

Теория вероятностей

Случайные величины

Черновик

Кафедра СМиМ

2019

План

Случайная величина

Закон и функция распределения СВ

Числовые характеристики

Математическое ожидание

Дисперсия

Медиана

Квантиль

Мода

Закон больших чисел

Теорема Чебышёва

Теорема Бернулли

Законы распределения

Равномерное распределение

Правило трёх сигм

Функция случайного аргумента

Ссылки

Outline

Случайная величина

Закон и функция распределения СВ

Числовые характеристики

- Математическое ожидание

- Дисперсия

- Медиана

- Квантиль

- Мода

Закон больших чисел

- Теорема Чебышёва

- Теорема Бернулли

Законы распределения

- Равномерное распределение

- Правило трёх сигм

Функция случайного аргумента

Ссылки

Случайная величина

Случайная величина (Random variable) - величина, которая в результате опыта может принять то или иное значение, причем неизвестно заранее, какое именно.

Случайная величина обычно обозначается заглавной латинской буквой, например X .

Случайная величина

Случайная величина (Random variable) - величина, которая в результате опыта может принять то или иное значение, причем неизвестно заранее, какое именно.

Случайная величина обычно обозначается заглавной латинской буквой, например X .

Возможные значения случайной величины обозначаются соответствующей строчной буквой.

$$X = \{x_1, x_2, \dots, x_n\}$$

Случайная величина и событие

Случайная величина может быть связана со случайным событием.

Например:

K - случайная величина: число очков выпавшее на игральной кости

A - случайное событие: выпадении более 3 очков на игральной кости ($K > 3$)

R - случайная величина: расстояние от центра плоской мишени до места попадания B - случайное событие: попадание в мишень $R < r$, где r - радиус мишени

Случайная величина

Примеры

- ▶ Число очков выпавшее на игральной кости
- ▶ Число орлов выпавшее в результате 10 бросков монеты
- ▶ Число детей в семье
- ▶ Число солнечных дней в году
- ▶ Средняя температура в аудитории в данный момент
- ▶ Рост случайно выбранного человека
- ▶ Кубиковая прочность бетона
- ▶ Количество выпавшего снега за месяц
- ▶ Время безотказной работы устройства

Случайная величина

- ▶ **Дискретная** (discrete) принимает конечное или счетное число значений.
- ▶ **Непрерывная** (continuous) может принимать все значения из некоторого конечного или бесконечного промежутка.

Случайная величина

Примеры

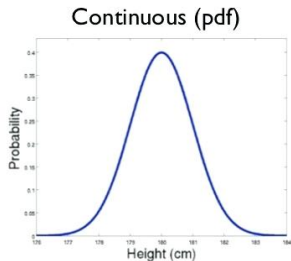
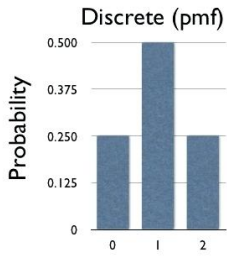
- ▶ Дискретная

Случайная величина

Примеры

- ▶ Дискретная
 - ▶ Число очков выпавшее на игральной кости
 - ▶ Число орлов выпавшее в результате 10 бросков монеты
 - ▶ Число студентов на конкретном занятии
 - ▶ Число солнечных дней в году
- ▶ Непрерывная
 - ▶ Средняя температура в аудитории в данный момент
 - ▶ Рост случайно выбранного человека
 - ▶ Кубиковая прочность бетона
 - ▶ Количество выпавшего снега за месяц
 - ▶ Время безотказной работы устройства

Случайная величина



Outline

Случайная величина

Закон и функция распределения СВ

Числовые характеристики

Математическое ожидание

Дисперсия

Медиана

Квантиль

Мода

Закон больших чисел

Теорема Чебышёва

Теорема Бернулли

Законы распределения

Равномерное распределение

Правило трёх сигм

Функция случайного аргумента

Ссылки

Функция вероятности

- ▶ Случайные величины отличаются друг от друга диапазоном своих значений
Например время ожидания троллейбуса на остановке в будний день в 8:00 и в 22:00
- ▶ Даже если случайные величины имеют одинаковый диапазон значений, одна СВ может быть более склонна принимать одни значения, а другая - другие
Например: процент оценок *отлично* по философии и теоретической механике у студентов направления 08.05.01
- ▶ Поэтому есть необходимость описывать значения случайной величины связывая их с вероятностью

Функция вероятности

Функция вероятности, probability mass function (pmf) – функция, возвращающая вероятность того, что дискретная случайная величина X примет определённое значение.

