Дискретная математика

Харитонцев-Беглов Сергей

2 ноября 2021 г.

Содержание

1. Теория множеств

1.1. Базовые понятия

Есть официальный конспект, который будет Здесь.

***Определение* 1.1.** Множество — набор различимых между собой по какому-то признаку предметов.

***Определение* 1.2.** Предметы входящие в это множество называются его элементами.

Если мы хотим описать множество, то нужно просто описать предметы этого множества. Например, чтобы задать множество студентов необходимо задать просто студентов.

Есть конечные, счетные, несчетные и целый зоопарк множеств разных мощностей. Самое простое множество — $\varnothing$, множество ничего не содержащее — пустое.

***Определение* 1.3.** X подмножество $(\subseteq)$ $Y \Leftarrow \forall y \in Y: \ y \in X$.
$\varnothing$ и X — тривиальные, остальные — нетривиальные. все подмножества, кроме X — собственные.

1.2. Операции с множествами

Символ	**Определение**	**Словами**
$\cap$	$A \cap B = \dots$	Пересечение множества
$\cup$	$A \cup B = \dots$	Объединение множеств
$\setminus$	$A \setminus B$ = ...	Разность множеств
$\triangle$	$A \triangle B = \dots$	Симметрическая разность множеств

***Определение* 1.4.** Алгебраическая структура — множество, на котором ввели какую-то операцию.

Пример. Пусть заданы несколько множеств:

1. $\exists e: \ a \cdot e = a \, \forall a \in G$
2. $\forall a \in G \, \exists a^{-1} \in G: \ a \cdot a^{-1} = a^{-1} \cdot a = e$
3. $\forall a, b, c: \ (a \cdot b) \cdot c = a \cdot (b \cdot c)$
4. $\forall a, b \in G a \cdot b = b \cdot a$

То это абелева группа и это к алгебре.

А дискретная математика не имеет аксиом, то есть мало чего можно использовать из алгебры / матана.

Если задать какое-то надмножество X над A, то появится операция дополнения: $A' = X \setminus A$. Законы Де Моргана:

Теорема 1.1. $(A \cup B)' = A' \cap B'$

Теорема 1.2. $(A \cap B)' = A' \cup B'$

Доказательство смотри в конспекте Омеля, тут мне лень это делать.

***Определение* 1.5.** Система иножеств — множество, элементами которого являются множества.

***Определение* 1.6.** Семейство множеств — упорядоченный набор неких множеств $(X_1, X_2, \dots, X_k)$. Причем множества в наборе могут повторяться.

***Определение* 1.7.** Некоторое покрытие множества X системой множеств — система множеств, объединение элементов которого равняется X.

***Определение* 1.8.** Разбиение множества X на блоки — система $(X_1, X_2, \dots, X_k)$, удовлетворяющая неким условиям:

1. $X = \bigcup_{i=1}^{k} X_i$
2. $\forall i : \ X_i \neq \varnothing$
3. $\forall i, j = 1..k : \ X_i \cap X_j = \varnothing$

***Определение* 1.9.** Пара элементов (x, y) — упорядоченный набор из двух элементов. То есть для $x \neq y$: $(x, y) \neq (y, x)$

***Определение* 1.10** (Декартово произведение)**.** $X \times Y = \{(x, y) \mid x \in X, y \in Y\}$

можно ввести понятие «nки» — упорядоченный набор из n элементов. Поэтому можно ввести $A \times B \times C \times \dots$ и A^2, A^n

***Определение* 1.11.** Отношение между множествами — некое подмножество декартого произведения этих множеств

Пусть ω — отношение между X и Y. Тогда их записывают $X \omega Y$, а отсутствие — $X \not\omega Y$.

***Определение* 1.12.** Отношение эквивалентности $(X, \sim)$:

1. $x \sim x \ \forall x \in X$
2. $x \sim, y \Rightarrow y \sim x \ \forall x, y \in X$
3. $x \sim y, y \sim z, \Rightarrow x \sim z \ \forall x, y, z \in X$

Пусть $\widetilde{x} = \{y \in X \mid y \sim x\}$.

