

Konsep Variabel Acak Kontinu

Variabel Acak Kontinu, Support, Fungsi Kepadatan Peluang, dan Fungsi Distribusi Kumulatif

1.1 Fungsi Kepadatan Peluang dan Fungsi Distribusinya

Sebuah wortel memiliki panjang 1 cm. Seorang ilmuwan komputer ingin memotong wortel tersebut secara acak dengan memiliki suatu titik di antara wortel, lalu memotongnya pada titik tersebut. Berapakah ekspektasi panjang potongan wortel terbesar yang dihasilkan oleh mekanisme ini?

Definisi. Misalkan X variabel acak diskrit, maka _____ (PMF) dari variabel acak X adalah suatu fungsi $f_X(x) : \mathbb{R} \rightarrow [0, 1]$ yang memenuhi sifat-sifat di bawah ini.

1. Untuk setiap $x \in S_X$ berlaku $0 \leq f_X(x) \leq 1$.
2. $\sum_{x \in S_X} f_X(x) = 1$.
3. $f_X(x) = \mathbb{P}(X = x)$.

Definisi. Misalkan X variabel acak kontinu, maka _____ (PDF) dari variabel acak X adalah suatu fungsi $f_X(x) : \mathbb{R} \rightarrow [0, 1]$ yang memenuhi sifat-sifat di bawah ini.

1. Untuk setiap $x \in S_X$ berlaku $f_X(x) \geq 0$.

2.
$$\int_{-\infty}^{\infty} f_X(x) dx = 1.$$

3.
$$\mathbb{P}(a < X < b) = \int_a^b f_X(x) dx.$$

Definisi. Misalkan X variabel acak kontinu, maka _____ (CDF) dari variabel acak X adalah $F_x : \mathbb{R} \rightarrow [0, 1]$ yang didefinisikan sebagai

$$F_x(x) = \mathbb{P}(X \leq x) = \int_{-\infty}^x f_X(x) dx.$$

Misalkan X variabel acak yang menyatakan besarnya kesalahan dari pengukuran suhu dengan termometer tembak dengan $S_X \in [-1, 2]$. Diketahui fungsi kepadatan peluangnya adalah

$$f_X(x) = \begin{cases} \frac{x^2}{3}, & x \in [-1, 2] \\ 0, & x \in \mathbb{R} \setminus [-1, 2] \end{cases}$$

- (a) Gambarkan fungsi kepadatan peluang dari X , lalu berikan intepretasi!
- (b) Dalam suatu pengukuran, berapa peluang kesalahan berada di antara $-0,5$ sampai $0,5$?

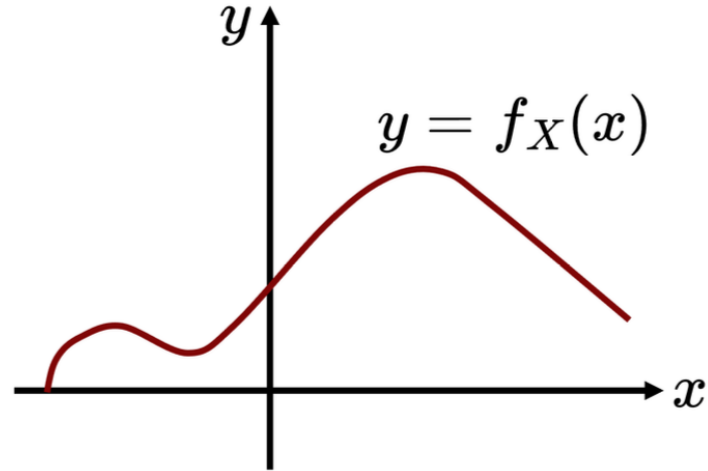
(c) Tentukan dan gambarkan fungsi distribusi kumulatif dari X .

$$f_X(x) = \begin{cases} \frac{x^2}{3}, & x \in [-1, 2] \\ 0, & x \in \mathbb{R} \setminus [-1, 2] \end{cases}$$

Dalam variabel acak kontinu, kita memiliki beberapa catatan.

