9 Estensione del concetto di valore atteso

Vogliamo ora estendere il concetto di valore atteso di una variabile casuale 1-D al caso $n-$dimensionale. Ci limitiamo ad analizzare il caso discreto.

DEFINIZIONE: Sia $X = (X_1, ..., X_n)$ una variabile casuale $n-$dimensionale con funzione di densità congiunta $f_{X_1,...,X_n}(x_1, ..., x_n)$ e sia $g : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ una funzione definita su $X_1, ..., X_n$, cioè $g = g(X_1, ..., X_n)$ (a sua volta è una variabile casuale).
Definiamo VALORE ATTESO di g la quantità:

$$E[g(X_1, ..., X_n)] = \sum g(x_1, ..., x_n) f_{X_1,...,X_n}(x_1, ..., x_n)$$

CASI PARTICOLARI

- $g(X_1, ..., X_n) = X_i \Rightarrow E[g] = E[X_i] = \mu_{X_i}$
- $g(X_1, ..., X_n) = (X_i - \mu_{X_i})^2$
  $\Rightarrow E[g] = \text{var}[X_i] = \sigma^2_{X_i}$
  Limitiamoci al caso bidimensionale ($n = 2$)
- $g(X, Y) = (X - \mu_X)(Y - \mu_Y)$
  $\Rightarrow E[g] = E[(X - \mu_X)(Y - \mu_Y)]$

DEFINIZIONE: Date le variabili casuali X e Y, definiamo COVARIANZA di X e Y la quantità:

$$\sigma_{X,Y} = \mathrm{cov}[X,Y] = E[(X-\mu_X)(Y-\mu_Y)]$$

PROPRIETÀ DELLA COVARIANZA

1. $\mathrm{cov}[X,Y] = E[XY] - \mu_X\mu_Y$
   Dalla definizione:
   $$\begin{aligned}\mathrm{cov}[X,Y] &= E[(X-\mu_X)(Y-\mu_Y)] = \\ &= E[XY - \mu_Y X - \mu_X Y + \mu_X\mu_Y] = \\ &= E[XY] - \mu_Y E[X] - \mu_X E[Y] + \mu_X\mu_Y = \\ &= E[XY] - \mu_X\mu_Y\end{aligned}$$

2. $\mathrm{cov}[aX,bY] = ab\,\mathrm{cov}[X,Y] \qquad \forall a,b \in \mathbb{R}$
   $\mathrm{cov}[aX,bY] = E[(aX-a\mu_X)(bY-b\mu_Y)] = ab\,\mathrm{cov}[X,Y]$

3. $\mathrm{cov}[X,Y] = \mathrm{cov}[Y,X]$

4. $\mathrm{cov}[X,X] = \mathrm{var}[X]$
   $\mathrm{cov}[X,X] = E[(X-\mu_X)^2] = \mathrm{var}[X]$

5. $\mathrm{cov}[X+Y,Z] = \mathrm{cov}[X,Z] + \mathrm{cov}[Y,Z]$

Per provare l'ultima uguaglianza notiamo che:

$$\mathrm{cov}[X+Y,Z] \underset{\substack{\uparrow \\ \text{per 1)}}}{=} E[(X+Y)Z] - E[X+Y]E[Z]$$

$$= E[XZ+YZ] - (E[X]+E[Y])E[Z]$$

$$= E[XZ] + E[YZ] - E[X]E[Z] - E[Y]E[Z]$$

$$= \mathrm{cov}[X,Z] + \mathrm{cov}[Y,Z]$$

La covarianza tra due variabili casuali descrive la possibilità che tra le due variabili possa esistere una relazione di tipo lineare.
Se la covarianza è nulla, tra X ed Y è possibile che esista una relazione di tipo non lineare.

Esempio (numerico)

Tabella 3

X	-3	-2	-1	0	1	2	3
Y	9	4	1	0	1	4	9
XY	-27	-8	-1	0	1	8	27

$E[X] = 0, \quad E[Y] = 28/7, \quad E[XY] = 0;$
allora $\mathrm{cov}[X,Y] = E[XY] - E[X]E[Y] = 0$,
ma tra X e Y sussiste la relazione $Y = X^2$ (non lineare).

La covarianza dipende dall'unità di misura utilizzata per misurare X e Y; perciò si preferisce usare un altro indice, indipendente dall'unità di misura.

