

## 哈爾濱工業大學

## 二维随机变量函数的分布













对二维随机变量函数Z=g(X,Y),已知二维随机变量(X,Y)的分布,如何求Z=g(X,Y)的分布?

### 离散型随机变量函数的分布



设二维离散型随机变量(X,Y)的分布列为

$$P(X=x_i,Y=y_j)=p_{ij}, i,j=1,2,\cdots$$

则Z=g(X,Y)是一维离散型随机变量,用

$$z_k=g(x_i,y_j)(k=1,2,\cdots)$$
表示 $Z$ 的取值,则 $Z$ 的分布列

$$P(Z = z_k) = P\{g(X,Y) = z_k\} = \sum_{g(X,Y)=z_k} P(X = x_i, Y = y_j),$$

$$k = 1, 2, \dots$$



例1 设
$$X$$
与 $Y$ 的联合分布列为

2 0.3 0.4

$$Z=X+Y,W=XY$$
,求 $Z,W$ 的分布列.

解 Z的所有取值为-3,0,3

$$P(Z = -3) = P(X + Y = -3) = P(X = -2, Y = -1) = 0.2,$$

$$P(Z=0) = P(X+Y=0) = P(X=1,Y=-1)$$

$$=P(X=-2,Y=2)=0.5,$$

$$P(Z=3) = P(X+Y=3) = P(X=1,Y=2) = 0.3,$$



#### 例2 设X与Y的联合分布列为 $U=\max(X, Y), V=\min(X, Y),$ 求U与V的联合分布列.

**解** U的所有取值为-1,1,2,

$$V$$
的所有取值为  $^{-1}$ ,

 $-1 \mid 0.1 \mid 0.2$ 

0.3 0.4

$$P(U=2,V=-2)=P(X=-2,Y=2)=0.4, P(U=2,V=-1)=0,$$

$$P(U=2,V=1)=P(X=1,Y=2)=0.3.$$

P(U=1,V=-1)=P(X=1,Y=-1)=0.1.



#### 例3 设随机变量 $Z \sim U[-2,2]$ ,随机变量

$$X = \begin{cases} -1, \ Z \le -1, \\ 1, \ Z > -1, \end{cases} Y = \begin{cases} -1, \ Z \le 1, \\ 1, \ Z > 1. \end{cases}$$

求(X,Y)的分布列.

求
$$(X,Y)$$
的分布列。

解  $Z \sim U[-2,2]$ 
 $f_Z(z) = \begin{cases} 1/4, & -2 \le z \le 2, \\ 0, &$  其他。

$$P(X=Y=-1) = P(Z \le -1, Z \le 1) = P(Z \le -1) = \int_{-2}^{-1} 1/4 dz = 1/4, \\ P(X=-1,Y=1) = P(Z \le -1, Z > 1) = 0, \\ P(X=1,Y=-1) = P(-1 < Z \le 1) = P(Z \le -1) = \int_{-1}^{1} 1/4 dz = 1/2, \\ P(X=Y=1) = P(Z > -1, Z > 1) = P(Z > 1) = \int_{1}^{2} 1/4 dz = 1/4.$$



例4 若X和Y相互独立,它们分别服从参数为  $\lambda_1$ , $\lambda_2$  的泊松分布,证明Z=X+Y服从参数为  $\lambda_1+\lambda_2$  的泊松分布.

证明 由 $X \sim P(\lambda_1)$ ,  $Y \sim P(\lambda_2)$ 得

$$P(X=i) = \frac{\lambda_1^i}{i!}e^{-\lambda_1}, \quad i=0,1,2,\cdots$$

$$P(X=j) = \frac{\lambda_1^{j}}{j!}e^{-\lambda_1}, \quad j=0,1,2,\dots$$



例4 若X和Y相互独立,它们分别服从参数为  $\lambda_1$ , $\lambda_2$  的泊松分布,证明Z=X+Y服从参数为  $\lambda_1+\lambda_2$  的泊松分布.