Вероятность того, что СВ X примет значение равное x

$$P(X = x)$$

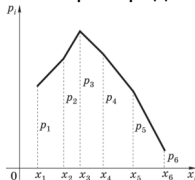
x - возможное значение случайной величины

Способы задания функции вероятности

- Таблично (ряд распределения)

x_i	x_1	x_2	\dots	x_n
p_i	p_1	p_2	\dots	p_n

Графически (многоугольник распределения)



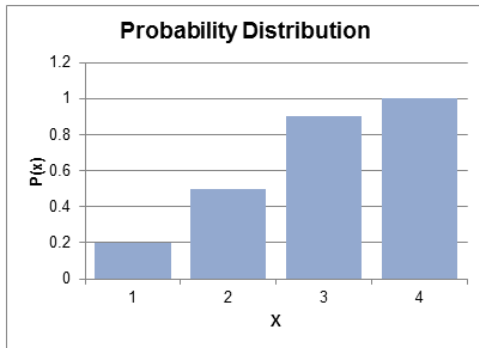
Аналитически

$$P(K) = f(k)$$

Способы задания функции вероятности

Гистограмма

Часто вместо многоугольника распределения строят гистограмму



Функция распределения

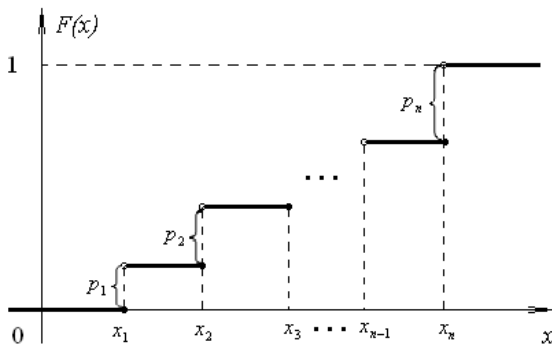
- ▶ Функция вероятности позволяет узнать вероятность только реализации одного значения случайной величины $P(X = x)$.
- ▶ Однако часто нужно знать вероятность того, что случайная величина не превысит заданного значения $P(X < x)$
- ▶ Эта вероятность задаётся **функцией распределения**

$$F(x) = P(X < x)$$

- ▶ В англоязычных источниках используется название **cumulative distribution function (cdf)**

Функция распределения

Функция распределения дискретной СВ



Функция распределения

Свойства

- ▶ неубывающая функция
 $x_1 < x_2, F(x_1) \leq F(x_2)$
- ▶ $F(-\infty) = 0$
- ▶ $F(+\infty) = 1$

Функция распределения

Пример

- ▶ В группе 5 человек
- ▶ Записать закон распределения в табличном виде СВ X - число человек присутствующих на занятии
- ▶ $p = 0.9$ - вероятность появления студента на занятии
- ▶ Считать появление отдельных студентов на занятии независимыми событиями

Функция распределения

Пример

- ▶ В группе 5 человек
- ▶ Записать закон распределения в табличном виде СВ X - число человек присутствующих на занятии
- ▶ $p = 0.9$ - вероятность появления студента на занятии
- ▶ Считать появление отдельных студентов на занятии независимыми событиями
- ▶ Записать в табличном виде функцию распределения

Функция распределения

Непрерывная случайная величина

- ▶ Для непрерывной случайной величины невозможно составить ряд распределения так же как для дискретной
- ▶ Но различные области значений непрерывной случайной величины могут не являются равновероятными Например рост случайно выбранного человека попадёт в интервал (150, 155) и в интервал от (170,175) с разной вероятностью.
- ▶ Поэтому вместо ряда распределения для описания непрерывной случайной величины используется **функция распределения (cdf)**

$$F(x) = P(X < x)$$

- ▶ Эту функцию иногда называют *интегральным законом распределения*

Вероятность попадания СВ на заданный участок

- ▶ Рассмотрим полуинтервал значений СВ $[a, b)$
- ▶ Согласно теореме о сумме событий

$$P(X < b) = P(X < a) + P(a \leq X < b)$$

- ▶ Отсюда

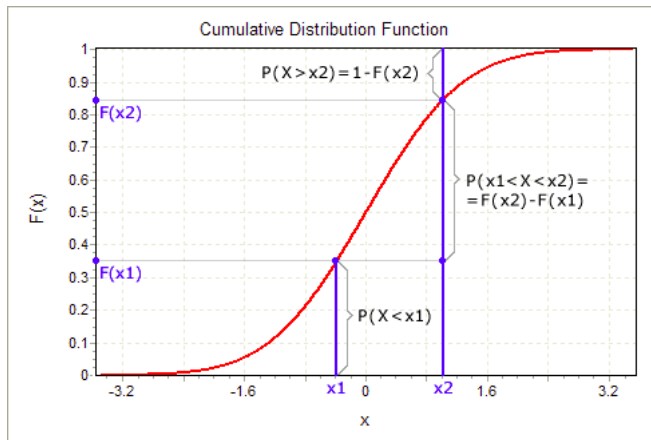
$$P(a \leq X < b) = P(X < b) - P(X < a)$$

