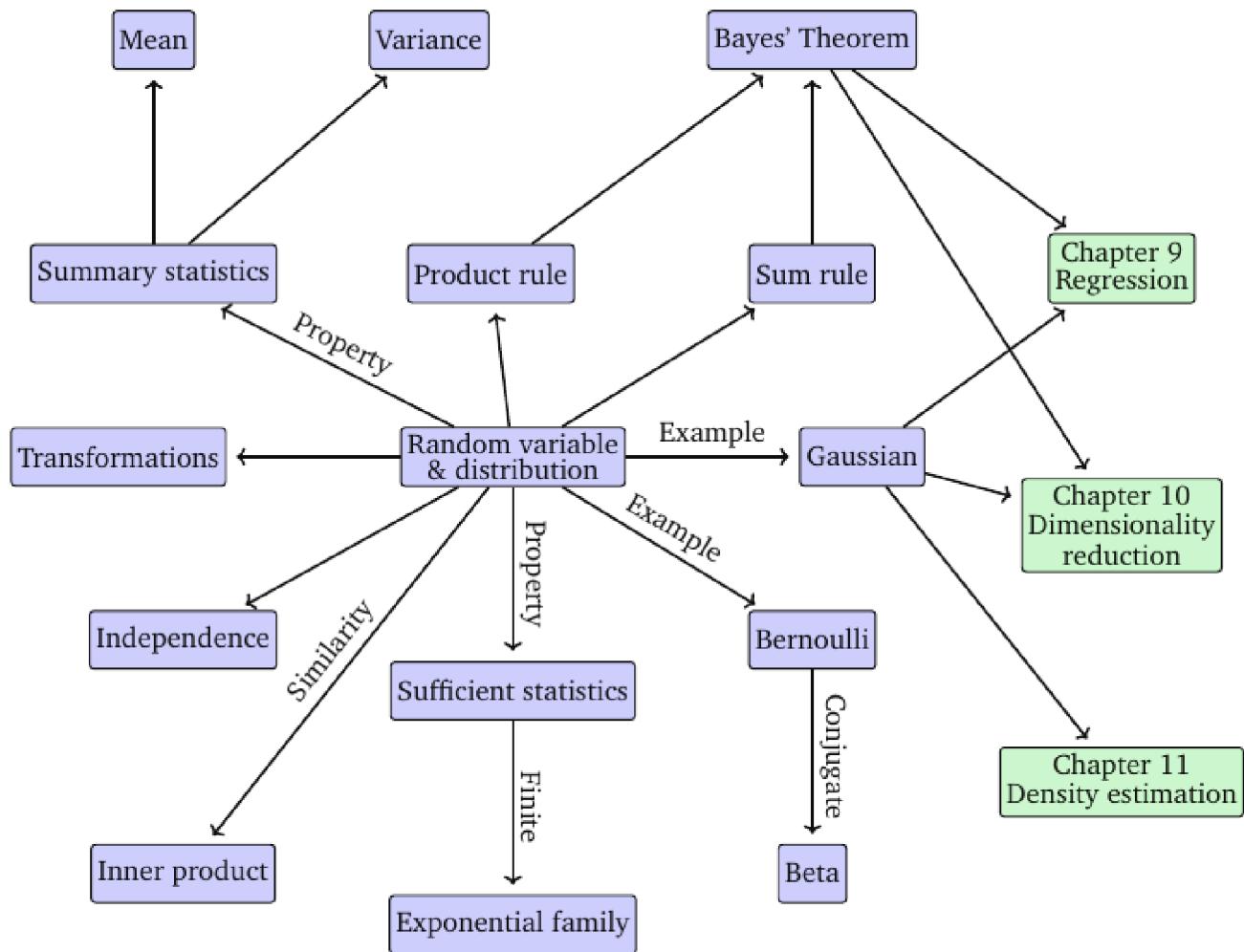


# Part 6 - Probability & Distributions



## 6.1 Construction of a Probability Space

### 6.1.1 Probabilitas dan Peubah Acak

Sebuah ruang probabilitas (*probability space*) adalah tripel  $(\Omega, \mathcal{A}, P)$ , dengan:

