

概率论与数理统计

第四章: 随机变量的数字特征

李立颖 (lily@sustech.edu.cn)

南方科技大学数学系

2023 秋季



南方科技大学
SOUTHERN UNIVERSITY OF SCIENCE AND TECHNOLOGY

1 随机变量的期望

- 引言
- 离散型随机变量的数学期望
- 连续型随机变量的数学期望
- 随机变量函数的数学期望
- 数学期望的基本性质
- 作业

2 方差和标准差

3 协方差和相关系数

4 条件期望和预测

5 矩生成函数

6 近似方法

数字特征

随机变量的概率特征

- 分布函数 (CDF, cumulative distribution function)
- 密度函数 (PDF, probability density function)
- 频率函数 (PMF, probability mass function)

特点

- 优点: 全面、详细、完整
- 不足: 复杂、重点不突出

问题

如何粗线条地描述随机变量的特性? 函数是一个无穷维/高维的对象, 如何用一个低维的对象去刻画?

数字特征

平均值

例子

甲、乙两射手进行打靶训练, 每人各打了 100 发子弹, 成绩如下:

甲:

环数	8	9	10
次数	15	40	45

乙:

环数	8	9	10
次数	35	10	55

怎样评估两人的射击水平?

分析

两人的总环数分别为

$$\text{甲: } 8 \times 15 + 9 \times 40 + 10 \times 45 = 930,$$

$$\text{乙: } 8 \times 35 + 9 \times 10 + 10 \times 55 = 920.$$

每枪的平均环数为

$$\text{甲: } \frac{8 \times 15 + 9 \times 40 + 10 \times 45}{100} = 9.3,$$

$$\text{乙: } \frac{8 \times 35 + 9 \times 10 + 10 \times 55}{100} = 9.2$$

平均值概念广泛存在

- 某班级某课程考试的平均成绩
- 电子产品的平均无故障时间
- 某地区的日平均气温和日平均降水量
- 某地区的家庭平均年收入
- 某地区的水稻的平均亩产量
- 某国家国民的平均寿命.

问题

怎样定义随机变量平均值概念？

例子

甲、乙两射手进行打靶训练, 每人各打了 100 发子弹, 成绩如下:

甲:

环数	8	9	10
次数	15	40	45

乙:

环数	8	9	10
次数	35	10	55

怎样评估两人的射击水平?

进一步分析

记甲每枪击中的环数为 X , 因为射击次数较多, 故可以认为 X 的频率函数为

X	8	9	10
p_k	0.15	0.40	0.45

则甲射手每枪的平均环数为

$$8 \times 0.15 + 9 \times 0.40 + 10 \times 0.45 = 9.3.$$

平均环数

$$\mathbb{E}(X) := \sum_{k=1}^3 x_k p_k.$$

离散型随机变量的数学期望

定义

设随机变量 X 的频率函数为

X	x_1	x_2	\cdots	x_k	\cdots
$P(X = x_k)$	p_1	p_2	\cdots	p_k	\cdots

若级数 $\sum_{k=1}^{\infty} |x_k| p_k < \infty$, 则称

$$\mathbb{E}(X) := \sum_{k=1}^{\infty} x_k p_k = \sum_{k=1}^{\infty} x_k P(X = x_k)$$

为随机变量 X 的**数学期望 (期望、均值)**

“数学期望 (Expectation, Expected Value)” 的由来

“数学期望”是历史上沿用下来的一个名词, 可理解为在数学上对随机变量进行计算期望到的值, 即平均值.

某商店对家用电器的销售先使用后付款. 付款额根据使用寿命 X 来确定:

寿命 (年)	$X \leq 1$	$1 < X \leq 2$	$2 < X \leq 3$	$X > 3$
付款 (元)	1500	2000	2500	3000

假设 $X \sim \text{Exp}(0.1)$, 试求该商店出售一台电器的平均收费额.

设出售一台电器的收费额为 Y , 则 Y 的频率函数为

$$P(Y = 1500) = P(X \leq 1) = \int_0^1 \frac{1}{10} e^{-x/10} = 0.0952$$

$$P(Y = 2000) = P(1 < X \leq 2) = \int_1^2 \frac{1}{10} e^{-x/10} = 0.0861$$

$$P(Y = 2500) = P(2 < X \leq 3) = \int_2^3 \frac{1}{10} e^{-x/10} = 0.0779$$

$$P(Y = 3000) = P(3 < X \leq 4) = \int_3^\infty \frac{1}{10} e^{-x/10} = 0.7408.$$

因此 $\mathbb{E}Y = 1500 \times 0.952 + 2000 \times 0.0861 + 2500 \times 0.0779 + 3000 \times 0.7408 = 2732.17$,
即商店出售一台电器平均收费额为 2732.17 元.

泊松分布的期望

若 $X \sim \pi(\lambda)$, 则 $\mathbb{E}X = \lambda$.

证明

由 $P(X = k) = \frac{\lambda^k}{k!} e^{-\lambda}$, $k = 0, 1, 2, \dots$, 我们有

$$\begin{aligned}\mathbb{E}X &= \sum_{k=0}^{\infty} k \cdot P(X = k) \\ &= \sum_{k=0}^{\infty} k \frac{\lambda^k}{k!} e^{-\lambda} \\ &= \lambda e^{-\lambda} \sum_{k=1}^{\infty} \frac{\lambda^{k-1}}{(k-1)!} \\ &= \lambda e^{-\lambda} \sum_{i=0}^{\infty} \frac{\lambda^i}{i!} = \lambda e^{-\lambda} \cdot e^{\lambda} = \lambda.\end{aligned}$$

二项分布的期望

若 $X \sim \text{Bin}(n, p)$, 则 $\mathbb{E}X = np$.