- ▶ Используем функцию распределения

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

Функция распределения

Функция распределения непрерывной СВ



- ▶ Рассмотрим непрерывную СВ X
- ▶ Определим вероятность попадания этой СВ на участок от x до $x + \Delta x$

$$P(x < X < x + \Delta x) = F(x + \Delta x) - F(x)$$

- ▶ Определим среднюю вероятность приходящуюся на длину этого участка при $\Delta x \rightarrow 0$

$$\lim_{\Delta x \rightarrow 0} = \frac{F(x + \Delta x) - F(x)}{\Delta x} = F'(x)$$

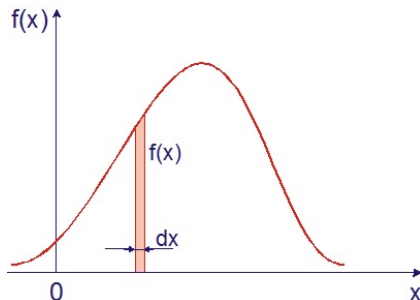
Плотность распределения

Непрерывная случайная величина

- Обозначим

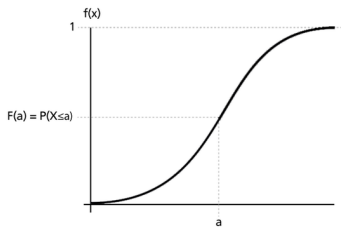
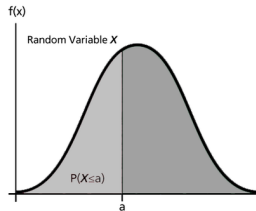
$$f(x) = F'(x)$$

- Это *плотность распределения* (плотность вероятности)
- Кривая определяемая $f(x)$ называется кривой распределения



Функция распределения и функция плотности

$$F(x) = \int_{-\infty}^x f(t) dt$$



Outline

Случайная величина

Закон и функция распределения СВ

Числовые характеристики

Математическое ожидание

Дисперсия

Медиана

Квантиль

Мода

Закон больших чисел

Теорема Чебышёва

Теорема Бернулли

Законы распределения

Равномерное распределение

Правило трёх сигм

Функция случайного аргумента

Ссылки

Числовые характеристики

- ▶ Случайную величину можно исчерпывающим образом описать:
 - ▶ функцией распределения $F(x)$ (дискретная и непрерывная СВ)
 - ▶ рядом распределения $P(x)$ (дискретная СВ)
 - ▶ плотностью распределения $f(x)$ (непрерывная СВ)
- ▶ Однако такое исчерпывающее описание не всегда удобно.
- ▶ Поэтому в дополнении к вышеприведённым способам описания СВ используют характеристики СВ отражающие наиболее существенные её особенности.
- ▶ Их называют **числовыми характеристиками**

Числовые характеристики

Некоторые числовые характеристики

- ▶ Математическое ожидание - характеристика положения СВ на числовой оси
- ▶ Медиана - характеристика положения СВ на числовой оси
- ▶ Мода
- ▶ Дисперсия, среднеквадратичное отклонение - характеристики рассеивания СВ около её математического ожидания

Outline

Случайная величина

Закон и функция распределения СВ

Числовые характеристики

Математическое ожидание

Дисперсия

Медиана

Квантиль

Мода

Закон больших чисел

Теорема Чебышёва

Теорема Бернулли

Законы распределения

Равномерное распределение

Правило трёх сигм

Функция случайного аргумента

Ссылки

Математическое ожидание

- ▶ Expected value, mean value
- ▶ Обозначение: $M(X)$ или $E(X)$
- ▶ характеристика положения СВ на числовой оси
- ▶ Это среднее (взвешенное) значение СВ
- ▶ Для дискретной СВ

$$M[X] = \sum_{i=1}^n x_i p_i.$$

- ▶ Для непрерывной СВ

$$M[X] = \int_{-\infty}^{+\infty} x \cdot f(x) dx$$

Математическое ожидание

Дискретная случайная величина. Пример

x	P(x)	x * P(x)
1	0.10	1 * 0.10 = 0.10
2	0.30	2 * 0.30 = 0.60
3	0.45	3 * 0.45 = 1.35
4	0.15	4 * 0.15 = 0.60
		$\mu_x = 2.65$

Математическое ожидание

Свойства

- ▶ Математическое ожидание числа есть само число.