DEFINIZIONE: Date le variabili casuali X e Y con covarianza $\text{cov}[X, Y]$ e deviazioni standard rispettivamente σ_X e σ_Y, definiamo COEFFICIENTE DI CORRELAZIONE di X e Y il numero:

$$\rho_{X,Y} = \frac{\text{cov}[X, Y]}{\sigma_X \sigma_Y} = \frac{\sigma_{X,Y}}{\sigma_X \sigma_Y}$$

Proprietà di $\rho_{X,Y}$

1. $|\rho_{X,Y}| \leq 1$
2. $\rho_{X,Y} = 0$ se $\text{cov}[X, Y] = 0$
3. Se $Y = mX + q$ (dipendenza lineare), allora

$$\begin{cases} \rho_{X,Y} = 1 & \text{se } m > 0\,, \\ \rho_{X,Y} = -1 & \text{se } m < 0\,. \end{cases}$$

Infatti:

$$\text{cov}[X, Y] = \text{cov}[X, mX + q] = \text{cov}[X, mX] + \underset{\uparrow \atop =0}{\text{cov}[X, q]}$$

$$= m\,\text{cov}[X, X] = m\,\text{var}[X] = m\sigma_X^2 \gtrless 0 \ \text{ se } \ m \gtrless 0$$

e
$\text{var}[Y] = \text{var}[mX + q] = m^2 \,\text{var}[X] \Rightarrow$
$\Rightarrow \sigma_Y = m\sigma_X > 0$ per definizione di deviazione standard.
Quindi:

$$\rho_{X,Y} = \begin{cases} \frac{m\sigma_X^2}{\sigma_X \cdot m\sigma_X} = 1 & \text{se } m > 0\,, \\ \frac{-|m|\sigma_X^2}{\sigma_X \cdot |m|\sigma_X} = -1 & \text{se } m < 0\,. \end{cases}$$

4. $\forall a, b \in \mathbb{R}^+ \quad \rho_{aX,bY} = \rho_{X,Y}$

   Infatti:

$$\rho_{aX,bY} = \frac{\text{cov}[aX, bY]}{\sigma_{aX}\sigma_{bY}} = \frac{ab\,\text{cov}[X, Y]}{ab\sigma_X\sigma_Y} = \rho_{X,Y}$$

$\text{var}[aX] = a^2 \,\text{var}[X] \Rightarrow \sigma_{aX} = a\sigma_X > 0$
$\text{var}[bX] = b^2 \,\text{var}[X] \Rightarrow \sigma_{bX} = b\sigma_X > 0$

DEFINIZIONE: Date le variabili casuali X e Y e la funzione $g(X, Y)$, definiamo VALORE ATTESO CONDIZIONATO di g, dato $X = x$, la quantità:

$$E[g(X, Y)|X = x] = \sum_y g(x, y) f_{Y|X}(y|x)$$

- se $g(X,Y) = Y$

$$E[Y|X=x] = E[Y|X] = \sum y f_{Y|X}(y|x)$$

Esempio. Calcolare il coefficiente di correlazione tra le variabili casuali X, Y dell'esempio del lancio dei due tetraedri.

Ricordiamo che $\rho_{X,Y} = \frac{\text{cov}[X,Y]}{\sigma_X \sigma_Y}$.
Dobbiamo calcolare la $\text{cov}[X,Y]$ e quindi $E[XY]$, $E[X]$ ed $E[Y]$.

- $g(X,Y) = XY$

$$E[XY] = \sum xy f_{X,Y}(x,y) =$$

$$= 1\cdot 1 f_{X,Y}(1,1) + 1\cdot 2 f_{X,Y}(1,2) + 1\cdot 3 f_{X,Y}(1,3) +$$
$$+ 1\cdot 4 f_{X,Y}(1,4) + 2\cdot 2 f_{X,Y}(2,2) + 2\cdot 3 f_{X,Y}(2,3) +$$
$$+ 2\cdot 4 f_{X,Y}(2,4) + 3\cdot 3 f_{X,Y}(3,3) + 3\cdot 4 f_{X,Y}(3,4) +$$
$$+ 4\cdot 4 f_{X,Y}(4,4) =$$
$$= \frac{1}{16} + 2\cdot\frac{1}{16} + 3\cdot\frac{1}{16} + 4\cdot\frac{1}{16} + 4\cdot\frac{2}{16} + 6\cdot\frac{1}{16} +$$
$$+ 8\cdot\frac{1}{16} + 9\cdot\frac{3}{16} + 12\cdot\frac{1}{16} + 16\cdot\frac{4}{16} = \frac{135}{16}$$