松分布.
证明 
$$P(Z = k) = P(X + Y = k) = \sum_{i=0}^{k} P(X = i, Y = k - i)$$

$$= \sum_{i=0}^{k} P(X = i) P(Y = k - i) = \sum_{i=0}^{k} \frac{\lambda_{1}^{i}}{i!} e^{-\lambda_{1}} \cdot \frac{\lambda_{2}^{(k-i)}}{(k-i)!} e^{-\lambda_{2}}$$

$$= \sum_{i=0}^{k} \frac{\lambda_{1}^{i} \lambda_{2}^{(k-i)}}{i!(k-i)!} e^{-(\lambda_{1} + \lambda_{2})} = \frac{e^{-(\lambda_{1} + \lambda_{2})}}{k!} \sum_{i=0}^{k} \frac{k!}{i!(k-i)!} \lambda_{1}^{i} \lambda_{2}^{(k-i)}$$

$$= \frac{e^{-(\lambda_{1} + \lambda_{2})}}{k!} \sum_{i=0}^{k} C_{k}^{i} \lambda_{1}^{i} \lambda_{2}^{(k-i)} = \frac{(\lambda_{1} + \lambda_{2})^{k}}{k!} e^{-(\lambda_{1} + \lambda_{2})} (k = 0, 1, \cdots)$$



#### ♣ 结论

$$1. X_1, X_2, \cdots X_n 独立且X_i \sim P(\lambda_i)(i = 1, 2, \cdots, n)则$$
$$X_1 + X_2 + \cdots + X_n \sim P(\lambda_1 + \lambda_2 + \cdots + \lambda_n).$$

$$2. X_1, X_2, \cdots X_n$$
独立且均服 $B(1, p)$ ,则  $X_1 + X_2 + \cdots + X_n \sim B(n, p)$ .

3. 
$$X_1, X_2, \dots X_k$$
独立且 $X_i \sim B(n_i, p)(i = 1, 2, \dots, k)$ 则  $X_1 + X_2 + \dots + X_k \sim B(n_1 + n_2 + \dots + n_k, p)$ .

#### 连续型随机变量函数的分布



 $\psi$  设(X, Y)是二维连续型随机变量,其概率密度为f(x,y), Z=g(X,Y),求Z的概率密度 $f_Z(z)$ 或分布函数 $F_Z(z)$ ?

#### 分布函数法

$$F_{Z}(z) = P(Z \le z) = P\{g(X,Y) \le z\}$$

$$= \iint_{g(x,y) \le z} f(x,y) dxdy$$

$$f_Z(z) = F_Z'(z).$$

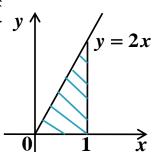


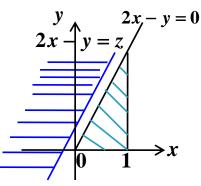
#### 例5 二维随机变量(X,Y)的概率密度 $_{v,\uparrow}$

$$f(x,y) = \begin{cases} 1, & 0 < x < 1, 0 < y < 2x, \\ 0, & 其他. \end{cases}$$

求
$$Z = 2X - Y$$
的概率密度 $f_Z(z)$ .

当 $z \le 0$ 时,画 $2x - y \le z$  的区域图,与f(x,y)的非零区域无交集,f(x,y)=0,从而 $F_z(z)=0$ .







#### 例5 二维随机变量(X,Y)的概率密度

$$f(x,y) = \begin{cases} 1, & 0 < x < 1, 0 < y < 2x, \\ 0, & \text{ 其他.} \end{cases}$$

求Z = 2X - Y的概率密度 $f_z(z)$ .

解 当0 < z < 2时,画 $2x - y \le z$  的区域图,

$$F_{Z}(z) = P(Z \le z) = P(2X - Y \le z).$$

$$= \iint_{2x-y \le z} f(x,y) dx dy = 1 - \iint_{2x-y>z} f(x,y) dx dy \sqrt[6]{\frac{|z|}{2}}$$

$$= 1 - \int_{z/2}^{1} dx \int_{0}^{2x-z} 1 dy = 1 - (1-z/2)^{2} = z - z^{2}/4.$$

当
$$z \ge 2$$
时, $F_z(z) = 1$ .