1. Sample space  $\Omega$ : himpunan semua kemungkinan hasil dari suatu percobaan acak.
  - Contoh: pada pelemparan koin,  $\Omega = \{\text{Head}, \text{Tail}\}$ .
2. Event space ( $\mathcal{A}$ )

Disebut juga *ruang kejadian*. Sebuah subset  $A \subseteq \Omega$  dikatakan elemen dari  $\mathcal{A}$  apabila setelah percobaan dilakukan, kita dapat *mengamati* apakah hasil  $\omega \in \Omega$  tersebut termasuk ke dalam  $A$  atau tidak.

Dengan kata lain: suatu subset masuk ke event space hanya jika ia teramat/terdefinisi secara jelas dalam eksperimen.

- Untuk distribusi diskret,  $\mathcal{A}$  seringkali diambil sebagai power set dari  $\Omega$ , yaitu semua subset yang mungkin.
- Untuk distribusi kontinu,  $\mathcal{A}$  biasanya berupa himpunan Borel, karena tidak semua subset dari  $\mathbb{R}$  bisa dijadikan event yang “terukur”.

### 3. Probability measure (PP)

Adalah fungsi yang memberikan probabilitas pada setiap event  $A \in \mathcal{A}$ , dengan sifat:

- $P(A) \in [0, 1]$  untuk semua  $A \in \mathcal{A}$ ,
- $P(\Omega) = 1$ ,
- Jika  $(A_i)_{i=1}^{\infty}$  adalah himpunan event yang saling lepas, maka

$$\left( \bigcup_{i=1}^{\infty} A_i \right) = \sum_{i=1}^{\infty} P(A_i)$$

#### Contoh 1: Permainan Funfair dengan Koin

Eksperimen:

- Kita punya sebuah kantong berisi koin USA (\$) dan koin UK (£).
- Kita melakukan dua kali pengambilan koin dengan pengembalian (*with replacement*).
- Probabilitas mengambil koin USA () dalam satu kali undian adalah \$0.3.
- Probabilitas mengambil koin UK (£) adalah 0.7.

$$\Omega = (\$, \$), (\$, £), (£, \$), (£, £)$$

Misal kita definisikan  $X$  sebagai peubah acak yang menotasikan seberapa banyak munculnya \$ pada percobaan, maka:

$$\begin{aligned} X((\$, \$)) &= 2 \\ X((\$, £)) &= 1 \\ X((£, \$)) &= 1 \\ X((£, £)) &= 0 \end{aligned}$$

Sehingga:

$$\begin{aligned}P(X = 2) &= P((\$, \$)) \\&= P(\$). P(\$) \\&= (0.3)(0.3) = 0.09 \\P(X = 1) &= P((\$, \mathcal{L}) \cup (\mathcal{L}, \$)) \\&= P((\$, \mathcal{L})) + P((\mathcal{L}, \$)) \\&= (0.3)(1 - 0.3) + (1 - 0.3)(0.3) = 0.42 \\P(x = 0) &= P((\mathcal{L}, \mathcal{L})) \\&= (1 - 0.3)(1 - 0.3) = 0.49\end{aligned}$$

## 6.2 Discrete and Continuous Probabilities

Jika *target space*  $T$  bersifat diskret (misalnya  $\{0, 1\}$ ,  $\{1, 2, 3, 4, 5, 6\}$ ), maka yang kita tanyakan adalah probabilitas bahwa variabel acak  $X$  sama dengan suatu nilai tertentu:

$$P(X = x), \quad x \in T$$

Fungsi  $p(x) = P(X = x)$  ini disebut probability mass function (pmf).

