

Subject:

$$P(X \geq a) \leq \frac{E[X]}{a} \quad \text{نامساوی مارکوف} \quad \text{۱- الف}$$

$$E[X] = \sum_{x \geq 0} x p(x) \geq \sum_{x \geq a} x p(x)$$

$$\geq \sum_{x \geq a} a p(x)$$

$$= a \sum_{x \geq a} p(x)$$

$$= a P(X \geq a)$$

$$P(|X - \mu| > a) \leq \frac{\text{var}[X]}{a^2} \quad \text{نامساوی چسب} \quad \text{ب}$$

چون  $(X - \mu)^2$  یک متغیر تصادفی نامنفی است. نامساوی مارکوف برای آن در نظر گرفته می شود:  $a = a^2$

$$P((X - \mu)^2 \geq a^2) \leq \frac{E[(X - \mu)^2]}{a^2}$$

چون  $(X - \mu)^2 \geq k^2$  نقطه در صورتی که  $|X - \mu| > a$  برقرار است پس:

$$P(|X - \mu| > a) \leq \frac{E[(X - \mu)^2]}{a^2} = \frac{\text{var}[X]}{a^2}$$

ج) با توجه به فرمول چسب در وقت ب داریم:

$$\text{var}[X] = \sigma^2 = 4$$

$$P(X = 5) < \frac{4}{a^2} \Rightarrow a = 5 \Rightarrow P(5) < \frac{4}{25}$$

$$P(5) < 0.16$$

Subject:

$$E(ax+b) = aE[X] + b$$

(الف) ٢

$$E(ax+b) = \sum_x (ax+b) P(x)$$

$$= \sum_x (ax \cdot P(x) + b \cdot P(x))$$

$$= \sum_x ax P(x) + \sum_x b \cdot P(x)$$

$$= a \underbrace{\left( \sum_x x P(x) \right)}_{E[X]} + b \underbrace{\left( \sum_x P(x) \right)}_1$$

$$= aE[X] + b$$

مثال:  $E(XY)$

(ب)

$$E(XY) = E(g(x)h(y))$$

مثال:

$$E[g(x)h(y)] = \iint_{R^2} g(x)h(y) f(x,y) dy dx$$

$$= \underbrace{\left( \int_R g(x) f_x(x) dx \right)}_{E[g(x)]} \underbrace{\left( \int_R h(y) f_y(y) dy \right)}_{E[h(y)]}$$

$$= E[X] E[Y] \quad (\checkmark)$$

IDEA

Subject:.....

Date:.....

$$\sigma_{ax+by+c}^2 = a^2 \sigma_x^2 + b^2 \sigma_y^2 + 2ab \sigma_{xy}$$

(C)

$$\text{var}[ax+by+c] = E[(ax+by+c)^2] - E[ax+by+c]^2$$

$$= E[a^2 x^2 + b^2 y^2 + c^2 + 2axc + 2bxc + 2abxy] - E[ax+by+c]^2$$

r.w.s

$$= E[a^2 x^2] + E[b^2 y^2] + E[c^2] + E[2acx] + E[2bcy] +$$

$$E[2abxy] - (aE[x] + bE[y] + c)^2 =$$

$$a^2 E[x^2] + b^2 E[y^2] + c^2 + 2acE[x] + 2bcE[y] +$$

$$2abE[xy] - (a^2 E[x]^2 + b^2 E[y]^2 + c^2 + 2abE[x]E[y]$$

$$+ 2acE[x] + 2bcE[y])$$

$$a^2 (E[x^2] - E[x]^2) + b^2 (E[y^2] - E[y]^2) +$$

$$2ab(E[xy] - E[x]E[y])$$

$$= a^2 \text{var}[x] + b^2 \text{var}[y] + 2ab \sigma_{xy}$$

$$a^2 \sigma_x^2 + b^2 \sigma_y^2 + 2ab \sigma_{xy}$$

Subject:.....