#### 例5 二维随机变量(X,Y)的概率密度

$$f(x,y) = \begin{cases} 1, & 0 < x < 1, 0 < y < 2x, \\ 0, & 其他. \end{cases}$$

求
$$Z = 2X - Y$$
的概率密度 $f_Z(z)$ .

$$\mathbf{F}_{z}(z) = \begin{cases}
0, & z \leq 0, \\
z - z^{2} / 4, & 0 < z < 2, \\
1, & z \geq 2.
\end{cases}$$

$$f_Z(z) = F_Z'(z) = \begin{cases} 1 - z/2, & 0 < z < 2, \\ 0, & 其他. \end{cases}$$

### 连续型随机变量Z=X+Y的分布

 $\triangleright$  设X和Y的联合密度为 f(x,y),则Z=X+Y的分布函数为

分布函数为
$$F_{Z}(z) = P(Z \le z) = P(X + Y \le Z) = \iint_{x+y \le z} f(x,y) dx dy$$
固定 $z,x,$ 

$$\Rightarrow \int_{-\infty}^{+\infty} \left( \int_{-\infty}^{z-x} f(x,y) dy \right) dx$$

$$= \int_{-\infty}^{+\infty} \left( \int_{-\infty}^{z} f(x,u-x) du \right) dx$$

$$= \int_{-\infty}^{z} \left( \int_{-\infty}^{+\infty} f(x,u-x) dx \right) du$$

$$= \int_{-\infty}^{z} f_{Z}(u) du.$$



故Z=X+Y的概率密度为

$$f_Z(z) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x,z-x) dx.$$

由X和Y的对称性,  $f_Z(z)$ 又可写成

$$f_Z(z) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x,z-x)dx$$
.

 $f_{Z}(z) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x,z-x)dx$ . 卷积公式 当X与Y独立时,称Z=X+Y的概率

密度公式为卷积公式,即

$$f_{Z}(z) = \int_{-\infty}^{+\infty} f_{X}(x) f_{Y}(z - x) dx,$$

$$f_{Z}(z) = \int_{-\infty}^{+\infty} f_{X}(z - y) f_{Y}(y) dy.$$



例6 设 $X \sim N(0,1), Y \sim N(0,1), \mathbb{L}X$ 和Y独立, 则 $Z = X + Y \sim N(0,2)$ .

证明 由卷积公式有  $f_z(z) = \int_{-\infty}^{+\infty} f_x(x) f_y(z-x) dx$  $= \int_{-\infty}^{+\infty} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{x^2}{2}} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{(z-x)^2}{2}} dx = \frac{1}{2\pi} e^{-\frac{z^2}{4}} \int_{-\infty}^{+\infty} e^{-(x-\frac{z}{2})^2} dx$  $x - \frac{z}{2} = \frac{t}{\sqrt{2}}$   $= \frac{1}{2\pi} e^{-\frac{z^2}{4}} \int_{-\infty}^{+\infty} e^{-\frac{t^2}{2}} \frac{1}{\sqrt{2}} dt = \frac{1}{2\pi} \sqrt{\pi} e^{-\frac{z^2}{4}} \int_{-\infty}^{+\infty} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{t^2}{2}} dt$   $= \frac{1}{2\pi} e^{-\frac{z^2}{4}} \int_{-\infty}^{+\infty} e^{-\frac{t^2}{2}} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} dt = \frac{1}{2\pi} \sqrt{\pi} e^{-\frac{z^2}{4}} \int_{-\infty}^{+\infty} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{t^2}{2}} dt$  $= \frac{1}{2\sqrt{\pi}}e^{-\frac{z^2}{4}} = \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sqrt{2}}e^{-\frac{(z-0)^2}{2(\sqrt{2})^2}}.$   $\mathbb{R}^2 Z = X + Y \sim N(0,2).$ 

$$= \frac{1}{2\sqrt{\pi}} e^{-4} = \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sqrt{2}} e^{-\frac{2(\sqrt{2})^2}{2}}.$$

$$\mathbb{P} Z = X + Y \sim N(0,2)$$



- # 推广 设 $X \sim N(\mu_1, \sigma_1^2), Y \sim N(\mu_2, \sigma_2^2), 且X和Y独立,$  则 $Z = X + Y \sim N(\mu_1 + \mu_2, \sigma_1^2 + \sigma_2^2).$
- → 一般结论 *n*个独立正态变量的线性组合 仍为正态分布,即