Jika *target space*  $T$  bersifat kontinu (misalnya  $\mathbb{R}$ ), maka lebih alami berbicara tentang probabilitas bahwa  $X$  jatuh dalam suatu interval:

$$P(a \leq X \leq b), \quad a < b$$

Untuk memudahkan, konvensi yang umum dipakai adalah mendefinisikan cumulative distribution function (cdf):

$$F(x) = P(X \leq x)$$

### 6.2.1 Discrete Probabilities

#### 🔗 Contoh 2: Pelemparan Dadu

Untuk variabel acak  $X =$  asil lemparan dadu, dan  $T = \{1, 2, 3, 4, 5, 6\}$ , maka:

$$p(x) = \frac{1}{6}, \quad \forall x \in T$$

Dalam kasus multivariat, jika kita punya beberapa variabel acak diskret misal  $(X_1, X_2, \dots, X_n)$ , maka distribusi gabungan didefinisikan sebagai joint pmf:

$$p(x_1, x_2, \dots, x_n) = P(X_1 = x_1, X_2 = x_2, \dots, X_n = x_n)$$

dan memenuhi:

$$\sum_{x_1} \dots \sum_{x_n} p(x_1, \dots, x_n) = 1$$

*Peluang marginal:* Peluang dari suatu variabel acak tanpa memperhatikan nilai variabel acak yang lain

*Peluang kondisional:* Peluang dari suatu variabel acak dengan memperhatikan nilai variabel acak yang lain sebagai syarat (misal  $P(X|)$ )

## 6.2.2 Continuous Probabilities

### 🔗 Fungsi Kepekatan Peluang/Probability Density Function (pdf)

Suatu fungsi  $f : \mathbb{R}^D \rightarrow R$  disebut *pdf* jika memenuhi:

1.  $\forall x \in \mathbb{R}^D : f(x) \geq 0$
2. integralnya ada dan

$$\int_{\mathbb{R}^D} f(x) dx = 1$$

Intuisi: Dalam kasus diskret, integral digantikan dengan sum.

Peluang suatu variabel acak kontinu  $X$  berada di interval  $[a, b]$  diberikan oleh:

$$\int_a^b f(x) dx$$

yang artinya adalah luas daerah di bawah kurva di antara  $a$  dan  $b$ . Akibatnya, untuk kasus kontinu nilai peluang di suatu titik  $P(X = x) = 0$  karena mengambil  $a = b$ .

### 🔗 Cumulative Distribution Function (CDF)

fungsi *cdf* dari suatu variabel acak multivariat  $X$  dengan  $x \in \mathbb{R}^D$  diberikan sebagai:

$$F_X(x) = P(X_1 \leq x_1, \dots, X_D \leq x_D)$$

di mana  $X = [X_1, \dots, X_D]^T$  dan  $x = [x_1, \dots, x_D]^T$ . Juga bisa ditulis sebagai integral dari pdf:

$$F_X(x) = \int_{-\infty}^{x_1} \dots \int_{-\infty}^{x_D} f(z_1, \dots, z_D) dz_1 \dots dz_D$$

Yang artinya adalah total area di bawah kurva dari  $-\infty$  ke  $x$ .

## 6.3 Sum Rule, Product Rule, and Bayes' Theorem

*Sum rule:* Jika kita punya dua variabel acak  $x$  dan  $y$ , maka probabilitas marjinal dari  $X$  bisa diperoleh dengan menjumlahkan (untuk diskrit) atau mengintegralkan (untuk kontinu) probabilitas gabungan

$$p(x) = \begin{cases} \sum_{y \in \mathcal{Y}} p(x, y), & \text{ika diskret} \\ \int_{\mathcal{Y}} p(x, y) dy, & \text{ika kontinu} \end{cases}$$

*intuisi:* Misal kita melempar koin dan dadu sekaligus, jika kita ingin menghitung total peluang dadu di angka 3 maka kita jumlahkan peluang dadu di angka 3 dengan kepala dan peluang dadu di angka 3 dengan ekor.

*Product Rule:*

$$P(X, Y) = P(Y|X)P(X)$$

*intuisi:* Misal kita punya 3 kelereng merah ( $R$ ) dan 5 kelereng biru ( $B$ ), jika kita ambil satu kelereng, lalu tanpa pengembalian kita ambil lagi 1 kelereng yang lain, berapa peluang  $P(R, B)$ . Pertama peluang terambil  $R$  di pengambilan pertama adalah  $P(R) = \frac{3}{8}$ , lalu peluang terambil  $B$  di pengambilan kedua adalah  $P(B|R) = \frac{5}{7}$  sehingga  $P(R, B) = P(R) \times P(B|R) = P(B|R) \times P(R) = \frac{5}{7} \times \frac{3}{8} = \frac{15}{56}$ .

