

Дискретная математика

Григорьева Н.С.¹

13.09.2023 - ...

¹"Записал Сергей Киселев"

Оглавление

1	Комбинаторика	2
1.1	Основные определения	2
1.2	Множества	3
1.3	Разбиения	4
2	Алгоритмы перебора	5
2.1	Перебор 0-1 векторов	5
2.2	Перебор прямого произведения	6
2.3	Перебор перестановок	6
2.4	Перебор перестановок в лексикографическом порядке (другой способ)	7
2.5	Перебор с минимальным изменением	8
2.6	Сочетания и бином Ньютона	9
2.7	Перебор сочетаний с хорошей нумерацией	10
2.8	Фибоначчи	10
2.9	Фибоначчиева система счисления	11
3	Элементарная теория вероятностей	12
3.1	Основные понятия	12
3.2	Случайные величины	14
3.3	Математическое ожидание	14
3.4	Дисперсия	15
3.5	Схема Бернулли	16
3.6	Случайные числа и схема Уолкера	17
3.7	Двоичный поиск и неравенство Крафта.	18
3.8	Задача о наилучших длинах кодов	21
3.9	Энтропия	22

Глава 1

Комбинаторика

Лекция 1: Введение

13.09.2023

1.1 Основные определения

Определение 1. Перестановкой называется упорядоченный набор неповторяющихся элементов длины n , состоящий из элементов от 1 до n .

Число перестановок: $P_n = n!$

Определение 2. Размещением называется упорядоченный набор неповторяющихся элементов длины k , состоящий из элементов от 1 до n .

Число размещений: $A_n^k = n(n-1)(n-2) \cdot \dots \cdot (n-k+1) =$
 $= \frac{n(n-1)(n-2) \cdot \dots \cdot (n-k+1)(n-k)!}{(n-k)!} = \frac{n!}{(n-k)!}$

Определение 3. Сочетанием называется набор неповторяющихся элементов длины k , состоящий из элементов от 1 до n .

Число сочетаний: $C_n^k = \frac{A_n^k}{k!} = \frac{n!}{k!(n-k)!}$

Определение 4. Перестановки с повторениями: $\overline{P}_n = \frac{n!}{n_1! \cdot n_2! \cdot \dots \cdot n_k!}$

Определение 5. Размещения с повторениями: $\overline{A}_n^k = n^k$

Определение 6. Сочетания с повторениями: $\overline{C}_n^k = C_{n+k-1}^k$

Пример. (Толкование к сочетаниям с повторениями) Сколькими способами можно разложить пять одинаковых шаров по трём различным ящикам? На число шаров в ящике ограничений нет.

Решение:

Представим себе, что ящики стоят вплотную друг к другу. Три та-

ких ящика — это фактически две перегородки между ними. Обозначим шар нулём, а перегородку — единицей. Тогда любому способу раскладывания пяти шаров по трём ящикам однозначно соответствует последовательность из пяти нулей и двух единиц; и наоборот, каждая такая последовательность однозначно определяет некоторый способ раскладывания. Например, 0010010 означает, что в первом ящике лежат два шара, во втором — два шара, в третьем — один шар; последовательность 0000011 соответствует случаю, когда все пять шаров лежат в первом ящике.

Теперь ясно, что способов разложить пять шаров по трём ящикам существует ровно столько же, сколько имеется последовательностей из пяти нулей и двух единиц. А число таких последовательностей равно C_7^2

1.2 Множества

Теорема 1. (Формула включений-исключений)

$$|A_1 \cup A_2 \cup \dots \cup A_n| = |\bigcup_{i=1}^n A_i| = \\ = \sum_{i=1}^n |A_i| - \sum_{1 \leq i < j \leq n} |A_i \cap A_j| + \sum_{1 \leq i < j < k \leq n} |A_i \cap A_j \cap A_k| - \dots + (-1)^{n-1} |A_1 \cap A_2 \cap \dots \cap A_n|$$

Доказательство. (докажем по индукции)