设
$$X_i \sim N(\mu_i, \sigma_i^2)$$
  $(i = 1, 2, \dots, n)$ ,且他们独立,则其线性组合  $a_1X_1 + a_2X_2 + \dots + a_nX_n + a_0 \sim N(\mu, \sigma^2)$ .  
其中  $\mu = a_1\mu_1 + a_2\mu_2 + \dots + a_n\mu_n + a_0$ ,  $\sigma^2 = a_1^2\sigma_1^2 + a_2^2\sigma_2^2 + \dots + a_n^2\sigma_n^2$ .

 $a_1, a_2, \cdots, a_n$ 是不全为零的常数.



#### 例7 设X与Y独立, X, Y的概率密度分别为

$$f_X(x) = \begin{cases} 2x, & 0 \le x \le 1, \\ 0, & 其他. \end{cases}$$
  $f_Y(y) = \begin{cases} 1, & 0 \le y \le 1, \\ 0, & 其他. \end{cases}$ 

求Z = X + Y的概率密度 $f_Z(z)$ .

解1 由卷积公式  $f_Z(z) = \int_{-\infty}^{+\infty} f_X(x) f_Y(z-x) dx$ 

$$f_{X}(x)f_{Y}(z-x) = \begin{cases} 2x, & 0 \le x \le 1, 0 \le z - x \le 1, \\ 0, & \text{其他.} \end{cases}$$

$$f_{Z}(z) = \begin{cases} \int_{0}^{z} 2x dx = z^{2}, & 0 \le z < 1, \\ \int_{z-1}^{1} 2x dx = 2z - z^{2}, & 1 \le z < 2, \\ 0, & \text{其他.} \end{cases}$$



#### 例7 设X与Y独立, X, Y的概率密度分别为

$$f_X(x) = \begin{cases} 2x, & 0 \le x \le 1, \\ 0, & 其他. \end{cases}$$
  $f_Y(y) = \begin{cases} 1, & 0 \le y \le 1, \\ 0, & 其他. \end{cases}$ 

求Z = X + Y的概率密度 $f_Z(z)$ .

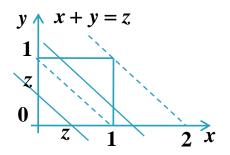
#### 解2分布函数法

$$F_{Z}(z) = P(Z \le z) = P(X + Y \le z)$$

$$= \iint_{x+y \le z} f(x,y) dx dy$$

$$= \iint_{x+y \le z} f_{X}(x) f_{Y}(y) dx dy$$

$$f_{X}(x)f_{Y}(y) = \begin{cases} 2x, & 0 \le x \le 1, 0 \le y \le 1, \\ 0, & 其他. \end{cases}$$



#### 解2分布函数法

$$f_X(x)f_Y(y) = \begin{cases} 2x, & 0 \le x \le 1, 0 \le y \le 1, \\ 0, & 其他. \end{cases}$$

$$F_Z(z) = \iint f_X(x) f_Y(y) dx dy$$

$$y + y = z$$

$$0$$

$$z$$

$$1$$

$$2$$

$$x$$

当
$$z < 0$$
时, $F_z(z) = 0$ ;

当
$$0 \le z < 1$$
时, $F_z(z) = \int_0^z 2x dx \int_0^{z-x} dy = \frac{z^3}{3}$ ,

当
$$1 \le z < 2$$
时, $F_z(z) = 1 - \int_{z-1}^1 dy \int_{z-y}^1 2x dx = z^2 - \frac{z^3}{3} - \frac{1}{3}$ ,