证明

注意到 $k \binom{n}{k} = k \frac{n!}{k!(n-k)!} = n \frac{(n-1)!}{(k-1)!(n-k)!} = n \binom{n-1}{k-1}$.

$$\begin{aligned} \mathbb{E}X &= \sum_{k=0}^n k \cdot \binom{n}{k} p^k (1-p)^{n-k} \\ &= \sum_{k=1}^n n \cdot \binom{n-1}{k-1} p^k (1-p)^{n-k} \\ &= np \sum_{k'=k-1=0}^{n-1} \binom{n-1}{k'} p^{k'} (1-p)^{n-1-k'} \\ &= np[p + (1-p)]^{n-1} \\ &= np. \end{aligned}$$

常见分布的数学期望

分布	概率分布	期望
0-1 分布	$P(X = 1) = p, P(X = 0) = 1 - p$	p
$\text{Bin}(n, p)$	$P(X = k) = \binom{n}{k} p^k (1 - p)^{n-k}, k = 0, 1, \dots, n$	np
$\pi(\lambda)$	$P(X = k) = \frac{\lambda^k}{k!} e^{-\lambda}, k = 0, 1, 2, \dots$	$\lambda.$

讨论

问题

数学期望的定义中, 为什么要求绝对收敛 $\sum_{k=1}^{\infty} |x_k| p_k < \infty$?

绝对收敛可以保证求和结果与顺序无关, 并且使得数学期望有与可列可加性兼容的一系列极限结果.

定义

若 $\sum_{k=1}^{\infty} |x_k| p_k = \infty$, 则称数学期望 $\mathbb{E}X$ 不存在.

定义

设随机变量的概率密度函数为 $f(x)$. 若

$$\int_{-\infty}^{\infty} |x|f(x) dx < \infty,$$

则称

$$\mathbb{E}X := \int_{-\infty}^{\infty} xf(x) dx$$

为随机变量 X 的**数学期望 (期望、均值)**.

注

若 $\int_{-\infty}^{\infty} |x|f(x) dx = \infty$, 则称 $\mathbb{E}X$ 不存在.

均匀分布的期望

若 $X \sim U[a, b]$, 则 $\mathbb{E}X = \frac{a+b}{2}$.

证明

X 的密度函数为 $f(x) = \mathbb{1}_{(a,b)}(x) \cdot \frac{1}{b-a}$. 因此

$$\begin{aligned}\mathbb{E}X &= \int_a^b \frac{x}{b-a} dx \\ &= \frac{1}{b-a} \frac{b^2 - a^2}{2} \\ &= \frac{a+b}{2}.\end{aligned}$$

正态分布的数学期望

若 $X \sim \mathcal{N}(\mu, \sigma^2)$, 则 $\mathbb{E}X = \mu$.

证明

$$\begin{aligned}\mathbb{E}X &= \int_{-\infty}^{\infty} x \cdot \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma} e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}} dx \\&= \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma} \int_{-\infty}^{\infty} (x - \mu + \mu) e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}} dx \\&= \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma} \int_{-\infty}^{\infty} (x - \mu) e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}} dx + \mu \cdot \int_{-\infty}^{\infty} \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma} e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}} dx \\&= 0 + \mu = \mu.\end{aligned}$$

指数分布的数学期望

设某元器件的寿命 X 服从指数分布 $\text{Exp}(1/\theta)$, 其密度为

$$f(x) = \mathbb{1}_{(0, \infty)}(x) \frac{1}{\theta} e^{-\frac{x}{\theta}}.$$

则 $\mathbb{E}X = \theta$.

$$\begin{aligned} \mathbb{E}X &= \int_0^{\infty} x \frac{1}{\theta} e^{-\frac{x}{\theta}} dx \\ &= \theta \int_0^{\infty} \frac{x}{\theta} e^{-\frac{x}{\theta}} d\left(\frac{x}{\theta}\right) \\ &= \theta \int_0^{\infty} t e^{-t} dt = \theta \left(-te^{-t} - e^{-t} \Big|_0^{\infty} \right) = \theta. \end{aligned}$$

工程上, 如果某件产品的平均寿命为 $\theta = 10^k$ (小时), 则称该产品为 “ k 级” 产品. k 越大, 失效率 10^{-k} 越低, 则平均寿命越长, 可靠性越高. 在航空、航天、军事、医疗等领域, 通常要求元器件达 9 级以上, 即 $\theta \approx 114160$ (年).

连续型随机变量的期望

分布	概率密度	期望
$U[a, b]$	$f(x) = \mathbb{1}_{(a,b)}(x) \frac{1}{b-a}$	$\frac{a+b}{2}$
$\text{Exp}(\lambda)$	$f(x) = \mathbb{1}_{(0,\infty)} \lambda e^{-\lambda x}$	$\frac{1}{\lambda}$
$\mathcal{N}(\mu, \sigma^2)$	$f(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma} e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}$	μ

例题

设随机变量 X 的密度函数为

$$f(x) = \frac{1}{2}e^{-|x|}, \quad x \in \mathbb{R}.$$

求 $\mathbb{E}X$.

解

$$\mathbb{E}X = \int_{-\infty}^{\infty} x \frac{1}{2}e^{-|x|} dx = 0 \quad (\text{对称性}).$$

Cauchy 分布的期望

设 $X \sim f(x) = \frac{1}{\pi} \frac{1}{1+x^2}$, 则 $\mathbb{E}X$ 不存在.

注意到

$$\begin{aligned}\int_{-\infty}^{\infty} |x|f(x) dx &= \lim_{M \rightarrow \infty} \int_{-M}^M |x|f(x) dx \\&= \lim_{M \rightarrow \infty} 2 \int_0^M x \cdot \frac{1}{\pi} \frac{1}{1+x^2} dx \\&= \lim_{M \rightarrow \infty} \frac{1}{\pi} \ln(1+x^2) \Big|_0^M = \infty.\end{aligned}$$

故 $\mathbb{E}X$ 不存在.

Markov 不等式

设随机变量 X 满足 $P(X \geq 0) = 1$, 且 $\mathbb{E}X$ 存在, 则

$$P(X \geq t) \leq \frac{\mathbb{E}X}{t}.$$

证明

我们只对连续情形证明. 因为 $X \geq 0$, 所以

$$\begin{aligned}\mathbb{E}X &= \int_0^{\infty} x f(x) dx = \int_0^t x f(x) dx + \int_t^{\infty} x f(x) dx \\ &\geq \int_t^{\infty} x f(x) dx \\ &\geq t \int_t^{\infty} f(x) dx = tP(X \geq t).\end{aligned}$$

移项即得结论.