Per calcolare $E[X]$ ed $E[Y]$ possiamo utilizzare

- $g(X,Y) = X$

$$E[X] = \sum x f_{X,Y}(x,y) = 1 \cdot \sum_y f_{X,Y}(1,y) +$$
$$+ 2 \cdot \sum_y f_{X,Y}(2,y) + 3 \cdot \sum_y f_{X,Y}(3,y) +$$
$$+ 4 \cdot \sum_y f_{X,Y}(4,y) =$$
$$= 1 \cdot \left(\frac{1}{16} + \frac{1}{16} + \frac{1}{16} + \frac{1}{16}\right) + 2 \cdot \left(\frac{2}{16} + \frac{1}{16} + \frac{1}{16}\right) +$$
$$+ 3 \cdot \left(\frac{3}{16} + \frac{1}{16}\right) + 4 \cdot \frac{4}{16} = \frac{40}{16}$$

- $g(X,Y) = Y$

$$E[Y] = \sum y f_{X,Y}(x,y) = 1 \cdot \sum_x f_{X,Y}(x,1) +$$
$$+ 2 \cdot \sum_x f_{X,Y}(x,2) + 3 \cdot \sum_x f_{X,Y}(x,3) +$$
$$+ 4 \cdot \sum_x f_{X,Y}(x,4) = 1 \cdot \frac{1}{16} + 2 \cdot \left(\frac{1}{16} + \frac{2}{16}\right) +$$
$$+ 3 \cdot \left(\frac{1}{16} + \frac{1}{16} + \frac{3}{16}\right) + 4 \cdot \left(\frac{1}{16} + \frac{1}{16} + \frac{1}{16} + \frac{1}{16}\right) =$$
$$= \frac{50}{16}$$

oppure molto più velocemente attraverso le funzioni di densità marginali: $E[X] = \sum x f_X(x)$ ed $E[Y] = \sum y f_Y(y)$, da cui

$$\begin{aligned} E[X] &= 1 \cdot f_X(1) + 2 \cdot f_X(2) + 3 \cdot f_X(3) + 4 \cdot f_X(4) \\ &= 1 \cdot \frac{4}{16} + 2 \cdot \frac{4}{16} + 3 \cdot \frac{4}{16} + 4 \cdot \frac{4}{16} = \frac{40}{16} \end{aligned}$$

ed

$$\begin{aligned} E[Y] &= 1 \cdot f_Y(1) + 2 \cdot f_Y(2) + 3 \cdot f_Y(3) + 4 \cdot f_Y(4) \\ &= 1 \cdot \frac{1}{16} + 2 \cdot \frac{3}{16} + 3 \cdot \frac{5}{16} + 4 \cdot \frac{7}{16} = \frac{50}{16} \end{aligned}$$

cosicchè:

$$\mathrm{cov}[X,Y] = E[XY] - E[X]E[Y] = \frac{135}{16} - \frac{40}{16} \cdot \frac{50}{16} = \frac{5}{8}$$

Calcoliamo ora σ_X e σ_Y.

$$\sigma_X^2 = \mathrm{var}[X] = E[X^2] - E[X]^2$$

ed $E[X^2] = \sum x^2 f_X(x) \Rightarrow$

$$E[X^2] = 1 \cdot f_X(1) + 4 \cdot f_X(2) + 9 \cdot f_X(3) + 16 \cdot f_X(4)$$

$$= 1 \cdot \frac{4}{16} + 4 \cdot \frac{4}{16} + 9 \cdot \frac{4}{16} + 16 \cdot \frac{4}{16} = \frac{120}{16} = \frac{15}{2}$$

perciò

$$\text{var}[X] = \frac{15}{2} - \left(\frac{5}{2}\right)^2 = \frac{5}{4} \Rightarrow \sigma_X = \frac{\sqrt{5}}{2}$$

Analogamente

$$E[Y^2] = 1 \cdot f_Y(1) + 4 \cdot f_Y(2) + 9 \cdot f_Y(3) + 16 \cdot f_Y(4)$$
$$= 1 \cdot \frac{1}{16} + 4 \cdot \frac{3}{16} + 9 \cdot \frac{5}{16} + 16 \cdot \frac{7}{16} = \frac{170}{16} = \frac{85}{8}$$

da cui

$$\text{var}[Y] = \frac{85}{8} - \left(\frac{25}{8}\right)^2 = \frac{55}{64} \Rightarrow \sigma_Y = \frac{\sqrt{55}}{8}$$