Date:.....

$$\sigma_{ax-by}^2 = a^2 \sigma_x^2 + b^2 \sigma_y^2 \quad (1)$$

$$\sigma_{ax-by}^2 = \text{var}[ax-by] = E[(ax-by)^2] - E[ax-by]^2$$

$$= E[a^2 x^2 + b^2 y^2 - 2abxy] - (aE[x] - bE[y])^2 =$$

$$a^2 E[x^2] + b^2 E[y^2] - 2ab E[xy] - a^2 E[x]^2 - b^2 E[y]^2 + 2ab E[x]E[y]$$

in  $\bar{y}$   $x$   $\bar{x}$   $y$

$$\Rightarrow -2ab E[x]E[y]$$

$$= a^2 (E[x^2] - E[x]^2) + b^2 (E[y^2] - E[y]^2) =$$

$$a^2 \text{var}[x] + b^2 \text{var}[y] = a^2 \sigma_x^2 + b^2 \sigma_y^2$$

$$\text{cov}(x,y) = E[(x - E(x))(y - E(y))]$$

$$\rho = \frac{\text{cov}(x,y)}{\sigma_x \sigma_y}$$

$$\text{var}\left(\frac{x}{\sigma_x} + \frac{y}{\sigma_y}\right) = 1 + \rho \quad (2)$$

$$\text{var}\left(\frac{x}{\sigma_x} + \frac{y}{\sigma_y}\right) = \sigma^2\left(\frac{x}{\sigma_x} + \frac{y}{\sigma_y}\right) = \frac{1}{\sigma_x^2} \sigma^2[x] + \frac{1}{\sigma_y^2} \sigma^2[y]$$

$$+ \frac{2}{\sigma_x \sigma_y} \text{cov}(x,y) = 1 + 2 \frac{\text{cov}(x,y)}{\sigma_x \sigma_y}$$

$$= 1 + \rho \quad \checkmark$$



Subject:.....

Date:.....

$$\text{var} \left( \frac{X}{\sigma_X} - \frac{Y}{\sigma_Y} \right) = 1 - \rho f(x, y)$$

$$\text{var} \left( \frac{X}{\sigma_X} - \frac{Y}{\sigma_Y} \right) = \sigma^2 \left( \frac{X}{\sigma_X} - \frac{Y}{\sigma_Y} \right) =$$

$$\frac{1}{\sigma_X^2} \sigma_X^2 + \frac{1}{\sigma_Y^2} \sigma_Y^2 - \frac{2}{\sigma_X \sigma_Y} \sigma_{XY}$$

$$= 1 - 2 \frac{\text{cov}_{XY}}{\sigma_X \sigma_Y} = 1 - \rho f_{XY} \quad (\checkmark)$$

$$-1 \leq f_{XY} \leq 1$$

بسته است (ب)

$$\text{var} \left( \frac{X}{\sigma_X} + \frac{Y}{\sigma_Y} \right) = 1 + \rho f(x, y)$$

$$1 + \rho f(x, y) \geq 0$$

$$\Leftarrow \text{var}[X] \geq 0 \quad \text{چون } \sigma_X^2 \geq 0$$

$$\rho f(x, y) \geq -1 \Rightarrow \boxed{\rho f(x, y) \geq -1} \quad (1)$$

$$\text{var} \left( \frac{X}{\sigma_X} - \frac{Y}{\sigma_Y} \right) = 1 - \rho f(x, y)$$

$$1 - \rho f(x, y) \geq 0$$

$$\Leftarrow \text{var}[X] \geq 0 \quad \text{چون } \sigma_X^2 \geq 0$$

$$\rho f(x, y) \leq 1 \Rightarrow \boxed{\rho f(x, y) \leq 1} \quad (2)$$

$$-1 \leq f(x, y) \leq 1$$

$$\Leftarrow (2), (1)$$

Subject:.....

Date:.....