$$M[a] = a$$

- ▶ Сумма случайных величин

$$M[X + Y] = M[X] + M[Y]$$

- ▶ Линейность математического ожидания

$$M[kX] = k \cdot M[X]$$

- ▶ Произведение независимых, некоррелированных случайных величин

$$M[X \cdot Y] = M[X] \cdot M[Y]$$

Outline

Случайная величина

Закон и функция распределения СВ

Числовые характеристики

Математическое ожидание

Дисперсия

Медиана

Квантиль

Мода

Закон больших чисел

Теорема Чебышёва

Теорема Бернулли

Законы распределения

Равномерное распределение

Правило трёх сигм

Функция случайного аргумента

Ссылки

Дисперсия

- ▶ Variance
- ▶ Обозначение: $D(X)$, $Var(X)$
- ▶ Обозначение в статистике: σ_X^2
- ▶ Характеризует рассеивания СВ около её математического ожидания
- ▶ $D[X] = M[(X - M[X])^2]$
- ▶ $X - M[X]$ - отклонение случайной величины

Дисперсия

- ▶ Для дискретной СВ

$$D[X] = \sum_{i=1}^n p_i (x_i - M[X])^2$$

- ▶ Для непрерывной СВ

$$D[X] = \int_{-\infty}^{+\infty} (x - M[X])^2 f(x) dx$$

- ▶ Иногда дисперсию проще вычислить так:

$$D[X] = M[X^2] - (M[X])^2$$

Среднее квадратичное отклонение

- ▶ Дисперсия имеет размерность квадрата СВ, что не слишком наглядно
- ▶ Поэтому из дисперсии извлекают квадратный корень
- ▶ Такую величину называют средним квадратическим отклонением (с.к.о.) $\sigma[X]$
- ▶ $\sigma[X] = \sqrt{D[X]}$
- ▶ В статистике с.к.о. обозначают SD

Дисперсия

Дискретная случайная величина. Пример

x	P(x)	x^2	$x^2 * P(x)$
1	0.10	$1*1 = 1$	$1 * 0.10 = 0.10$
2	0.30	$2*2 = 4$	$4 * 0.30 = 1.20$
3	0.45	$3*3 = 9$	$9 * 0.45 = 4.05$
4	0.15	$4*4 = 16$	$16 * 0.15 = 2.40$

$$M[X] =$$

Дисперсия

Дискретная случайная величина. Пример

x	P(x)	x^2	$x^2 * P(x)$
1	0.10	$1 * 1 = 1$	$1 * 0.10 = 0.10$
2	0.30	$2 * 2 = 4$	$4 * 0.30 = 1.20$
3	0.45	$3 * 3 = 9$	$9 * 0.45 = 4.05$
4	0.15	$4 * 4 = 16$	$16 * 0.15 = 2.40$

$$M[X] = 0.1 \cdot 1 + 1.2 \cdot 2 + 4.05 \cdot 3 + 2.4 \cdot 4 = 2.65$$

$$M[X^2] =$$

Дисперсия

Дискретная случайная величина. Пример

x	P(x)	x^2	$x^2 * P(x)$
1	0.10	$1*1 = 1$	$1 * 0.10 = 0.10$
2	0.30	$2*2 = 4$	$4 * 0.30 = 1.20$
3	0.45	$3*3 = 9$	$9 * 0.45 = 4.05$
4	0.15	$4*4 = 16$	$16 * 0.15 = 2.40$

$$M[X] = 0.1 \cdot 1 + 1.2 \cdot 2 + 4.05 \cdot 3 + 2.4 \cdot 4 = 2.65$$

$$M[X^2] = 0.1 + 1.2 + 4.05 + 2.4 = 7.75$$

$$D[X] =$$

Дисперсия

Дискретная случайная величина. Пример

x	P(x)	x^2	$x^2 * P(x)$
1	0.10	$1*1 = 1$	$1 * 0.10 = 0.10$
2	0.30	$2*2 = 4$	$4 * 0.30 = 1.20$
3	0.45	$3*3 = 9$	$9 * 0.45 = 4.05$
4	0.15	$4*4 = 16$	$16 * 0.15 = 2.40$

$$M[X] = 0.1 \cdot 1 + 1.2 \cdot 2 + 4.05 \cdot 3 + 2.4 \cdot 4 = 2.65$$

$$M[X^2] = 0.1 + 1.2 + 4.05 + 2.4 = 7.75$$

$$D[X] = 7.75 - 2.65^2 = 0.7275$$

$$\sigma[x] = 0.8529$$

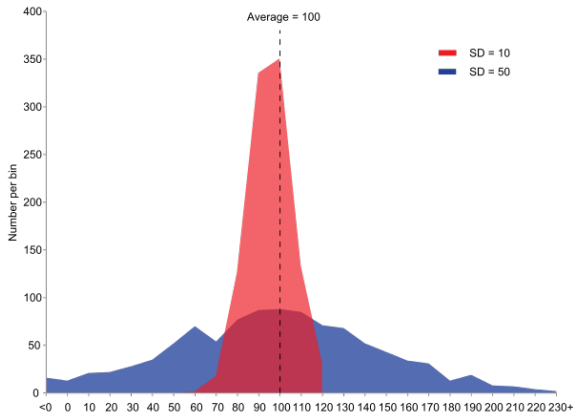
Дисперсия

Свойства

- ▶ Дисперсия всегда неотрицательна: $D[X] \geq 0$
- ▶ Дисперсия константы равна нулю: $D[a] = 0$
- ▶ Дисперсия суммы двух случайных величин
 $D[X + Y] = D[X] + D[Y] + 2\text{cov}(X, Y)^1$
- ▶ $D[kX] = k^2 D[X]$
- ▶ $D[-X] = D[X]$
- ▶ $D[X + a] = D[X]$