背景

设已知随机变量 X 的分布, 我们需要计算的不是 X 的期望, 而是 X 的某个函数 $g(X)$ 的期望. 如何计算?

例子

飞机机翼受到的压力为 $W = kv^2$, 其中 v 为风速, $k > 0$ 为常数. 问机翼受到的平均压力有多大?

思路

已知 $X \sim g(X)$, 则 $Y = g(X) \sim f_Y(y)$. 因此

$$\mathbb{E}g(X) = \mathbb{E}Y = \int_{-\infty}^{\infty} y f_Y(y) dy.$$

是否可以不求 $g(X)$ 的分布而只根据 X 的分布求 $\mathbb{E}g(X)$?

定理

设 $y = g(x)$ 为一 (可测) 函数, 则

① 若 X 为离散型, 且频率函数为 $P(X = x_k) = p_k, k = 1, 2, \dots$, 且

$$\sum_{k=1}^{\infty} |g(x_k)| \cdot p_k < \infty, \text{ 则}$$

$$\mathbb{E}Y = \mathbb{E}g(X) = \sum_{k=1}^{\infty} g(x_k)p_k.$$

② 若 X 为连续型, 且密度函数为 $f(x)$, 且 $\int_{-\infty}^{\infty} |g(x)|f(x) dx < \infty$, 则

$$\mathbb{E}Y = \mathbb{E}g(X) = \int_{-\infty}^{\infty} g(x)f(x) dx.$$

求 $g(X)$ 时只需要知道 X 的分布, 这给我们带来很大的便利性.

例题

设风速 $V \sim U(0, a)$, 且飞机机翼受到的正压力 $W = kV^2$, $k > 0$ 为常数. 求 $\mathbb{E}W$.

解

V 的密度函数为 $f(v) = \mathbb{1}_{(0,a)}(v) \frac{1}{a}$. 因此

$$\begin{aligned}\mathbb{E}W &= \int_0^a \frac{k}{a} v^2 dv \\ &= \frac{1}{3} k a^3.\end{aligned}$$

因此飞机机翼受到的平均正压力为 $\frac{1}{3} k a^3$.

二元随机变量函数的期望

设 $z = g(x, y)$ 为二元 (可测) 函数.

① 若 X, Y 为离散型, 且联合频率函数为

$$P(X = x_i, Y = y_j) = p_{ij}, \quad i, j = 1, 2, \dots$$

若 $\sum_{i,j=1}^{\infty} |g(x_i, y_j)| p_{ij} < \infty$, 则

$$\mathbb{E}Z = \mathbb{E}g(X, Y) = \sum_{i,j=1}^{\infty} g(x_i, y_j) p_{ij}.$$

② 若 X, Y 为连续型, 且联合密度函数为 $f(x, y)$. 若

$$\int_{-\infty}^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} |g(x, y)| f(x, y) dx dy < \infty,$$

则

$$\mathbb{E}Z = \mathbb{E}g(X, Y) = \int_{-\infty}^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} g(x, y) f(x, y) dx dy.$$

例

设 (X, Y) 的密度函数为 $f(x, y) = \mathbb{1}_{\{0 \leq y \leq x \leq 1\}}(x, y) 15xy^2$. 试求 $\mathbb{E}X$, $\mathbb{E}Y$ 及 $\mathbb{E}XY$.

思路

除了可以先求 $f_X(x)$, $f_Y(y)$ 然后利用一元随机变量期望的公式, 我们还可以对 $g(x, y) = x$ 或 $g(x, y) = y$ 利用二维随机变量的公式.

$$\begin{aligned}\mathbb{E}X &= \iint_{\mathbb{R} \times \mathbb{R}} xf(x, y) dx dy = \iint_{0 \leq y \leq x \leq 1} x \cdot 15xy^2 dx dy \\ &= \int_0^1 dx \int_0^x 15x^2 y^2 dx dy = \frac{15}{3} \int_0^1 x^5 dx = \frac{5}{6}.\end{aligned}$$

$$\mathbb{E}Y = \iint_{\mathbb{R}^2} yf(x, y) dx dy = \frac{5}{8}.$$

$$\mathbb{E}(XY) = \iint_{\mathbb{R}^2} xyf(x, y) dx dy = \iint_{0 \leq y \leq x \leq 1} xy \cdot 15xy^2 dx dy = \frac{15}{28}.$$

例题

设随机变量 X 的分布律为

X	-2	0	2
P	0.4	0.3	0.3

求 $\mathbb{E}(3X^2 + 5)$.

解

$$\begin{aligned}\mathbb{E}(3X^2 + 5) &= [3 \cdot (-2)^2 + 5] \cdot 0.4 + [3 \cdot 0^2 + 5] \cdot 0.3 + [3 \cdot 2^2 + 5] \cdot 0.3 \\ &= 13.4.\end{aligned}$$

例题

设 (X, Y) 在区域 A 上服从均匀分布, 其中 A 为 x 轴、 y 轴与直线 $x + y + 1 = 0$ 围成的区域. 求 $\mathbb{E}X$, $\mathbb{E}(-3X + 2Y)$, $\mathbb{E}XY$.

解

区域 A 可以写为

$$A = \{(x, y) : -1 \leq x \leq 0, \quad -1 - x \leq y \leq 0\}.$$

且 A 的面积为 $1/2$. 因此密度函数为 $f(x, y) = \mathbb{1}_A(x, y) \cdot 2$,

$$\mathbb{E}X = \int_{-1}^0 dx \int_{-1-x}^0 x \cdot 2 dy = -\frac{1}{3},$$

$$\mathbb{E}(-3X + 2Y) = \int_{-1}^0 dx \int_{-1-x}^0 2(-3x + 2y) dy = \frac{1}{3},$$

$$\mathbb{E}XY = \int_{-1}^0 dx \int_{-1-x}^0 2xy dy = \frac{1}{12}.$$

数学期望的基本性质

- 设 $a \leq X \leq b$, 则 $a \leq \mathbb{E}X \leq b$.
- 若 $X = c$, (a.e.), 则 $\mathbb{E}X = c$.