$$f(x, y) = 1 \quad y = ax + b \quad a > 0$$

$$\text{Cor}_{xy} = E[ax + b] - E[x]E[ax + b]$$

$$\text{Var}[x] = E[x^2] - E[x]^2 = E[x - \mu_x]^2 = \sigma_x^2$$

$$\text{Var}[y] = E[y^2] - E[y]^2 = E[y - \mu_y]^2$$

$$\text{Var}[ax + b] = E[(ax + b)^2] - E[ax + b]^2$$

$$= a^2 E[x^2] + b^2 + 2ab E[x] - (a E[x] + b)^2 =$$

$$a^2 E[x^2] + b^2 + 2ab E[x] - a^2 E[x]^2 - b^2 - 2ab E[x]$$

$$a^2 (E[x^2] - E[x]^2) = a^2 \text{Var}[x] = a^2 \sigma_x^2$$

$$\text{Var}\left(\frac{x}{\sigma_x} - \frac{y}{\sigma_y}\right) = \text{Var}\left[\frac{x}{\sigma_x} - \frac{ax + b}{a\sigma_x}\right] =$$

$$\text{Var}\left[\frac{x}{\sigma_x} - \frac{x}{\sigma_x} - \frac{b}{a\sigma_x}\right] = \text{Var}\left[\frac{-b}{a\sigma_x}\right] = \text{Var}[\text{constant}] = 0$$

$$\rightarrow r = \text{Cor}(x, y) = 0 \Rightarrow \boxed{f(x, y) = 1}$$

Subject: .....

Date: .....

$$y = ax + b \quad f(x, y) = 1 \quad (y = z) : \text{نقطة}$$

↳ العلاقة

$$\rho \cdot \text{Var} \left( \frac{x}{\sigma_x} - \frac{y}{\sigma_y} \right) = 1 - \rho \quad f(x, y) = 0 \Rightarrow \frac{x}{\sigma_x} - \frac{y}{\sigma_y} = c$$

$$\frac{y}{\sigma_y} = \frac{x}{\sigma_x} - c \Rightarrow y = \left( \frac{\sigma_y}{\sigma_x} \right) x - (c \sigma_y) \Rightarrow y = ax + b$$

$$a = \frac{\sigma_y}{\sigma_x}$$

$$\sigma_y = \sqrt{\text{Var}(y)}$$

$$\sigma_x = \sqrt{\text{Var}(x)}$$

$$\Rightarrow \frac{\sigma_y}{\sigma_x} \Rightarrow \boxed{a}$$

$$P(x > y) = 0,5 \quad P(y > z) = 0,5 \quad P(z > x) = 0,5 \quad - \Sigma$$

برهان خلف

$$P(x > y \cup y > z) = P(x > y) + P(y > z) - P(x > y \cap y > z) < 1$$

$$\Rightarrow P(x > y \cap y > z) > 0,5$$

$$\Rightarrow P(x > y > z) < P(x > z) \Rightarrow \frac{P(x > z)}{0,5} > 0,5$$

$$\Rightarrow 0,5 + 0,5 + 0 < P(x > z) + P(z > x) + P(x = z)$$

$$\Rightarrow 1 > 1 \Rightarrow \text{ناقض}$$

Subject:.....

Date:.....

$$f(k:p) = \begin{cases} p & \text{if } k=1 \\ 1-p & \text{if } k=0 \end{cases}$$

و- الف) توزیع برنولی

$$E[X] = 1 \times p + 0 \times (1-p) = p$$

$$\text{Var}[X] = E[X^2] - E[X]^2 = p - p^2 = p(1-p) = pq$$

ب) توزیع binomial

$$Pr(k;n,p) = \binom{n}{k} p^k (1-p)^{n-k} \quad \text{for } k=0,1,2,\dots,n$$

$$E[X] = \sum_{k=0}^n k \binom{n}{k} p^k (1-p)^{n-k}$$

$$= \sum_{k=1}^n k \frac{n!}{k!(n-k)!} p^k (1-p)^{n-k}$$

$$= \sum_{k=1}^n \frac{n(n-1)!}{(k-1)!(n-k)!} p^k (1-p)^{n-k}$$

$$= np \sum_{k=1}^n \frac{(n-1)!}{(k-1)!(n-k)!} p^{k-1} (1-p)^{n-k}$$

$$= np \sum_{j=0}^{n-1} \frac{(n-1)!}{(j)!(n-1-j)!} p^j (1-p)^{n-1-j}$$

$$= np \sum_{j=0}^{n-1} \binom{n-1}{j} p^j (1-p)^{n-1-j}$$

عبایت جلوی کے آخرین جملہ خود کیا تو جمع دے گا ای است۔ و صحت کی تائید جمع احکام کا کیا گیا ہے  
سب کے عبایت میدان کے برابر کیا است بنا براین:

$$E[X] = np$$



9/

Subject:.....