¹ $\text{cov}(X, Y)$ - ковариация - мера линейной зависимости двух случайных величин. $\text{cov}(X, Y) = 0$ если величины линейно независимы

Дисперсия



Коэффициент вариации

$$\nu[X] = \frac{\sigma[X]}{M[X]}$$

Outline

Случайная величина

Закон и функция распределения СВ

Числовые характеристики

Математическое ожидание

Дисперсия

Медиана

Квантиль

Мода

Закон больших чисел

Теорема Чебышёва

Теорема Бернулли

Законы распределения

Равномерное распределение

Правило трёх сигм

Функция случайного аргумента

Ссылки

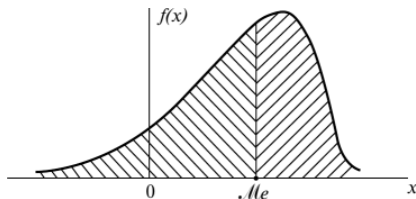
Медиана

Медиана $Me[X]$ - такое значение случайной величины для которого выполняется равенство

$$P(X < Me) = P(X > Me)$$

Для непрерывной СВ:

$$F(Me) = 0.5$$



Outline

Случайная величина

Закон и функция распределения СВ

Числовые характеристики

Математическое ожидание

Дисперсия

Медиана

Квантиль

Мода

Закон больших чисел

Теорема Чебышёва

Теорема Бернулли

Законы распределения

Равномерное распределение

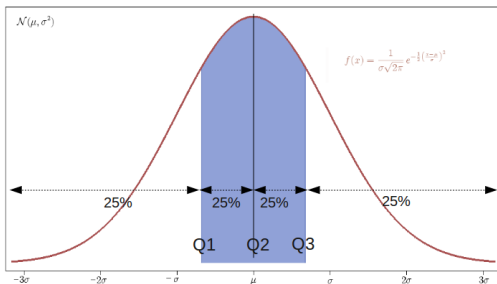
Правило трёх сигм

Функция случайного аргумента

Ссылки

Квантиль

- ▶ **Квантиль** - значение, которое заданная случайная величина не превышает с фиксированной вероятностью
- ▶ **Квартили** Q1, Q2, Q3 - значения случайной величины которые делят распределение на 4 равные части



Outline

Случайная величина

Закон и функция распределения СВ

Числовые характеристики

Математическое ожидание

Дисперсия

Медиана

Квантиль

Мода

Закон больших чисел

Теорема Чебышёва

Теорема Бернулли

Законы распределения

Равномерное распределение

Правило трёх сигм

Функция случайного аргумента

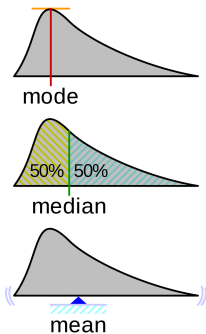
Ссылки

Мода

Мода - значение СВ, которое встречается наиболее часто

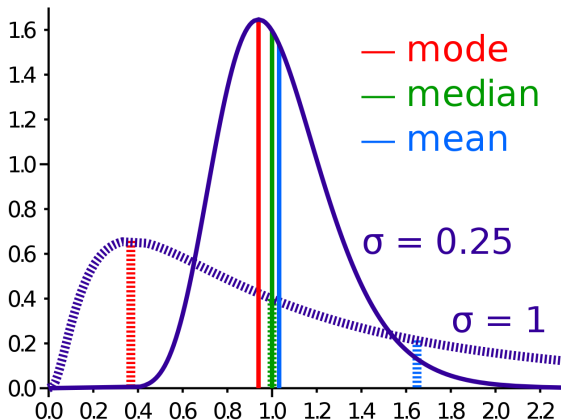
Мода, медиана, математическое ожидание

Пример



Мода, медиана, математическое ожидание

Пример



Outline

Случайная величина

Закон и функция распределения СВ

Числовые характеристики

Математическое ожидание

Дисперсия

Медиана

Квантиль

Мода

Закон больших чисел

Теорема Чебышёва

Теорема Бернулли

Законы распределения

Равномерное распределение

Правило трёх сигм

Функция случайного аргумента

Ссылки

Закон больших чисел

- ▶ При очень большом числе случайных явлений их результат практически перестаёт быть случайным и может быть определён с большой степенью определённости
- ▶ Закон больших чисел
 - ▶ Теорема Чебышёва
 - ▶ Теорема Бернулли

