \frac{1}{m}, \quad k = 1, \dots, m.$$

Allora, considerato un evento E con r casi favorevoli, ad esempio $E = C_1 \vee \dots \vee C_r$, dalla formula (15) si ottiene

$$P(E) = P(C_1) + \dots + P(C_r) = \frac{r}{m},$$

cioè la probabilità di E è pari al *rapporto tra il numero di casi favorevoli e il numero di casi possibili*.

Verifica della coerenza

$\mathcal{F}_n = \{E_1, \dots, E_n\}$, famiglia di eventi arbitrari, legati da possibili relazioni logiche.

$\mathcal{P}_n = (p_1, \dots, p_n)$, assegnazione di probabilità su \mathcal{F}_n , con $p_i = P(E_i)$, $i = 1, \dots, n$.

C_1, \dots, C_m ($m \leq 2^n$), costituenti relativi alla famiglia \mathcal{F}_n .

Ricordiamo che

$$E_i = \bigvee_{h: C_h \subseteq E_i} C_h. \quad (19)$$

Posto $P(C_h) = \lambda_h$, dev'essere

$$\lambda_h \geq 0, \quad h = 1, \dots, m; \quad \sum_{h=1}^m \lambda_h = 1. \quad (20)$$

Inoltre, dalla (19) segue

$$P(E_i) = \sum_{h: C_h \subseteq E_i} \lambda_h. \quad (21)$$

Si consideri il seguente sistema nelle incognite (non negative) $\lambda_1, \dots, \lambda_m$

$$(\mathcal{S}) : \begin{cases} \sum_{h:C_h \subseteq E_i} \lambda_h = p_i, & i = 1, \dots, n; \\ \sum_{h=1}^m \lambda_h = 1, \\ \lambda_h \geq 0, & h = 1, \dots, m. \end{cases} \quad (22)$$

Si può dimostrare il seguente risultato

Teorema 2 La valutazione di probabilità \mathcal{P}_n è coerente se e solo se il sistema (\mathcal{S}) è compatibile.

Propagazione

Sia $\mathcal{F}_n = \{E_1, E_2, \dots, E_n\}$ una famiglia di eventi e sia $P_n = \{p_1, p_2, \dots, p_n\}$ una valutazione di probabilità coerente su \mathcal{F}_n .

Se consideriamo un ulteriore evento E_{n+1} , sorge il problema di come valutare la probabilità $p_{n+1} = P(E_{n+1})$ in modo tale che la valutazione $P_{n+1} = \{p_1, \dots, p_n, p_{n+1}\}$ su $\mathcal{F}_{n+1} = \{E_1, \dots, E_n, E_{n+1}\}$ sia coerente.

... la scelta di p_{n+1} non è arbitraria, ma va fatta in un opportuno intervallo $[p', p''] \subseteq [0, 1]$.

Esempio.

Sia $\mathcal{F}_1 = \{E_1\}$, con $P(E_1) = p_1 \in [0, 1]$. Dato un evento E_2 incompatibile con E_1 , con $E_1 \vee E_2 \subset \Omega$, si ponga $P(E_2) = p_2$.

Determinare i valori di p_2 tali che la valutazione (p_1, p_2) su $\mathcal{F}_2 = \{E_1, E_2\}$ sia coerente.

Soluzione: $p_2 \in [0, 1 - p_1]$.

Infatti $P(E_2) \geq 0$, inoltre

$$P(E_1 \vee E_2) = P(E_1) + P(E_2) \leq 1,$$

e quindi

$$0 \leq P(E_2) \leq 1 - P(E_1).$$

Determinazione dell'intervallo $[p', p'']$.

Siano C_1, C_2, \dots, C_m i costituenti relativi alla famiglia $\mathcal{F}_n = \{E_1, E_2, \dots, E_n\}$.

Dato E_{n+1} , distinguiamo 3 classi di costituenti:

- (i) costituenti che implicano (cioè favorevoli a) E_{n+1} ;
- (ii) costituenti che non implicano E_{n+1} , ma sono con esso compatibili;
- (iii) costituenti incompatibili con E_{n+1} .

Definiamo gli insiemi

$$J_1 = \{h : C_h \wedge E_{n+1} = C_h\},$$

$$J_2 = \{h : \emptyset \subset C_h \wedge E_{n+1} \subset C_h\},$$

$$J_3 = \{h : C_h \wedge E_{n+1} = \emptyset\}.$$

Osservando che $\bigvee_{h \in J_3} E_{n+1} C_h = \emptyset$, si ha

$$\begin{aligned} E_{n+1} &= \bigvee_{h=1}^m E_{n+1} C_h = \bigvee_{j \in J_1 \cup J_2 \cup J_3} E_{n+1} C_h = \\ &= \left(\bigvee_{h \in J_1} E_{n+1} C_h \right) \vee \left(\bigvee_{h \in J_2} E_{n+1} C_h \right) = \\ &= \left(\bigvee_{h \in J_1} C_h \right) \vee \left(\bigvee_{h \in J_2} E_{n+1} C_h \right). \end{aligned}$$

Posto

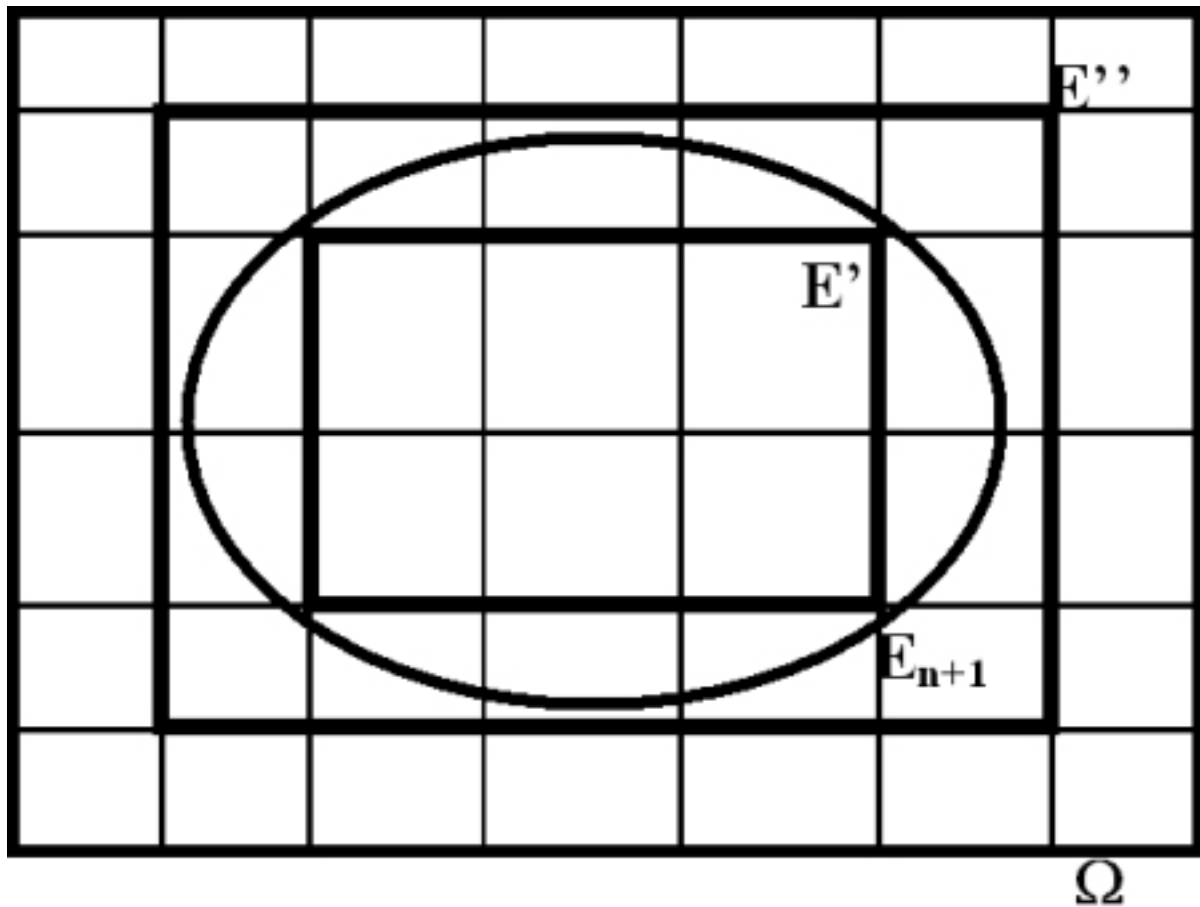
$$E' = \bigvee_{h \in J_1} C_h, \quad E'' = \bigvee_{h \in J_1 \cup J_2} C_h,$$

vale la seguente relazione

$$E' \subseteq E_{n+1} \subseteq E''. \quad (23)$$

E' si chiama *massimo evento logicamente dipendente* da E_1, E_2, \dots, E_n contenuto in E_{n+1} .

E'' si chiama *minimo evento logicamente dipendente* da E_1, E_2, \dots, E_n contenente E_{n+1} .