当
$$z \ge 2$$
时, $F_z(z) = 1$ .



$$F_{Z}(z) = \begin{cases} 0, & z < 0, \\ \frac{z^{3}}{3}, & 0 \le z < 1, \\ z^{2} - \frac{z^{3}}{3} - \frac{1}{3}, & 1 \le z < 2, \\ 1, & z \ge 2. \end{cases}$$

$$f_{Z}(z) = F_{Z}'(z) = \begin{cases} z^{2}, & 0 \le z < 1, \\ 2z - z^{2}, & 1 \le z < 2, \\ 0, & 其他. \end{cases}$$

$$f_{z}(z) = F'_{z}(z) =$$
 
$$\begin{cases} z^{2}, & 0 \leq z < 1, \\ 2z - z^{2}, & 1 \leq z < 2, \\ 0, & 其他. \end{cases}$$



例8 设P(X=1)=0.3,P(X=2)=0.7,Y的概率密度为

 $f_Y(y)$ , X与Y独立,求Z=X+Y的概率密度.

#### 瑞利分布



例9 设X与Y独立,且服从同一正态分布 $N(0,\sigma^2)$ ,求  $Z = \sqrt{X^2 + Y^2}$ 的分布.

解 
$$F_{Z}(z) = P(Z \le z) = P(\sqrt{X^{2} + Y^{2}} \le z)$$
当 $z \le 0$ 时,  $F_{Z}(z) = 0$ ,
当 $z > 0$ 时,  $F_{Z}(z) = \iint_{\sqrt{x^{2} + y^{2}} \le z} f(x, y) dx dy$ 

$$= \iint_{\sqrt{x^{2} + y^{2}} \le z} f_{X}(x) f_{Y}(y) dx dy = \iint_{\sqrt{x^{2} + y^{2}} \le z} \frac{1}{2\pi\sigma^{2}} \exp(-\frac{x^{2} + y^{2}}{2\sigma^{2}}) dx dy$$

$$\frac{\sum_{x=r\cos\theta}^{x=r\cos\theta} \frac{1}{2\pi\sigma^{2}} \int_{0}^{2\pi} d\theta \int_{0}^{z} \exp(-\frac{r^{2}}{2\sigma^{2}}) r dr = 1 - \exp(-\frac{z^{2}}{2\sigma^{2}}).$$



$$F_{Z}(z) = \begin{cases} 1 - e^{-\frac{z^{2}}{2\sigma^{2}}}, & z > 0, \\ 0, & z \leq 0. \end{cases}$$

$$f_{Z}(z) = \begin{cases} \frac{z}{\sigma^{2}} e^{-\frac{z^{2}}{2\sigma^{2}}}, & z > 0, \\ 0, & z \leq 0. \end{cases}$$

• 此分布称为瑞利分布.

Max(X,Y)及min(X,Y)的分布

+ 设X,Y是两个相互独立的随机变量,它们的 分布函数分别为 $F_{Y}(x)$ 和 $F_{Y}(y)$ ,求 $M=\max(X,Y)$ 及 $N=\min(X,Y)$ 的分布函数 $F_M(z)$ 和 $F_N(z)$ .

#### $M=\max(X,Y)$ 分布函数为

$$F_{M}(z) = P(M \le z) = P(\max(X,Y) \le z)$$

$$= P(X \le z, Y \le z) = P(X \le z)P(Y \le z),$$

$$F_{M}(z) = F_{X}(z)F_{Y}(z).$$



#### + N = min(X,Y)的分布函数为

$$F_{N}(z) = P(N \le z) = P(\min(X,Y) \le z)$$

$$= 1 - P(\min(X,Y) > z)$$

$$= 1 - P(X > z, Y > z)$$

$$\stackrel{\text{dis}}{=} 1 - P(X > z)P(Y > z),$$

$$F_N(z) = 1 - [1 - F_X(z)][1 - F_Y(z)].$$

#### n个独立随机变量的最值分布

 $M=\max(X_1,...,X_n)$ 和 $N=\min(X_1,...,X_n)$ 的分布函数为

$$F_{\text{max}}(z) = F_{X_1}(z)F_{X_2}(z)\cdots F_{X_n}(z),$$
  

$$F_{\text{min}}(z) = 1 - [1 - F_{X_1}(z)][1 - F_{X_2}(z)]\cdots [1 - F_{X_n}(z)].$$