*Teorema Bayes:*

$$\underbrace{P(X|Y)}_{posterior} = \frac{\underbrace{P(Y|X)P(X)}_{likelihood \ prior}}{\underbrace{P(Y)}_{evidence}}$$

dengan

- $P(X)$ : prior  $\rightarrow$  keyakinan awal tentang  $X$ .

- $P(\cdot | X)$ : likelihood → seberapa mungkin kita mengamati jika  $X$  benar.
- $P(X | \cdot)$ : posterior → keyakinan baru tentang  $X$  setelah melihat data .
- $P(\cdot)$ : evidence → faktor normalisasi supaya hasilnya tetap jadi probabilitas valid.

### Contoh 3: Kantong Permen

Misalkan ada dua kantong permen:

- Kantong A: 70% merah , 30% hijau .
- Kantong B: 30% merah , 70% hijau .

Kita pilih satu kantong secara acak (probabilitas 50%-50%), lalu ambil satu permen.

Jika ternyata permennya merah. *Seberapa besar peluang kita memilih dari Kantong A?*

Definisikan:

- $H_A$ : Peluang terpilih kantong A.
- $H_B$ : Peluang terpilih kantong B.
- $E$ : Peluang terambil permen merah.

Kita memiliki informasi awal yakni:

- Prior:  $H_A = H_B = 0.5$ .
- Likelihood:  $P(E | H_A) = 0.7$ ,  $P(E | H_B) = 0.3$ .

Teorema Bayes:

$$P(H_A | E) = \frac{P(E | H_A) P(H_A)}{P(E)}$$

Dengan:

$$\begin{aligned} P(E) &= P(E | H_A)P(H_A) + P(E | H_B)P(H_B) \\ &= (0.7)(0.5) + (0.3)(0.5) = 0.35 + 0.15 = 0.5 \end{aligned}$$

Sehingga:

$$P(H_A | E) = \frac{0.7 \times 0.5}{0.5} = 0.7$$

Artinya, setelah melihat permen merah, peluang bahwa kantong yang dipilih adalah Kantong A naik dari 50% → 70%.

## 6.4 Summary Statistics and Independence

### 6.4.1 Means and Covariances

## Mean

Mean (Nilai ekspektasi) dari suatu variabel acak  $X$  dengan  $x \in \mathbb{R}^D$  adalah rerata dan didefinisikan sebagai:

$$E_X[x] = \begin{bmatrix} E_{X_1}[x_1] \\ \vdots \\ E_{X_D}[x_D] \end{bmatrix} \in \mathbb{R}^D$$

di mana

$$E_{X_d}[x_d] = \begin{cases} \sum_{x_d \in \mathcal{X}} x_d p(x_d) dx_d, & \text{ika kontinu} \\ \sum_{x_i \in \mathcal{X}} x_i p(x_d = x_i), & \text{ika diskret}, \end{cases} \quad d = 1, \dots, D$$

Misal kita punya data sebagai berikut:

	probability	X	Y
State 1: Panas	0.5	Rp9jt	Rp8jt
State 2: Biasa	0.3	Rp5jt	Rp6jt
State 3: Dingin	0.2	Rp3jt	Rp4jt

(Tabel 1: pengaruh hawa cuaca terhadap penjualan produk X dan Y)

Maka nilai harapan untuk X dan Y adalah

$$\begin{aligned} E[X] &= (0.5)(9jt) + (0.3)(5jt) + (0.2)(3jt) \\ &= 6.6jt \\ E[Y] &= (0.5)(8jt) + (0.3)(6jt) + (0.2)(4jt) \\ &= 6.6jt \end{aligned}$$

Note: kadangkala mean juga ditulis sebagai  $\mu$ .