quindi

$$\rho_{X,Y} = \frac{5/8}{\sqrt{5}/2 \cdot \sqrt{55}/8} = \frac{2}{\sqrt{11}}$$

Adesso calcoliamo $E[Y|X=2]$
Ricordiamo che

$$f_{Y|X}(y|x) = \frac{f_{X,Y}(x,y)}{f_X(x)}$$

e

$$E[Y|X=2] = \sum_i y_i f_{Y|X}(y_i|x=2)$$

se $x = 2 \Rightarrow y \geq 2$

$$f_{Y|X}(2|2) = \frac{f_{X,Y}(2,2)}{f_X(2)} = \frac{1}{2}$$
$$f_{Y|X}(3|2) = \frac{f_{X,Y}(2,3)}{f_X(2)} = \frac{1}{4}$$
$$f_{Y|X}(4|2) = \frac{f_{X,Y}(2,4)}{f_X(2)} = \frac{1}{4}$$

perciò

$$E[Y|X=2] = 2 \cdot \frac{1}{2} + 3 \cdot \frac{1}{4} + 4 \cdot \frac{1}{4} = \frac{11}{4}$$

Esempio. (prova scritta del 17.07.2007)
Si consideri un'urna contenente 12 palline numerate.
2 palline hanno inciso il numero 1.
4 palline hanno inciso il numero 2.
2 palline hanno inciso il numero 3.
4 palline hanno inciso il numero 4.
Viene estratta una pallina. Sia X la variabile casuale che indica il numero inciso sulla pallina estratta ed Y la variabile casuale data da $Y = \frac{1}{2}(X-2)^2$.
Calcolare:

1. la funzione di densità congiunta $f_{X,Y}$ e le relative marginali;

2. la covarianza;

3. $P[X > 2|Y = 1/2]$.

1)

$$P(X=1) = P(X=3) = \frac{2}{12} = \frac{1}{6};$$

$$P(X=2) = P(X=4) = \frac{4}{12} = \frac{1}{3}.$$

Inoltre

$$\begin{array}{ll} X = 1 \Rightarrow Y = \frac{1}{2} & \\ X = 2 \Rightarrow Y = 0 & \Rightarrow X = \{1, 2, 3, 4\} \\ X = 3 \Rightarrow Y = \frac{1}{2} & \Rightarrow Y = \{0, \frac{1}{2}, 2\} \\ X = 4 \Rightarrow Y = 2 & \end{array}$$

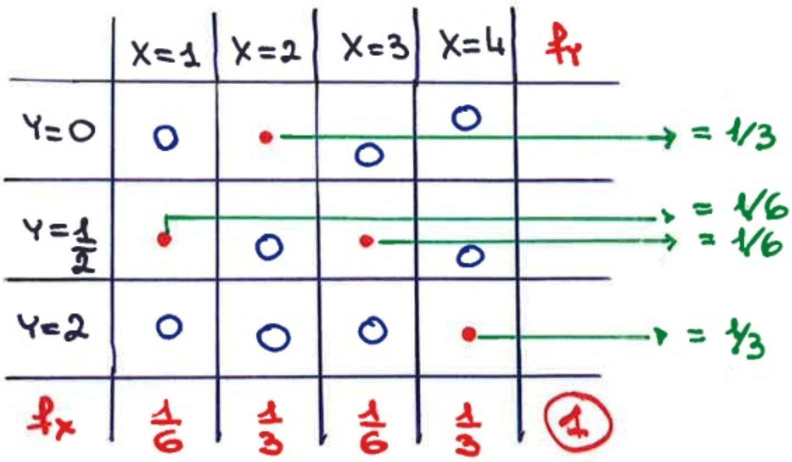

Figura 37: Tabella dei valori della funzione di densità congiunta $f_{X,Y}$

Dai valori di $P(X = i)$, $i = 1, .., 4$ otteniamo subito i valori della funzione di densità marginale f_X.
Dai valori congiunti di X e Y individuiamo subito nella tabella a doppia entrata le coppie (x, y) per le quali la funzione di densità congiunta è diversa da zero ($\bullet$)
Quindi

$$f_{X,Y}(1, \frac{1}{2}) = \frac{1}{6}\,,\ f_{X,Y}(2, 0) = \frac{1}{3},$$

$$f_{X,Y}(3, \frac{1}{2}) = \frac{1}{6}\,,\ f_{X,Y}(4, 2) = \frac{1}{3},$$

da cui si ricavano i valori della marginale f_Y:

$$f_Y(0) = \frac{1}{3}$$

$$f_Y(\frac{1}{2}) = \frac{1}{6} + \frac{1}{6} = \frac{1}{3}$$

$$f_Y(2) = \frac{1}{3}$$

2) Ovviamente X ed Y non sono indipendenti. Infatti presa la coppia $(X, Y) = (1, 0)$
$f_{X,Y}(1, 0) = 0$, ma $f_X(1) = \dfrac{1}{6}$ e $f_Y(0) = \dfrac{1}{3}$
$\Rightarrow f_{X,Y} \neq f_X \cdot f_Y$