若 $X_1, \ldots, X_n$ 独立同分布于相同的分布函数F(z),则

$$F_{\max}(z) = [F(z)]^n,$$
  $f_{\max}(z) = n[F(z)]^{n-1} f(z),$   $F_{\min}(z) = 1 - [1 - F(z)]^n.$   $f_{\min}(z) = n[1 - F(z)]^{n-1} f(z).$ 

 $X_i$ 是连续随机变量且有相同概率密度f(z)



例10 设电子仪器由两个相互独立的电子装置 $L_1,L_2$ 组成,组成方式有两种(1)  $L_1$ 与 $L_2$ 串联; (2) )  $L_1$ 与 $L_2$ 并联.已知)  $L_1$ 与 $L_2$ 的寿命分别为X与Y,其分布函数分别为

$$F_X(x) = \begin{cases} 1 - e^{-\alpha x}, & x > 0, \\ 0, & x \le 0. \end{cases} F_Y(y) = \begin{cases} 1 - e^{-\beta y}, & y > 0, \\ 0, & y \le 0. \end{cases}$$

其中  $\alpha > 0, \beta > 0$ . 在两种联结方式下,分别求仪器寿命Z的概率密度.



# $\mathbf{P}(1)$ $L_1$ 与 $L_2$ 串联; $L_1$ $L_2$ $L_3$ $L_4$ $L_5$ $L_4$ $L_5$ $L_5$ $L_6$ $L_7$ $L_8$ $L_8$ $L_8$ $L_8$ $L_8$ $L_9$ $L_$

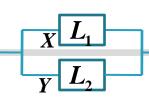
当 $L_1$ 与 $L_2$ 有一个损坏时,仪器就停止工作,所以仪器寿命为  $Z=\min(X,Y)$ .已知X,Y的分布函数

$$F_X(x) = \begin{cases} 1 - e^{-\alpha x}, & x > 0, \\ 0, & x \le 0. \end{cases} \quad F_Y(y) = \begin{cases} 1 - e^{-\beta y}, & y > 0, \\ 0, & y \le 0. \end{cases}$$

则Z的分布函数为

$$F_{Z}(z) = 1 - [1 - F_{X}(z)][1 - F_{Y}(z)] = \begin{cases} 1 - e^{-(\alpha + \beta)z}, z > 0, \\ 0, & z \le 0. \end{cases}$$

$$f_{Z}(z) = \begin{cases} (\alpha + \beta)e^{-(\alpha + \beta)z}, z > 0, \\ 0, & z \le 0. \end{cases}$$



#### $(2) L_1 与 L_2$ 并联.

当 $L_1$ 与 $L_2$ 都损坏时,仪器才停止工作,所以 仪器寿命为  $Z=\max(X,Y)$ .已知X,Y的分布函数

$$F_X(x) = \begin{cases} 1 - e^{-\alpha x}, & x > 0, \\ 0, & x \le 0. \end{cases} F_Y(y) = \begin{cases} 1 - e^{-\beta y}, & y > 0, \\ 0, & y \le 0. \end{cases}$$

则Z的分布函数为

$$F_{Z}(z) = F_{X}(z)F_{Y}(z) = \begin{cases} (1 - e^{-\alpha z})(1 - e^{-\beta z}), z > 0, \\ 0, & z \le 0. \end{cases}$$

$$f_{Z}(z) = \begin{cases} \alpha e^{-\alpha z} + \beta e^{-\beta z} - (\alpha + \beta)e^{-(\alpha + \beta)z}, z > 0, \\ 0, & z \le 0. \end{cases}$$



# 谢 谢!