Свойство. пусть $y \in \widetilde{x} \Rightarrow \widetilde{y} = \widetilde{x}$

Теорема 1.3. Разбиение на блоки задает классы эквивалентности.

- $X = \bigcup_{x \in X} \widetilde{x}$
- $\widetilde{x} \neq \varnothing$, т.к. хотя бы $x \in \widetilde{x}$.
- Рассмотрим $\widetilde{x}, \widetilde{y}$. Пусть $\exists z : \ z \in \widetilde{x} \cap \widetilde{y}$. Тогда $\left.\begin{matrix} \widetilde{z} = \widetilde{x} \\ \widetilde{z} = \widetilde{y} \end{matrix}\right\} \Rightarrow \widetilde{x} = \widetilde{y}$

***Определение* 1.13.** Мультимножество — $(x; \varphi) : \ \varphi \to \mathbb{Z}_+$

Есть еще несколько базовых понятий: k-перестановки/сочетания из n элементов с/без повторений.

$|A \cup B| = |A| + |B|$, если $A \cap B = \varnothing$. Поэтому, если есть разбиение на блоки, то $X = X_1 \cup \ldots \cup X_k \Rightarrow |X| = |X_1| + \ldots + |X_k|$

$X = X_1 \times \ldots \times X_k$, тогда $|X| = |X_1| \cdot \ldots \cdot |X_k|$

$|A' \cap B'| = |(A \cup B)'| = |X| - |A \cup B| = |X| - |A| - |B| + |A \cap B|$

2. Комбинаторика

2.1. Сшки

Есть два способа записи цэшек: $C_n^k = \binom{n}{k} = \frac{n!}{k!\cdot(n-k)!}$. Обычно формулы в комбинаторике используются не для подсчетов, а для определения асимптотики/верней оценки и так далее. Например если взять $n = 100$, то уже проблема: 100! — довольно большое число. Но там еще и деление!!! Короче, может получиться небольшое число при больших числах в подсчетах.

Давайте забудем эту дурацкую формулу и будем использовать рекурренты: легко считать, пишется в миг. $\binom{n}{k} = \binom{n-1}{k} + \binom{n}{k-1}, \binom{0}{0} = 1$.

Доказательство. Пусть есть множество из n элементов. Разобьем все k-элементные подмножества на блоки: в одном все без последнего элемента, в другом все с последним.Тогда в первом блоке тогда есть $\binom{n-1}{k}$ элементов. В другом $\binom{n-1}{k-1}$ элементов. А значит $\binom{n}{k} = \binom{n-1}{k-1} + \binom{n-1}{k}$ □

Есть пара граничных случаев: $\binom{n}{0} = 1, \binom{n}{k}(n < k) = 0$. После этого можно сделать треугольник Паскаля:

$$
\begin{array}{ccccccccccccc}
 & & & & & & 1 & & & & & & \\
 & & & & & 1 & & 1 & & & & & \\
 & & & & 1 & & 2 & & 1 & & & & \\
 & & & 1 & & 3 & & 3 & & 1 & & & \\
 & & 1 & & 4 & & 6 & & 4 & & 1 & & \\
 & 1 & & 5 & & 10 & & 10 & & 5 & & 1 & \\
1 & & 6 & & 15 & & 20 & & 15 & & 6 & & 1
\end{array}
$$

Рассмотрим решетчатую плоскость (если вы это читаете это и здесь нет картиночки напишите `@doktorkrab`, чтобы я добавил картиночку). Какое здесь количество путей? Ну $An^k = A_{n-1}^k + A_{n-1}^{k-1}$. А это Сшки.

Теперь посмотрим на сумму на диагонали. Получаем гипотезу: $\sum m = 0^n \binom{m}{k} = \binom{k}{k} + \binom{k+1}{k} + \ldots + \binom{n-1}{k} + \binom{n}{k} = \binom{n+1}{k+1}$.