1. База индукции: $n = 2$: $|A_1 \cup A_2| = |A_1| + |A_2| - |A_1 \cap A_2|$

2. Переход индукции: $n \rightarrow n + 1$:

$$|A_1 \cup A_2 \cup \dots \cup A_{n+1}| = |A_1 \cup A_2 \cup \dots \cup A_n| + |A_{n+1}| - |(A_1 \cup A_2 \cup \dots \cup A_n) \cap A_{n+1}| =$$

$$= \sum_{i=1}^n |A_i| - \sum_{1 \leq i < j \leq n} |A_i \cap A_j| + \sum_{1 \leq i < j < k \leq n} |A_i \cap A_j \cap A_k| - \\ - \dots + (-1)^{n-1} |A_1 \cap A_2 \cap \dots \cap A_n| + |A_{n+1}| - |(A_1 \cap A_{n+1}) \cup (A_2 \cap A_{n+1}) \cup \dots \cup (A_n \cap A_{n+1})| =$$

$$= \sum_{i=1}^n |A_i| - \sum_{1 \leq i < j \leq n} |A_i \cap A_j| + \sum_{1 \leq i < j < k \leq n} |A_i \cap A_j \cap A_k| - \\ - \dots + (-1)^{n-1} |A_1 \cap A_2 \cap \dots \cap A_n| - \left(\sum_{i=1}^n |A_i \cap A_{n+1}| - \right.$$

$$\begin{aligned}
 & - \sum_{1 \leq i < j \leq n} |A_i \cap A_j \cap A_{n+1}| + \dots (-1)^{n-1} |A_1 \cap A_2 \cap \dots \cap A_{n+1}|) = \\
 & = \sum_{i=1}^{n+1} |A_i| - \sum_{1 \leq i < j \leq n+1} |A_i \cap A_j| + \sum_{1 \leq i < j < k \leq n+1} |A_i \cap A_j \cap A_k| - \\
 & \dots + (-1)^n |A_1 \cap A_2 \cap \dots \cap A_{n+1}|
 \end{aligned}$$

□

1.3 Разбиения

Определение 7. Пусть A — множество. Имеется A_1, A_2, \dots, A_n . Совокупность этих множеств — разбиение, если: $A = \bigcup_{i=1}^n A_i$; $A_i \cap A_j = \emptyset$

Определение 8. Пусть у A есть разбиения \mathcal{A} и \mathcal{B} . Тогда \mathcal{B} — измельчение \mathcal{A} , если $\forall B_i \in \mathcal{B} \exists! A_j \in \mathcal{A} : B_i \subset A_j$

Определение 9. Произведение разбиений — разбиение, которое является измельчением \mathcal{A} и \mathcal{B} и является самым крупным измельчением.

Лекция 2: Разбиения, прямое произведение, нумерация

20.09.2023

Теорема 2. Произведение разбиений существует.

Доказательство. \mathcal{A}, \mathcal{B} — разбиения.

Возьмем все множества вида $C_{ij} = A_i \cap B_j$

- \mathcal{C} — измельчение \mathcal{A} , так как $\forall C_{ij} \exists A_i : C_{ij} \subset A_i$
- аналогично \mathcal{C} — измельчение \mathcal{B}

Предположим, что F — измельчение, большее \mathcal{C} , тогда:

$$\forall F_k : \begin{cases} \exists A_i : F_k \subset A_i \\ \exists B_j : F_k \subset B_j \end{cases} \Rightarrow F_k \subset A_i \cap B_j \Rightarrow F_k \subset C_{ij}$$

из измельчений.

□

Глава 2

Алгоритмы перебора

2.1 Перебор 0-1 векторов

Будем рассматривать множество B^m всех наборов из m битов, каждый из которых может быть нулем и единицей. Элемент множества B^m — вектор $(0, 0, 1, \dots, 1)$ длиной m . Количество элементов в множестве (мощность): $|B^m| = 2^m$.

Для того, чтобы создать вычислительный процесс, при котором на каждом шаге будет формироваться новый, не встречавшийся ранее, элемент рассматриваемого множества, достаточно заметить, что существует взаимнооднозначное соответствие между числами из $0 \dots 2^m - 1$ и наборами 0-1 векторов. Т. е. достаточно первым взять число 0 и его двоичное представление $(0, \dots, 0)$, а затем просто добавлять по единице, имитируя это на текущем наборе, пока мы не дойдем до набора из одних единиц.