$$E[XY] = 1 \cdot \frac{1}{2} \cdot \frac{1}{6} + 2 \cdot 0 \cdot \frac{1}{3} + 3 \cdot \frac{1}{2} \cdot \frac{1}{3} + 4 \cdot 2 \cdot \frac{1}{3} = 3$$

$$E[X] = 1 \cdot \frac{1}{6} + 2 \cdot \frac{1}{3} + 3 \cdot \frac{1}{6} + 4 \cdot \frac{1}{3} = \frac{8}{3}$$

$$E[Y] = 0 \cdot \frac{1}{3} + \frac{1}{2} \cdot \frac{1}{3} + 2 \cdot \frac{1}{3} = \frac{5}{6}$$

$$\Rightarrow \mathrm{cov}[X, Y] = 3 - \frac{20}{9} = \frac{7}{9}$$

3) $P[X > 2|Y = \frac{1}{2}] = P[X = 3|Y = \frac{1}{2}] +$
$+ P[X = 4|Y = \frac{1}{2}]$

$$P[X = 3|Y = \frac{1}{2}] = f_{X|Y}(3|\frac{1}{2}) = \frac{f_{X,Y}(3, \frac{1}{2})}{f_Y(\frac{1}{2})} = \frac{1/6}{1/3} = \frac{1}{2}$$

$$P[X = 4|Y = \frac{1}{2}] = f_{X|Y}(4|\frac{1}{2}) = \frac{f_{X,Y}(4, \frac{1}{2})}{f_Y(\frac{1}{2})} = \frac{0}{1/3} = 0$$

$$\Rightarrow P[X > 2|Y = \frac{1}{2}] = \frac{1}{2}$$

Esempio. (prova scritta del 09.01.2017)
Sia X la variabile casuale che assume i valori $\{0, 1\}$ ed Y la variabile casuale che assume i valori $\{2, 3\}$.
Sapendo che
$P[Y = 2] = \dfrac{2}{5}$,
$P[X = 0|Y = 2] = P[Y = 2|X = 0] = \dfrac{2}{3}$,
calcolare

$$P[X = 1|Y = 3].$$

Costruisco la tabella a doppia entrata

	$X = 0$	$X = 1$	f_Y
$Y = 2$			$\frac{2}{5}$
$Y = 3$			
f_X			1

Ricordo che $P[X = x|Y = y] = \frac{P[X=x,Y=y]}{P[Y=y]}$,
$P[Y = y|X = x] = \frac{P[X=x,Y=y]}{P[X=x]}$.
Dalla tabella ricavo subito $P[Y = 3] = 1 - \frac{2}{5} = \frac{3}{5}$
mentre da
$P[X = 0|Y = 2] = \frac{P[X=0,Y=2]}{P[Y=2]}$

ottengo

$P[X = 0, Y = 2] = P[X = 0|Y = 2] \cdot P[Y = 2] =$

$= \frac{2}{3} \cdot \frac{2}{5} = \frac{4}{15}$

e quindi

$P[X = 1, Y = 2] = \frac{2}{5} - \frac{4}{15} = \frac{2}{15}$

e da

$P[Y = 2|X = 0] = \frac{P[X=0,Y=2]}{P[X=0]}$

ricavo

$P[X = 0] = \frac{P[X=0,Y=2]}{P[Y=2|X=0]} = \frac{4/15}{2/3} = \frac{2}{5}$

Di conseguenza

$P[X = 1] = 1 - \frac{2}{5} = \frac{3}{5}$

e infine

$P[X = 0|Y = 3] = \frac{3}{5} - \frac{4}{15} = \frac{2}{15}$

$P[X = 1|Y = 3] = \frac{3}{5} - \frac{2}{15} = \frac{7}{15}$

Pertanto

$P[X = 1|Y = 3] = \frac{P[X=1,Y=3]}{P[Y=3]} = \frac{7/15}{3/5} = \frac{7}{9}$

TEOREMA 1. Siano X, Y variabili casuali indipendenti e g_1, g_2 funzioni tali che $g_1 = g_1(X)$ e $g_2 = g_2(Y)$ siano variabili casuali. Allora vale

$$E[g_1 \cdot g_2] = E[g_1] \cdot E[g_2]$$

Nel caso discreto

$$E[g_1(X)g_2(Y)] = \sum_i \sum_j g_1(x_i)g_2(y_j) \underbrace{f_{X,Y}(x_i, y_j)}_{=f_X(x_i)f_Y(y_j)}$$

$$= \sum_i \sum_j g_1(x_i)g_2(y_j)f_X(x_i)f_Y(y_j)$$

$$= \sum_i g_1(x_i)f_X(x_i) \sum_j g_2(y_j)f_Y(y_j) = E[g_1]E[g_2]$$

TEOREMA 2. Se X, Y sono variabili casuali indipendenti allora $\text{cov}[X, Y] = 0$