## Kovarians Univariat

Kovarians untuk variabel acak univariat  $X$  dan  $Y$  adalah ekspektasi dari perkalian antara selisih (deviasi) nilai dengan ekspektasinya keduanya:

$$Cov_{X,Y}[x, y] = E_{X,Y}[(x - \mu_x)(y - \mu_y)] = E[X] - E[X]E[Y]$$

Note: Kovarian antara suatu variabel dengan dirinya sendiri ( $Cov[x, x]$ ) disebut *varians* ( $V_X(x)$ ), dan akar dari varians disebut *standar deviasi* ( $\sigma_x$ ).

### Kovarians Multivariat

untuk variabel acak multivariat  $X$  dan dengan  $x \in \mathbb{R}^D$  dan  $y \in \mathbb{R}^E$  maka:

$$Cov[x, y] = E[xy^T] - E[x]E[y]^T = Cov[y, x]^T \in \mathbb{R}^{D \times E}$$

### Korelasi

$$\text{corr}[x, y] = \frac{Cov[x, y]}{\sigma_x \sigma_y} \in [-1, 1]$$

Korelasi menunjukkan hubungan antara dua variabel, jika nilai korelasi mendekati 1 maka kedua variabel mempunyai *korelasi positif* (jika  $x$  meningkat  $y$  meningkat dan sebaliknya), jika nilai korelasi mendekati  $-1$  maka kedua variabel mempunyai *korelasi negatif* (jika  $x$  meningkat  $y$  menurun dan sebaliknya), jika korelasi bernilai 0 maka kedua variabel tidak saling berhubungan.

## 6.4.2 Empirical Means and Covariances

Dalam praktik, kita jarang tahu data distribusi populasi/penuh, melainkan data sampel/empiris.

Dalam kasus ini, maka mean adalah:

$$\bar{x} := \frac{1}{N} \sum_{n=1}^N x_n$$

di mana  $x_n \in \mathbb{R}^D$ , dan korelasinya adalah:

$$\Sigma := \frac{1}{N} \sum_{n=1}^N (x_n - \bar{x})(x_n - \bar{x})^T \in \mathbb{R}^{D \times D}$$

## 6.4.3 Three Expressions for the Variance

- $\text{ar}[X] = \mathbb{E}[(X - \mathbb{E}[X])^2]$
- $\text{ar}[X] = \mathbb{E}[X^2] - (\mathbb{E}[X])^2$

- $\text{ar}[X] = \text{o}[X, X]$

## 6.4.4 Sums and Transformations of Random Variables

- $E[aX + b] = aE[X] + b$
- $\text{Var}[aX + b] = a^2\text{Var}[X]$

## 6.4.5 Statistical Independence

Dua variabel acak  $X$ , disebut independen secara statistik jika dan hanya jika:

$$p(x, y) = p(x)p(y)$$

Jika  $X$ , independen, maka:

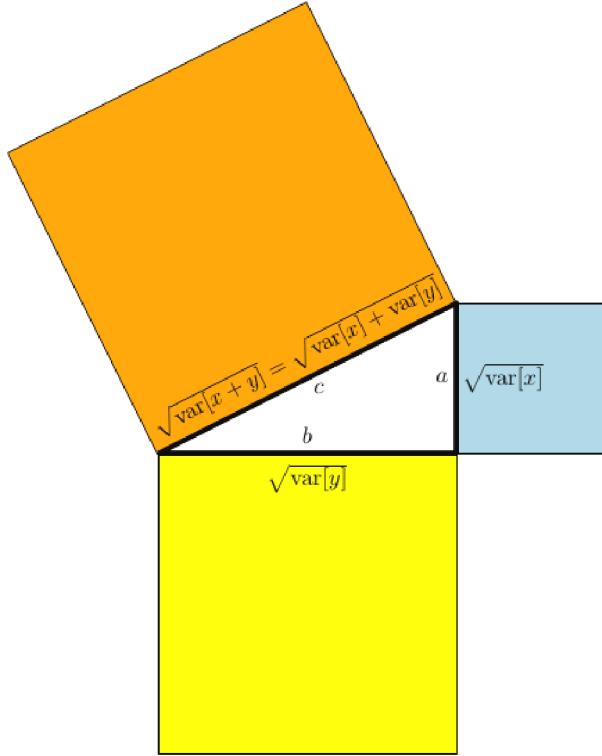
- $p(y|x) = p(y)$
- $p(x|y) = p(x)$
- $V_{X,Y}[x + y] = V_X[x] + V_Y[y]$
- $\text{Cov}_{X,Y}[x, y] = 0$

Note: poin terakhir tidak berlaku sebaliknya.