Кроме рассмотренного способа перебора наборов, можно предложить другой алгоритм, который на каждом шаге меняет значение только одной компоненты:

Алгоритм. (Перебор и нумерация 0-1 векторов в порядке минимального изменения)

- создаем 2 набора x и y , каждый из m битов. Первоначально $x = y = (0, 0, 0, 0)$
- прибавляем к x единицу и фиксируем позицию j , где произошло изменение.
- изменить j -ую компоненту в наборе $y : y_j = 1 - y_j$
- вернуть y

Пример. (Рассмотрим на примере $m = 4$)

x	y	j
0000	0000	-
0001	0001	4
0010	0011	3
0011	0010	4
0100	0110	2
0101	0111	4

2.2 Перебор прямого произведения

Рассматриваем множество $M(1:k) = M_1 \times M_2 \times \dots \times M_k$. Число элементов: $\prod_{i \in 1:k} m_i$, где $m_i = |M_i|$.

Будем считать, что каждое M_i состоит из m_i элементов, которые мы будем нумеровать от 0 до $m_i - 1$. Тогда каждый элемент $M(1:k)$ — последовательность неотрицательных чисел $(r_1, \dots, r_k), r_i < m_i$

Общая формула перехода от элемента (r_1, \dots, r_k) к номеру этого элемента:

$$\text{num}(r_1, \dots, r_k) = \sum_{i=1}^k \left(\prod_{j=1}^{i-1} m_j \right) r_i$$

2.3 Перебор перестановок

Рассмотрим множество $T_k = M_1 \times M_2 \times \dots \times M_k, M_i = \{0, 1, \dots, i-1\}, |T_k| = k!$. Обозначим множество всех перестановок из k элементов через P_k .

Построим взаимнооднозначное соответствие между T_k и P_k . Возьмем перестановку (r_1, \dots, r_k) и сопоставим ей элемент (t_1, \dots, t_k) следующим образом: $\forall i \in 1:k$ найдем число значений, меньших r_i среди r_{i+1}, \dots, r_k — это число перепишем в качестве t_i .

Пример.

i	1	2	3	4	5	6	7	8
r_i	4	8	1	5	7	2	3	6
t_i	3	6	0	2	3	0	0	0

Чтобы получить перестановку по записи (t_1, \dots, t_k) , нужно помнить множество значений S_i , которые могут быть в перестановке на i -ом месте. Так, $S_1 = 1:8, t_1 = 3$ означает, что $r_1 = 4$. Далее $S_2 = 1:3 \cup 5:8, t_2 = 6$ значит, что $r_2 = 8$

Замечание. Если использовать отображение из примера при переборе, то перестановки будут идти в лексикографическом порядке. Это значит, что:

(r_1, \dots, r_k) предшествует $(R_1, \dots, R_k) \Leftrightarrow$ начала этих перестановок совпадают до i индекса, а далее $r_i < R_i$

Замечание. Очевидно, что если факториальная запись (t_1, \dots, t_k) лек-

сикографически предшествует другой, то порядок верен и для соответствующих перестановок.

Алгоритм. (Перебор перестановок в лексикографическом порядке)

1. в заданной перестановке (r_1, \dots, r_k) найдем наибольший суффикс (r_t, \dots, r_k) , в котором элементы расположены по убыванию.
2. выбрать в (r_t, \dots, r_k) элемент, следующий по величине после r_{t-1} и поставить его на r_{t-1} . Оставшиеся элементы, включая r_{t-1} расположить за ним в порядке возрастания.

Пример.

3	4	2	1	7	8	9	5	6
3	4	2	1	7	8	9	6	5
3	4	2	1	7	9	5	6	8
3	4	2	1	7	9	5	8	6
3	4	2	1	7	9	6	5	8
3	4	2	1	7	9	6	8	5
3	4	2	1	7	9	8	5	6
3	4	2	1	7	9	8	6	5
3	4	2	1	8	5	6	7	9

Лекция 3: Продолжение

27.09.2023

2.4 Перебор перестановок в лексикографическом порядке (другой способ)

Алгоритм. Будем брать элементы (t_1, \dots, t_k) из T_k и сопоставлять им перестановки так, как делали ранее. Переход к следующей перестановке осуществляется путем прибавления единицы к (t_1, \dots, t_k) . (причем последний элемент в (t_1, \dots, t_k) всегда ноль, т.к. ничего не значит)