Basta scegliere:

$g_1(X) = X - \mu_X$

$g_2(Y) = Y - \mu_Y$

cosicchè

$$\text{cov}[X, Y] = E[(X - \mu_X)(Y - \mu_Y)]$$

$$= E[g_1 g_2] \underbrace{=}_{\text{Th.1}} E[g_1]E[g_2] = E[X - \mu_X]E[Y - \mu_Y]$$

$$= (E[X] - \mu_X)(E[Y] - \mu_Y) = 0$$

oppure
$g_1(X) = X$, $g_2(Y) = Y$ e dal teorema 1)
$E[XY] = E[X]E[Y] \Rightarrow$
$\Rightarrow \operatorname{cov}[X, Y] = E[XY] - E[X]E[Y] = 0.$

OSSERVAZIONE
$\operatorname{cov}[X, Y] = 0 \nRightarrow X, Y$ indipendenti
cioè se $\operatorname{cov}[X, Y] = 0$ non vale $f_{X,Y}(x, y) = f_X(x)f_Y(y)$

DEFINIZIONE: Due variabili casuali X, Y si dicono non correlate se e solo se $\operatorname{cov}[X, Y] = 0$.
Quindi:

$$\text{INDIPENDENZA} \underset{\nLeftarrow}{\Rightarrow} \text{NON CORRELAZIONE}$$

Vedi esempio in cui $\operatorname{cov}[X, Y] = 0$, ma $Y = X^2$.

Nota bene: esiste un solo caso in cui $\operatorname{cov}[X, Y] = 0$ $\Rightarrow$ indipendenza. Ciò avviene quando la funzione di densità congiunta di X ed Y è GAUSSIANA.

COMBINAZIONI LINEARI DI VARIABILI CASUALI

Date n variabili casuali $X_1, ..., X_n$ si consideri:

1) $g(X_1, ..., X_n) = X_1 + \cdots + X_n$

si ha che:

- $E[g] = \sum_{i=1}^{n} E[X_i]$

  La dimostrazione è ovvia.

- $\operatorname{var}[g] = \sum_{i=1}^{n} \operatorname{var}[X_i] + 2 \sum_{i} \sum_{\substack{j \\ i \neq j}} \operatorname{cov}[X_i, X_j]$

  Infatti:

$$
\begin{aligned}
\operatorname{var}[g] &= \operatorname{var}\left[\sum_{i=1}^{n} X_i\right] \\
&= E\left[\left(\sum_{i=1}^{n} X_i - E\left[\sum_{i=1}^{n} X_i\right]\right)^2\right] \\
&= E\left[\left(\sum_{i=1}^{n} X_i - \sum_{i=1}^{n} E[X_i]\right)^2\right] \\
&= E\left[\left(\sum_{i=1}^{n} (X_i - E[X_i])\right)^2\right]
\end{aligned}
$$

$$= E\left[\sum_{i=1}^{n}\sum_{j=1}^{n}\left(X_i - E[X_i]\right)\left(X_j - E[X_j]\right)\right]$$

$$= \sum_{i=1}^{n}\sum_{j=1}^{n} E\left[\left(X_i - E[X_i]\right)\left(X_j - E[X_j]\right)\right]$$

si spezza nella somma in cui $i = j$

$$\Rightarrow \sum_{i=1}^{n} E\left[\left(X_i - E[X_i]\right)^2\right] = \sum_{i=1}^{n} \mathrm{var}[X_i]$$

e nella somma in cui $i \neq j$

$$2\sum_{\substack{i=1 \\ i\neq j}}^{n}\sum_{j=1}^{n} E\left[\left(X_i - E[X_i]\right)\left(X_j - E[X_j]\right)\right]$$

$$= 2\sum_{\substack{i=1 \\ i\neq j}}^{n}\sum_{j=1}^{n} \mathrm{cov}[X_i, X_j].$$