Доказательство. По основному комбинаторному тождеству: $\binom{m+1}{k+1} = \binom{m}{k+1}\binom{m}{k} \Rightarrow \binom{m}{k} = \binom{m+1}{k+1} - \binom{m}{k+1}$. Тогда:

$$\sum_{m=k}^{n} \binom{m}{k} = \underbrace{\sum_{m=k}^{n} \binom{m+1}{k+1}}_{\binom{n+1}{k+1} + \sum_{m=k}^{n-1}\binom{m+1}{k+1}} - \underbrace{\sum_{m=k}^{n} \binom{m}{k+1}}_{\sum_{m=k+1}^{n}\binom{m}{k+1}}.$$

Дальше, если, расписать сумму все получится.

Пусть хочу набрать $k+1$-элементное подмножество из $n+1$-элементного множества. Пусть мы выбрали последний элемент, тогда у нас есть $\binom{n}{k}$ способов, а если не выбрали, то $\binom{n}{k+1}$ способов. А по индукции $\binom{n}{k+1} = \binom{n-1}{k+1} + \binom{n-1}{k}$. И так далее. □

Рассмотрим $\binom{n+m}{k} = \sum_{i=0}^{k} \binom{n}{i} \cdot \binom{m}{k-i}$

Доказательство. Рассмотрим два множества: одно n-элементное ("мальчики"), другое m-элементное ("девушки"). Тогда пусть мы выбрали i мальчиков, тогда нам нужно выбрать $k - i$ девушек. □

Мы здесь применили принцип `double counting`: если мы посчитали что-то двумя способами, то результаты равны.

2.2. Биномиальные коэффициенты

Подробности на втором курсе.

Рассмотрим бином Ньютона: $(x+y)^n = \sum_{k=0}^{n} \binom{n}{k} x^k \cdot y^{n-k}$

Доказательство. Раскроем скобки в левой части: $(x+y)(x+y)(x+y)\ldots$. Когда у нас x^k? Когда мы ровно в k скобках выбрали x. Сколько способов? Очевидно $\binom{n}{k}$. □

Частные случаи:

- $x = y = 1$. Тогда $2^n = \sum_{k=0}^{n} \binom{n}{k}$

  Рассмотрим множество $\{x_1, x_2, \ldots, x_n\}$. Каждому числу можно сопоставить $0/1$ — берем/не берем. Тогда количество подмножеств — количество бинарных строчек длины n. Такой метод называется биективным: когда мы доказываем, что один объект является биекцией другого, то их количества равны.

- $x = 1, y = -1$. Тогда $0 = \sum_{k=0}^{n} (-1)^k \binom{n}{k}$ — количества способов выбрать подмножество четных длин и нечетных длин равны.

2.3. Мультимножество

Хотим посчитать $\left(\!\binom{n}{k}\!\right)$ — количество k-элементных подмультимножеств.

Пусть $X = [n]$. По принципу биекции найдем сначала $\left(\!\binom{n}{k}\!\right)$ для X, а потом найти для произвольного множества.

Пусть есть множество A, заменим его на множество $\{i + A_i\}$. $\left(\!\binom{n}{k}\!\right) = \binom{n+k-1}{k}$

2.4. k-перестановки

***Определение* 2.1.** Упорядоченные набор из k элементов, где все элементы принадлежат множеству X.

Если мы считаем, что с повторениям, то ответ n^k, а если без то $n \cdot (n-1) \cdot \ldots \cdot (n-k+1) = (n)_k$. Перестановку можно записать как: $\begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 & \ldots & n-1 & n \\ a_1 & a_2 & a_3 & \ldots & a_{n-1} & a_n \end{pmatrix}$. То есть i перешло в a_i. После этого можно композировать перестановки: $\begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 3 & 2 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 3 & 1 & 2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 2 & 1 & 3 \end{pmatrix}$.

Заметим, что:

1. Существует нейтральный элемент — тождественная перестановка $e = \{1, 2, \ldots, n-1, n\}$
2. Существует обратный элемент: $\sigma\sigma^{-1} = \sigma^{-1}\sigma = e$
3. Ассоциативность: $\sigma \cdot (\tau \cdot \pi) = (\sigma \cdot \tau) \cdot \pi$

Значит перестановки с операцией композиции — группа. Носит название S_n. Есть теорема о том, что любая конечная группа представима как подгруппа S_n.