Пример. (для P_4)

num	t	p
0	(0, 0, 0, 0)	(1, 2, 3, 4)
1	(0, 0, 1, 0)	(1, 2, 4, 3)
2	(0, 1, 0, 0)	(1, 3, 2, 4)
3	(0, 1, 1, 0)	(1, 3, 4, 2)
4	(0, 2, 0, 0)	(1, 4, 2, 3)
5	(0, 2, 1, 0)	(1, 4, 3, 2)
6	(0, 3, 0, 0)	(2, 1, 3, 4)
\vdots	\vdots	\vdots
23	(3, 2, 1, 0)	(4, 3, 2, 1)

2.5 Перебор с минимальным изменением

На каждой итерации будем менять только два соседних элемента. Для этого необходимо:

- берем последний элемент в перестановке и меняем его с соседом до тех пор, пока элемент не дойдет до начала.
- когда этот элемент оказался в начале, мы меняем у него направление: теперь он будет меняться с соседом справа, а элемент, который оказался на последней позиции, делает 1 шаг (и так каждый раз, когда наш первый элемент меняет направление). Такие действия применяются ко всем элементам в перестановке.

Алгоритм. Кроме самой перестановки p и ее номера t (на этот раз младший разряд в номере — последний), будем хранить массив d , в котором будем хранить направление движения элементов. Если элемент движется вправо, то $d[i] = +$, если влево, то $d[i] = -$. Начальное значение $d[i] = -$ для всех i .

Также храним j где будем записывать индекс элемента в t , в котором значение увеличилось.

1. Прибавляем 1 к t
2. Определяем номер разряда в котором значение увеличивается на 1, записываем в j
3. $\forall i \in [1, n] : i > j$, меняем $d_i = -d_i$.
4. j (не номер, именно такой элемент) меняем с соседом слева если $d_j = -$, и с соседом справа, если $d_j = +$.

Пример.

num	t	d	p	j
0	0000	— — — —	1234	-
1	0001	— — — —	1243	4
2	0002	— — — —	1423	4
3	0003	— — — —	4123	4
4	0010	— — — +	4132	3
5	0011	— — — +	1432	4
6	0012	— — — +	1342	4
⋮	⋮	⋮	⋮	⋮
19	0113	— — ++	4231	4
20	0120	— — ++	4213	3
21	0121	— — ++	2413	4
22	0122	— — ++	2143	4
23	0123	— — ++	2134	4
24	1000	— + — —	—	1

2.6 Сочетания и бином Ньютона

$$C_n^k = \frac{n!}{k!(n-k)!}$$

Свойства. (Свойства сочетаний)

1. $C_n^k = C_n^{n-k}$
2. $C_{n-1}^k + C_{n-1}^{k-1} = C_n^k$

Доказательство. Доказывается путем подстановки непосредственно в формулу, или можно рассматривать пути на целочисленной решетке. \square

Теорема 3. (Бином Ньютона)

$$\forall a, b \in \mathbb{R}, n \in \mathbb{N}_0 : (a + b)^n = \sum_{k=0}^n C_n^k a^k b^{n-k}$$

Доказательство. (По индукции)

1. База $n = 1$ очевидна.
2. индукционный переход $n - 1 \rightarrow n$:

$$\begin{aligned} (a + b)^n &= (a + b)(a + b)^{n-1} = a(a + b)^{n-1} + b(a + b)^{n-1} = \\ &= a \cdot \sum_{k=0}^{n-1} C_{n-1}^k a^k b^{n-1-k} + b \cdot \sum_{k=0}^{n-1} C_{n-1}^k a^k b^{n-1-k} = \\ &= \sum_{k=0}^{n-1} C_{n-1}^k a^{k+1} b^{n-1-k} + \sum_{k=0}^{n-1} C_{n-1}^k a^k b^{n-k} = \\ &= \sum_{k=1}^n C_{n-1}^{k-1} a^k b^{n-k} + \sum_{k=0}^{n-1} C_{n-1}^k a^k b^{n-k} = \\ &= a^n + \sum_{k=1}^{n-1} C_{n-1}^{k-1} a^k b^{n-k} + b^n + \sum_{k=1}^{n-1} C_{n-1}^k a^k b^{n-k} = \\ &= a^n + b^n + \sum_{k=1}^{n-1} (C_{n-1}^{k-1} + C_{n-1}^k) a^k b^{n-k} = (a + b)^n \end{aligned}$$

\square

2.7 Перебор сочетаний с хорошей нумерацией

Для того чтобы присваивать номер сочетанию, будем рассматривать сочетание как вектор из нулей и единиц: если элемент взяли — единица, иначе — ноль.