1. Peluang dari suatu _____ adalah nol, kita tuliskan sebagai $\mathbb{P}(X = k) = 0$.
2. Misalkan $f_X(x)$ dan $F_X(x)$ berturut-turut adalah PDF dan CDF dari X . Maka,
 - CDF adalah _____ dari PDF, yakni $F_X(x) = \int_{-\infty}^x f_X(t) dt$.
 - PDF adalah _____ dari CDF, yakni $f_X(x) = \frac{d}{dx} F_X(x)$.

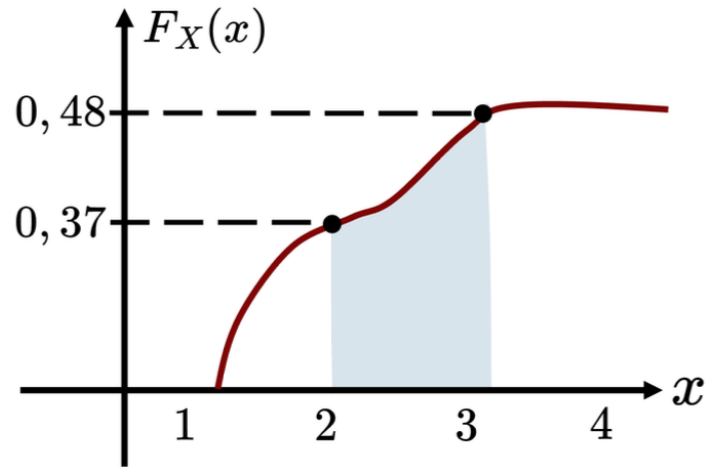
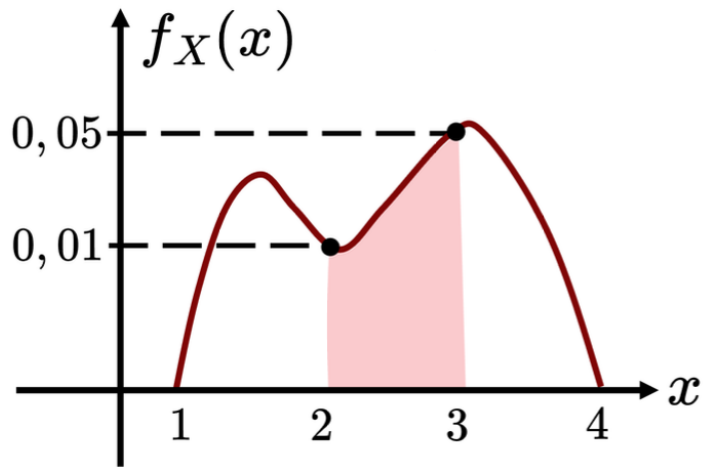
(a) Perhatikan grafik fungsi kepadatan peluang dari suatu peubah acak berikut!



Manakah deskripsi yang paling tepat untuk deksripsikan grafik tersebut?

- A. Nilai X tidak mungkin negatif.
- B. Nilai X lebih mungkin negatif daripada positif.
- C. Nilai X tidak mungkin positif.
- D. Nilai X lebih mungkin positif daripada negatif.
- E. Nilai X sama-sama mungkin positif atau negatif.

(b) Diberikan grafik PDF dan CDF suatu peubah acak.



Pernyataan	Benar/Salah
$\mathbb{P}(2 \leq X \leq 3)$ adalah luas daerah yang diarsir merah.	
$\mathbb{P}(X = 2) = 0,01$.	
$\mathbb{P}(2 \leq X \leq 3) = 0.48 - 0,37$.	
Luas yang diarsir biru adalah nilai $\mathbb{P}(2 \leq X \leq 3)$.	

