Zdarzenie elementarne

Każdy możliwy wynik eksperymentu losowego nazywamy **zdarzeniem elementarnym** ω, a zbiór wszystkich możliwych wyników eksperymentu (wszystkich zdarzeń elementarnych) nazywamy **zbiorem zdarzeń elementarnych** i oznaczamy $\Omega, (\omega \in \Omega)$.

Aksjomaty prawdopodobieństwa

Dla danego zbioru zdarzeń elementarnych Ω oraz σ-ciała zdarzeń losowych $\mathcal{F}$, **prawdopodobieństwem** nazywamy funkcję $P : \mathcal{F} \to \mathcal{R}$ spełniającą:

1. Dla dowolnego zdarzenia losowego $A \in \mathcal{F}$, $P(A) \geqslant 0$.
2. $P(\Omega) = 1$.
3. Dla dowolnego nieskończonego ciągu zdarzeń losowych $A_1, A_2, \ldots, \forall_{n \in \mathcal{N}} A_n \in \mathcal{F}$, parami rozłącznych, mamy $P\left(\bigcup_{n=1}^{\infty}\right) = \sum_{n=1}^{\infty} P(A_n)$.

Dla dowolnych zdarzeń A, B mamy $P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A \cap B)$.

Prawdopodobieństwo warunkowe

Prawdopodobieństwo A pod warunkiem że zaszło zdarzenie B: $P(A|B) = \frac{P(A \cup B)}{P(B)}$.

Jeżeli $P(A_1 \cap \ldots \cap A_n) > 0$, to $P(A_1 \cap \ldots \cap A_n) = P(A_1) \prod_{i=2}^{n} P(A_i | A_1 \cap \ldots \cap A_{i-1})$.

Prawdopodobieństwo zupełne

Ciąg zdarzeń nazywamy zupełnym, jeśli:

1. $\bigcup_i A_i = \Omega$,
2. $\forall_{i \neq j} A_i \cap A_j = \emptyset$,
3. $\forall_i P(A_i) > 0$.

Twierdzenie

Jeśli zdarzenia tworzą układ zupełny, to dla dowolnego zdarzenia B mamy $P(B) = \sum_i P(B|A_i) P(A_i)$

Reguła Bayesa

Twierdzenie Niech A_i tworzą układ zupełny. Wtedy dla dowolnego zdarzenia losowego $B, P(B) > 0$ i dowolnego j zachodzi $P(A_j|B) = \frac{P(B|A_j)P(A_j)}{\sum_i P(B|A_i)P(A_i)}$

Niezależność zdarzeń

Definicja Zdarzenia są wzajemnie niezależne gdy $P(A \cap B) = P(A) \cdot P(B)$

Jeżeli zdarzenia A i B są niezależne, to niezależne są również zdarzenia A i $\overline{B}$, $\overline{A}$ i B, $\overline{A}$ i $\overline{B}$.

Zdarzenia są wzajemnie niezależne jeśli $P\left(\bigcap_{j=1}^{k} A_{i_j}\right) = \prod_{j=1}^{k} P(A_{i_j})$.

Jeśli $A_1 \ldots$ są zdarzeniami wzajemnie niezależnymi, to $(\bigcup_{i=1}^{n} A_i) = 1 - \prod_{i=1}^{n}(1 - P(A_i))$

Łączenie prawdopodobieństw

szeregowe: $P(A_s) = \prod_{i=1}^{n} p_i$

równoległe: $P(A_r) = 1 - \prod_{i=1}^{n}(1 - p_i)$

Dystrybuanta

$F(x) = P(X \leqslant x) = P(\{\omega \in \Omega : X(\omega) \leqslant x\})$

Własności:

$\lim_{x \to -\infty} F(x) = 0$, $\lim_{x \to \infty} F(x) = 1$

niemalejąca, prawostronnie ciągła

$P(a < X \leqslant b) = F(b) - F(a)$

Zmienne losowe dyskretne

$p(a) = P(X = a)$ - funkcja prawdopodobieństwa, własności:

$p(x) \geqslant 0$, $\sum_{x \in X} p(x) = 1$

Dystrybuanta dyskretna zmiennej X o nośniku χ: $F(x) = \sum_{\{x_i \in \chi : x_i \leqslant x\}} p(x_i)$.

Przykład:

$$F(x) = \begin{cases} 0, x < 1 \\ 0.4, 1 \leqslant x < 2 \\ 0.9, 2 \leqslant x \end{cases}$$

Zmienne losowe ciągłe

$P(X \in B) = \int_B f(x)\,\mathrm{d}x$

$F(x) = \int_{-\infty}^{x} f(t)\,\mathrm{d}t$

$f(x) = F'(x)$

$P(a \leqslant X \leqslant b) = F(b) - F(a)$

$P(X = a) = 0$ dla dowolnego $a \in R$

Własności funkcji gęstości:

$\forall_{x \in R} f(x) \geqslant 0$, $\int_{-\infty}^{+\infty} f(x)\,\mathrm{d}x = 1$

Funkcje zmiennych losowych

Dyskretne:

$P(Y = y_i) = \sum_{\{x_j \in \chi : g(x_j) = y_i\}} P(X = x_j)$

Ciągłe: gęstość liniowej funkcji zm.los.

$\forall_{a \neq 0} b \in R f_{aX+b}(y) = \frac{1}{|a|} f_X\left(\frac{y-b}{a}\right)$

gęstość kwadratu zm.los.

$$f_{X^2}(y) = \begin{cases} 0, x \leqslant 0 \\ \frac{1}{2\sqrt{y}}\left[f_X(\sqrt{y}) + f_X(-\sqrt{y})\right], x > 0 \end{cases}$$

Jeśli g jest ściśle monotoniczna i różniczkowalna, to $Y = g(X)$: $f_Y(y) = f_X(g^{-1}(y)) \cdot \frac{1}{|g'(g^{-1}(y))|}$

Doświadczenie Bernoulliego

Doświadczenie kończące się sukcesem z prawdopodobieństwem p lub porażką z prawdopodobieństwem 1-p.

Ciąg n doświadczeń z prawd. sukcesu p oznaczamy $b(n, p)$.

Prawdopodobieństwo uzyskania ciągu składającego się z k sukcesów, przy założeniu niezależności: $p^k(1-p)^{n-k}$.

Prawdopodobieństwo uzyskania k sukcesów w n niezależnych doświadczeniach z $p \in [0, 1]$: $b(k; n, p) = \binom{n}{k} p^k (1-p)^{n-k}$.

Poisson (fr. Ryba)

Dla $n \geqslant 25$ i $\lambda = n \cdot p \leqslant 10$ możemy przybliżyć rozkładem Poißona: $b(k; n, p) \approx e^{-np} \frac{(np)^k}{k!}$, na przykład:

$\sum_{k=0}^{14} b(k; 500, 0.02) \approx F(14; 500 \cdot 0.02)$, gdzie F jest dystrybuantą rozkładu Ryby, dostępna w tablicach.