

PRÁCTICA 7: TEOREMA DE RADON-NIKODYM Y MEDIDAS DE PROBABILIDAD

Ejercicio 1. Sea ν una medida con signo sobre el espacio medible (Ω, \mathcal{F}) . Sean A un conjunto positivo y B un conjunto negativo con respecto a ν tales que: $\Omega = A \cup B$ y $A \cap B = \emptyset$. Dado $E \in \mathcal{F}$, probar:

1. $\nu^+(E) = \nu(E \cap A) = \sup\{\nu(H) : H \subseteq E, H \in \mathcal{F}\}$,
2. $-\nu^-(E) = \nu(E \cap B) = \inf\{\nu(H) : H \subseteq E, H \in \mathcal{F}\}$.

Ejercicio 2. Sean $(\Omega, \mathcal{F}, \mu)$ un espacio de medida, f tal que existe $\int_{\Omega} f d\mu$ y $\nu(E) = \int_E f d\mu$ ($E \in \mathcal{F}$). Probar que:

1. $\nu^+(E) = \int_E f^+ d\mu$ ($E \in \mathcal{F}$),
2. $\nu^-(E) = \int_E f^- d\mu$ ($E \in \mathcal{F}$).

Ejercicio 3.

1. Sean λ y μ medidas sobre (Ω, \mathcal{F}) y $\lambda(\Omega) < \infty$. Probar:

$$\lambda \ll \mu \iff \forall \epsilon > 0, \exists \delta = \delta(\epsilon) > 0 : \mu(E) < \delta \Rightarrow \lambda(E) < \epsilon.$$

2. Demostrar que la hipótesis $\lambda(\Omega) < \infty$ es necesaria en (a). (Sug. Considerar μ la medida de Lebesgue en $(0, 1)$ y $\lambda(E) = \int_E \frac{dt}{t}$ para todo $E \subseteq (0, 1)$ medible Lebesgue.)

Ejercicio 4. Sea el espacio de medida $(\mathbb{R}^n, \mathcal{M}, \delta)$ donde \mathcal{M} es la σ -álgebra de conjuntos medibles Lebesgue y,

$$\delta(A) = \begin{cases} 1, & 0 \in A, \\ 0, & 0 \notin A. \end{cases}$$

1. Probar que no existe $f : \mathbb{R}^n \rightarrow \overline{\mathbb{R}}$ medible tal que

$$\delta(A) = \int_A f(x) dx \quad (\forall A \in \mathcal{M}).$$

2. Dada $f : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ medible, hallar todas las funciones medibles $g : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ tales que $f = g$ a. e. con respecto a δ .
3. Dada $f : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ medible, hallar $\int_{\mathbb{R}^n} f d\delta$.

Ejercicio 5. Sea μ la medida de contar en \mathbb{R} y sea m la medida de Lebesgue. Probar que $m \ll \mu$ pero no existe f tal que

$$m(E) = \int_E f d\mu.$$

¿Por qué esto no contradice el Teorema de Radon-Nikodym?

Ejercicio 6. Sean (Ω, \mathcal{F}) un espacio de medida, μ una medida finita y ν una medida signada definidas en \mathcal{F} , tales que $\nu \ll \mu$.

1. Probar que existe una función $g \in L^1(\mu)$ tal que

$$\int f d\mu = \int fg d\mu \quad \forall f \text{ medible .}$$

2. Probar que $\{x \in \Omega : g(x) \geq 0\}$ y $\{x \in \Omega : g(x) < 0\}$ son respectivamente un conjunto positivo y uno negativo para ν .

Ejercicio 7. Sea (Ω, \mathcal{F}) un espacio de medida y sean μ y ν dos medidas finitas en (Ω, \mathcal{F}) . Definimos, en el mismo espacio, una nueva medida dada por $\bar{\mu} = \mu + \nu$.

1. Probar que existe una función $f \in L^1(\bar{\mu})$ tal que $\nu(E) = \int f d\bar{\mu}$ y que $0 \leq f < 1$ $\mu - a.e.$

2. Deducir que $\int g d\nu = \int gf d\bar{\mu}$ para toda $g \geq 0$ medible.

3. Si, además, $\nu(E) = \int_E h d\mu$ para todo $E \in \mathcal{F}$ entonces $h = \frac{f}{1-f} \mu - a.e.$

Ejercicio 8. Sea (X, Y) un vector aleatorio $(X, Y) : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^2$ definido en (Ω, \mathcal{F}, P) y sea P_{XY} la medida inducida por (X, Y) en \mathbb{R}^2 . Probar que si $P_{XY} \ll \mathcal{L}$ entonces P_X y P_Y también lo son y hallar sus funciones de densidad (derivada de Radón-Nikodym respecto de la medida de Lebesgue).