Nella rappresentazione grafica i costituenti sono i rettangolini. Dalla relazione (23), supponendo assegnate le probabilità ai costituenti, segue

$$\sum_{h \in J_1} \lambda_h = P(E') \leq P(E_{n+1}) \leq P(E'') = \sum_{h \in J_1 \cup J_2} \lambda_h .$$

Avendo supposto coerente la valutazione \mathcal{P}_n su \mathcal{F}_n , segue che esistono soluzioni $(\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_m)$ del

sistema (\mathcal{S}) di pag.38. Indicando con S l'insieme delle soluzioni, definiamo le seguenti quantità:

$$p' = \min_{(\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_m) \in S} P(E'),$$

$$p'' = \max_{(\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_m) \in S} P(E'').$$

... la valutazione \mathcal{P}_{n+1} è coerente se e solo se $p_{n+1} \in [p', p'']$.

Ad esempio, dati due eventi compatibili A, B , con $P(A) = 0.6$, $P(B) = 0.7$, ricordando le (17) e (18), la valutazione di probabilità $(0.6, 0.7, \alpha)$ sulla famiglia $\{A, B, A \vee B\}$ è coerente se e solo se

Nell'esempio precedente, posto $P(AB) = \beta$, si può dimostrare che la valutazione $(0.6, 0.7, \beta)$ su $\{A, B, AB\}$ è coerente se e solo se

Esempi.

1. Sia $\mathcal{F}_1 = \{E_1\}$, con $P(E_1) = p_1 \in [0, 1]$. Dato un evento E_2 incompatibile con E_1 , con $E_2 \neq E_1^c$, si ponga $P(E_2) = p_2$.

Per quali valori di p_2 la valutazione (p_1, p_2) su $\mathcal{F}_2 = \{E_1, E_2\}$ è coerente?

Risposta: osservando che $P(E_1 \vee E_2) = p_1 + p_2 \leq 1$, si ha $p_2 \in [0, 1 - p_1]$.

2. Date le probabilità $P(A) = x, P(B) = y$, la valutazione $P(A \vee B) = z$ è un'estensione coerente di (x, y) se e solo se

$$\text{Max } \{x, y\} \leq z \leq \text{Min } \{1, x + y\},$$

mentre la valutazione $P(AB) = p$ è un'estensione coerente se e solo se

$$\text{Max } \{0, x + y - 1\} \leq p \leq \text{Min } \{x, y\}.$$

3. Un sistema S è costituito da 3 moduli M_1, M_2, M_3 . Definiti gli eventi $A_i = \text{“il modulo } M_i \text{ funziona”}$, $i = 1, 2, 3$, supponiamo che se M_i funziona allora M_{i+1} funziona, $i = 1, 2$. Posto $P(A_1) = \frac{1}{4}$, $P(A_3) = \frac{6}{10}$, determinare l'intervallo $[p', p'']$ delle estensioni coerenti $P(A_2) = p$.

Soluzione: Dalla proprietà di monotonia della probabilità segue $P(A_1) \leq P(A_2) \leq P(A_3)$ e quindi $\frac{1}{4} \leq P(A_2) \leq \frac{3}{5}$. Si può verificare che $[p', p''] = [\frac{1}{4}, \frac{3}{5}]$. Infatti, essendo $A_1 \subseteq A_2 \subseteq A_3$, i costituenti sono

$$C_1 = A_1 \wedge A_2 \wedge A_3; \quad C_2 = A_1^c \wedge A_2 \wedge A_3;$$

$$C_3 = A_1^c \wedge A_2^c \wedge A_3; \quad C_4 = A_1^c \wedge A_2^c \wedge A_3^c.$$

Allora, posto $P(C_h) = \lambda_h$, la coerenza della valutazione

$$P(A_1) = \frac{1}{4}, \quad P(A_3) = \frac{3}{5}, \quad P(A_2) = p,$$

equivale alla risolubilità del sistema

$$\begin{cases} \lambda_1 = \frac{1}{4}, & \lambda_1 + \lambda_2 = p, & \lambda_1 + \lambda_2 + \lambda_3 = \frac{3}{5}, \\ \lambda_1 + \lambda_2 + \lambda_3 + \lambda_4 = 1, & \lambda_h \geq 0, \forall h. \end{cases}$$

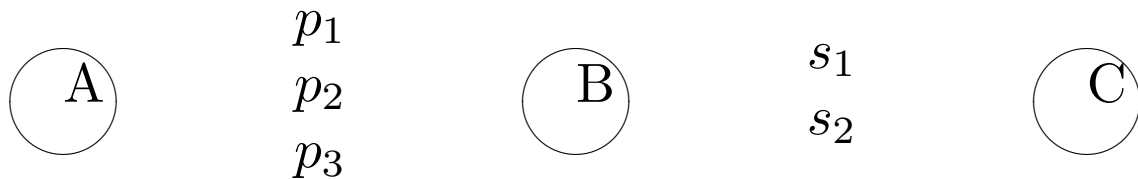
Si ha: $p = \frac{1}{4} + \lambda_2 = \frac{3}{5} - \lambda_3$, $\lambda_2 + \lambda_3 = \frac{7}{20}$;

pertanto, il sistema è risolubile se e solo se $p \in [\frac{1}{4}, \frac{3}{5}]$.

In particolare, le soluzioni del sistema sono tutti e soli i vettori $(\lambda_1, \lambda_2, \lambda_3, \lambda_4) = (\frac{1}{4}, \lambda, \frac{7}{20} - \lambda, \frac{2}{5})$, con $\lambda \in [0, \frac{7}{20}]$.

Richiami di calcolo combinatorio

Esempio 8 Tre località A, B, C sono collegate nel seguente modo : per andare da A a B vi sono 3 percorsi distinti : p_1, p_2, p_3 ; da B a C vi sono 2 percorsi distinti : s_1, s_2 .



I percorsi distinti (per almeno un tratto) che vanno da A a C passando per B non sono $3+2$, ma $3 \times 2 = 6$, cioè i seguenti :

(p_1, s_1) , (p_1, s_2) , (p_2, s_1) , (p_2, s_2) , (p_3, s_1) , (p_3, s_2) .

Il *principio della moltiplicazione* interviene spesso nel calcolo combinatorio.

Nell'Esempio 8 la scelta di un percorso richiede l'esecuzione di una procedura in due passi, con un certo

numero di alternative in ogni passo:

1. si sceglie il tratto da A a B (3 alternative);
2. si sceglie il tratto da B a C (2 alternative);

il numero di modi in cui si può svolgere l'intera procedura è pari al prodotto delle alternative in ogni passo ($3 \times 2 = 6$).

Ogni percorso corrisponde ad una **coppia ordinata** (p_i, s_j) , $i = 1, 2, 3$; $j = 1, 2$.

In generale, dato un insieme S formato da n oggetti a_1, a_2, \dots, a_n , può essere utile calcolare il numero di *disposizioni* o *gruppi ordinati* distinti $(\alpha_1, \dots, \alpha_r)$, dove $\alpha_i \in S, i = 1, \dots, r$, che si possono formare utilizzando gli elementi di S .

Due gruppi ordinati si dicono distinti se differiscono per almeno un **elemento** oppure per **l'ordine**.

Per scegliere un gruppo ordinato si esegue una procedura di r passi.

Disposizioni con ripetizione. Le componenti $\alpha_1, \dots, \alpha_r$ possono essere (in parte o anche tutte) coincidenti. In questo caso si parla di *disposizioni con ripetizione* di classe r di n oggetti. Le alternative in ogni passo sono sempre n ; pertanto, in base al principio della moltiplicazione visto nell'Esempio (8), indicando con $D'_{n,r}$ il numero di disposizioni con ripetizione si ha

$$D'_{n,r} = n \times \dots \times n = n^r . \quad (24)$$

Disposizioni semplici o senza ripetizione. Se $\alpha_i \neq \alpha_j$, per $i \neq j$. In questo caso si parla di *disposizioni semplici o senza ripetizione* (di classe r di n oggetti) e dev'essere ovviamente $r \leq n$. Indicando con $D_{n,r}$ il numero di disposizioni senza ripetizione si ha

$$D_{n,r} = n(n-1) \dots (n-r+1) . \quad (25)$$

In particolare, per $r = n$ si ha $n - r + 1 = 1$, da cui segue :

$$D_{n,n} = P_n = n \times (n-1) \dots \times 2 \times 1 = n! . \quad (26)$$

Il simbolo $n!$ si legge n *fattoriale* e rappresenta il prodotto di tutti i numeri da 1 sino a n . Indica il numero di **permutazioni** o *ordinamenti* di n oggetti.

Ad esempio : $3! = 3 \times 2 \times 1 = 6$; $5! = \dots = 120$.
Per convenzione si pone $0! = 1$. La definizione di $n!$ può esser data in forma ricorsiva:

$$n! = \begin{cases} n \times (n - 1)! & \text{se } n \in \mathcal{N} \\ 1 & \text{se } n = 0. \end{cases} \quad (27)$$

Inoltre :

$$D_{n,r} = n(n - 1) \cdots (n - r + 1) = \frac{n!}{(n - r)!} . \quad (28)$$

Ad esempio : $D_{5,2} = 5 \times 4 = \frac{5!}{3!}$; $D_{10,4} = 10 \times 9 \times 8 \times 7 = \frac{10!}{6!}$.