Пример. Вектору $b = (1, 0, 1, 1, 1, 0, 0, 0)$ соответствует сочетание 1345.

Алгоритм. определяем номер рекурсивно:

$$num(b[1 : n - 1], m) = \begin{cases} num(b[1 : n - 1], m), & \text{если } b[n] = 0, \\ num(b[1 : n - 1], m - 1), & \text{если } b[n] = 1, \end{cases}$$

Где m — кол-во единиц.

Пример. Рассмотрим $b = (1, 0, 1, 1, 1, 0, 0, 0)$, $m = 4$:

$$\begin{aligned} num(b, m) &= C_6^4 + num(b[1 : n - 1], 3) = \\ &= C_6^4 + C_4^3 + num(b[1 : n - 2], 3) = \\ &= C_6^4 + C_4^3 + num(b[1 : n - 3], 2) = \\ &= C_6^4 + C_4^3 + num(b[1 : n - 4], 2) = \\ &= C_6^4 + C_4^3 + C_2^2 + num(b[1 : n - 5], 1) = \\ &= C_6^4 + C_4^3 + C_2^2 + 0 = 15 + 4 + 1 = 20 \end{aligned}$$

Лекция 4: Фибоначчи и теория вероятностей

04.10.2023

2.8 Фибоначчи

Определение 10. Последовательность Фибоначчи определяется как:

$$\begin{cases} F_0 = 0, \\ F_1 = 1, \\ F_n = F_{n-1} + F_{n-2}, n \geq 2. \end{cases}$$

Лемма 1.

$$F_{2k} = F_{2k-1} + F_{2k-3} + \dots + F_1$$

$$F_{2k-1} = F_{2k} + F_{2k-2} + \dots + F_0 + 1$$

Доказательство. Докажем по индукции. База: $k = 1$:

$$F_2 = F_1 + F_0 = 1 + 0 = 1.$$

$$F_1 = F_0 + 1 = 0 + 1 = 1.$$

Переход: $k \rightarrow k + 1$. По предположению индукции:

$$F_{2k} = F_{2k-1} + F_{2k-3} + \dots + F_1. \text{ Тогда } F_{2k+2} = F_{2k+1} + F_{2k-1} + \dots + F_1 + F_0 = F_{2k+1} + F_{2k}. \text{ Аналогично для нечетных. } \square$$

Теорема 4. (Представление натуральных чисел в виде суммы чисел Фибоначчи)

$$\forall S \in \mathbb{N} : S = F_{i_0} + F_{i_1} + \dots + F_{i_s}$$

Где $i_0 = 0, i_{k-1} + 1 < i_k : k \in 1 : s$

Доказательство. Докажем, что такое представление существует. Пусть $j(s)$ — номер максимального числа Фибоначчи, не большего чем S . Положим $S' = S - F_{j(s)}$. Предположим, что $S' > F_{j(s)-1}$, тогда: $S' > F_{j(s)-1} \Rightarrow S > F_{j(s)} + F_{j(s)-1} \Rightarrow S > F_{j(s)+1}$, но по лемме $S \leq F_{j(s)+1}$ — противоречие, значит $S' < F_{j(s)-1}$

Далее можно построить представление для S' , итоговое число S представляется в виде представления для S' , дополненное слагаемым $F_{j(s)}$

Проверим однозначность представления: пусть $S = F_{j_0} + \dots + F_{j_q}(2)$. Не умоляя общности, $j_q < j(s)$ (больше быть не может, а равные можно отбросить). Заменяем F_{j_q} на $F_{j(s)-1}$, тогда правая часть равенства (2) увеличится. Будем заменять F_{j_q-1} на $F_{j(s)-3}$ и т.д. Но при таких заменах сумма не превзойдет $F_{j(s)}$ по лемме, значит, представление для S однозначно. \square

2.9 Фибоначчиева система счисления

Вектор набора (i_0, i_1, \dots, i_s) — запись числа S в фибоначчиевой системе счисления.

Алгоритм. (Прибавление единицы в фибоначчиевой системе счисления)

- Начальное положение: имеем набор $x[0 : n-1]$ из нулей и единиц, в котором нет двух единиц рядом и $x[0] = 1$.
- Положим $x[1] := 1$.
- Шаг: выберем наибольшее k : $x[k] = 1 \wedge x[k-1] = 1$. Тогда:

$$\begin{cases} x[k] := 0, \\ x[k-1] := 0, \\ x[k+1] := 1, \\ x[0] := 1. \end{cases}$$

Пример.