Рассмотрим $(n)_k = n \cdot (n-1) \cdot \ldots \cdot (n-k+1) = \binom{n}{k} \cdot k!$. Тогда $\binom{n}{k} = \frac{(n)_k}{k!}$. Тогда можно заменить n на $q, q \in \mathbb{C}$. Тогда

$$\binom{q}{k} = \begin{cases} \frac{(q)_k}{k!} & k > 0 \\ 1 & k = 0 \\ 0 & k < 0 \end{cases}.$$

Пусть $(n)^k = n \cdot (n+1) \cdot \ldots \cdot (n+k-1)$. Тогда $\left(\!\binom{n}{k}\!\right) = \frac{(n)^k}{k!}$

2.5. Комбинаторика в схемах и мемах

Пусть есть n различных предметов. Нужно выбрать k предметов с различными ограничениям: с повторениями/без, упорядоченные/неупорядоченные.

	с повторениями	без повторений
упорядоченные	n^k	$(n)_k$
неупорядоченные	$\left(\!\binom{n}{k}\!\right)$	$\binom{n}{k}$

Схема ящиков.

	$\forall$	$\leqslant 1$	1	$\geqslant 1$
ящики+предметы различимы	n^k	$(n)_k$	$1/n!$	$\widehat{S}(n,k)$
ящики различимы, а предметы — нет	$\left(\!\binom{n}{k}\!\right)$	$\binom{n}{k}$	$1/0$	$\left(\!\binom{n}{k-n}\!\right)$
ящики не различимы, а предметы различимы				$S(n,k)$
ящики+предметы неразличимы				

Последнюю строчку мы не сможем заполнить на первом курсе, нужны производящие функции. Эта строчка решает множество задач, например, разложение числа на слагаемые.

Отображение $f : X \to Y$ — такое правило, что $\forall x \in X\ \exists! y \in Y : y = f(x)$. Количество k^n $(|X| = n, |Y| = k)$

***Определение* 2.2.** Отображение — тройка из $(x, y, \Gamma \subseteq X \times Y)$, причем каждый x_i встречается в Γ ровно один раз.

***Определение* 2.3.** Отображение называется иньективным, если $\forall x_1, x_2 \in X\ f(x_1) \neq f(x_2) \Rightarrow x_1 = x_2$. Их количество — $(k)_n$

***Определение* 2.4.** Отображение называется биективным, если $\forall y \in Y\ \exists! x \in X : y = f(x)$. Количество — $n!$.

***Определение* 2.5.** Отображение называется сурьективным, если $\forall y \in Y\ \exists x \in X : y = f(x)$.

Посчитаем количество сурьективных отображений. Пусть $\mathrm{Im}(f) = \{y \in Y \mid \exists x \in X : y = f(x)\}$. Тогда для любого отношения $f : X \to \mathrm{Im}(f)$ — сурьективно.

Пусть $|\mathrm{Im}(f)| = i$, а количество сурьективных отображений — $\widehat{S}(n,i)$. Тогда $\widehat{S}(n,i) \cdot \binom{k}{i}$ — количество суьективных подмножеств мощности k.

Тогда $k^n = \sum_{i=0}^{k} \binom{k}{i} \widehat{S}(n,i)$

Пусть есть две числовые последовательности $f_0, f_1, \ldots, f_k, \ldots$ и $g_0, g_1, \ldots, g_k, \ldots$. Причем $g_k = \sum_{i=0}^{k} \binom{k}{i} f_i$, тогда $f_k = \sum_{i=0}^{k} (-1)^{k-1} \binom{k}{i} g_i$. Значит $\widehat{S}(n,k) = \sum_{i=0}^{k} (-1)^{k-1} \binom{k}{i} \cdot i^n$

Рассмотрим отображение $\{\{x_1, x_2\}, \{x_3\}, \varnothing\}$. Получение разбиение на блоки. Предположим, что отображение сурьективно, значит получили разбиение k предметов n ящиков.