Per esempio, se scegliamo $n = 2$
$g = X_1 + X_2$

$$\mathrm{var}\left[X_1 + X_2\right] = E\left[\left(X_1 + X_2\right)^2\right] - \left(E\left[X_1 + X_2\right]\right)^2$$

$$= E[X_1^2 + 2X_1X_2 + X_2^2] - \left(E\left[X_1\right] + E\left[X_2\right]\right)^2$$

$$= E\left[X_1^2\right] + 2E\left[X_1X_2\right] + E\left[X_2^2\right] +$$
$$-\left(E\left[X_1\right]^2 + 2E\left[X_1\right]E\left[X_2\right] + E\left[X_2\right]^2\right)$$
$$= \mathrm{var}[X_1] + \mathrm{var}[X_2] + 2\,\mathrm{cov}[X_1, X_2]$$

Quanti sono i termini di covarianza?

$n = 2 \rightarrow \mathrm{cov}[X_1, X_2] \rightarrow 1$

$n = 3 \rightarrow \mathrm{cov}[X_1, X_2], \mathrm{cov}[X_1, X_3], \mathrm{cov}[X_2, X_3] \rightarrow 3$

$n = 4 \rightarrow \mathrm{cov}[X_1, X_2], \mathrm{cov}[X_1, X_3], \mathrm{cov}[X_1, X_4],$
$\mathrm{cov}[X_2, X_3], \mathrm{cov}[X_2, X_4], \mathrm{cov}[X_3, X_4] \rightarrow 6$

$\vdots$

$n = k \rightarrow \cdots \qquad \cdots \qquad \cdots \rightarrow \frac{k(k-1)}{2}$

quindi nel caso generale, in cui $g = X_1 + ... + X_n$, i termini di covarianza sono $\frac{n(n-1)}{2}$, mentre i termini di varianza sono n, per un totale di $\frac{n(n+1)}{2}$ termini differenti.

2) $g(X_1, ..., X_n) = a_1X_1 + \cdots + a_nX_n$, con $a_i \in \mathbb{R}$, per $i = 1, ..., n$.

- $E[g] = \sum_{i=1}^{n} a_i E[X_i]$

  La dimostrazione è ovvia.

- $\operatorname{var}[g] = \sum_{i=1}^{n} a_i^2 \operatorname{var}[X_i] + 2\sum_{i}\sum_{\substack{j \\ i \neq j}} a_i a_j \operatorname{cov}[X_i, X_j]$

Infatti:

$$\begin{aligned}
\operatorname{var}[g] &= \operatorname{var}\left[\sum_{i=1}^{n} a_i X_i\right] \\
&= \sum_{i=1}^{n} \operatorname{var}[a_i X_i] + 2\sum_{i=1}^{n}\sum_{\substack{j=1 \\ i \neq j}}^{n} \operatorname{cov}[a_i X_i, a_j X_j] \\
&= \sum_{i=1}^{n} a_i^2 \operatorname{var}[X_i] + 2\sum_{i=1}^{n}\sum_{\substack{j=1 \\ i \neq j}}^{n} a_i a_j \operatorname{cov}[X_i, X_j]
\end{aligned}$$

CASO PARTICOLARE
n=2, $g(X, Y) = X \pm Y$

$E[g] = E[X \pm Y] = E[X] \pm E[Y]$

$\operatorname{var}[g] = \operatorname{var}[X \pm Y] = \operatorname{var}[X] + \operatorname{var}[Y] \pm 2 \operatorname{cov}[X, Y]$

3) $g(X_1, ..., X_n) = X_1 + \cdots + X_n$, con X_i a due a due NON CORRELATE, cioè $\operatorname{cov}[X_i, X_j] = 0, i \neq j$

- $E[g] = \sum_{i=1}^{n} E[X_i]$

- $\mathrm{var}[g] = \mathrm{var}\left[\sum_{i=1}^{n} X_i\right] = \sum_{i=1}^{n} \mathrm{var}[X_i]$

4) $g(X_1, ..., X_n) = X_1 + \cdots + X_n$, con X_i a due a due NON CORRELATE ed IDENTICAMENTE DISTRIBUITE, cioè $\mathrm{cov}[X_i, X_j] = 0$ per $i \neq j$; $\mu_{X_i} = \mu$ e $\sigma^2_{X_i} = \sigma^2$, $\forall i = 1, ..., n$.