## 6.4.6 Inner Products of Random Variables

Kita tahu bahwa untuk dua variabel acak yang tidak berkorelasi maka:

$$V[X + Y] = V[X] + V[Y]$$



$$\begin{aligned}
 \langle X, \rangle &:= Cov[x, y] \\
 \|X\| &= \sqrt{Cov[x, x]} = \sqrt{V[x]} = \sigma_x \\
 \cos \theta &= \frac{\langle X, \rangle}{\|X\| \|y\|} = \frac{Cov[x, y]}{\sigma_x \sigma_y}
 \end{aligned}$$

## 6.5 Gaussian Distribution (Normal Distribution)

### Distribusi Gaussian Univariat

Suatu variabel acak kontinu  $X \in \mathbb{R}$  dikatakan mengikuti *distribusi Gaussian* dengan mean  $\mu$  dan varians  $\sigma^2$  dinotasikan  $X \sim \mathcal{N}(\mu, \sigma^2)$  jika pdf-nya berbentuk:

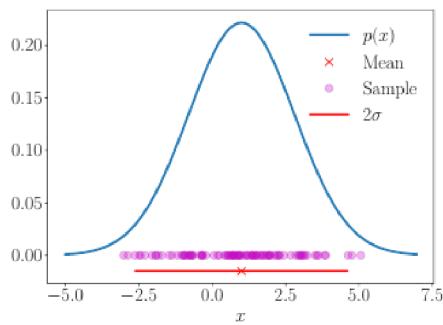
$$p(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma^2}} \exp\left(-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}\right)$$

### Distribusi Gaussian Multivariat

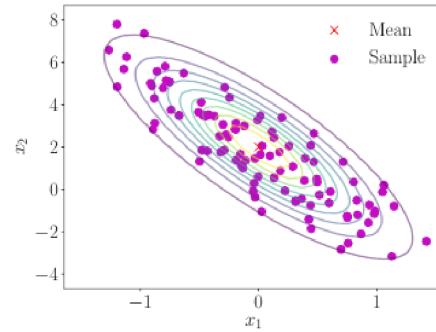
Untuk vektor acak  $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^D$ , distribusi gaussian didefiniskan dengan mean vektor  $\mu$  dan matriks kovarians  $\Sigma$  dinotasikan  $x \sim \mathcal{N}(\mu, \Sigma)$  jika pdf-nya:

$$p(x) = (2\pi)^{-\frac{D}{2}} |\Sigma|^{-\frac{1}{2}} \exp -\frac{1}{2} (x - \mu)^T \Sigma^{-1} (x - \mu)$$

Grafik dari distribusi gaussian membentuk lonceng dengan sebaran data simetris terhadap  $\mu$ .



(a) Univariate (one-dimensional) Gaussian; The red cross shows the mean and the red line shows the extent of the variance.



(b) Multivariate (two-dimensional) Gaussian, viewed from top. The red cross shows the mean and the colored lines show the contour lines of the density.

## 6.5.1 Marginal dan Kondisional dari Gaussian juga Gaussian

Misal  $X$  dan  $y$  adalah variabel acak multivariat, kita dapat menulis gaussian dalam bentuk sebagai berikut:

$$p(x, y) = \mathcal{N} \left( \begin{bmatrix} \mu_x \\ \mu_y \end{bmatrix}, \begin{bmatrix} \Sigma_{xx} & \Sigma_{xy} \\ \Sigma_{yx} & \Sigma_{yy} \end{bmatrix} \right)$$

distribusi kondisional  $p(x|y)$  juga gaussian, dengan:

$$\begin{aligned} p(x|y) &= \mathcal{N}(\mu_{x|y}, \Sigma_{x|y}), \text{ dengan:} \\ \mu_{x|y} &= \mu_x + \Sigma_{xy}\Sigma_{yy}^{-1}(y - \mu_y) \\ \Sigma_{x|y} &= \Sigma_{xx} + \Sigma_{xy}\Sigma_{yy}^{-1}\Sigma_{yx} \end{aligned}$$

dan distribusi marginal  $p(x)$  diberikan:

$$p(x) = \int p(x, y) dy = \mathcal{N}(x|\mu_x, \Sigma_{xx})$$

### Contoh 4: Marginal & Kondisional Gaussian

Untuk suatu distribusi Gaussian bivariate

$$p(\mathbf{x}) = \mathcal{N} \left( \begin{bmatrix} 0 \\ 2 \end{bmatrix}, \begin{bmatrix} 0.3 & -1 \\ -1 & 5 \end{bmatrix} \right), \quad \mathbf{x} = \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix}$$

Akan dihitung:

(a) Distribusi kondisional  $p(x_1 | x_2 = -1)$ .

(b) Distribusi marginal  $p(x_1)$ .

Partisi mean dan kovarians sesuai variabel:

$$= \begin{bmatrix} \mu_1 \\ \mu_2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 \\ 2 \end{bmatrix}, \quad \Sigma = \begin{bmatrix} \Sigma_{11} & \Sigma_{12} \\ \Sigma_{21} & \Sigma_{22} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0.3 & -1 \\ -1 & 5 \end{bmatrix}.$$

dengan  $|\Sigma| = 0.3 \cdot 5 - (-1)^2 = 1.5 - 1 = 0.5 > 0$

(a) Kondisional:  $p(x_1 | x_2 = -1)$

Kita masukkan  $b = -1$ .

- Hitung  $\Sigma_{22}^{-1} = 1/5 = 0.2$ .
- Mean kondisional:

$$\mu_{1|2} = 0 + (-1) \cdot 0.2 \cdot (-1 - 2) = (-0.2) \cdot (-3) = 0.6.$$

- Varians kondisional:

$$\Sigma_{1|2} = 0.3 - (-1) \cdot 0.2 \cdot (-1) = 0.3 - 0.2 = 0.1.$$

Sehingga

$$p(x_1 | x_2 = -1) = \mathcal{N}(x_1 | 0.6, 0.1)$$

Interpretasi singkat: mengetahui  $x_2 = -1$  menggeser mean dari 0 menjadi 0.6 dan mengecilkan varians dari 0.3 menjadi 0.1 – yaitu ketidakpastian mengenai  $x_1$  berkurang dan pusat tebakan bergeser sesuai korelasi negatif di kovarians.

(b) Marginal:  $p(x_1)$

Untuk marginal cukup ambil komponen mean dan varians yang sesuai:

$$p(x_1) = \mathcal{N}(x_1 | 0, 0.3)$$

Catatan: varians marginal (0.3) lebih besar daripada varians kondisional (0.1) – ini sesuai: informasi tambahan tentang  $x_2$  menurunkan ketidakpastian terhadap  $x_1$ .

## 6.6 Conjugacy and the Exponential Family

### 6.6.1 Conjugacy

Dalam Bayesian inference:

$$p(\theta|\mathcal{D}) \propto p(\mathcal{D}|\theta) p(\theta).$$

Jika prior  $p(\theta)$  dan likelihood  $p(\mathcal{D}|\theta)$  dipilih dengan tepat, maka posterior  $p(\theta|\mathcal{D})$  berada dalam keluarga distribusi yang sama dengan prior. Disebut conjugate prior.

Contohnya jika kita mempunyai distribusi dengan Likelihood:  $X \sim \text{ernoulli}(\theta)$ , Prior:  $\theta \sim \text{eta}(\alpha, \beta)$ . Maka Posterior tetap Beta dengan parameter diperbarui:

$$\theta|\mathcal{D} \sim \text{eta}(\alpha + \text{jumlah sukses}, \beta + \text{jumlah gagal}).$$

*Intuisi:* conjugacy membuat update distribusi seperti menambahkan catatan baru ke parameter prior.