Date:.....

$$E[X^r] = \sum_{k=1}^n k^r \binom{n}{k} p^k (1-p)^{n-k}$$

$$= np[(n-1)p + 1]$$

$$\begin{aligned} \Rightarrow \text{var}[X] &= E[X^r] - E[X]^r \\ &= n^r p^r - np^r + np - (np)^r \\ &= np(1-p) \end{aligned}$$

$$\Rightarrow \text{var}[X] = np(1-p)$$

$$f(k; \lambda) = \frac{\lambda^k e^{-\lambda}}{k!} \quad k = 0, 1, 2, \dots \quad \text{(توزيع بواسون)}$$

$$E[X] = \sum_{k=0}^{\infty} k e^{-\lambda} \frac{\lambda^k}{k!} = e^{-\lambda} \sum_{k=1}^{\infty} k \frac{\lambda^k}{k!} = e^{-\lambda} \lambda \sum_{k=0}^{\infty} \frac{\lambda^{k-1}}{(k-1)!}$$

$$= e^{-\lambda} \lambda e^{\lambda} = \lambda$$

$$E[X^r] = \sum_{k=0}^{\infty} k^r e^{-\lambda} \frac{\lambda^k}{k!} = \lambda e^{-\lambda} \sum_{k=1}^{\infty} k \frac{\lambda^{k-1}}{(k-1)!}$$

$$= \lambda e^{-\lambda} \frac{d}{d\lambda} \sum_{k=0}^{\infty} \frac{\lambda^k}{k!} \quad \because \frac{d}{d\lambda} \lambda^k = k \lambda^{k-1}$$

$$= \lambda e^{-\lambda} \frac{d}{d\lambda} \lambda e^{\lambda} = \lambda e^{-\lambda} (e^{\lambda} + \lambda e^{\lambda}) = \lambda + \lambda^r$$

$$\text{var}[X] = E[X^r] - E[X]^r = \lambda^r + \lambda - \lambda^r = \lambda$$

Subject:.....

Date:.....

$$f(x; \lambda) = \begin{cases} \lambda e^{-\lambda x} & x \geq 0 \\ 0 & x < 0 \end{cases}$$

(د) توزيع

$$E[X] = \int_0^{\infty} x \lambda e^{-\lambda x} dx \xrightarrow{\text{integration by parts}} -x e^{-\lambda x} \Big|_0^{\infty} + \int_0^{\infty} e^{-\lambda x} dx = \frac{1}{\lambda}$$

$$E[X^r] = \int_0^{\infty} x^r \lambda e^{-\lambda x} dx = -x^r e^{-\lambda x} \Big|_0^{\infty} + \int_0^{\infty} r x^{r-1} e^{-\lambda x} dx$$

$$= \frac{r}{\lambda}$$

$$\Rightarrow \text{var}[X] = \frac{r}{\lambda^2} - \frac{1}{\lambda^2} = \frac{1}{\lambda^2}$$

$$P(x, y) = P(y) P(x|y)$$

(ع) 9

$$\text{inter} \quad E[X] = E(E(X|Y))$$

$$E[X|Y=y] = g(y) \Rightarrow E[X|Y] = g(Y) = (g \circ Y)$$

$$E(E[X|Y]) = \int_{y=-\infty}^{\infty} g(y) f_Y(y) dy$$

$$g(y) = \int_{x=-\infty}^{\infty} x f_{X|Y}(x|y) dx = \int_{x=-\infty}^{\infty} x \frac{f(x, y)}{f_Y(y)} dx$$

$$E(E(X|Y)) = \int_{y=-\infty}^{\infty} \int_{x=-\infty}^{\infty} x \frac{f(x, y)}{f_Y(y)} dx f_Y(y) dy$$

$$= \int_{x=-\infty}^{\infty} \int_{y=-\infty}^{\infty} x f(x, y) dy dx = E[X] \quad \checkmark$$

Subject:

توزیع پواسون

$$\begin{cases} \mu = \lambda \\ \sigma^2 = \lambda \end{cases}$$

اموال برایش هر یک =  $\frac{1}{\lambda}$

$$E[E[A|B']] + E[E[B|A']] =$$

$$E[A] + E[B] = \mu + \sigma = \lambda$$

۹- ایا: تعدادهای کمی از سوره.