Combinazioni

Consideriamo per l'insieme $S = \{a_1, a_2, \dots, a_n\}$ il calcolo del numero di *gruppi non ordinati* distinti $[\alpha_1, \dots, \alpha_r]$, dove $\alpha_i \in S, i = 1, \dots, r$, che si possono formare utilizzando gli elementi di S .

Due gruppi non ordinati si dicono distinti se differiscono per almeno un elemento.

Distinguiamo due casi:

- le componenti $\alpha_1, \dots, \alpha_r$ possono essere (in parte o anche tutte) coincidenti. In questo caso si parla di *combinazioni con ripetizione* (di classe r di n oggetti).
- $\alpha_i \neq \alpha_j$, se $i \neq j$.

In questo caso si parla di *combinazioni semplici* (di classe r di n oggetti) e dev'essere ovviamente $r \leq n$. Ogni combinazione semplice rappresenta un sottoinsieme di r oggetti di S e si indica con il simbolo $\{\alpha_1, \dots, \alpha_r\}$.

Comb. Semplici. Il numero di combinazioni semplici si indica con il simbolo $C_{n,r}$ e rappresenta il numero di sottoinsiemi distinti di r oggetti che si possono formare con gli elementi di S .

Osservando che ogni combinazione semplice dà luogo ad $r!$ disposizioni semplici (distinte per l'ordine), segue:

$$D_{n,r} = r! \times C_{n,r} ,$$

e quindi :

$$C_{n,r} = \frac{D_{n,r}}{r!} = \frac{n!}{r!(n-r)!} = \binom{n}{r} . \quad (29)$$

Il simbolo $\binom{n}{r}$ si legge *coefficiente binomiale n su r* . Ovviamente essendo:

$$\binom{n}{r} = \binom{n}{n-r} = \frac{n!}{r!(n-r)!} ,$$

segue che $C_{n,r} = C_{n,n-r}$.

Un'altra formula utile è la seguente :

$$\binom{n}{r} = \binom{n-1}{r-1} + \binom{n-1}{r},$$

ovvero: $C_{n,r} = C_{n-1,r-1} + C_{n-1,r}$.

Osserviamo che, volendo costruire un generico sottoinsieme $I \subseteq S$, si deve eseguire una procedura di n passi, con 2 alternative in ogni passo. Infatti, occorre decidere per ciascuno degli elementi a_1, \dots, a_n se includerlo oppure no in I .

Pertanto, il numero di sottoinsiemi di S , compreso il sottoinsieme vuoto \emptyset e lo stesso S , è dato da

$$\sum_{r=0}^n \binom{n}{r} = 2^n,$$

come segue anche dalla formula del *binomio di Newton* ponendo $a = b = 1$:

$$(a + b)^n = \sum_{r=0}^n \binom{n}{r} a^r b^{n-r},$$

Combinazioni con ripetizione. Infine, in relazione al numero $C'_{n,r}$ di combinazioni (con ripetizione) di classe r di n oggetti, con un opportuno ragionamento combinatorio si potrebbe verificare che risulta :

$$C'_{n,r} = \binom{r+n-1}{r} = \binom{r+n-1}{n-1} .$$

Coefficiente multinomiale. Dati n interi $r_k \geq 0$, tali che $r_1 + r_2 + \dots + r_n = r$, si definisce coefficiente multinomiale il seguente:

$$\frac{r!}{r_1!r_2!\dots r_n!}$$

esso individua il numero di modi in cui r elementi uguali (palline) si possono ripartire in n scatole in modo che la scatola k contenga r_k elementi.

scatola 1	scatola 2	...	scatola n
r_1	r_2	...	r_n

Paradosso di De Méré.

... lanciando 4 volte un dado i casi possibili sono 6^4 (disposizioni con ripetizione di classe 4 di 6 oggetti). I casi favorevoli all'evento $E_h =$ "la faccia 6 esce esattamente h volte" sono

$$\binom{4}{h} 5^{4-h}, \quad h = 0, 1, \dots, 4.$$

Infatti, $\binom{4}{h}$ è il numero di modi distinti in cui la faccia 6 esce in h dei 4 lanci del dado, mentre 5^{4-h} è il numero di modi distinti in cui nei rimanenti $4 - h$ lanci può uscire una delle altre cinque facce diverse da 6. Il prodotto di tali numeri rappresenta i casi favorevoli ad E_h e quindi:

$$P(E_h) = \frac{\binom{4}{h} 5^{4-h}}{6^4}.$$

Pertanto :

$$P(A) = \sum_{h=1}^4 \frac{\binom{4}{h} 5^{4-h}}{6^4} \simeq 0.51 .$$

In modo analogo, si può dimostrare che :

$$P(B) = \sum_{k=1}^{24} \frac{\binom{24}{k} 35^{24-k}}{36^{24}} \simeq 0.49 ,$$

e quindi : $P(A) > P(B)$.

Ricordiamo che alla stessa conclusione si può giungere in modo più rapido utilizzando le relazioni

$$P(A) = 1 - P(A^c) ; \quad P(B) = 1 - P(B^c) .$$

Numeri Aleatori

Dati n eventi E_1, E_2, \dots, E_n ed n numeri reali x_1, x_2, \dots, x_n si definisce *numero aleatorio semplice* la seguente quantità:

$$X = x_1 \cdot |E_1| + x_2 \cdot |E_2| + \dots + x_n \cdot |E_n|. \quad (30)$$

X è un numero ben determinato ma incognito.

I possibili valori di X si ottengono assegnando i valori 1 o 0 agli indicatori degli eventi E_i , $i = 1, \dots, n$, in tutti i modi *possibili*.

X si può anche considerare come una funzione reale definita sull'insieme dei costituenti C_1, \dots, C_m .

L'insieme dei possibili valori di X costituisce il codominio di tale funzione.

Esempio. Dato un evento E , il suo indicatore è il numero aleatorio

$$X = 1 \cdot |E| + 0 \cdot |E^c| = |E|,$$

con valori possibili 0 e 1.

Esempio. (*lancio di un dado*) Definiamo gli eventi

$$E_i = \text{"esce il numero } i\text{"}, \quad i = 1, 2, \dots, 6.$$

Risultato aleatorio del lancio:

$$X = 1 \cdot |E_1| + 2 \cdot |E_2| + \dots + 6 \cdot |E_6|.$$

E_1, E_2, \dots, E_6 formano una partizione e quindi $1, 2, \dots, 6$ rappresentano i possibili valori di X .

Forma Canonica.

Dato

$$X = x_1 \cdot |H_1| + x_2 \cdot |H_2| + \dots + x_n \cdot |H_n|,$$

con $\{H_1, H_2, \dots, H_n\}$ partizione di Ω , il codominio di X è $\{x_1, x_2, \dots, x_n\}$.

In generale non è così semplice determinare il codominio di X .

Esempio Dati tre eventi E_1, E_2, E_3 , con le seguenti relazioni logiche

$$E_1 E_2 = \emptyset, \quad E_3 \subseteq E_1,$$

determiniamo i valori possibili del numero aleatorio

$$X = 2|E_1| - |E_2| + |E_3| = 2 \cdot |E_1| + (-1) \cdot |E_2| + 1 \cdot |E_3|.$$

Costituenti generati da E_1, E_2, E_3 e corrispondenti valori di X :

$$C_1 = E_1 E_2^c E_3, \quad \chi_1 = 3; \quad C_2 = E_1 E_2^c E_3^c, \quad \chi_2 = 2;$$

$$C_3 = E_1^c E_2 E_3^c, \quad \chi_3 = -1; \quad C_4 = E_1^c E_2^c E_3^c, \quad \chi_4 = 0.$$

Pertanto l'insieme dei possibili valori (o codominio) di X è $\{-1, 0, 2, 3\}$.

In generale, per ottenere la forma canonica occorre calcolare i costituenti e i corrispondenti valori di X .

Sia $\{E_1, E_2, \dots, E_n\}$ una famiglia di eventi e siano C_1, C_2, \dots, C_m i relativi costituenti.

Si consideri inoltre il numero aleatorio

$$X = x_1|E_1| + x_2|E_2| + \dots + x_n|E_n|.$$

Al costituente C_h corrisponde per X un ben determinato valore χ_h .

$$\begin{array}{lcl} C_1 & \rightarrow & \chi_1 \\ C_2 & \rightarrow & \chi_2 \\ \vdots & \vdots & \vdots \\ C_m & \rightarrow & \chi_m \end{array}$$

Rappresentazione canonica

$$X = \chi_1 \cdot |C_1| + \chi_2 \cdot |C_2| + \dots + \chi_m \cdot |C_m|.$$

Legame tra i coefficienti x_i e i valori χ_h :

$$\chi_h = \dots = \sum_{i: C_h \subseteq E_i} x_i.$$

Previsione di un N.A.