Предположим, что в первый ящик нужно положить a_1 предмет, во второй — a_2, и так далее. Тогда количество вариантов: $\sum \binom{n}{a_1}\binom{n-a_1}{a_2} \ldots$. Если взять $\sum_{a_i \geqslant 0, a_1 + \ldots + a_k = n} \binom{n}{a_1}\binom{n-a_1}{a_2} = k^n = \frac{n!}{a_1! a_2! \ldots a_k!}$. А если $\sum_{a_i > 0, a_1 + \ldots + a_k = n} \binom{n}{a_1}\binom{n-a_1}{a_2} = \widehat{S}(n,k)$

Хотим разбить на блоки вида a_1 предметов + a_2 предметов + a_3 предметов...Тогда заметим, что это $\sum_{a_i \geqslant 0, \sum a_i = n} \binom{n}{a_1}\binom{n-a_1}{a_2} \ldots \binom{n-a_1-a_{k-1}}{a_k}$. Заметим, что суммарно это k^n, а если строго больше нуля, то $\widehat{S}(n,k)$. Также можно раскрыть скобки и получить. $\frac{n!}{a_1! a_2! \ldots a_k!}$

Рассмотрим $\binom{n}{k} = \frac{n!}{k!\cdot(n-k)!} = P(n;k;n-k)$. Комбинаторно они равны через битовые строки.

Теперь посмотрим на $\left(\!\binom{n}{k}\!\right) = \frac{(n-1+k)!}{(n-1)!\cdot k!}$, через шары и перегородки.

Вернемся к k^n — все отображения, $\widehat{S}(n,k)$ — все сюръективные отображение, $S(n,k)$ — количество разбиений n-множества на k-подмножества. (Числа Стирлинга второго рода).

Заметим, что $S(n,k)\cdot k! = \widehat{S}(n,k)$, так как в S с крышечкой это про неупорядоченные. $S(n,k) = \frac{1}{k!}\sum_{i=0}^{k}(-1)^{k-i}\binom{k}{i}i^n$. $S(0,0) = 1$. $\forall S(n,0) = 0$. $S(n,k) = S(n-1,k-1) + k\cdot S(n-1,k)$. Доказываем так: либо удаляем x_n, либо пихаем x_n куда-то.

$$k^n = \sum_{i=0}^{n}\binom{k}{i}\widehat{S}(n,i) = \sum_{i=0}^{n}\frac{k!}{i!(k-i!)}S(n,i).$$

Откуда:

$$x^n = \sum_{i=0}^{n}(x)_i\cdot S(n,i) \iff (x)_n = \sum_{i=0}^{n}x^i s(n,i)..$$

Где $s(n,i)$ — числа Стирлинга первого рода.

Решим задачу, где мы хотим разбить n различимых предметов в k различимых ящиков $B(n,k) = \sum_{i=0}^{k}S(n,i)$. Причем $B(n,n) = B_n$ — числа Белла. Количество способов разбить n-множество на блоки.

3. Вероятности

3.1. Дискретная вероятность

Вероятностное событие — событие в какой-то вероятностной математической модели. (Результат трудно предсказать)

Множество исходов $\Omega = \{\omega_1, \dots, \omega_n\}$ — состоит из элементарных исходов. В дискретной вероятности Ω конечно или счетно.

Событие A — подмножество Ω.

Рассмотрим какой-то набор событий, добавим туда $\varnothing, \Omega$. Получим алгебру. Тогда вероятность это отображение $P : \Omega \mapsto [0, 1]$, такое что $\sum_{\omega \in \Omega} P(\omega) = 1$. Тогда $P(A) = \sum_{\omega \in A} P(\omega)$.

1. $P(\varnothing) = 0, P(\Omega) = 1$
2. $P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A \cap B)$

***Определение* 3.1.** Назовем события A и B несовместными, если $A \cap B = \varnothing$.

Некоторым очень хочется дать определение вида $P_r(A) = \frac{|A|}{|\Omega|}$. Это не работает, если события не равновероятны.

Пусть есть два события на кубике: A — число > 3, B — четное число. $P_r(A) = \frac{1}{2}, P_r(B) = \frac{1}{2}$.

Теперь пусть есть инсайд: событие A произошло. Тогда $P_r(B \mid A) = \frac{2}{3}$. Тогда посмотрим на картинку и получим $P_r(B \mid A = \frac{|A \cap B|}{|A|})$. Но не забудем, про то, что мы смотрели на равновероятные события, тогда поделим на $|\Omega|$. Получим $P_r(B|A) \overset{\text{def}}{=} \frac{P_r(A \cap B)}{P_r(A)}$.

