

①

Вероятностные пр-ва

- дискретный случай:
- $|\Omega| < \infty$
 - Ω счётно
- 1) $\Omega = \{\omega_1, \dots, \omega_n, \dots\}$
- 2) $\mathcal{F} = \mathcal{P}(\Omega)$
- 3) $P(\omega_n) = p_n$
- $\sum_{i=1}^{n/\infty} p_n = 1, \forall p_i \geq 0$
- $A \in \mathcal{F}$
- $P(A) = \sum_{\{n: \omega_n \in A\}} p_n$

- непрерывный случай:

- $\Omega = \mathbb{R}^n$

- $p(x_1, \dots, x_n)$ — непрерывная суммируемая по Риману ф-ция на Ω

$$\int_{\mathbb{R}^n} \dots \int p(x_1, \dots, x_n) dx_1 \dots dx_n = 1$$

$$P(A) = \int_A \dots \int p(x_1, \dots, x_n) dx_1 \dots dx_n$$