Dati n eventi E_1, E_2, \dots, E_n , con

$$p_1 = P(E_1), p_2 = P(E_2), \dots, p_n = P(E_n),$$

si consideri il numero aleatorio

$$X = x_1|E_1| + x_2|E_2| + \dots + x_n|E_n|.$$

Si definisce *Previsione* (o *Speranza Matematica* o *Valor Medio*) di X la seguente quantità:

$$\mathbb{P}(X) = p_1x_1 + p_2x_2 + \dots + p_nx_n \quad (31)$$

Interpretazione di $\mathbb{P}(X)$ con il criterio della scommessa.

Supponiamo che il n.a. X sia una vincita aleatoria, nel senso che

$$\begin{array}{llll} \text{se si verifica } E_1 & (|E_1| = 1) & \Rightarrow & \text{si vince } x_1 \\ \text{se si verifica } E_2 & (|E_2| = 1) & \Rightarrow & \text{si vince } x_2 \\ & \vdots & & \vdots \\ \text{se si verifica } E_n & (|E_n| = 1) & \Rightarrow & \text{si vince } x_n \end{array}$$

dove X rappresenta l'importo totale che si riceve.

$\mathbb{P}(X)$ rappresenta *la quantità che si deve pagare (ricevere) per ricevere (pagare) X* . Infatti

si paga $p_1 x_1$ per ricevere $\begin{cases} x_1, & \text{se si verific. } E_1, \\ 0, & \text{se si verific. } E_1^c, \end{cases}$
 (ovvero, per ricevere $x_1 | E_1 |$)

si paga $p_2 x_2$ per ricevere $x_2 | E_2 |$

\vdots \vdots \vdots \vdots
 si paga $p_n x_n$ per ricevere $x_n | E_n |$.

Allora, sommando tali termini

si paga $\sum_{i=1}^n p_i x_i$ per ricevere $\sum_{i=1}^n x_i | E_i |$

cioè: si paga $\mathbb{P}(X)$ per ricevere X .

Esempio.

$$X = |E| = 1|E| + 0|E^c|,$$

con $p = P(E)$. Si ha

$$\mathbb{P}(X) = \mathbb{P}(|E|) = 1 \cdot p + 0 \cdot (1 - p) = p,$$

cioè: $\mathbb{P}(|E|) = p = P(E)$.

Interpretazione meccanica.

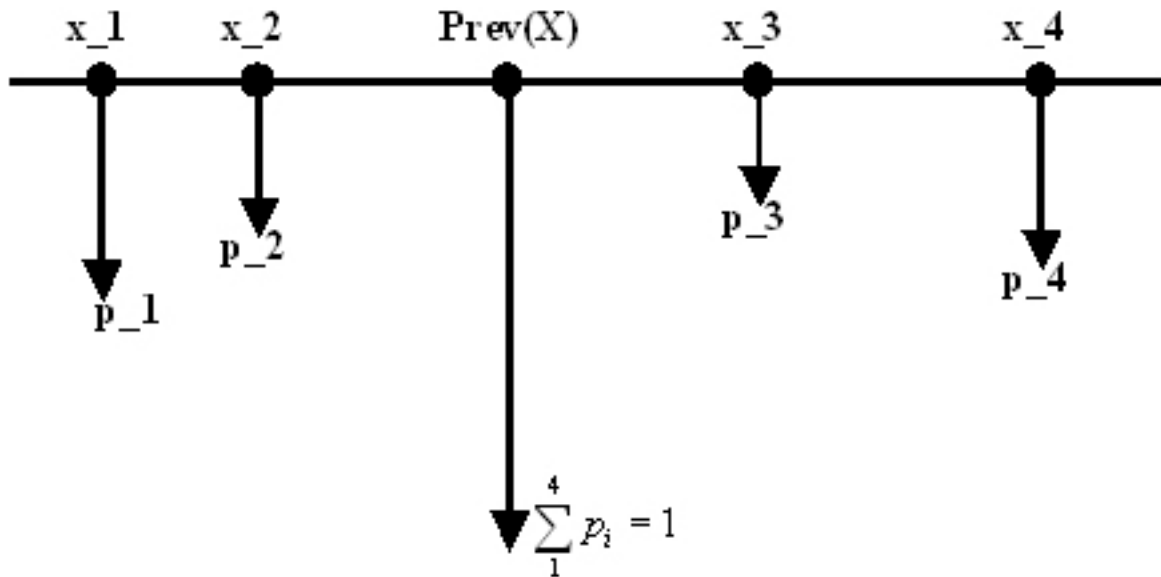
Sia data una *partizione* di Ω , $\{H_1, \dots, H_n\}$, con

$$p_1 = P(H_1), p_2 = P(H_2), \dots, p_n = P(H_n).$$

Ricordiamo che $\sum_{i=1}^n p_i = 1$. La previsione $\mathbb{P}(X)$ del numero

$$X = x_1|H_1| + x_2|H_2| + \dots + x_n|H_n|$$

si può interpretare come il *baricentro* di una distribuzione di masse p_1, \dots, p_n , collocate in n punti di ascissa x_1, \dots, x_n .



Osservazione. La prevision gode della seguente proprietà

$$\min(X) \leq \mathbb{P}(X) \leq \max(X). \quad (32)$$

Dim. Consideriamo solo il caso

$$X = x_1|H_1| + x_2|H_2| + \cdots + x_n|H_n|,$$

con $\{H_1, \dots, H_n\}$ una *partizione* di Ω .

Affinchè le probabilità p_1, p_2, \dots, p_n siano coerenti

dev'essere

$$\sum_{i=1}^n p_i = 1, \quad p_i \geq 0, \quad i = 1, \dots, n.$$

Quindi $\mathbb{P}(X) = p_1x_1 + p_2x_2 + \dots + p_nx_n$ è combinazione lineare convessa dei punti (ascisse) x_i . Osserviamo che, per ogni $i = 1, \dots, n$, si ha

$$\min(X) \leq x_i \leq \max(X),$$

e quindi

$$p_i \min(X) \leq p_i x_i \leq p_i \max(X).$$

Allora

.....

$$\min(X) \leq \mathbb{P}(X) \leq \max(X).$$

Combinazioni lineari di n.a. Siano dati due numeri aleatori

$$\begin{aligned} X &= x_1|E_1| + x_2|E_2| + \dots + x_n|E_n| \\ Y &= y_1|A_1| + y_2|A_2| + \dots + y_n|A_m| \end{aligned}$$

e siano a e b due numeri reali arbitrari. La quantità $Z = aX + bY$ è il numero aleatorio che si ottiene dalla combinazione lineare degli indicatori degli eventi

$$E_1, \dots, E_n, A_1, \dots, A_m,$$

con coefficienti

$$ax_1, \dots, ax_n, by_1, \dots, by_m,$$

ovvero

$$\begin{aligned} Z = aX + bY = & ax_1|E_1| + ax_2|E_2| + \dots + ax_n|E_n| + \\ & + by_1|A_1| + by_2|A_2| + \dots + by_m|A_m|. \end{aligned}$$

Linearità della Previsione. Dati X, Y, a, b si ha

$$\mathbb{P}(aX + bY) = a\mathbb{P}(X) + b\mathbb{P}(Y). \quad (33)$$

Infatti

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(aX + bY) &= \mathbb{P}\left(\sum_{i=1}^n ax_i|E_i| + \sum_{j=1}^m by_j|A_j|\right) = \\ &= \sum_{i=1}^n ax_i P(E_i) + \sum_{j=1}^m by_j P(A_j) = a\mathbb{P}(X) + b\mathbb{P}(Y). \end{aligned}$$

In particolare $\mathbb{P}(b) = b$. Infatti, b si può interpretare come il numero aleatorio $Y = b|\Omega|$ e quindi

$$\mathbb{P}(Y) = b \cdot P(\Omega) = b \cdot 1 = b.$$

Casi particolari:

$$\mathbb{P}(aX) = a\mathbb{P}(X), \quad \mathbb{P}(b) = b,$$

$$\mathbb{P}(aX + b) = a\mathbb{P}(X) + b, \quad \mathbb{P}(-X) = -\mathbb{P}(X).$$

Dati n n.a. X_1, X_2, \dots, X_n , dalla (33) si ottiene

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(X_1 + \dots + X_n) &= \mathbb{P}(X_1 + \dots + X_{n-1}) + \mathbb{P}(X_n) = \\ &= \dots = \mathbb{P}(X_1) + \mathbb{P}(X_2) + \dots + \mathbb{P}(X_n). \end{aligned}$$

Più in generale, dati n numeri reali arbitrari a_1, a_2, \dots, a_n , si ha

$$\mathbb{P}\left(\sum_{i=1}^n a_i X_i\right) = \mathbb{P}\left(\sum_{i=1}^{n-1} a_i X_i\right) + a_n \mathbb{P}(X_n) = \dots = \sum_{i=1}^n a_i \mathbb{P}(X_i).$$

Esempio. (*n* estrazioni con restituzione da un'urna di composizione nota, contenente palline bianche e nere)

Definiamo

$E_i =$ "esce pallina bianca alla *i*-esima estrazione".