Посмотрим на крайние случаи: $P_r(A|A) = 1$, $P_r(A|\Omega) = P_r(A)$, $P_r(B|A) = 1$, если $A \subseteq B$.

Тогда пусть $B_1 \cap B_2 = \varnothing$. Тогда $P_r((B_1 \cup B_2) \cap A) = P_r((B_1 \cap A) \cup (b_2 \cap A)) = P_r(B_1 \cap A) + P_r(B_2 \cap A)$. А $P_r(B_1 \cup B_2 \mid A) = P_r(B_1 \mid A) + P_r(B_2 \mid A)$.

Посмотрим на $P_r(B|\overline{A}) = \frac{1}{3}$. Докажем, что $P_r(B \mid A) \cdot P_r(A) + P_r(B \mid \overline{A}) \cdot P_2(\overline{A}) = 1$. Докажем формулу полной вероятности.

Доказательство. Пусть Ω разбита на блоки $\{A_1, \dots, A_k\}$. Заметим, что $P_r(B) = P_r(B \cap \Omega) = P_r(B \cap (A_1 \cup \ldots \cup A_k)) = P_r((B \cap A_1) \cup (B \cap A_2) \cup \ldots \cup (B \cap A_k))$. Дальше заметим, что $\forall i, j : A_i \cap A_j = \varnothing$. Тогда получаем $P_r(B \cap A_1) + P_r(B \cap A_2) + \ldots + P_r(B \cap A_k)$. Применив формулу условной вероятности, получим формулу полной вероятности:

$$P_r(B) = P_r(B \mid A_1) \cdot P_r(A_1) + P_r(B \mid A_2) \cdot P_r(A_2) + \ldots + P_r(B|A_k) \cdot P_r(A_k).$$

□

Заметим, что $P_r(A \cap B) = P_r(B \mid A) \cdot P_r(A)$ и $P_r(B \cap A) = P_r(A \mid B) \cdot P_r(B) \Rightarrow P_r(A \mid B) = \frac{P_r(B|A) P_r(A)}{P_r(B)}$. Тогда, вспомнив формулу полной вероятности, получаем:

$$P_r(A_i \mid B) = \frac{P_r(B \mid A_i) \cdot P_r(A_i)}{\sum_{j=1}^{k} P_r(B \mid A_j) \cdot P_r(A_j)}.$$

Пусть у вас есть событие $P_r(B)$, причем $P_r(B) = P_r(B \mid A) = \frac{P_r(A \cap B)}{P_2(A)} P_r(A) \Rightarrow P_r(A \cap B) = P_r(A) \cdot P_r(B)$

***Определение* 3.2.** Два события называются независимыми, если вероятность их пересечения равна произведению вероятностей этих событий.

Схема Бернулли: есть n независимых испытаний, где есть два исхода: $p > 0$ и $q > 0$, $p+q = 1$. Все элементарных исходов можно записать в виде бинарной строки длины n. Тогда для какого-то ω $P_r(\omega) = p^k \cdot q^{n-k}, k = \sum_{i=1}^n a_i$. Заметим, что $\sum_{k=0}^n \binom{n}{k} p^k q^{n-k} = (p+q)^n = 1^n = 1$.

***Определение* 3.3.** Независимые в совокупности события — события $A_1, \ldots, A_k$, такие что $P_r(A_1 \cap A_2 \cap \ldots \cap A_k) = P_r(A_1) \cdot P_r(A_2) \cdot \ldots \cdot P_r(A_k)$,

$\Omega_1 = \{\text{успех}, \text{неудача}\}$, $P_{r_1}(\omega) = \begin{cases} p & \text{успех} \\ q & \text{неуспех} \end{cases}$, $A_1 = \{\varnothing, \text{успех}, \text{неудача}, \Omega\}$. Тогда $\Omega = \Omega_1 \times \ldots \Omega_n$, $A = A_1 \times \ldots \times A_n$.

Тогда рассмотрим (Ω_1, A_1, P_{r_1}), (Ω_2, A_2, P_{r_2}). Тогда $\Omega = \Omega_1 \times \Omega_2$, $A = A_1 \times A_2$. Тогда события $A_1 \times \Omega_2$, $\Omega_1 \times A_2$.