线性性质

- 设 c 为常数, 则 $\mathbb{E}(cX) = c\mathbb{E}X$.
- 设 X, Y 为随机变量, $\mathbb{E}(X + Y) = \mathbb{E}X + \mathbb{E}Y$.
- 设 a_1, \dots, a_n 为常数, 则对随机变量 X_1, \dots, X_n , 有

$$\mathbb{E}\left(\sum_{i=1}^n a_i X_i\right) = \sum_{i=1}^n a_i \mathbb{E}X_i.$$

独立随机变量乘积的期望

- 设 X, Y 相互独立, 则 $\mathbb{E}XY = \mathbb{E}X \cdot \mathbb{E}Y$.
- 设 X_1, X_2, \dots, X_n 相互独立, 则

$$\mathbb{E}(X_1 X_2 \cdots X_n) = \mathbb{E}X_1 \cdot \mathbb{E}X_2 \cdots \mathbb{E}X_n.$$

例题

已知随机变量 X 服从参数为 2 的泊松分布, 令 $Z = 3X - 2$, 求 $\mathbb{E}Z$.

解

由于 $X \sim \pi(2)$, 因此 $\mathbb{E}X = 2$. 由线性性, 我们有

$$\mathbb{E}Z = \mathbb{E}(3X - 2) = 3\mathbb{E}X - 2 = 3 \cdot 2 - 2 = 4.$$

例题

设二维随机变量 (X, Y) 的密度函数为

$$f(x, y) = \begin{cases} \frac{1}{4}x(1 + 3y^2), & 0 < x < 2, 0 < y < 1, \\ 0, & \text{其它.} \end{cases}$$

求 $\mathbb{E}X$, $\mathbb{E}Y$, $\mathbb{E}(X + Y)$, $\mathbb{E}(XY)$.

解

$$\mathbb{E}X = \int_0^2 x \cdot \frac{1}{4}x dx \int_0^1 (1 + 3y^2) dy = \frac{4}{3}, \mathbb{E}Y = \int_0^2 \frac{1}{4}x dx \int_0^1 y \cdot (1 + 3y^2) dy = \frac{5}{8}.$$

由线性性,

$$\mathbb{E}(X + Y) = \mathbb{E}X + \mathbb{E}Y = \frac{4}{3} + \frac{5}{8} = \frac{47}{24}.$$

由独立性,

$$\mathbb{E}XY = \mathbb{E}X \cdot \mathbb{E}Y = \frac{4}{3} \cdot \frac{5}{8} = \frac{5}{6}.$$

作业

• P116: 6, 15, 20, 21, 31

• ① 设随机变量 X 的概率密度为

$$f(x) = \begin{cases} e^{-x}, & x > 0, \\ 0, & x \leq 0. \end{cases}$$

求以下随机变量的期望:

(1) $Y = 2X$,

(2) $Y = e^{-2X}$.

② 设随机变量 (X, Y) 的概率密度为

$$f(x, y) = \begin{cases} 12y^2, & 0 \leq y \leq x \leq 1, \\ 0, & \text{其它}. \end{cases}$$

求 $\mathbb{E}X$, $\mathbb{E}Y$, $\mathbb{E}XY$, $\mathbb{E}(X^2 + Y^2)$.

思考题

考虑把原本属于 n 个人的 n 封信打乱重新分发, 每个人拿到一封信. 令 X 为拿到自己信的总人数. 对于伯努利装错信封问题, 我们知道

$$P(X=0) = 1 - \frac{1}{1!} + \frac{1}{2!} + \cdots + (-1)^n \cdot \frac{1}{n!}.$$

现在我们考察 X 的期望. 求

- $n=3$ 时, $\mathbb{E}X=?$
- $n=4$ 时, $\mathbb{E}X=?$

提示

将 X 改写为

$$X = \xi_1 + \xi_2 + \cdots + \xi_n, \quad \xi_k = \begin{cases} 1, & \text{第 } k \text{ 个人拿到属于自己的信封,} \\ 0, & \text{没拿到.} \end{cases}$$

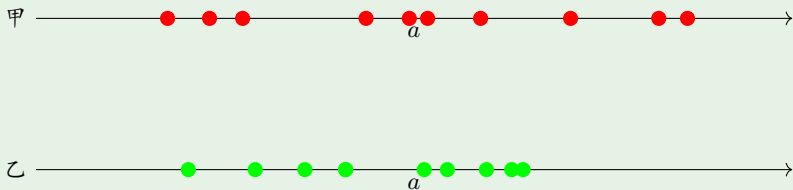
易知 $P(\xi_k = 1) = \frac{1}{n}.$

- ① 随机变量的期望
- ② 方差和标准差
 - 引言
 - 定义
 - 重要分布的方差
 - 方差的基本性质
 - 作业
- ③ 协方差和相关系数
- ④ 条件期望和预测
- ⑤ 矩生成函数
- ⑥ 近似方法

我们已经介绍了随机变量的数学期望, 它体现了随机变量取值的平均水平, 是随机变量的一个重要数值特征. 但是在很多场合, 仅仅知道平均值是不够的.

例 1: 长度测量

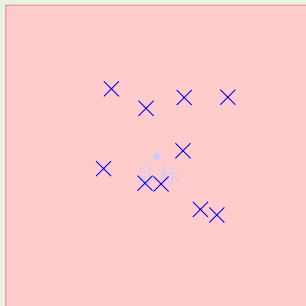
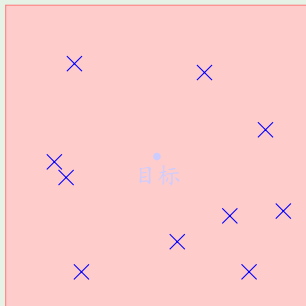
某零件的真实长度为 a , 现用甲、乙两台仪器各测量 10 次, 将测量结果 X 用坐标上的点表示:



我们认为乙仪器更准确一些, 因为乙的结果更**集中**在均值附近.