Outline

Случайная величина

Закон и функция распределения СВ

Числовые характеристики

Математическое ожидание

Дисперсия

Медиана

Квантиль

Мода

Закон больших чисел

Теорема Чебышёва

Теорема Бернулли

Законы распределения

Равномерное распределение

Правило трёх сигм

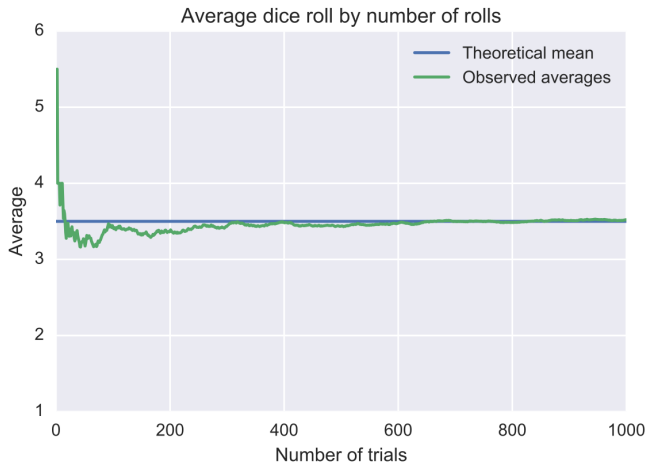
Функция случайного аргумента

Ссылки

Теорема Чебышёва

- ▶ При достаточно большом числе независимых опытов среднее арифметическое наблюдаемых значений случайной величины *сходится по вероятности* к ее математическому ожиданию.
- ▶ Другими словами: на практике можно использовать вместо математического ожидания среднее значение случайной величины (если этих значений много)

Теорема Чебышёва



Outline

Случайная величина

Закон и функция распределения СВ

Числовые характеристики

Математическое ожидание

Дисперсия

Медиана

Квантиль

Мода

Закон больших чисел

Теорема Чебышёва

Теорема Бернулли

Законы распределения

Равномерное распределение

Правило трёх сигм

Функция случайного аргумента

Ссылки

Теорема Бернулли

Если в каждом из n независимых испытаний вероятность появления события A постоянна, то как угодно близка к единице вероятность того, что отклонение относительной частоты от вероятности по абсолютной величине будет сколь угодно малым, если число испытаний достаточно велико.

Другими словами: на практике можно использовать вместо вероятности события относительную частоту события (при условиях описанных выше)

Outline

Случайная величина

Закон и функция распределения СВ

Числовые характеристики

- Математическое ожидание

- Дисперсия

- Медиана

- Квантиль

- Мода

Закон больших чисел

- Теорема Чебышёва

- Теорема Бернулли

Законы распределения

- Равномерное распределение

- Правило трёх сигм

Функция случайного аргумента

Ссылки

Outline

Случайная величина

Закон и функция распределения СВ

Числовые характеристики

- Математическое ожидание

- Дисперсия

- Медиана

- Квантиль

- Мода

Закон больших чисел

- Теорема Чебышёва

- Теорема Бернулли

Законы распределения

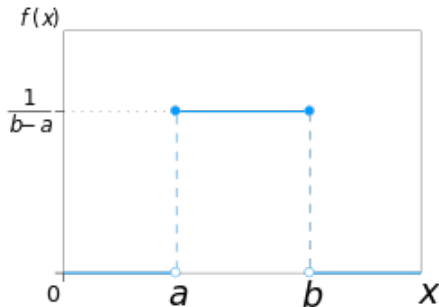
- Равномерное распределение**

 - Правило трёх сигм

Функция случайного аргумента

Ссылки

Равномерное распределение



Все возможные значения случайной величины равновероятны.

Равномерное распределение может иметь как дискретная случайная величина, так и непрерывная

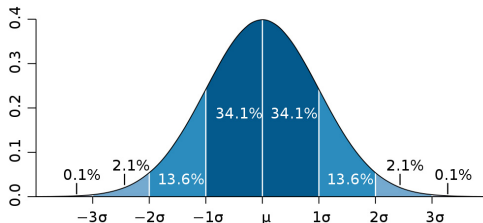
```
scipy.stats.uniform.rvs ( loc = a, scale = b)
```

Равномерное распределение. Примеры

- ▶ Количество очков, выпавших на игральной кости
- ▶ Число выпавшее на рулетке
- ▶ Номер автобусного билета (в единичном испытании)
- ▶ Время ожидания события, происходящего со строгой периодичностью. например время ожидания поезда, который отправляется со станции раз в 30 минут

Значения случайной величины с равномерным распределением используются для осуществления случайных выборов.