Ejercicio 9. Sea $X = \sum_{i=1}^k a_i \chi_{A_i}$ una variable aleatoria simple, donde los números reales a_i son todos distintos, los conjuntos A_i son disjuntos dos a dos y $\Omega = \bigcup_{i=1}^k A_i$. Sea $\sigma(X)$ la σ -álgebra generada por X .

1. Describir precisamente los conjuntos que componen $\sigma(X)$.

2. Probar que si la v.a. Y es $\sigma(X)$ -medible entonces Y es constante en cada uno de los conjuntos A_i .

3. Mostrar que entonces Y puede ser escrita como una función de X .

Ejercicio 10. Sea $\Omega = [0, 1] \times [0, 1]$, \mathcal{U} la σ -álgebra de Borel y P la medida de Lebesgue. Sea $g : [0, 1] \rightarrow \mathbb{R}$ continua. Definimos en Ω las siguientes variables aleatorias

$$X_1(\omega_1, \omega_2) = g(\omega_1), \quad X_2(\omega_1, \omega_2) = g(\omega_2).$$

Probar que X_1 y X_2 son variables aleatorias independientes e idénticamente distribuidas.

Ejercicio 11. Dado un espacio de medida $(\Omega, \mathcal{F}, \mu)$ y una función medible $X : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$, considerar la medida μ_X en los boreleanos de \mathbb{R} , dada por

$$\mu_X(A) := \mu(X^{-1}(A)) .$$

Probar que para toda función $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ μ_X integrable, vale que $\forall A \subset \mathbb{R}$ boreleano,

$$\int_A f(y) d\mu_X = \int_{X^{-1}(A)} f(X) d\mu .$$

1. Dado un espacio de probabilidad (Ω, \mathcal{U}, P) y una función $f : \Omega \rightarrow \mathbb{R}_+$ medible con $\int_{\Omega} f dP = 1$, considere la medida ν definida sobre (Ω, \mathcal{U}) dada por

$$\nu(A) = \int_A f dP .$$

Pruebe que $(\Omega, \mathcal{U}, \nu)$ es un espacio de probabilidad y que para toda $g : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ ν -integrable, vale que

$$\int_{\Omega} g d\nu = \int_{\Omega} g f dP .$$

2. En particular, sea $X : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^n$ una v.a. y supongamos que μ_X tiene función de densidad f . Sea $g : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$, y supongamos que

$$Y = g(X)$$

es integrable. Entonces

$$E(Y) = \int_{\mathbb{R}^n} g(x)f(x) dx,$$

una integral sobre \mathbb{R}^n que se puede “calcular”.

Ejercicio 12. Sea (X, Y) un vector aleatorio $(X, Y) : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^2$ definido en (Ω, \mathcal{F}, P) . Hallar

1. $E(X|\mathcal{V})$ con $\mathcal{V} = \{\emptyset, \Omega\}$
2. $E(X|\mathcal{V})$ con $\mathcal{V} = \{\emptyset, \Omega, B, B^c\}$
3. $E(X|Y)$ con Y una variable aleatoria que toma los valores y_i con probabilidad p_i , $1 \leq i \leq n$.

Ejercicio 13. Probar que

1. $E(E(X|\mathcal{V})) = E(X)$.
2. $E(X) = E(X|\mathcal{W})$ si \mathcal{W} es la σ -álgebra trivial, $\mathcal{W} = \{\emptyset, \Omega\}$.

Ejercicio 14. Sean X, Y dos variables aleatorias con función de densidad conjunta $f_{XY}(x, y)$. Probar que

$$E(X|Y) = \Phi(Y), \quad \text{con} \quad \Phi(y) = \int_{-\infty}^{\infty} x \frac{f_{XY}(x, y)}{f_Y(y)} dx.$$

Sugerencia:

1. $\Phi(Y)$ es $\mathcal{U}(Y)$ -medible.
2. Si $A \in \mathcal{U}(Y)$, $A = Y^{-1}(B)$ para algún conjunto de Borel de \mathbb{R} . Entonces

$$\int_A X dP = \int_{-\infty}^{\infty} \int_B x f_{XY}(x, y) dy dx.$$

3.

$$\int_A \Phi(Y) dP = \int_{-\infty}^{\infty} \int_B \Phi(y) f_{XY}(x, y) dy dx.$$

4.

$$\int_A X dP = \int_A \Phi(Y) dP \quad \text{para todo } A \in \mathcal{U}(Y).$$