3.2. Случайная величина

***Определение* 3.4.** Случайная величина ξ — отображение $\xi : \Omega \to \mathbb{R}$.

Иногда описание при помощи $\Omega, \mathbb{A}, \Pr$ даёт слишком точное, громоздкое описание. А мы хотим только суть: например сумму значений после броска двух кубиков.

Рассмотрим некую Ω: $|\Omega| = m, |X| = n$, где $X = \{x_i \mid x_i = \xi(\omega)\}$. Рассмотрим событие $A_k = \{\omega \in \Omega \mid \xi(\omega) = x_k\}$. Тогда $\Pr(A_k) = \sum_{\omega \in \Omega; \xi(\omega) = x_k} \Pr(\omega)$.

***Определение* 3.5.** $\{\Pr(A_1), \ldots, \Pr(A_n)\}$ — распределение вероятности случайной величины ξ. Причем $\sum_{k=1}^n \Pr(A_k) = 1$.

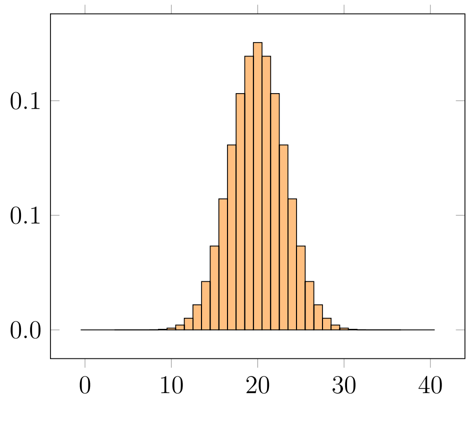
А теперь пусть B — множество всех подмножеств X, тогда можно перейти к пространству $(X, B, \Pr)$. Так мы получили более простой эксперимент.

3.3. Биномиальное распределение

Вспомним, что такое схема Бернулли: пусть есть монетка, которую кидаем n раз, орел выпадает с вероятностью p, решка с вероятностью q. Тогда $\omega = (0, 1, 1, 0, \ldots, 0)$, в общем случае $\omega = (a_1, a_2, \ldots, a_n), a_n \in \{0, 1\}$. $k := \sum_{i=1}^n a_i$ — количество успехов в n испытаниях.

Нам кажется, что такое описание ω довольно сложно, нам хочется просто знать что-то про k. Тогда введем ξ: $\xi(\omega) = k$. Тогда $X = \{0, 1, 2, \ldots, n\}$, а $\Pr(\xi(\omega) = w) = \binom{n}{k} p^k q^{n-k}$.

Тогда заметим, что $\sum_{k=0}^n \binom{n}{k} p^k q^{n-k} = (p+q)^n = 1^n = 1$. Значит, у нас нормальная вероятность. Построим тогда график.



3.4. Геометрическое распределение

Нам интересен первый момент, когда у нас произошел фейл. Тогда пусть $\xi(\omega) = k$ — первый момент фейла. $\Pr(\xi(\omega) = k) = q^{k-1} \cdot p$. Тогда проверим нормировку: $\sum_{k=1}^{\infty} = p \cdot q^{k-1} = p \sum_{k=1}^{\infty} q^{k-1} = \frac{p}{1-q} = \frac{p}{p} = 1$.

3.5. Гипергеометрическое распределение

У нас есть три переменных n, m, k. Число предметов первого и второго сорта. $\xi(\omega)$ — кол-во предметов 1-го сорта в выборке из k человек. $\Pr(\xi(\omega) = i) = \frac{\binom{n}{i}\binom{m}{k-i}}{\binom{n+m}{k}}$

У нас могут начаться проблемы из-за того, что у нас может быть задано несколько величин. Пусть η — произведение при броске двух кубиков.

y	1	2	3	4	5	6	8	9	10	12	15	16
$\Pr(B)$	$\frac{1}{36}$	$\frac{2}{36}$										

***Определение* 3.6.** Если $\forall\omega : \Pr(\xi(\omega) = x \wedge \eta(\omega) = y) = \Pr(\xi(\omega) = x_k) \cdot \Pr(\eta(\omega) = k)$, то случайные величины независимы.