例 2: 炮弹落点

甲、乙两门炮同时向一目标射击 10 发炮弹, 其落点距目标的位置如图:



我们认为乙炮更好, 因为射击结果更**集中**于中心附近.

例子

设有两个牌子的手表，其走时误差情况如下表：

日误差 (秒)	-3	-2	-1	0	1	2	3
概率 (甲)	0.10	0.15	0.15	0.20	0.15	0.15	0.10
概率 (乙)	0.05	0.05	0.10	0.60	0.10	0.05	0.05

试问哪种牌号的手表质量较好？

分析

设两种手表的走时误差分别为 X, Y ，则

$$\begin{aligned}\mathbb{E}X &= \sum_{k=1}^7 x_k \mathbf{P}(X = x_k) = 0 \\ \mathbb{E}Y &= \sum_{k=1}^7 y_k \mathbf{P}(Y = y_k) = 0.\end{aligned}$$

因此两种手表的平均误差一样。

质量是否一样？

从偏离平均值的大小来考虑

对随机变量 X , 考虑偏差 $|X - \mathbb{E}X|$:

- 偏差越小, 说明质量越稳定
- 缺点: 绝对值运算不方便.

平方偏差

- 平方偏差 $(X - \mathbb{E}X)^2$ 仍是随机变量.
- 平方偏差的平均值 $\mathbb{E}(X - \mathbb{E}X)^2$ 反映了偏离平均值的大小.

定义

对随机变量 X , 若

$$\text{Var}(X) := D(X) := \mathbb{E}(X - \mathbb{E}X)^2$$

存在, 则称 $D(X)$ 为随机变量 X 的**方差 (variance)**, $\sqrt{D(X)}$ 称为**标准差 (standard deviation)**.

例题

设甲、乙两射手击中环数分别为 X, Y , 频率函数为

$$\begin{array}{c|ccc} X & 8 & 9 & 10 \\ \hline p_k & 0.15 & 0.40 & 0.45 \end{array}, \quad \begin{array}{c|ccc} Y & 8 & 9 & 10 \\ \hline p_k & 0.35 & 0.10 & 0.55 \end{array}.$$

试从均值和方差两方面评估两个的射击技术.

解

先计算数学期望

$$\mathbb{E}X = 8 \times 0.15 + 9 \times 0.40 + 10 \times 0.45 = 9.3$$

$$\mathbb{E}Y = 8 \times 0.35 + 9 \times 0.10 + 10 \times 0.55 = 9.2.$$

再计算方差

$$\text{Var}(X) = (8 - 9.3)^2 \cdot 0.15 + (9 - 9.3)^2 \cdot 0.4 + (10 - 9.3)^2 \cdot 0.45 = 0.51$$

$$\text{Var}(Y) = (8 - 9.2)^2 \cdot 0.35 + (9 - 9.2)^2 \cdot 0.1 + (10 - 9.2)^2 \cdot 0.55 = 0.86.$$

可看出甲的射击水平比乙高, 且更稳定.

数学期望 随机变量的平均值

方差 随机变量与其平均值的平均偏离程度.

方差的计算

视 $\text{Var}(X) = \mathbb{E}(X - \mathbb{E}X)^2$ 为 $g(X) = (X - \mathbb{E}X)^2$ 的数学期望, 则有

- 离散型: 设 X 的频率函数为 $P(X = x_k) = p_k, k = 1, 2, \dots$, 则

$$\text{Var}(X) = \sum_{k=1}^{\infty} (x_k - \mathbb{E}X)^2 \cdot p_k.$$

- 连续型: 设 X 的概率密度函数为 $f(x)$, 则

$$\text{Var}(X) = \int_{-\infty}^{\infty} (x - \mathbb{E}X)^2 f(x) dx.$$

$$\begin{aligned}\text{Var}(X) &= \mathbb{E}(X - \mathbb{E}X)^2 \quad (c = \mathbb{E}X) \\ &= \mathbb{E}X^2 - 2\mathbb{E}cX + \mathbb{E}c^2 = \mathbb{E}X^2 - 2c \cdot c + c^2 \\ &= \mathbb{E}X^2 - (\mathbb{E}X)^2.\end{aligned}$$

例题

对于随机变量 X , 其分布列为

X	-1	0	1
p	0.1	0.8	0.1

求 $\text{Var}(X)$.

解

$$\mathbb{E}X = 0,$$

$$\mathbb{E}X^2 = (-1)^2 \cdot 0.1 + 1^2 \cdot 0.1 = 0.2$$

$$\text{Var}(X) = \mathbb{E}X^2 - (\mathbb{E}X)^2 = 0.2.$$

例题

设随机变量 X 的密度函数为

$$f(x) = \begin{cases} 1+x, & -1 \leq x \leq 0, \\ 1-x, & 0 < x \leq 1. \end{cases}$$

求 $\text{Var}(X)$.

解

$$\mathbb{E}X = \int_{-1}^0 x(1+x) dx + \int_0^1 x(1-x) dx = 0,$$

$$\mathbb{E}X^2 = \int_{-1}^0 x^2(1+x) dx + \int_0^1 x^2(1-x) dx = \frac{1}{6},$$

$$\text{Var}(X) = \mathbb{E}X^2 - (\mathbb{E}X)^2 = \frac{1}{6}.$$

例题

一批零件中有 9 个合格品 3 个次品, 从这批零件中任取一个, 如果每次取出的废品不再放回去. 求在取得合格品以前, 已取出的废品数的期望、方差和标准差.