Per convenzione, diciamo che si ha un "successo" (oppure "insuccesso") nell'*i*-esima prova se E_i è vero (oppure falso). Il numero aleatorio

$$X = |E_1| + |E_2| + \cdots + |E_n|$$

rappresenta il "numero di successi su *n* prove".

Se assumiamo gli eventi E_i equiprobabili, con

$$P(E_i) = p, \quad i = 1, 2, \dots, n,$$

si ottiene

$$\mathbb{P}(X) = \mathbb{P}(|E_1| + |E_2| + \cdots + |E_n|) = \cdots = np.$$

Per il numero aleatorio

$$Z = \frac{|E_1| + |E_2| + \cdots + |E_n|}{n},$$

che rappresenta il numero medio di successi o frequenza relativa di successo, si ha $\mathbb{P}(Z) = \mathbb{P}\left(\frac{X}{n}\right) = p$.
(la previsione della frequenza relativa coincide con la probabilità di successo in ogni prova)

Probabilità dell'unione di n eventi: principio di inclusione-esclusione.

Dati n eventi E_1, \dots, E_n e supposto che siano state assegnate le probabilità

$$P(E_{i_1} E_{i_2} \cdots E_{i_h}), \quad \forall \{i_1, i_2, \dots, i_h\} \subseteq \{1, 2, \dots, n\},$$

con $1 \leq h \leq n$, calcoliamo la probabilità dell'evento $A = E_1 \vee \cdots \vee E_n$. Si ha

$$\begin{aligned} A^c &= E_1^c E_2^c \cdots E_n^c, \quad P(A) = 1 - P(A^c) = 1 - \mathbb{P}(|A^c|); \\ |A^c| &= |E_1^c| \cdots |E_n^c| = (1 - |E_1|) \cdots (1 - |E_n|) = \\ &= 1 - \sum_i |E_i| + \sum_{\{i,j\}} |E_i E_j| - \sum_{\{i,j,k\}} |E_i E_j E_k| + \cdots \\ &\cdots + (-1)^n |E_1 E_2 \cdots E_n|. \end{aligned}$$

Allora, posto

$$s_1 = \sum_i \mathbb{P}(|E_i|) = \sum_i P(E_i),$$

$$s_2 = \sum_{\{i,j\}} \mathbb{P}(|E_i E_j|) = \sum_{\{i,j\}} P(E_i E_j),$$

$$s_3 = \sum_{\{i,j,k\}} \mathbb{P}(|E_i E_j E_k|) = \sum_{\{i,j,k\}} P(E_i E_j E_k),$$

.....

$$s_n = \mathbb{P}(|E_1 E_2 \cdots E_n|) = P(E_1 E_2 \cdots E_n),$$

dalla linearità della previsione segue

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(|A^c|) &= P(A^c) = 1 - s_1 + s_2 - s_3 + \cdots + (-1)^n s_n = \\ &= \sum_{h=0}^n (-1)^h s_h, \end{aligned}$$

dove per convenzione $s_0 = 1$, e quindi

$$\begin{aligned} P(A) &= \sum_{h=1}^n (-1)^{h+1} s_h = \sum_i P(E_i) - \sum_{\{i,j\}} P(E_i E_j) + \\ &+ \sum_{\{i,j,k\}} P(E_i E_j E_k) - \cdots + (-1)^{n+1} P(E_1 E_2 \cdots E_n). \end{aligned}$$

Problema delle concordanze.

Supponiamo di dover inserire n lettere in n buste, ognuna con un proprio indirizzo. Se le lettere vengono inserite a caso nelle buste, qual'è la probabilità p che vi siano zero concordanze, cioè che nessuna lettera capiti nella propria busta?

Definito l'evento

$A =$ "almeno una lettera capita nella sua busta",
si ha:

$$P(E_i) = \frac{1}{n}, \quad P(E_i E_j) = \frac{1}{n(n-1)} = \frac{(n-2)!}{n!},$$

$$P(E_i E_j E_k) = \frac{1}{n(n-1)(n-2)} = \frac{(n-3)!}{n!}, \quad \dots$$

$$\dots, \quad P(E_1 E_2 \dots E_n) = \frac{1}{n!}, \quad \text{da cui segue}$$

$$s_1 = \sum_i P(E_i) = \sum_i \frac{1}{n} = 1,$$

$$s_2 = \sum_{\{i,j\}} P(E_i E_j) = \sum_{\{i,j\}} \frac{(n-2)!}{n!} = \binom{n}{2} \cdot \frac{(n-2)!}{n!} = \frac{1}{2},$$

$$s_3 = \sum_{\{i,j,k\}} P(E_i E_j E_k) = \sum_{\{i,j,k\}} \frac{(n-3)!}{n!} =$$

$$= \binom{n}{3} \cdot \frac{(n-3)!}{n!} = \frac{1}{3!}, \quad \dots \dots, \quad s_n = P(E_1 E_2 \dots E_n) = \frac{1}{n!}.$$

Allora, per n abbastanza grande (in questo caso basta $n > 7$) si ottiene

$$\begin{aligned} p = P(A^c) &= \sum_{h=0}^n (-1)^h s_h = \sum_{h=0}^n \frac{(-1)^h}{h!} \simeq \\ &\simeq \sum_{h=0}^{+\infty} \frac{(-1)^h}{h!} = e^{-1}. \end{aligned}$$

Pertanto, la probabilità di zero concordanze è all'incirca uguale all'inverso del numero di Nepero ($e^{-1} \simeq 0.367879$).

Se indichiamo con X il numero aleatorio di concordanze, si ha

$$X = |E_1| + |E_2| + \cdots + |E_n|,$$

ed essendo $P(E_i) = \frac{1}{n}$, segue: $\mathbb{P}(X) = 1$.

Nota: $X \in \{0, 1, \dots, n-2, n\}$, con

$$P(X = k) = \cdots = \frac{1}{k!} \sum_{h=0}^{n-k} \frac{(-1)^h}{h!}.$$

Varianza.

La previsione $\mathbb{P}(X)$ si può interpretare come il valore centrale della distribuzione di probabilità di X e in alcuni casi la sua conoscenza è sufficiente per sintetizzare la distribuzione di probabilità (come accade per il baricentro nel caso di un sistema di masse).

In generale, assegnare solo la previsione non è sufficiente. Un altro aspetto importante è quello di descrivere la dispersione della distribuzione di probabilità.

Esempio: Enzo mangia 2 polli e Marco non ne mangia nessuno "in media" ne mangiano uno a testa!

Per misurare la dispersione della distribuzione di probabilità di X (attorno al suo valor medio $\mathbb{P}(X)$), si introduce il concetto di *varianza*.

Definizione. Dato un numero aleatorio X , con $\mathbb{P}(X) = m$, si definisce *Varianza* di X , indicata con $Var(X)$ oppure σ_X^2 , la seguente quantità