Посмотрим на $\xi(\omega) = x_i, \eta(\omega) = y_i$. Тогда пусть $\chi(\omega) = \eta(\omega) + \xi(\omega)$. Тогда $\Pr(\chi(\omega) = z) = \Pr(\chi(\omega) = x_i + y_i) = \sum_{k,j: x_k + y_j = z} \Pr(\xi(\omega) = x_k \wedge \eta(\omega) = y_k)$. Если величины независимы, то получим под суммой $\Pr(\xi(\omega)) \cdot \Pr(\eta(\omega))$

3.6. Численные характеристики

$\xi(\omega) \in X = \{x_1, \ldots, x_n\}$. $\{p_1, p_n\}$ — распределение вероятности: $p_i = \Pr(\xi(\omega) = x_i)$. Посмотрим на среднее: $\frac{x_1 \cdot (p_1 N) + x_2 \cdot (p_2 N) + \ldots + x_n \cdot (p_n N)}{N} = \sum_{i=1}^{n} p_i \cdot x_i =: E(\xi)$.

***Определение* 3.7.** $E(\xi)$ — мат. ожидание величины ξ.

***Определение* 3.8.** Медианой называется число m, такое что $\Pr(\xi(\omega) \geqslant m) \geqslant \frac{1}{2}$ и $\Pr(\xi(\omega) \leqslant m) \geqslant \frac{1}{2}$

Пример. Пусть в университете работает 100 человек, у 96 зарплата 20 тысяч рублей, у 4 — 2 миллиона. Тогда $E = 99200$ рублей. А медиана равна 20 тысячам. Поэтому медиану лучше использовать в неравномерных распределениях.

Помним, что $E(\xi) = \sum_{k=1}^{n} x_k \cdot p_k = \sum_{\omega \in \Omega} \xi(\omega) \cdot \Pr(\omega)$. Так как $p_k = \Pr(\xi(\omega) = x_k) = \sum_{\omega : \xi(\omega) = x_k} \Pr(\omega)$.

Утверждение 3.1. $E(c_1\xi_1 + c_2\xi_2) = c_1 E(\xi_1) + c_2 E(\xi_2)$.

Доказательство. $E(\xi_1 + \xi_2) = \sum_{\omega \in \Omega} (\xi_1 + \xi_2) \Pr(\omega) = \sum_{\omega} \xi_1 \Pr(\omega) + \sum_{\omega} \xi_2 \Pr(\omega) = E(\xi_1) + E(\xi_2)$ □

***Определение* 3.9.** Дисперсия $Var(\xi) = E(\xi - E(\xi))^2$

Посчитаем это: $= E(\xi^2 - 2E(\xi)\xi + E^2(\xi)) = E(\xi^2) - 2E(\xi)E(\xi) + E^2(\xi) = E(\xi^2) - E^2(\xi)$.

Заметим, что дисперсия не линейна: $Var(\xi_1 + \xi_2) = E((\xi_1 + \xi_2)^2) - E^2(\xi_1 + \xi_2) = \ldots = E(\xi_1^2) + 2E(\xi_1 \cdot \xi_2) + E(\xi^2) - E^2(\xi_1) - 2E(\xi_1)E(\xi_2) - E^2(\xi_2) = Var(\xi_1) + Var(\xi_2) + 2cor(\xi_1; \xi_2)$, где $cor(\xi_1, \xi_2) = E(\xi_1\xi_2) - E(\xi_1) \cdot E(\xi_2)$

Теорема 3.2 (Теорема Чебышева)**.** $E((\xi - \mu)^2 \geqslant \alpha) \leqslant \frac{Var(\xi)}{\alpha}$ $\forall\alpha > 0$, где $\mu \coloneqq E(\xi)$.

Следствие. $\sigma \coloneqq \sqrt{Var(\xi)}; Var(\xi) = \sigma^2 \Rightarrow \alpha = c^2\sigma^2$. Тогда $E(|\xi - \mu| \geqslant c\sigma) \leqslant \frac{1}{c^2}$.