解

我们可以求得 X 的分布列:

X	0	1	2	3
p	$\frac{3}{4}$	$\frac{9}{44}$	$\frac{9}{44}$	$\frac{1}{220}$

因此,

$$\mathbb{E}X = \sum_{k=0}^3 x_k p_k = 0.301,$$

$$\text{Var}(X) = \sum_{k=0}^3 x_k^2 p_k - 0.301^2 = 0.322,$$

$$\sqrt{\text{Var}(X)} = \sqrt{0.322} = 0.567.$$

例题

设随机变量 X 的数学期望为 $\mathbb{E}X$, 方差为 $\text{Var}(X) > 0$. 引入新的随机变量

$$X^* = \frac{X - \mathbb{E}X}{\sqrt{\text{Var}(X)}}.$$

证明 $\mathbb{E}X^* = 0$, $\text{Var}(X^*) = 1$.

证明

令 $\mathbb{E}X = c$, $\text{Var}(X) = d$. 则

$$\begin{aligned}\mathbb{E}X^* &= \mathbb{E} \frac{X - c}{\sqrt{d}} = \frac{1}{\sqrt{d}} (\mathbb{E}X - c) = 0 \\ \text{Var}(X^*) &= \mathbb{E}(X^*)^2 = \mathbb{E} \left[\frac{X - c}{\sqrt{d}} \right]^2 \\ &= \frac{1}{d} \mathbb{E}(X - c)^2 = \frac{d}{d} = 1.\end{aligned}$$

泊松分布的方差

若 $X \sim \pi(\lambda)$, 则 $\text{Var}(X) = \lambda$.

证明

已知 $\mathbb{E}X = \lambda$. 我们还有

$$\begin{aligned}\mathbb{E}X^2 &= \mathbb{E}[X(X-1) + X] \\&= \sum_{k=0}^{\infty} k(k-1) \frac{\lambda^k}{k!} e^{-\lambda} + \mathbb{E}X \\&= \lambda^2 e^{-\lambda} \sum_{k=2}^{\infty} \frac{\lambda^{k-2}}{(k-2)!} + \lambda \\&= \lambda^2 + \lambda.\end{aligned}$$

因此

$$\text{Var}(X) = \mathbb{E}X^2 - (\mathbb{E}X)^2 = \lambda^2 + \lambda - \lambda^2 = \lambda.$$

二项分布的方差

若 $X \sim \text{Bin}(n, p)$, 则 $\text{Var}(X) = np(1 - p)$.

引理

若 X 与 Y 独立, 且 $\mathbb{E}X = \mathbb{E}Y = 0$, 则 $\mathbb{E}(X + Y)^2 = \mathbb{E}X^2 + \mathbb{E}Y^2$.

特别地, 若 X 与 Y 独立, 则 $\text{Var}(X \pm Y) = \text{Var}(X) + \text{Var}(Y)$.

证明

二项分布 X 可看作 n 个独立同分布的两点分布的和:

$$X = \xi_1 + \xi_2 + \cdots + \xi_n, \quad \xi_k \sim \text{Ber}(p).$$

易见 $\mathbb{E}\xi = p$, $\mathbb{E}\xi^2 = p$, 故 $\text{Var}(\xi) = p(1 - p)$. 由引理,

$$\text{Var}(X) = \text{Var}(\xi_1 + \xi_2 + \cdots + \xi_n) = \text{Var}(\xi_1) + \text{Var}(\xi_2) + \cdots + \text{Var}(\xi_n) = np(1 - p).$$

均匀分布的方差

若 $X \sim U(a, b)$, 则 $\text{Var}(X) = \frac{(b-a)^2}{12}$.

证明

已知 $\mathbb{E}X = \frac{a+b}{2}$. 我们有

$$\begin{aligned}\mathbb{E}X^2 &= \int_a^b \frac{x^2}{b-a} dx \\ &= \frac{b^3 - a^3}{3(b-a)} = \frac{a^2 + ab + b^2}{3}.\end{aligned}$$

$$\begin{aligned}\text{Var}(X) &= \mathbb{E}X^2 - (\mathbb{E}X)^2 \\ &= \frac{a^2 + ab + b^2}{3} - \frac{(a+b)^2}{4} \\ &= \frac{(b-a)^2}{12}.\end{aligned}$$

指数分布的方差

若 $X \sim \text{Exp}(\lambda)$, 则 $\text{Var}(X) = \frac{1}{\lambda^2}$.

证明

已知 $\mathbb{E}X = \frac{1}{\lambda}$. 我们有

$$\begin{aligned}\text{Var}(X) &= \mathbb{E}X^2 - \frac{1}{\lambda^2} \\ &= \int_0^{\infty} x^2 \lambda e^{-\lambda x} dx - \frac{1}{\lambda^2} \\ &= \frac{2}{\lambda^2} - \frac{1}{\lambda^2} = \frac{1}{\lambda^2}.\end{aligned}$$

正态分布的方差

若 $X \sim \mathcal{N}(\mu, \sigma^2)$, 则 $\text{Var}(X) = \sigma^2$.

证明

$$\begin{aligned}\text{Var}(X) &= \int_{-\infty}^{\infty} (x - \mu)^2 \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma} e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}} dx \\ &\stackrel{t=\frac{x-\mu}{\sigma}}{=} \int_{-\infty}^{\infty} \sigma^2 t^2 \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{t^2}{2}} dt.\end{aligned}$$

由分部积分,

$$\int_{-\infty}^{\infty} t^2 e^{-\frac{t^2}{2}} dt = \int_{-\infty}^{\infty} t d\left(-e^{-\frac{t^2}{2}}\right) = \int_{-\infty}^{\infty} e^{-\frac{t^2}{2}} dt = \sqrt{2\pi}.$$

代入得 $\text{Var}(X) = \sigma^2$.