## 6.6.2 Sufficient Statistics

### Sufficient Statistics

Fungsi dari data  $T(\mathcal{D})$  disebut *sufficient statistic* untuk parameter  $\theta$  jika:

$$p(\mathcal{D}|\theta) = g(\mathcal{D}) h(T(\mathcal{D}), \theta),$$

sehingga semua informasi tentang  $\theta$  dalam data dapat diringkas hanya melalui  $T(\mathcal{D})$ .

Contoh pada distribusi normal dengan varian diketahui maka sufficient statisticnya adalah rata-rata data. Lalu pada distribusi Bernoulli maka sufficient statisticnya jumlah sukses.

## 6.6.3 Exponential Family

Banyak distribusi populer bisa ditulis dalam bentuk *Exponential Family*:

$$p(x|\theta) = h(x) \exp\left((\theta)^\top T(x) - A((\theta))\right),$$

dengan:

- $h(x)$ : base measure
- $T(x)$ : sufficient statistics
- $(\theta)$ : natural parameter
- $A()$ : log-partition function (normalizer)

## 6.7 Change of Variables / Inverse Transform

## 6.7.1 Distribution Function Technique

Teknik distribution function bertumpu pada sifat cumulative distribution function (CDF). Misalkan  $X$  adalah variabel acak dengan distribusi yang diketahui, dan kita definisikan variabel acak baru  $Y = g(X)$  dengan  $g$  fungsi monoton. Distribusi dapat diperoleh dengan mendefinisikan CDF dari  $Y$  sebagai

$$F(y) = P(Y \leq y) = P(g(X) \leq y).$$

Dari bentuk ini, fungsi densitas probabilitas (pdf)  $f(y)$  diperoleh dengan diferensiasi terhadap  $y$ :

$$f(y) = \frac{d}{dy} F(y).$$

### Contoh 5: Distribution Function Technique

Misalkan  $X \sim U(0, 1)$  dengan pdf  $f_X(x) = 1$  untuk  $0 \leq x \leq 1$ . Definisikan  $Y = X^2$ . Untuk memperoleh distribusi  $Y$ , kita gunakan teknik distribution function. Pertama kita hitung CDF:

$$F(y) = P(Y \leq y) = P(X^2 \leq y) = P(X \leq \sqrt{y}).$$

Karena  $X$  seragam pada  $(0, 1)$ , maka  $F(y) = \sqrt{y}$  untuk  $0 \leq y \leq 1$ . Diferensiasi terhadap  $y$  menghasilkan pdf:

$$f(y) = \frac{d}{dy} F(y) = \frac{1}{2\sqrt{y}}, \quad 0 \leq y \leq 1.$$

## 6.7.2 Change of Variables

Pendekatan kedua adalah melalui transformasi langsung pada pdf menggunakan aturan change of variables. Misalkan  $Y = g(X)$  dengan  $g$  invertibel dan terdiferensialkan. Maka pdf dari  $Y$  adalah

$$f(y) = f_X(g^{-1}(y)) \cdot \left| \frac{d}{dy} g^{-1}(y) \right|.$$

Untuk kasus multivariat  $\mathbf{Y} = g(\mathbf{x})$ , hasilnya menjadi

$$f_{\mathbf{Y}}(\mathbf{y}) = f(g^{-1}(\mathbf{y})) \cdot |\det J_{g^{-1}}(\mathbf{y})|,$$

dengan  $J_{g^{-1}}$  adalah Jacobian dari fungsi invers  $g^{-1}$ .

## Contoh 6: Change of Variables

Misalkan  $X \sim U(0, 1)$  dengan pdf  $f_X(x) = 1$  untuk  $0 \leq x \leq 1$ . Definisikan  $y = -\ln(X)$ .

Karena  $X = e^{-y}$ , kita dapatkan

$$\frac{d}{dy}x = \frac{d}{dy}e^{-y} = -e^{-y}.$$

Maka pdf dari  $y$  adalah

$$f(y) = f_X(e^{-y}) \cdot |-e^{-y}| = 1 \cdot e^{-y} = e^{-y}, \quad y \geq 0.$$

Dengan demikian,  $y$  berdistribusi eksponensial dengan parameter 1.