$$E[X] = \frac{\sigma}{\lambda} (E[X] + \mu) + \frac{\mu}{\lambda} (E[X] + \sigma)$$

b

$$\left( \frac{1}{\lambda} E[X] + \frac{\mu}{\lambda} \right) = E[X]$$

$$\frac{\mu}{\lambda} E[X] = \frac{\mu^2}{\lambda} \rightarrow E[X] = \mu$$

جواب:  $E[X] = \frac{1}{\mu} (\mu + E(X|Y)) + \frac{1}{\mu} (\mu + E(X|Z)) =$

اول:  $\mu$

دوم:  $\mu$

$$\frac{1}{\mu} (\mu + \frac{1}{\mu} \times \mu + \frac{1}{\mu} \times \mu) + \frac{1}{\mu} (\mu + \frac{1}{\mu} \times \mu + \frac{1}{\mu} \times \mu) = \frac{1\mu}{\mu} = \frac{\mu}{\mu}$$

$$E[X^2] = \frac{\sigma}{\lambda} (E[X] + \mu)^2 + \frac{\mu}{\lambda} (E[X] + \sigma)^2$$

جواب: (ج)

$$= \frac{\sigma}{\lambda} \times 1\mu^2 + \frac{\mu}{\lambda} \times 1\mu^2 = 1\mu$$

$$\text{Var}[X] = E[X^2] - E[X]^2 = 1\mu - \mu^2 = \mu^2 \mu$$

IDEA

Subject:

$$E[X^2] = \frac{1}{12} \left( \left( 2 + \frac{1}{4} \times 12 \right)^2 \right) + \frac{1}{12} \left( \left( 3 + \frac{1}{4} \times 12 \right)^2 \right) \quad (ب)$$

$$= \frac{1}{12} (4,5)^2 + \frac{1}{12} (5)^2 = \frac{249}{12}$$

$$var[X] = E[X^2] - E[X]^2 = \frac{249}{12} - \frac{25}{4} = \frac{249 - 75}{12}$$

$$= \frac{174}{12} = \frac{46}{3}$$

$$\frac{1}{\lambda} = \infty = E[X] \quad \text{میانگین تابع توزیع نمایی}$$

$$E[T] = E(t_1) + E(t_2) = 10$$

بر صورت میانگین  
خفیه ۲ می کند

استیج: ساعتی ۲ تومان + آلودگی محل کارش رسد + هادفتی کارشیه  

$$-20 + \frac{20}{4} = -10 + 5 = -5$$
  
 تاکن:  $T + 10$  رسد به محل کارش رسد + هادفتی کارشیه کند  

$$= -10 + 20 = 10$$

$$-\frac{5}{4} \times 20 > -5 \Rightarrow$$

یعنی با استیج خفیه بیشتر از دست می دهد  
 یعنی با تاکن برده بهتر است.



۱- این تابع توزیع حاشیه‌ای:

$$f_{X_1}(x_1) = \int_0^{x_1} 4x_2 dx_2 = 2x_2^2 \Big|_0^{x_1} = 2x_1^2 \quad 0 < x_1 < 1 \quad (I)$$

حک: (۱) این تابع می‌تواند مقادیر غیرکتر از یک داشته باشد (بازان  $0 < x_1 < 1$ )

$$(2) f_{X_1}(x_1) \geq 0$$

$$\int_{-\infty}^{+\infty} f(x_1) dx_1 = \int_0^1 2x_1^2 dx_1 = x_1^3 \Big|_0^1 = 1 \quad (3)$$

← پس این تابع می‌تواند تابع توزیع حاشیه‌ای باشد

$$P(x_2 < 0.5 \mid x_1 = 0.5)$$

(ب)

$$= \int_0^{0.5} 4x_2 dx_2 = 2x_2^2 \Big|_0^{0.5} = 2 \times 0.25 = 0.5$$

$$2x_1^2 \xrightarrow{x_1=0.5} 2 \times (0.5)^2 = 0.5 \times 2$$

$$\Rightarrow P(x_2 < 0.5 \mid x_1 = 0.5) = \frac{2 \times 0.25}{2 \times 0.5} = \frac{0.5}{1} = 0.5$$