常见分布的期望与方差

分布	概率函数	期望	方差
0-1 分布	$P(X = k) = \mathbb{1}_{k=1}p + \mathbb{1}_{k=0}(1 - p)$	p	$p(1 - p)$
$\text{Ber}(n, p)$	$P(X = k) = \binom{n}{k} p^k (1 - p)^{n-k}$	np	$np(1 - p)$
$\pi(\lambda)$	$P(X = k) = \frac{\lambda^k e^{-\lambda}}{k!}$	λ	λ
$U(a, b)$	$f(x) = \mathbb{1}_{(a,b)}(x) \frac{1}{b - a}$	$\frac{a + b}{2}$	$\frac{(b - a)^2}{12}$
$\text{Exp}(\lambda)$	$f(x) = \mathbb{1}_{(0,\infty)}(x) \lambda e^{-\lambda x}$	$\frac{1}{\lambda}$	$\frac{1}{\lambda^2}$
$\mathcal{N}(\mu, \sigma^2)$	$f(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma} e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}$	μ	σ^2

方差的性质

- ① 若 $X \stackrel{\text{a.e.}}{=} c$, 则 $\text{Var}(X) = 0$.
- ② 设 c 为常数, 则 $\text{Var}(cX) = c^2 \text{Var}(X)$.

$$\text{Var}(cX) = \mathbb{E}(cX - \mathbb{E}(cX))^2 = \mathbb{E}(cX - c\mathbb{E}X)^2 = c^2 \mathbb{E}(X - \mathbb{E}X)^2 = c^2 \text{Var}(X).$$

- ③ 对于随机变量 X 和 Y , 有

$$\begin{aligned}\text{Var}(X + Y) &= \mathbb{E}((X + Y) - \mathbb{E}(X + Y))^2 \\ &= \mathbb{E}((X - \mathbb{E}X) + (Y - \mathbb{E}Y))^2 \\ &= \mathbb{E}(X - \mathbb{E}X)^2 + \mathbb{E}(Y - \mathbb{E}Y)^2 + 2\mathbb{E}(X - \mathbb{E}X)(Y - \mathbb{E}Y) \\ &= \text{Var}(X) + \text{Var}(Y) + 2\mathbb{E}(X - \mathbb{E}X)(Y - \mathbb{E}Y).\end{aligned}$$

- ④ 特别地, 当 X, Y 独立时, $\mathbb{E}(X - \mathbb{E}X)(Y - \mathbb{E}Y) = \mathbb{E}(X - \mathbb{E}X) \cdot \mathbb{E}(Y - \mathbb{E}Y) = 0$, 因此

$$\text{Var}(X + Y) = \text{Var}(X) + \text{Var}(Y).$$

- ⑤ 若 $\text{Var}(X) = 0$, 则 $X \stackrel{\text{a.e.}}{=} c$ (常数).

Chebyshev 不等式

3σ -原则

正态随机变量的值几乎都落在 $(\mu - 3\sigma, \mu + 3\sigma)$ 之间, 即 $X \sim \mathcal{N}(\mu, \sigma^2)$ 时,

$$P(|X - \mu| < 3\sigma) = 99.74\%.$$

问

对一般的随机变量 X , 如何估计概率 $P(|X - \mu| \leq \varepsilon)$? 其中 $\mu = \mathbb{E}X$, $\varepsilon > 0$ 为任意正实数.

切比雪夫 (Chebyshev) 不等式

设 $\mu = \mathbb{E}X$, $\sigma^2 = \text{Var}(X)$ 都存在, 则 $\forall \varepsilon > 0$, 有

$$P(|X - \mu| \geq \varepsilon) \leq \frac{\sigma^2}{\varepsilon^2}.$$

切比雪夫 (Chebyshev) 不等式

设 $\mu = \mathbb{E}X$, $\sigma^2 = \text{Var}(X)$ 都存在, 则 $\forall \varepsilon > 0$, 有

$$P(|X - \mu| \geq \varepsilon) \leq \frac{\sigma^2}{\varepsilon^2}.$$

回顾: Markov 不等式

若随机变量 $X \geq 0$, 且 $\mathbb{E}X$ 存在, 则

$$P(X \geq t) \leq \frac{\mathbb{E}X}{t}, \quad t > 0.$$

证明

由 Markov 不等式,

$$P(|X - \mu| \geq \varepsilon) = P(|X - \mu|^2 \geq \varepsilon^2) \leq \frac{\mathbb{E}|X - \mu|^2}{\varepsilon^2} = \frac{\text{Var}(X)}{\varepsilon^2}.$$

Chebyshev 不等式推论

3 σ -原则

取 $\varepsilon = 3\sigma, 4\sigma$, 有

$$P(|X - \mu| < 3\sigma) = 1 - P(|X - \mu| \geq 3\sigma) \geq 1 - \frac{1}{9} = 88.90\%,$$

$$P(|X - \mu| < 4\sigma) = 1 - P(|X - \mu| \geq 4\sigma) \geq 1 - \frac{1}{16} = 93.75\%.$$

因此对一般的随机变量, 3 σ -原则的可信度也接近 90%.

推论 2

若 $\sigma^2 = 0$, 则 $P(|X - \mu| = 0) = 1$.

例题

已知正常男性成人血液中, 每一毫升白细胞数平均是 7300, 标准差是 700. 利用 Chebyshev 不等式估计每毫升白细胞数在 5200 至 9400 之间的概率.

解

设每毫升白细胞数为 X , 依题意, $\mathbb{E}X = 7300$, $\text{Var}(X) = 700^2$,
 $\{X \in (5200, 9400)\} = \{|X - 7300| \geq 3 \cdot 700\}$. 因此

$$P(X \in (5200, 9400)) = 1 - P(|X - 7300| \geq 3 \cdot 700) \geq 1 - \frac{700^2}{3^2 \cdot 700^2} = \frac{8}{9}.$$

- P118: 49, 50, 55

- 补充题

- ① 设 X, Y 是相互独立的随机变量, 且有 $\mathbb{E}X = 3, \mathbb{E}Y = 1, \text{Var}(X) = 4, \text{Var}(Y) = 9$. 令 $Z = 5X - 2Y + 15$. 求 $\mathbb{E}Z$ 与 $\text{Var}(Z)$.
- ② 设随机变量 X_1, X_2, X_3, X_4 相互独立, 且有 $\mathbb{E}X_i = 2i, \text{Var}(X_i) = 5 - i, i = 1, 2, 3, 4$. 令 $Z = 2X_1 - X_2 + 3X_3 - \frac{1}{2}X_4$. 求 $\mathbb{E}Z$ 与 $\text{Var}(Z)$.