0	1	2	3	4	5	6	7	8	9	пояснение
1	0	1	0	1	0	1	0	0	1	= 46
1	1	1	0	1	0	1	0	0	1	начало
1	0	0	1	1	0	1	0	0	1	1-й шаг
1	0	0	0	0	1	1	0	0	1	2-й шаг
1	0	0	0	0	0	0	1	0	1	3-й шаг

Глава 3

Элементарная теория вероятностей

3.1 Основные понятия

Определение 11. Ω — множество элементарных исходов. $A \subset \Omega$ — событие.

Определение 12. $\emptyset \subset \Omega$ — невозможное событие, $\Omega \subset \Omega$ — достоверное событие.

Определение 13. Пусть есть события A, B , тогда:

- $A \cup B$ — объединение событий
- $A \cap B$ — совмещение событий, причем, если $A \cap B = \emptyset$, то A, B — несовместные события.
- \bar{A} — противоположное событие.

Определение 14. $p : \Omega \rightarrow [0, 1]$ — вероятность события. Причем:

1. $0 \leq p(A) \leq 1$
2. $A \subset B \Rightarrow p(A) \leq p(B)$
3. если $A = A_1 + A_2, A_1 \cap A_2 = \emptyset$, то $p(A) = p(A_1) + p(A_2)$

Определение 15. $p(A) = \frac{|A|}{|\Omega|}$ — классическая вероятность.

Определение 16. (Полная система событий)
Пусть есть события S_1, \dots, S_n , таких, что:

- $S_i \cap S_j = \emptyset, i \neq j$
- $S_1 \cup \dots \cup S_n = \Omega$

Тогда вероятность события A можно посчитать следующим образом:

$$p(A) = \sum_{i=1}^n p(A \cap S_i)$$

Определение 17. События A, B — независимы, если:

$$p(A \cap B) = p(A) \cdot p(B)$$

Определение 18. События A_1, \dots, A_n — независимы попарно, если:

$$p(A_i \cap A_j) = p(A_i) \cdot p(A_j)$$

И независимы в совокупности, если:

$$p(A_1 \cap \dots \cap A_n) = \prod_{i=1}^n p(A_i)$$

Определение 19. (Условная вероятность)

Событие B при условии, что произошло событие A :

$$p(B|A) = \frac{p(A \cap B)}{p(A)}$$

Пример. Пусть есть тетраэдр с одной красной, одной черной, одной белой и одной, покрашенной во все цвета гранями. Тогда:

- $p(\text{Крас.}) = \frac{1}{2}$
- $p(\text{Крас.} \cap \text{Черн.}) = \frac{1}{4}$ — попарно независимы
- $p(\text{Крас.} \cap \text{Черн.} \cap \text{Бел.}) = \frac{1}{4}$ — не независимы в совокупности.

Определение 20. (Полная вероятность, используя условную)

$$p(A) = \sum_{i=1}^n p(A \cap S_i) = \sum_{i=1}^n p(A|S_i) \cdot p(S_i)$$

Определение 21. (Формула Байеса) Пусть есть события A, B :

$$p(B) = \sum_{i=1}^n p(B|A_i) \cdot p(A_i)$$

$$p(B|A_i) = \frac{p(A_i \cap B)}{p(A_i)} \Rightarrow p(B \cap A_i) = p(A_i) \cdot p(B|A_i) = p(B) \cdot p(A_i|B)$$

Получаем формулу Байеса:

$$p(A_i|B) = \frac{p(B|A_i) \cdot p(A_i)}{\sum_{j=1}^n p(B|A_j) \cdot p(A_j)}$$

Лекция 5: Случайные величины, мат.ожидание, дисперсия

11.10.2023

3.2 Случайные величины

Определение 22. Пусть Ω — множество элементарных событий, p_ω — вероятность события ω . Функция $\xi : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^1$ называется случайной величиной.