Нормальное распределение



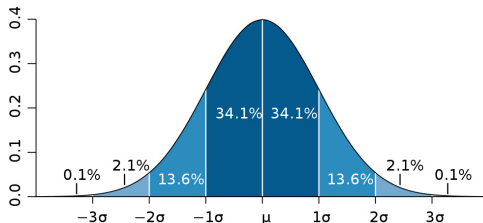
μ - математическое ожидание, σ - среднеквадратичное отклонение.

Возможные значения СВ близкие к мат. ожидания наиболее вероятны.

Если СВ является суммой большого числа других независимых величин, то она подчиняется нормальному закону распределения.²

²см. центральная предельная теорема

Нормальное распределение



μ - математическое ожидание, σ - среднеквадратичное отклонение.

Возможные значения СВ близкие к мат. ожидания наиболее вероятны.

Если СВ является суммой большого числа других независимых величин, то она подчиняется нормальному закону распределения.³

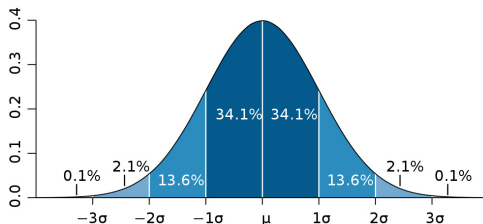
³см. центральная предельная теорема

Нормальное распределение. Примеры

- ▶ Рост человека
- ▶ Ошибка измерения
- ▶ Прочность бетона
- ▶ Масса новорождённых детей
- ▶ Объём молока производимый коровой каждый день

Правило трёх сигм

Вероятность того, что случайная величина отклонится от своего математического ожидания на большую величину, чем утроенное среднее квадратичное отклонение, практически равна нулю.

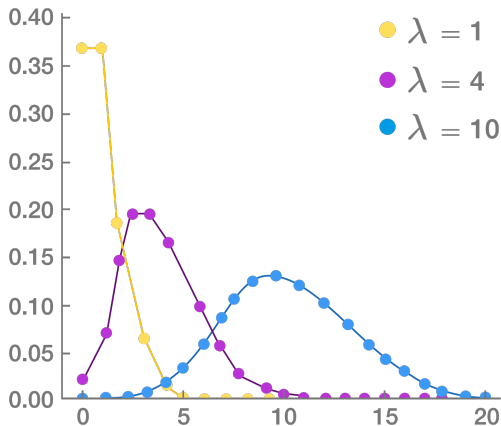


$$P(\mu - 1\sigma \leq X \leq \mu + 1\sigma) \approx 0.6827$$

$$Pr(\mu - 2\sigma \leq X \leq \mu + 2\sigma) \approx 0.9545$$

$$Pr(\mu - 3\sigma \leq X \leq \mu + 3\sigma) \approx 0.9973$$

Распределение Пуассона



СВ - количество событий на меру пространства или времени,
при средней частоте λ

Распределение Пуассона. Примеры

ДТП в определённом районе города случается в среднем дважды в неделю.

Какова вероятность того, что на этой неделе не будет ДТП?

Используем закон Пуассона⁴:

$$P(k) = \frac{\lambda^k e^{-\lambda}}{k!}$$

где $\lambda = 2$, $k = 0$ - число событий.

тогда $P(0) = \frac{2^0 e^{-2}}{0!} = 0.14$

⁴ в пакете scipy: `scipy.stats.distributions.poisson.pmf(x, lambda)`

Распределение Пуассона. Примеры

ДТП в определённом районе города случается в среднем дважды в неделю.

Какова вероятность того, что на этой неделе не будет ДТП?

Используем закон Пуассона⁴:

$$P(k) = \frac{\lambda^k e^{-\lambda}}{k!}$$

где $\lambda = 2$, $k = 0$ - число событий.



$$\text{тогда } P(0) = \frac{2^0 e^{-2}}{0!} = 0.14$$

Какова вероятность того, что на этой неделе будет 1 и 2 ДТП?

$$P(1) = \frac{2^1 e^{-2}}{1!} = 0.27, \quad P(2) = \frac{2^2 e^{-2}}{2!} = 0.27$$

Какова вероятность того, что на этой неделе будет больше 2-х ДТП?

$$P(X > 2) = 1 - P(0) - P(1) - P(2)$$

⁴ в пакете `scipy`: `scipy.stats.distributions.poisson.pmf(x, lambda)`  

Распределение Пуассона. Примеры

Для при определении вероятности для заданного числа событий произошедших за t единиц времени параметр λ определяют так:

$$\lambda = tn$$

где n число событий за единицу времени

Сравним вероятности следующих событий:

- ▶ 3 ДТП за неделю
- ▶ 15 ДТП за 5 недель

Распределение Пуассона. Примеры

Для при определении вероятности для заданного числа событий произошедших за t единиц времени параметр λ определяют так:

$$\lambda = tn$$

где n число событий за единицу времени

Сравним вероятности следующих событий:

- ▶ 3 ДТП за неделю
- ▶ 15 ДТП за 5 недель

$$n = 2, t_1 = 1, \lambda_1 = 2, t_2 = 5, \lambda_2 = 2 \cdot 5 = 10$$

$$P(3, \lambda_1 = 2) = 0.18$$

$$P(15, \lambda_2 = 10) = 0.035$$

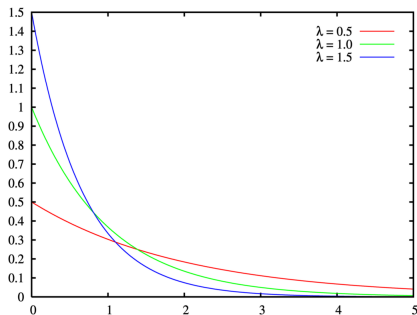
Распределение Пуассона. Примеры

Величины подчиняющиеся распределению Пуассона

- ▶ Число изюминок в булочке
- ▶ Число мутация в ДНК
- ▶ Число звонков в службу технической поддержки
- ▶ Число смертей в год для заданной возрастной категории
- ▶ Число альфа-частиц излучённых за определённый промежуток времени

kvant.mccme.ru/1988/08/raspredelenie_puassona.htm

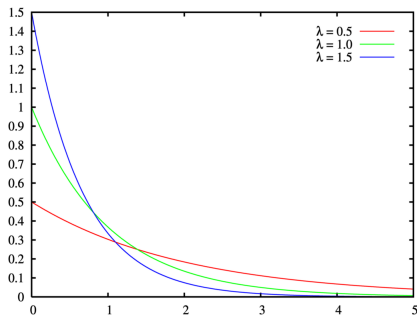
Экспоненциальное (показательное) распределение



λ - параметр скорости. $M(X) = \frac{1}{\lambda}$

моделирует время между двумя последовательными свершениями одного и того же события.

Экспоненциальное (показательное) распределение



λ - параметр скорости. $M(X) = \frac{1}{\lambda}$

моделирует время между двумя последовательными свершениями одного и того же события.

Экспоненциальное (показательное) распределение.

Пример

Среднее время ожидания покупателя - 15 минут. Какова вероятность, что во время перерыва длительностью 5, 10 и 15 минут придёт покупатель?

Тогда $\frac{1}{\lambda} = 15 \rightarrow \lambda = 0.067$.

$$P(X < 5) = F(5) = 1 - e^{-0.067 \cdot 5} = 0.28$$

$$P(X < 10) = F(10) = 1 - e^{-0.067 \cdot 10} = 0.49$$

$$P(X < 15) = F(15) = 1 - e^{-0.067 \cdot 15} = 0.63$$

```
scipy.stats.expon.cdf ( x = 5, scale = 15)  # 0.28
```

Экспоненциальное распределение vs распределение Пуассона

В чём разница и что общее у экспоненциального распределения и распределения Пуассона?

Экспоненциальное (показательное) распределение

Величины подчиняющиеся экспоненциальному распределению

- ▶ Расстояние между участками ДНК с мутациями
- ▶ Время ожидания звонка службу технической поддержки
- ▶ Время между излучением частиц
- ▶ Расстояние между местами ДТП на дороге⁵

⁵ в предположении, что вероятность ДТП на каждом участке дороги одинакова

Outline

Случайная величина

Закон и функция распределения СВ

Числовые характеристики

- Математическое ожидание

- Дисперсия

- Медиана

- Квантиль

- Мода

Закон больших чисел

- Теорема Чебышёва

- Теорема Бернулли

Законы распределения

- Равномерное распределение

- Правило трёх сигм

Функция случайного аргумента

Ссылки

Функция случайного аргумента

Outline

Случайная величина

Закон и функция распределения СВ

Числовые характеристики

- Математическое ожидание

- Дисперсия

- Медиана

- Квантиль

- Мода

Закон больших чисел

- Теорема Чебышёва

- Теорема Бернулли

Законы распределения

- Равномерное распределение

- Правило трёх сигм

Функция случайного аргумента

Ссылки

- ▶ Теория вероятностей и математическая статистика. Гмурман В.Е. biblio-online.ru/book/teoriya-veroyatnostey-i-matematicheskaya-statistika-431095
- ▶ Руководство к решению задач по теории вероятностей и математической статистике. В. Е. Гмурман. — 11-е изд., Издательство Юрайт, 2019. — 406 с www.biblio-online.ru/book/02E0C1D3-4EEA-43AA-AA6B-5E25C4991D0

Материалы курса

github.com/VetrovSV/ST