Subject:

$$E(T_F | \text{start} = A) = 1 + E(T_F | B) \quad (1) \quad \text{الف - 1}$$

$$E(T_F | B) = \frac{1}{3} E(T_F | C) + \frac{1}{3} E(T_F | A) + \frac{1}{3} E(T_F | D) + 1 \quad (2)$$

$$E(T_F | C) = \frac{1}{2} E(T_F | B) + \frac{1}{2} E(T_F | E) + 1 = E(T_F | D) \quad (3)$$

$$E(T_F | E) = \frac{1}{3} E(T_F | C) + \frac{1}{3} E(T_F | D) + \frac{1}{3} E(T_F | F) + 1 \quad (4)$$

$$E(T_F | C) \quad (2)$$

با جایگزینی (1) و (2) داریم:

$$E(T_F | D) = 1 + E(T_F | C) = E(T_F | C)$$

$$E(T_F | A) - 1 = \frac{1}{3} E(T_F | C) + \frac{1}{3} E(T_F | A) + \frac{1}{3} E(T_F | D) + 1$$

$$\downarrow (3)$$

$$\frac{2}{3} E(T_F | A) = 2 + \frac{2}{3} E(T_F | C) \quad E(T_F | C)$$

$$\Rightarrow E(T_F | C) = E(T_F | A) - 3 \quad (5)$$

$$(6)$$

$$E(T_F | C) = \frac{1}{2} (E(T_F | A) - 3) + \frac{1}{2} E(T_F | E) + 1 \quad (1), (3) \text{ جایگزینی}$$

$$\frac{1}{2} - \frac{1}{2} E(T_F | A) = \frac{1}{2} (1 - E(T_F | E)) \quad (4) \text{ و (5) را در (4) قرار می دهیم:}$$

$$E(T_F | E) = \frac{2}{3} (E(T_F | A) - 3) + \frac{1}{3} E(T_F | F) + 1$$

$$= \frac{2}{3} E(T_F | A) - 2 + \frac{1}{3} E(T_F | F) \quad (7)$$

(5) و (6) را مساوی قرار می دهیم و داریم  $E(T_F | F) = 0$  چرا که هیچ مسیری وجود ندارد و به راه نرسد

$$E(T_F | A) - 3 = \frac{1}{3} E(T_F | A) - \frac{1}{3} + \frac{1}{3} E(T_F | E) + 1$$

$$\frac{1}{2} E(T_F | A) = \frac{4}{2} + \frac{1}{2} E(T_F | E)$$

$$E(T_F | E) = E(T_F | A) - 4 \quad (8)$$

امسده تری دهیم (7), (8)

$$\frac{4}{3} E(T_F | A) - 1 = \frac{1}{2} E(T_F | A) - \frac{4}{2}$$

$$\frac{4}{3} E(T_F | A) = 4 \rightarrow E(T_F | A) = 12$$

$$\Rightarrow E(T_F | B) = 14 \quad E(T_F | E) = 11$$

$$E(T_F | C) = 15 \quad E(T_F | D) = 15$$

$$E(T_F | C) + 2 = 15 + 2 = 17$$

(ب)

$$\left\{ \begin{array}{l} A \ B \ C \ E \ F : 1 \times \frac{1}{3} \times \frac{1}{2} \times \frac{1}{2} = \frac{1}{12} \\ A \ B \ D \ E \ F : 1 \times \frac{1}{3} \times \frac{1}{2} \times \frac{1}{2} = \frac{1}{12} \end{array} \right.$$

(ج)

$$\Rightarrow \frac{2}{12} = \frac{1}{6}$$

(د) چنین حالتی وجود ندارد چون بعد از قدم های که بالا بردیم ، برای اینکه بخواند هندی شود

باید از مثلا C ، B باز برگرد و تا اینجا 3 قدم رفته است (A B C B) و باید از B برگرد

F قدم بردارد که در این حالت جدا از اینکه چه مسیری را انتخاب کند باید 3 قدم دیگر بردارد (B D E F) حتما

پس 5 قدم برای قدم زدن وجود ندارد.  
دقیقا