- $E[g] = n\mu$

- $\mathrm{var}[g] = n\sigma^2$

Infatti:

$$E[g] = E\left[\sum_{i=1}^{n} X_i\right] = \sum_{i=1}^{n} E[X_i] = \sum_{i=1}^{n} \mu_{X_i} = n\mu,$$

$$\mathrm{var}[g] = \mathrm{var}\left[\sum_{i=1}^{n} X_i\right] = \sum_{i=1}^{n} \mathrm{var}[X_i] = \sum_{i=1}^{n} \sigma^2_{X_i} = n\sigma^2$$

5) $g(X_1, ..., X_n) = \dfrac{1}{n}(X_1 + \cdots + X_n) = \overline{X}_n$

con X_i a due a due NON CORRELATE ed IDENTICAMENTE DISTRIBUITE con media μ e varianza σ^2.

$\overline{X}_n$ è detta MEDIA CAMPIONARIA.

- $E[g] = E[\overline{X}_n] = \mu$
- $\text{var}[g] = \text{var}[\overline{X}_n] = \dfrac{\sigma^2}{n}$

Infatti:

$$E[g] = E\left[\frac{1}{n}\sum_{i=1}^{n} X_i\right] = \frac{1}{n}\sum_{i=1}^{n} E[X_i] = \frac{1}{n}\sum_{i=1}^{n} \mu_{X_i} = \frac{1}{n}\cdot n\mu = \mu,$$

$$\text{var}[g] = \text{var}\left[\frac{1}{n}\sum_{i=1}^{n} X_i\right] = \frac{1}{n^2}\text{var}\left[\sum_{i=1}^{n} X_i\right] = \frac{1}{n^2}\sum_{i=1}^{n}\text{var}[X_i] = \frac{1}{n^2}\sum_{i=1}^{n}\sigma_{X_i}^2 = \frac{1}{n^2}\cdot n\sigma^2 = \frac{\sigma^2}{n}$$

OSSERVAZIONE

Nei punti numero 4) e 5) l'ipotesi di non correlazione a due a due può anche essere sostituita con l'ipotesi più forte di INDIPENDENZA (più forte perchè indipendenza $\underset{\not\Leftarrow}{\Rightarrow}$ non correlazione)

In tal caso le variabili casuali $X_1, ..., X_n$ si dicono indipendenti ed identicamente distribuite che nel seguito abbrevieremo con i.i.d.

Relativamente al caso 5) è possibile provare che se X_i sono i.i.d. con funzione di densità normale $N(\mu, \sigma^2)$, allora

$$\overline{X}_n \text{ è NORMALE } N(\mu, \frac{\sigma^2}{n})$$

Esempio. Le precipitazioni annuali a Brescia hanno distribuzione normale $N(\mu = 12.08\,\mathrm{cm}, \sigma = 3.1\,\mathrm{cm})$. Le precipitazioni di anni successivi sono indipendenti. Calcolare:
1) la probabilità che le precipitazioni dei prossimi 2 anni superino i 25 cm;
2) la probabilità che le precipitazioni del prossimo anno superino quelle dell'anno successivo per più di 3 cm.

1) Chiamiamo X_1 ed X_2 le precipitazioni (in cm) dei prossimi 2 anni. Introduciamo

$$Y = X_1 + X_2 \sim N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$$

dove $\mu_Y = E[Y] = n\mu = 2 \cdot 12.08\,\mathrm{cm} = 24.16\,\mathrm{cm}$
$\sigma_Y^2 = n\sigma^2 = 2 \cdot (3.1)^2\mathrm{cm}^2 = 19.22\,\mathrm{cm}^2$

Quindi

$$P[Y > 25] = P[Z > \frac{25 - \mu_Y}{\sigma_Y}] = P[Z > \frac{0.84}{\sqrt{19.22}}]$$
$$= P[Z > 0.1916] = 1 - P[Z \leq 0.1916] \cong$$
$$\cong 1 - 0.576 = 0.424$$

2) La seconda domanda chiede di trovare
$P[X_1 > X_2 + 3] = P[X_1 - X_2 > 3]$.
Chiamiamo
$T = X_1 - X_2 \Rightarrow T \sim N(\mu_T, \sigma_T^2)$ dove
$\mu_T = \mu_{X_1} - \mu_{X_2} = \mu - \mu = 0$
$\sigma_T^2 = \sigma_{X_1}^2 + \sigma_{X_2}^2 = 2\sigma^2 = 19.22 \text{ cm}^2$
Quindi:

$$P[T > 3] = P[\frac{T - \mu_T}{\sigma_T} > \frac{3 - \mu_T}{\sigma_T}] = P[Z > \frac{3}{\sqrt{19.22}}]$$
$$= P[Z > 0.6843] = 1 - P[Z \leq 0.6843] \cong$$
$$\cong 1 - 0.754 = 0.246.$$