$$Var(X) = \mathbb{P}[(X - m)^2]. \quad (34)$$

Indicando con x_1, x_2, \dots, x_n i **possibili valori** di X , si ha

$$X = x_1|X = x_1| + x_2|X = x_2| + \dots + x_n|X = x_n|.$$

Posto $P(X = x_i) = p_i$, segue

$$\mathbb{P}(X) = p_1x_1 + p_2x_2 + \dots + p_nx_n.$$

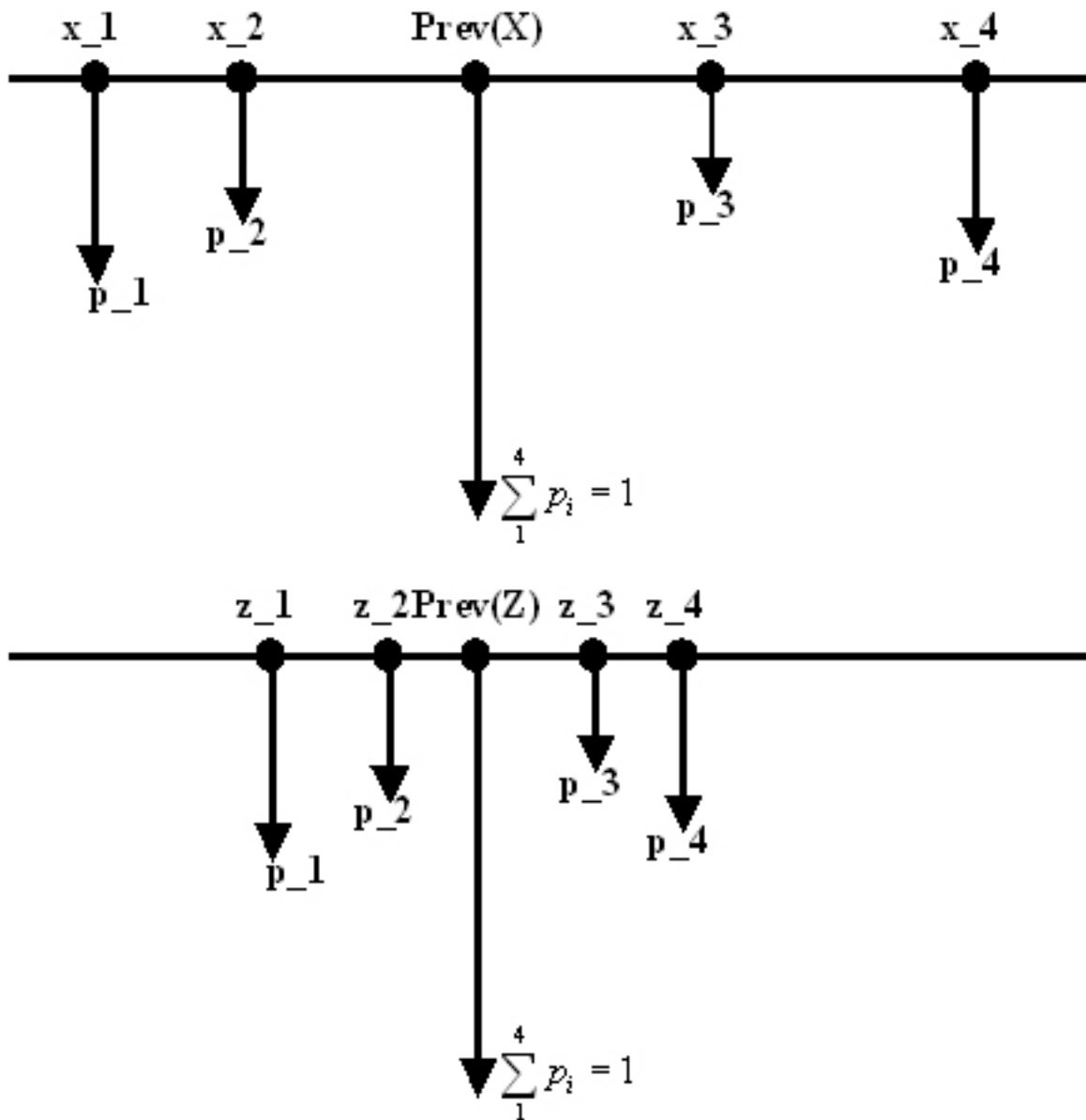
Posto $Y = (X - m)^2$, si ha

$$Y = (x_1 - m)^2|X = x_1| + \dots + (x_n - m)^2|X = x_n|.$$

Allora,

$$\begin{aligned} \text{Var}(X) &= \mathbb{P}[(X - m)^2] = \mathbb{P}(Y) = \\ &= p_1(x_1 - m)^2 + p_2(x_2 - m)^2 + \dots + p_n(x_n - m)^2 = \\ &= \sum_{i=1}^n p_i(x_i - m)^2. \end{aligned}$$

Come si può intuire, la varianza è tanto più grande quanto più la distribuzione è *dispersa* attorno al valor medio, ovvero quanto più sono probabili i valori di X lontani dal valor medio $\mathbb{P}(X)$.



Osservazione:

$$\mathbb{P}(X) = \mathbb{P}(Z), \quad \text{Var}(X) > \text{Var}(Z).$$

Dal punto di vista meccanico, la $Var(X)$ coincide con il momento d'inerzia rispetto al baricentro (com'è noto, tale momento d'inerzia misura la dispersione di massa rispetto al baricentro).

Scarto quadratico medio (deviazione standard).

$$\sigma_X = \sqrt{\sigma_X^2} = \sqrt{\mathbb{P}[(X - m)^2]}. \quad (35)$$

Esempio. Siano dati tre numeri aleatori X, Y, Z , con le seguenti distribuzioni:

	-2	-1	1	2
X		$\frac{1}{2}$	$\frac{1}{2}$	
Y	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{4}$
Z	$\frac{1}{2}$			$\frac{1}{2}$

cioè

$$P(X = -1) = P(X = 1) = \frac{1}{2},$$

$$P(Y = -2) = P(Y = -1) = P(Y = 1) = P(Y = 2) = \frac{1}{4},$$

$$P(Z = -2) = P(Z = 2) = \frac{1}{2}.$$

Si ha $\mathbb{P}(X) = \mathbb{P}(Y) = \mathbb{P}(Z) = 0$, mentre per le varianze risulta

$$\begin{aligned}\sigma_X^2 &= \frac{1}{2}(-1 - 0)^2 + \frac{1}{2}(1 - 0)^2 = 1, \\ \sigma_Y^2 &= \dots = \frac{5}{2}, \quad \sigma_Z^2 = \dots = 4.\end{aligned}$$

Quindi: $Var(Z) > Var(Y) > Var(X)$.

Esempio. ... popolazione statistica costituita da due individui: uno mangia 2 polli (supponiamo, a settimana) e l'altro 0 polli.

X = numero (aleatorio) di polli mangiati ogni settimana dalla persona estratta.

$$X = \begin{cases} 0, & P(X = 0) = \frac{1}{2}, \\ 2, & P(X = 2) = \frac{1}{2}. \end{cases}$$

... altra popolazione statistica, in cui entrambi gli individui mangiano 1 pollo a settimana.

Y = numero (aleatorio) di polli mangiati settimanalmente dalla persona estratta.

$$Y = 1, \quad P(Y = 1) = 1.$$

Allora:

$$\mathbb{P}(X) = \mathbb{P}(Y) = 1,$$

mentre:

$$\sigma_X^2 = 1 > \sigma_Y^2 = 0.$$

Varianza di un indicatore. Dato un evento E con $P(E) = p$ e $p(E^c) = 1 - p = q$, essendo $\mathbb{P}(|E|) = p$, si ha $Var(|E|) = pq$. Infatti

$$\sigma_{|E|}^2 = \mathbb{P}[(|E| - p)^2] = \dots = pq.$$

Nota: $Var(|E|) = pq \leq \frac{1}{4}$.

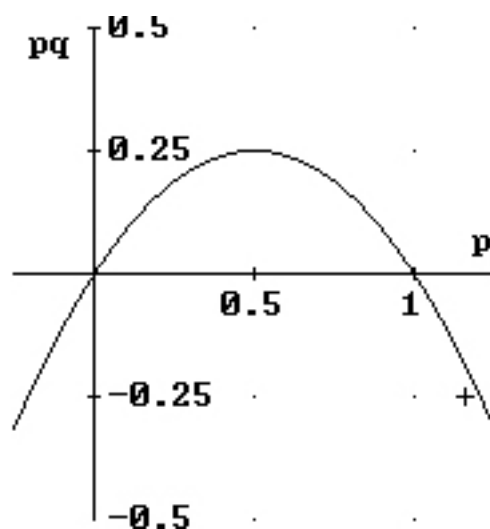


Figura 1: $Var(|E|)$

Proprietà della varianza.

1. $Var(X) \geq 0$;
2. $Var(X + c) = Var(X)$;
3. $Var(aX) = a^2 Var(X)$, per ogni $a \in \mathbb{R}$;
4. $Var(aX + b) = a^2 Var(X)$, per ogni $a, b \in \mathbb{R}$;
5. $Var(-X) = Var(X)$;
6. $Var(X) = \mathbb{P}(X^2) - [\mathbb{P}(X)]^2$.

Dim. della 6 ($m = \mathbb{P}(X)$):

$$\begin{aligned}\sigma_X^2 &= \mathbb{P}[(X - m)^2] = \mathbb{P}(X^2 - 2mX + m^2) = \\ &= \mathbb{P}(X^2) - 2m\mathbb{P}(X) + m^2 = \mathbb{P}(X^2) - [\mathbb{P}(X)]^2.\end{aligned}$$

Dalla proprietà 4, per la deviazione standard si ha

$$\sigma_{(aX+b)} = |a|\sigma_X, \quad \text{per ogni } a, b \in \mathbb{R}.$$

Standardizzazione

Dato un n.a. X , con $\mathbb{P}(X) = m$ e deviazione standard σ_X , consideriamo il seguente n.a.

$$Z = \frac{X - m}{\sigma_X}.$$

Utilizzando sia le proprietà della previsione che della varianza si ha

$$\mathbb{P}(Z) = 0, \quad \sigma_Z^2 = \sigma_Z = 1.$$

Il n.a. $Z = \frac{X-m}{\sigma_X}$ dicesi numero aleatorio **ridotto** o **standardizzato**.