Замечание. Способ задать случайную величину (дискретный случай)

$$\xi : \begin{array}{c|c|c|c} a_1 & a_2 & \dots & a_n \\ \hline p_1 & p_2 & \dots & p_n \end{array}$$

$$p(\xi = a_i) = p_i, \text{ где } \xi = a_i \Leftrightarrow \{\omega \in \Omega : \xi(\omega) = a_i\}$$

Пример. Стрелок стреляет 3 раза, вероятность попадания — 0,8:

$$\begin{array}{c|c|c|c} 0 & 1 & 2 & 3 \\ \hline 0,2^3 & 3 \cdot 0,2^2 \cdot 0,8 & 3 \cdot 0,8^2 \cdot 0,2 & 0,8^3 \end{array}$$

3.3 Математическое ожидание

Определение 23. математическим ожиданием случайной величины называется:

$$E_\xi = \sum_{i=1}^n a_i \cdot p(\xi = a_i)$$

Свойства. 1. Если $p(\xi = a) = 1$, то $E_\xi = a$

2. Если $\eta = c \cdot \xi$, c — константа, то $E_\eta = c \cdot E_\xi$

3. $E(\xi + \eta) = E_\xi + E_\eta$

4. $E(\xi \cdot \eta) = E_\xi \cdot E_\eta$ — для независимых

Определение 24. Случайные величины ξ и η — независимы, если:

$$p(\xi = a_i \wedge \eta = b_j) = p(\xi = a_i) \cdot p(\eta = b_j)$$

Доказательство. (доказательство свойства 3 для независимых величин)

$$\begin{aligned} E(\xi + \eta) &= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^k (a_i + b_j) \cdot p(\xi + \eta = a_i + b_j) = \\ &= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^k a_i p(\xi = a_i) p(\eta = b_j) + \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^k b_j p(\xi = a_i) p(\eta = b_j) = \\ &= \sum_{i=1}^n \left(a_i p(\xi = a_i) \underbrace{\sum_{j=1}^k p(\eta = b_j)}_{=1} \right) + \sum_{j=1}^k \left(b_j p(\eta = b_j) \underbrace{\sum_{i=1}^n p(\xi = a_i)}_{=1} \right) = \\ &= E_\xi + E_\eta \end{aligned}$$

□

Доказательство. (доказательство свойства 4)

$$\begin{aligned} \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^k a_i b_j p(\xi \cdot \eta = a_i b_j) &= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^k a_i b_j p(\xi = a_i) p(\eta = b_j) = \\ &= \sum_{i=1}^n \left(a_i p(\xi = a_i) \sum_{j=1}^k b_j p(\eta = b_j) \right) = E_\xi \cdot E_\eta \end{aligned}$$

□

3.4 Дисперсия

Определение 25. Дисперсией случайной величины называется:

$$\begin{aligned} D_\xi &= E(\xi - E_\xi)^2 = E(\xi^2 - 2\xi E_\xi + (E_\xi)^2) = \\ &= E_{\xi^2} - E(2\xi E_\xi) + E((E_\xi)^2) = E_{\xi^2} - 2E_\xi E_\xi + (E_\xi)^2 = \\ &= E_{\xi^2} - (E_\xi)^2 \end{aligned}$$

Пример.

$$\begin{array}{c} \xi : \begin{array}{c|c|c} -1 & 0 & 1 \\ \hline \frac{1}{4} & \frac{1}{2} & \frac{1}{4} \end{array} \quad E\xi = -\frac{1}{4} + \frac{1}{4} = 0 \\ \xi^2 : \begin{array}{c|c|c} 0 & 1 & 1 \\ \hline \frac{1}{2} & \frac{1}{2} & \frac{1}{2} \end{array} \quad E\xi^2 = \frac{1}{2}, D\xi = \frac{1}{2} - 0 = \frac{1}{2} \end{array}$$

Свойства.

1. $p(\xi = a) = 1 \Rightarrow D\xi = 0$
2. $\eta = c \cdot \xi \Rightarrow D\eta = c^2 D\xi$
3. $D(\xi + \eta) = D\xi + D\eta$ — независимы

Доказательство. (свойство 3)

$$\begin{aligned} D(\xi + \eta) &= E(\xi + \eta)^2 - (E(\xi + \eta))^2 = E(\xi^2 + 2\xi\eta + \eta^2) - (E\xi + E\eta)^2 = \\ &= E\xi^2 + 2E\xi E\eta - (E\xi)^2 - 2E\xi E\eta - (E\eta)^2 = D\xi + D\eta \end{aligned}$$

□