

# Лабораторная работа по теории вероятности

1.  $X$  – случайная величина, принимающая значения только значения вида  $k^2$ , где  $k \in \mathbb{N}$ . При этом  $\forall k \in \mathbb{N} P(X = k^2) > 0$ . Показать, что  $X$  нельзя разложить в сумму двух независимых невырожденных случайных величин.

Пусть  $X$  представим в виде  $Y + Z$ , где  $Y$  и  $Z$  – случайные величины со свойствами из условия. Из независимости следует, что если  $Y$  принимает значение  $y$ , а  $Z$  принимает значение  $z$ , то  $Y + Z$  принимает значение  $y + z$  с ненулевой вероятностью. Из матана известно, что конечная сумма по семейству обладает счетным числом ненулевых слагаемых, поэтому можем пронумеровать множество значений случайных величин  $Y$  и  $Z$ . Заметим, что так как  $\forall i, j. y_i + z_j \in \mathbb{N}$ , то все дробные части  $y_i$  и  $z_j$  должны совпадать. Тогда все  $y_i$  и все  $z_j$  можно сдвинуть на значения дробной части и получить целые числа. Так как  $\forall i, j. y_i + z_j \geq 0$ , то отрицательных значений конечное количество, причем они есть либо только среди  $y_i$ , либо среди только  $z_j$ . Пусть отрицательные значения только в  $z_j$ , тогда ко всем  $z_j$  можно прибавить  $|\min z_j|$ , а у всех  $y_i$  вычесть  $|\min z_j|$ . После сдвигов случайные величины  $Y$  и  $Z$  принимают только неотрицательные целые значения. Так как  $Y + Z$  должна принимать все значения  $k^2$ , то  $Y$  и  $Z$  принимают 0. Либо  $Y$ , либо  $Z$  должны принимать 1. Пусть  $Y$  принимает 1, тогда  $Z$  не может принимать других значений, так как  $\nexists n \in \mathbb{N} \setminus \{0\} : n = k_1^2$  и  $n + 1 = k_2^2$ . Получили противоречия с невырожденностью.

2. Даны  $U, V \sim U[0, 1]$ . Показать, что  $X = \sqrt{-2 \ln V} \cos(2\pi U)$ ,  $Y = \sqrt{-2 \ln V} \sin(2\pi U)$  образуют стандартный гауссов вектор.

Воспользуемся формулой преобразования плотности:

Для этого нужно предварительно выразить старые координаты через новые. Заметим, что

$$\begin{cases} X^2 + Y^2 = -2 \ln V \\ \frac{Y}{X} = \tan(2\pi U) \end{cases}$$

Тогда преобразование получает вид:

$$\begin{cases} V = e^{-\frac{X^2 + Y^2}{2}} \\ U = \frac{1}{2\pi} \arctan\left(\frac{Y}{X}\right) \end{cases}$$

Тогда множитель при переходе в другие координаты равен:

$$\left\| \begin{pmatrix} -xe^{-\frac{x^2 + y^2}{2}} & -ye^{-\frac{x^2 + y^2}{2}} \\ -\frac{1}{2\pi} \frac{y}{x^2 + y^2} & \frac{1}{2\pi} \frac{x}{x^2 + y^2} \end{pmatrix} \right\| = \frac{1}{2\pi} e^{-\frac{x^2 + y^2}{2}}$$

$p_{U,V}(u, v) = 1$ , поэтому  $p_{X,Y}(x, y) = \frac{1}{2\pi} e^{-\frac{x^2 + y^2}{2}}$ , что совпадает с формулой плотности для стандартного гауссова вектора. ( $EX = 0, EY = 0, Var X = 1, Var Y = 1, \rho(X, Y) = 0$ ).