Disuguaglianza di Markov. Dato un n.a. $X \geq 0$, con $\mathbb{P}(X) = m$, e un numero reale $\alpha > m$, si ha

$$P(X \geq \alpha) \leq \frac{m}{\alpha}. \quad (36)$$

Disuguaglianza di Cebicev. Dato un n.a. arbitrario X , con $\mathbb{P}(X) = m$ e deviazione standard σ , si ha

$$P(|X - m| \geq k\sigma) \leq \frac{1}{k^2}, \quad \forall k \in \mathbb{R} \ (k > 1). \quad (37)$$

Covarianza Ricordiamo che, dati due numeri aleatori X e Y , con $\mathbb{P}(X) = m_X$, $\mathbb{P}(Y) = m_Y$, si ha

$$\mathbb{P}(X + Y) = \mathbb{P}(X) + \mathbb{P}(Y) = m_X + m_Y .$$

Calcoliamo $Var(X + Y)$.

$$\begin{aligned} Var(X + Y) &= \mathbb{P}\{[(X + Y) - (m_X + m_Y)]^2\} = \\ &= \dots\dots\dots = \\ &= Var(X) + Var(Y) + 2\mathbb{P}[(X - m_X)(Y - m_Y)] . \end{aligned} \tag{38}$$

La quantità $\mathbb{P}[(X - m_X)(Y - m_Y)]$ si definisce **co-varianza** di X, Y e si indica con $Cov(X, Y)$, oppure σ_{XY} ; quindi

$$Var(X + Y) = Var(X) + Var(Y) + 2Cov(X, Y) . \tag{39}$$

Pertanto: $\sigma_{X+Y}^2 = \sigma_X^2 + \sigma_Y^2 + 2\sigma_{XY}$.

Osserviamo che

$$\begin{aligned} \text{Cov}(X, Y) &= \mathbb{P}[(X - m_X)(Y - m_Y)] = \\ &= \dots = \mathbb{P}(XY) - \mathbb{P}(X)\mathbb{P}(Y). \end{aligned} \quad (40)$$

In particolare

$$\text{Cov}(X, X) = \mathbb{P}(X^2) - [\mathbb{P}(X)]^2 = \sigma_X^2.$$

La covarianza di X e Y è una misura della tendenza di X e Y ad associarsi prevalentemente secondo valori

X	Y	X	Y	
1. grande	grande,	piccolo	piccolo	$(\Leftrightarrow \sigma_{XY} > 0)$
2. grande	piccolo,	piccolo	grande	$(\Leftrightarrow \sigma_{XY} < 0)$

dove X grande e Y grande significano $X > \mathbb{P}(X)$ e $Y > \mathbb{P}(Y)$ e, analogamente, X piccolo e Y piccolo significano $X < \mathbb{P}(X)$ e $Y < \mathbb{P}(Y)$.

Se come tendenza prevale il 1^o caso si ha correlazione positiva ($\sigma_{XY} > 0$).

Se prevale il 2^o caso si ha correlazione negativa ($\sigma_{XY} < 0$).

Esempio. n palline vengono distribuite a caso in 2 scatole. Ogni pallina ha 2 alternative e quindi ci sono 2^n ripartizioni possibili, ognuna di probabilità $\frac{1}{2^n}$. Siano
 $X =$ “numero di palline nella prima scatola”
 $Y =$ “numero di scatole non vuote”.

Si ha:

$$X \in \{0, 1, \dots, n\}, \quad Y \in \{1, 2\}.$$

Per ogni fissato h , si ha

$$P(X = h) = P(X = n - h) = \frac{\binom{n}{h}}{2^n}.$$

Inoltre

$$P(Y = 1) = P(X = 0) + P(X = n) = \frac{2}{2^n} = \frac{1}{2^{n-1}},$$

$$P(Y = 2) = 1 - \frac{1}{2^{n-1}}.$$

Indicando con E_i l'evento “la i -ma pallina capita nella prima scatola”, $i = 1, \dots, n$, si ha $P(E_i) = \frac{1}{2}$, $\forall i$.

Inoltre

$$X = \sum_{i=1}^n |E_i| = \sum_{h=0}^n h \cdot |X = h|,$$

$$Y = 1|Y = 1| + 2|Y = 2|,$$

e quindi

$$\mathbb{P}(X) = \sum_{i=1}^n \mathbb{P}(|E_i|) = \frac{n}{2}.$$

In alternativa:

$$\mathbb{P}(X) = \sum_{h=0}^n h \frac{\binom{n}{h}}{2^n} = \frac{n}{2}.$$

$$\mathbb{P}(Y) = \frac{1}{2^{n-1}} + 2\left(1 - \frac{1}{2^{n-1}}\right) = 2 - \frac{1}{2^{n-1}}.$$

Quindi

$$\mathbb{P}(X)\mathbb{P}(Y) = \frac{n}{2} \cdot \left(2 - \frac{1}{2^{n-1}}\right) = n - \frac{n}{2^n}.$$

Valori possibili per (X, Y) :

$$(0, 1), (1, 2), \dots, (n-1, 2), (n, 1).$$

Valori possibili per XY :

$$0, 2, 4, \dots, 2(n-1), n.$$

Quindi, la previsione di XY è uguale a

$$\begin{aligned} & 0 \cdot \frac{1}{2^n} + 2 \cdot \frac{\binom{n}{1}}{2^n} + \dots + 2(n-1) \cdot \frac{\binom{n}{n-1}}{2^n} + n \cdot \frac{1}{2^n} = \\ & = 2 \cdot \sum_{h=0}^n h \cdot \frac{\binom{n}{h}}{2^n} - 2n \cdot \frac{\binom{n}{n}}{2^n} + n \cdot \frac{1}{2^n} = \\ & = 2 \cdot \frac{n}{2} - n \cdot \frac{1}{2^n} = n - \frac{n}{2^n} = \mathbb{P}(X)\mathbb{P}(Y). \end{aligned}$$

Pertanto $Cov(X, Y) = 0$.

Esempio. . . . esempio precedente con 2 palline da ripartire a caso in n scatole.

Verificare che i valori possibili di X sono 0, 1, 2, con rispettive probabilità

$$\frac{(n-1)^2}{n^2}, \quad \frac{2(n-1)}{n^2}, \quad \frac{1}{n^2};$$

che i valori possibili di Y sono 1, 2, con

$$P(Y = 1) = \frac{n}{n^2} = \frac{1}{n}, \quad P(Y = 2) = 1 - \frac{1}{n}.$$

Quindi

$$\mathbb{P}(X) = \frac{2}{n}, \quad \mathbb{P}(Y) = 2 - \frac{1}{n}, \quad \mathbb{P}(X)\mathbb{P}(Y) = \frac{4}{n} - \frac{2}{n^2}.$$

Inoltre, i valori possibili per (X, Y) sono:

$$(0, 1), \quad (0, 2), \quad (1, 2), \quad (2, 1),$$

con rispettive probabilità

$$\frac{n-1}{n^2}, \quad \frac{(n-1)(n-2)}{n^2}, \quad \frac{2(n-1)}{n^2}, \quad \frac{1}{n^2}.$$

Infine, i valori possibili per XY sono 0, 2, con

$$P(XY = 0) = \frac{(n-1)^2}{n^2}, \quad P(XY = 2) = \frac{2n-1}{n^2},$$

e quindi

$$\mathbb{P}(XY) = \frac{4}{n} - \frac{2}{n^2} = \mathbb{P}(X)\mathbb{P}(Y).$$

Pertanto $Cov(X, Y) = 0$.

Incorrelazione.

X ed Y si dicono *incorrelati* se $Cov(X, Y) = 0$.

Se X, Y sono incorrelati, si ha

$$Var(X + Y) = Var(X) + Var(Y).$$

Proprietà della covarianza.

$$Cov(aX + b, cY + d) = \dots = ac Cov(X, Y).$$

Coefficiente di correlazione

$$\rho_{XY} = \frac{Cov(X, Y)}{\sqrt{Var(X)Var(Y)}} = \frac{\sigma_{XY}}{\sigma_X \sigma_Y}.$$

ρ_{XY} si chiama anche covarianza normalizzata in quanto

$$\begin{aligned} Cov\left(\frac{X-m_X}{\sigma_X}, \frac{Y-m_Y}{\sigma_Y}\right) &= Cov\left(\frac{X}{\sigma_X} - \frac{m_X}{\sigma_X}, \frac{Y}{\sigma_Y} - \frac{m_Y}{\sigma_Y}\right) = \\ &= Cov\left(\frac{X}{\sigma_X}, \frac{Y}{\sigma_Y}\right) = \frac{1}{\sigma_X \sigma_Y} Cov(X, Y) = \rho_{XY}. \end{aligned}$$

Osservazione. Posto

$$X' = aX + b, \quad Y' = cY + d, \quad a, b, c, d \in \mathbb{R}, \quad a \neq 0, \quad c \neq 0,$$

si ha

$$\rho_{X'Y'} = \frac{\sigma_{(aX+b)(cY+d)}}{\sigma_{(aX+b)}\sigma_{(cY+d)}} = \frac{ac\sigma_{XY}}{|ac|\sigma_X\sigma_Y} = \pm\rho_{XY}.$$

Proprietà.

1. $\rho_{XY} = 0 \iff \sigma_{XY} = 0$ (incorrelazione);
2. $-1 \leq \rho_{XY} \leq 1$;
3. $\rho_{XY} = \pm 1 \iff Y = aX + b$.
 $(a > 0 \implies \rho_{XY} = 1, \quad a < 0 \implies \rho_{XY} = -1)$

La proprietà 3 corrisponde al caso di dipendenza lineare tra X e Y . Per dimostrare tali proprietà, osserviamo che:

- $Var(X + Y) = Var(X) + Var(Y) + 2Cov(X, Y)$,
- $Var(X - Y) = Var(X) + Var(Y) - 2Cov(X, Y)$,
- $Var(aX + cY) =$
 $= a^2Var(X) + c^2Var(Y) + 2acCov(X, Y)$.