Lema. Misalkan X variabel acak kontinu dengan fungsi kepadatan peluangnya adalah $f_X(x)$ dan fungsi distribusi kumulatifnya adalah $F_X(x)$. Maka, untuk sembarang x dan y di S_X berlaku

1. $\mathbb{P}(X < x) = \mathbb{P}(X \leq x) = F_X(x)$.
2. $\mathbb{P}(X > x) = \mathbb{P}(X \geq x) = 1 - F_X(x)$.
3. $\mathbb{P}(y < X < x) = \mathbb{P}(y \leq X \leq x) = F_X(x) - F_X(y)$.

Misalkan diketahui data berikut:

x	$f_X(x)$	$F_X(x)$
1	0,050	0,25
2	0,100	0,56
3	0,075	0,85
4	0,001	0,93

Berapakah nilai dari peluang

(a) $\mathbb{P}(X < 2)$

(b) $\mathbb{P}(X > 3)$

(c) $\mathbb{P}(2 \leq X < 4)$

Misalkan X merupakan variabel acak yang menyatakan panjang potongan wortel terbesar hasil potongan acak. Diberikan informasi bahwa fungsi distribusi kumulatif dari X adalah

$$F_X(x) = \begin{cases} 0, & x \leq \frac{1}{2} \\ 2x - 1, & \frac{1}{2} < x \leq 1 \\ 1, & x > 1 \end{cases}$$

- (a) Hitunglah fungsi kepadatan peluang dari variabel acak tersebut!
- (b) Berapa peluang potongan wortel terbesar berukuran 0,6 sampai dengan 0,8?
- (c) Berapa peluang potongan wortel berukuran lebih besar dari 0,98?

Ekspektasi dan Variansi Kontinu

Definisi dan Sifat-sifatnya

1.2 Definisi dan Sifat Ekspektasi

Definisi. Misalkan X merupakan suatu variabel acak kontinu dengan *support* S_X dan fungsi kepadatan peluangnya adalah $f_X(x)$. _____ dari X dapat didefinisikan sebagai

$$\mu_X = \mathbb{E}[X] = \int_{-\infty}^{\infty} x \cdot f_X(x) dx.$$

Lebih jauh, _____ dari X dapat didefinisikan sebagai

$$\text{Var}[X] = \mathbb{E}[(X - \mu_X)^2] = \int_{-\infty}^{\infty} (x - \mu_X)^2 \cdot f_X(x) dx.$$

Teorema. Misalkan X variabel acak kontinu dan S_X tidak memuat bilangan negatif, maka

$$\mathbb{E}[X] = \int_0^{\infty} \mathbb{P}(X > x) dx = \int_0^{\infty} 1 - F_X(x) dx.$$

Fungsi $1 - F_X(x)$ bisa dituliskan sebagai $S_X(x)$, yakni fungsi _____ (*survival function*).

Misalkan X merupakan peubah acak yang menyatakan panjang potongan wortel terbesar hasil potongan acak dengan fungsi kepadatan peluang dari X adalah

$$f_X(x) = \begin{cases} 0, & x \leq \frac{1}{2} \\ 2, & \frac{1}{2} < x \leq 1 \\ 0, & x > 1 \end{cases}$$

- (a) Tentukan *support* dari X dan sketsa fungsi kepadatan peluang di atas!
- (b) Berapakah harapan ukuran potongan wortel terbesar?
- (c) Berapakah variansi ukuran potongan wortel terbesar?

$$\mathbb{E}[X] = \int_0^{\infty} \mathbb{P}(X > x) dx = \int_0^{\infty} 1 - F_X(x) dx.$$

Misalkan X merupakan peubah acak yang menyatakan panjang potongan wortel terbesar hasil potongan acak dengan fungsi kepadatan peluang dari X adalah

$$f_X(x) = \begin{cases} 0, & x \leq \frac{1}{2} \\ 2, & \frac{1}{2} < x \leq 1 \\ 0, & x > 1 \end{cases}$$

Berapakah harapan ukuran potongan wortel terbesar?

Teorema. Misalkan X variabel acak kontinu, maka $\text{Var}[X] = E[X^2] - (E[X])^2$.

Apakah teorema di atas dapat diterapkan untuk variabel acak diskrit? Bagaimana membuktikannya?