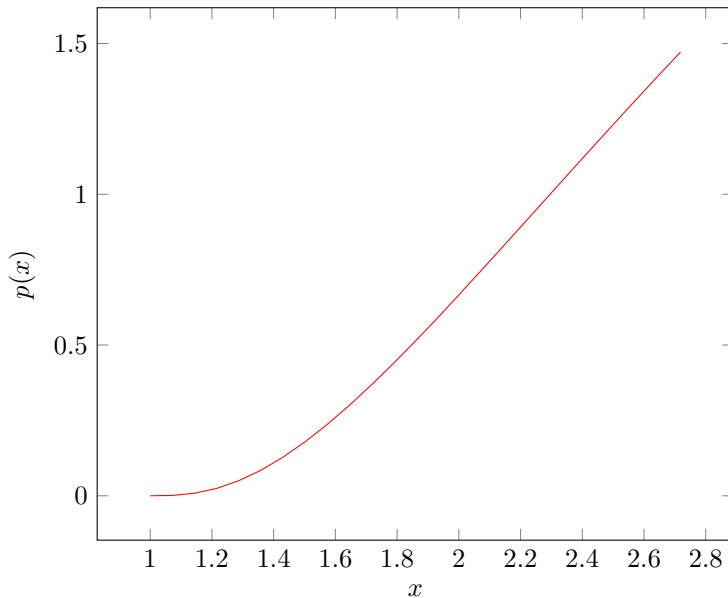
3. Реализация генератора случайных чисел для распределения с плотностью  $p(x) = 4 \frac{\ln^3(x)}{x}$  на  $[1, e]$ .

Рассматриваются три реализации:

1. Стандартная – задана только плотность.
2. Через квантили.
3. Rejection sample метод.

Принцип работы rejection sample метода: рассмотрим прямоугольник, в котором полностью укладывается функция плотности. Будем равновероятно генерировать точку  $(x, y)$  пока она не попадет в подграфик  $p(x)$ , при этом  $x$  – случайно сгенерированное число, соответствующее распределению. Рассмотрим вероятность того, что  $x$  лежит в некотором отрезке  $[a, b]$ . Очевидно, что вероятность этого – это площадь под графиком  $p(x)$ , то есть  $\int_a^b p(x)dx$ .

Поэтому сгенерированные числа действительно соответствуют распределению. Вероятность попасть под график  $p(x)$  равна  $\frac{1}{S(\text{прямоугольника})} = \frac{e}{4(e-1)}$ , а тогда матожидание числа попыток  $= \frac{4(e-1)}{e} \approx 2.5$



Замеры в репозитории показывают ожидаемые результаты линейного времени работы при генерации  $n$  случайных чисел. Rejection sampling работает медленнее метода через квантили, потому что методу через квантили требуется только одно случайное число, а rejection sampling не детерминирован. При этом стандартный метод показывает самый худший результат, так как скорее всего реализован через квантили, но обратная функция считается приближенно численным интегрированием.

Стоит отметить, что графики распределения генераций чисел всеми 3 методами практически совпадают и очень близки к идеальному.

4. Оценка кооректности теорем о больших числах для распределения Пуассона при  $\lambda \in (0, 10)$ :  
Оценка через ЦПТ:

$$P\left(|\bar{X}_n - \mu| \leq a\sqrt{\frac{\text{Var}X_1}{n}}\right) \approx \text{Erf}(a)$$

Тогда  $\text{Erf}(a) \geq 1 - \delta \Leftrightarrow a \geq \text{Erf}^{-1}(1 - \delta)$  и  $a\sqrt{\frac{\text{Var}X_1}{n}} \leq \varepsilon \Leftrightarrow \frac{\text{Erf}^{-1}(1 - \delta)\text{Var}X_1}{\varepsilon^2} \leq n$

При заданных  $\varepsilon = 0.01$ ,  $\delta = 0.05$  и  $\text{Var}X_1 = \lambda$ , где максимальное значение достигает 10, получается  $n \approx 192000$ .

Оценка через неравенство Чебышева:

$$P(|\bar{X}_n - \mu| \leq \varepsilon) \geq 1 - \frac{Var \bar{X}_n}{\varepsilon^2} = 1 - \frac{\lambda}{n\varepsilon^2}$$

Тогда  $\frac{\lambda}{n\varepsilon^2} \leq \delta$  достигается при  $n \approx 2000000$ .