(Dim. della 2.) Si ha

$$\begin{aligned} \text{Var}\left(\frac{X}{\sigma_X} + \frac{Y}{\sigma_Y}\right) &= \frac{\sigma_X^2}{\sigma_X^2} + \frac{\sigma_Y^2}{\sigma_Y^2} + 2\text{Cov}\left(\frac{X}{\sigma_X}, \frac{Y}{\sigma_Y}\right) = \\ &= 2 + 2\frac{\text{Cov}(X,Y)}{\sigma_X\sigma_Y} = 2(1 + \rho_{XY}) \geq 0; \end{aligned}$$

$$\text{Var}\left(\frac{X}{\sigma_X} - \frac{Y}{\sigma_Y}\right) = 2(1 - \rho_{XY}) \geq 0;$$

quindi $-1 \leq \rho_{XY} \leq 1$.

(Dim. della 3.) Se $Y = aX + b$, segue

$$\rho_{XY} = \frac{\text{Cov}(X, aX+b)}{\sigma_X\sigma_{aX+b}} = \frac{a\text{Cov}(X,X)}{|a|\sigma_X\sigma_X} = \pm 1.$$

Viceversa, sia $|\rho_{XY}| = 1$ e dimostriamo che esiste una dipendenza lineare tra X e Y .

Se $\rho_{XY} = -1$, segue $\text{Var}\left(\frac{X}{\sigma_X} + \frac{Y}{\sigma_Y}\right) = 0$ cioè il n.a. $\frac{X}{\sigma_X} + \frac{Y}{\sigma_Y}$ ha varianza nulla. Allora (con prob. 1) $\frac{X}{\sigma_X} + \frac{Y}{\sigma_Y}$ è costante e coincide con il suo valor medio

$\mathbb{P}\left(\frac{X}{\sigma_X} + \frac{Y}{\sigma_Y}\right) = \frac{m_X}{\sigma_X} + \frac{m_Y}{\sigma_Y}$. Quindi

$$\frac{X}{\sigma_X} + \frac{Y}{\sigma_Y} = \frac{m_X}{\sigma_X} + \frac{m_Y}{\sigma_Y}, \quad (\text{prob.1})$$

ovvero

$$Y = m_Y - \frac{\sigma_Y}{\sigma_X}(X - m_X) = \underbrace{-\frac{\sigma_Y}{\sigma_X}}_{a} X + \underbrace{m_Y + \frac{\sigma_Y}{\sigma_X}m_X}_b$$

$Y = aX + b$ con $a = -\frac{\sigma_Y}{\sigma_X}, b = m_Y - am_X$

oppure

$$X = cY + d \text{ con } c = -\frac{\sigma_X}{\sigma_Y}, d = m_X - cm_Y$$

Una dimostrazione analoga si può fare nel caso in cui $\rho_{XY} = 1$, osservando che il n.a. $\frac{X}{\sigma_X} - \frac{Y}{\sigma_Y}$ ha varianza nulla.

Covarianza di due indicatori. Dati due eventi A e B , si ha

$$\begin{aligned} \text{Cov}(|A|, |B|) &= \mathbb{P}(|AB|) - \mathbb{P}(|A|)\mathbb{P}(|B|) = \\ &= P(AB) - P(A)P(B). \end{aligned}$$

In particolare, dato un evento E , con $P(E) = p$, posto $q = 1 - p$ ed osservando che $|E^c| = 1 - |E|$, si ha

$$Cov(|E|, |E^c|) = -Var(|E|) = -pq, \quad \rho_{|E||E^c|} = -1.$$

Esempio. Estrazioni senza restituzione da un'urna contenente due palline, una bianca e una nera.

A = La prima pallina estratta è bianca;

B = La seconda pallina estratta è bianca.

Si dimostra che: $Cov(|A|, |B|) = -\frac{1}{4}$.

... effettuando estrazioni con restituzione, si ha $Cov(|A|, |B|) = 0$.

Esempio. Una pallina bianca e una nera vengono distribuite a caso in due urne U, V . Definiti i n.a.

X = numero di palline bianche in U ,

Y = numero di urne non vuote,

si può verificare che $Cov(X, Y) = 0$.

Esempio. Considerate due urne U, V , contenenti ciascuna una pallina bianca e una nera, da U si estrae a caso una pallina e la si inserisce in V . Definiti i n.a.

X = "numero di palline bianche in U ",

Y = "numero di palline bianche in V ",

determinare ρ_{XY} .

Matrice delle varianze-covarianze.

Dati $n + m$ numeri aleatori

$$X_1, X_2, \dots, X_n, Y_1, Y_2, \dots, Y_m,$$

consideriamo le combinazioni lineari:

$$X = \sum_{i=1}^n a_i X_i, \quad Y = \sum_{j=1}^m b_j Y_j,$$

con

$$a_i, b_j \in \mathbb{R}, \quad i = 1, \dots, n; \quad j = 1, \dots, m.$$

Posto $Cov(X_i, Y_j) = \sigma_{X_i Y_j}$, si ha

$$\begin{aligned} Cov(X, Y) &= Cov\left(\sum_{i=1}^n a_i X_i, \sum_{j=1}^m b_j Y_j\right) = \\ &= \dots = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^m a_i b_j \sigma_{X_i Y_j}. \end{aligned}$$

In particolare

$$Cov(X, X) = Var(X) = \sum_{i=1}^n a_i^2 \sigma_{X_i}^2 + 2 \sum_{i < j} a_i a_j \sigma_{X_i X_j}. \quad (41)$$

Indicando con $\mathbf{a}^t = (a_1, a_2, \dots, a_n)$ il vettore dei coefficienti e con Σ la seguente matrice (delle varianze-covarianze)

$$\Sigma = \begin{pmatrix} \sigma_{11} & \sigma_{12} & \cdots & \sigma_{1n} \\ \sigma_{21} & \sigma_{22} & \cdots & \sigma_{2n} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots \\ \sigma_{n1} & \sigma_{n2} & \cdots & \sigma_{nn} \end{pmatrix}, \quad \sigma_{ij} = \sigma_{X_i X_j},$$

possiamo scrivere la (41) nella seguente forma matriciale

$$\begin{aligned} Cov(X, X) = Var(X) &= \mathbf{a}^t \cdot \Sigma \cdot \mathbf{a} = \\ &= (a_1, a_2, \dots, a_n) \begin{pmatrix} \sigma_{11} & \sigma_{12} & \cdots & \sigma_{1n} \\ \sigma_{21} & \sigma_{22} & \cdots & \sigma_{2n} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots \\ \sigma_{n1} & \sigma_{n2} & \cdots & \sigma_{nn} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} a_1 \\ a_2 \\ \vdots \\ a_n \end{pmatrix}. \end{aligned} \quad (42)$$

Se X_1, \dots, X_n sono a due a due incorrelati si ha

$$\begin{aligned} \text{Var}(X) &= \sum_{i=1}^n a_i^2 \sigma_{X_i}^2 = \\ &= (a_1, a_2, \dots, a_n) \begin{pmatrix} \sigma_{11} & 0 & \cdots & 0 \\ 0 & \sigma_{22} & \cdots & 0 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & \cdots & \sigma_{nn} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} a_1 \\ a_2 \\ \vdots \\ a_n \end{pmatrix}. \end{aligned}$$

Frequenza di successo.

Dati n eventi E_1, E_2, \dots, E_n a 2 a 2 incorrelati e posto $P(E_i) = p_i$, indichiamo con con

$$f_n = \frac{|E_1| + |E_2| + \cdots + |E_n|}{n} \quad (43)$$

la frequenza relativa di successo. Si ha

$$\mathbb{P}(f_n) = \dots = \frac{p_1 + p_2 + \cdots + p_n}{n},$$

$$\text{Var}(f_n) = \text{Var}\left(\frac{\sum_{i=1}^n |E_i|}{n}\right) = \frac{1}{n^2} \sum_{i=1}^n p_i q_i \leq \frac{1}{4n}.$$

Al tendere di $n \rightarrow \infty$ si ha $Var(f_n) \rightarrow 0$.

Ciò significa che la dispersione di f_n attorno al suo valor medio $\frac{\sum_{i=1}^n p_i}{n}$ diventa sempre più piccola al crescere del numero delle prove.

Sfruttando la disuguaglianza di Cebicev si perviene alla seguente *legge (debole) dei grandi numeri*

$$\lim_{n \rightarrow \infty} P\left(\left|f_n - \frac{\sum_{i=1}^n p_i}{n}\right| > \varepsilon\right) = 0.$$

Se, in particolare, gli eventi E_i sono equiprobabili, con $P(E_i) = p$, si ha:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} P(|f_n - p| > \varepsilon) = 0.$$