- ① 随机变量的期望
- ② 方差和标准差
- ③ 协方差和相关系数
 - 协方差的定义
 - 相关系数
 - 矩与协方差矩阵
 - 作业
- ④ 条件期望和预测
- ⑤ 矩生成函数
- ⑥ 近似方法

随机变量间的关系

回顾

设 $(X, Y) \sim f(x, y)$, $X \sim f_X(x)$, $Y \sim f_Y(y)$, 则

$$X, Y \text{ 相互独立} \Leftrightarrow f(x, y) = f_X(x)f_Y(y).$$

问: 若 X, Y 不独立, 如何刻画它们之间的关系?

若 X, Y 相互独立, 则

$$\mathbb{E}[(X - \mathbb{E}X)(Y - \mathbb{E}Y)] = 0.$$

反之, 若上式不为 0, 则 X, Y 必不独立, 它们之间一定存在某些联系.

定义

若 X, Y 的方差均存在, 记

$$\text{Cov}(X, Y) := \mathbb{E}[(X - \mathbb{E}X)(Y - \mathbb{E}Y)],$$

称为 X, Y 的**协方差 (covariance)**.

协方差的基本性质

$$\text{Cov}(X, Y) := \mathbb{E}[(X - \mathbb{E}X)(Y - \mathbb{E}Y)],$$

❶ 若 X, Y 相互独立, 则 $\text{Cov}(X, Y) = 0$.

❷ (对称性) $\text{Cov}(X, Y) = \text{Cov}(Y, X)$.

❸ $\text{Var}(X) = \mathbb{E}(X - \mathbb{E}X)^2 = \text{Cov}(X, X)$.

❹ 协方差的计算

$$\begin{aligned}\text{Cov}(X, Y) &= \mathbb{E}(X - \mathbb{E}X)(Y - \mathbb{E}Y) = \mathbb{E}(X - \mu_X)(Y - \mu_Y) \\ &= \mathbb{E}XY - \mathbb{E}\mu_X Y - \mathbb{E}X\mu_Y + \mu_X\mu_Y \\ &= \mathbb{E}XY - \mu_X\mu_Y = \mathbb{E}XY - \mathbb{E}X \cdot \mathbb{E}Y.\end{aligned}$$

❺ $\text{Cov}(X, Y) = \text{Var}(X) + \text{Var}(Y) + 2\text{Cov}(X, Y)$.

协方差的双线性性

性质

- ① 对任意常数 a, b , 有

$$\begin{aligned}\text{Cov}(aX, bY) &= \mathbb{E}[(aX - \mathbb{E}(aX))(bY - \mathbb{E}(bY))] \\ &= ab\mathbb{E}(X - \mathbb{E}X)(Y - \mathbb{E}Y) = ab \text{Cov}(X, Y).\end{aligned}$$

- ② $\text{Cov}(X_1 + X_2, Y) = \text{Cov}(X_1, Y) + \text{Cov}(X_2, Y)$.

双线性性 (bilinearity)

假设 $U = a + \sum_{i=1}^n b_i X_i$, $V = c + \sum_{j=1}^m d_j Y_j$, 则

$$\text{Cov}(U, V) = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^m b_i d_j \text{Cov}(X_i, Y_j).$$

相关系数

协方差的意义

- X, Y 相互独立 $\Rightarrow \text{Cov}(X, Y) = 0$.
- $\text{Cov}(X, Y) \neq 0 \Rightarrow X, Y$ 不独立

单位化

注意到 $\forall k \in \mathbb{R}$, $\text{Cov}(kX, kY) = k^2 \text{Cov}(X, Y)$, 我们可以考虑“单位化”的随机变量

$$X^* := \frac{X - \mathbb{E}X}{\sqrt{\text{Var}(X)}}, \quad Y^* := \frac{Y - \mathbb{E}Y}{\sqrt{\text{Var}(Y)}}.$$

协方差的定义

称

$$\rho_{XY} := \text{Cov}(X^*, Y^*) = \frac{\text{Cov}(X, Y)}{\sqrt{\text{Var}(X) \cdot \text{Var}(Y)}}$$

为 X, Y 的**相关系数**.

相关系数与线性逼近

问题

对于随机变量 X, Y , Y 是否能表为 X 的线性函数? 若不能, **均方误差**

$$e = \mathbb{E}[Y - (a + bX)]^2$$

何时取得最小值?

限定 $b = 0$, $e = \mathbb{E}(Y - a)^2$ 何时最小?

由

$$\frac{\partial e}{\partial a} = \mathbb{E}2(Y - a) \cdot (-1) = 0 \quad \Rightarrow \quad a = \mathbb{E}Y.$$

此时 e 为 Y 的方差!

原问题的简化

假设 $b \neq 0$, 则 $a = \mathbb{E}(Y - bX)$. 为此, 不失一般性, 我们可以只考虑 $\mathbb{E}Y = \mathbb{E}X = 0$, 否则我们以中心化的

$$\tilde{X} = X - \mathbb{E}X, \quad \tilde{Y} = Y - \mathbb{E}Y$$

代替 X, Y .

$e = \mathbb{E}(Y - bX)^2$ 何时最小?

解

对 b 求导, 得

$$\frac{\partial e}{\partial b} = \mathbb{E}2(Y - bX) \cdot (-X) = 0 \quad \Rightarrow \quad b = \frac{\mathbb{E}YX}{\mathbb{E}X^2} = \frac{\text{Cov}(X, Y)}{\text{Var}(X)}.$$

此时

$$e_{\min} = \text{Var}(Y)(1 - \rho_{XY}^2).$$

定理

- $|\rho_{XY}| \leq 1$ (Cauchy 不等式)
- $|\rho_{XY}| = 1 \Leftrightarrow Y \stackrel{\text{a.e.}}{=} a + bX$, a, b 为常数.

正相关与负相关

相关系数的实际意义

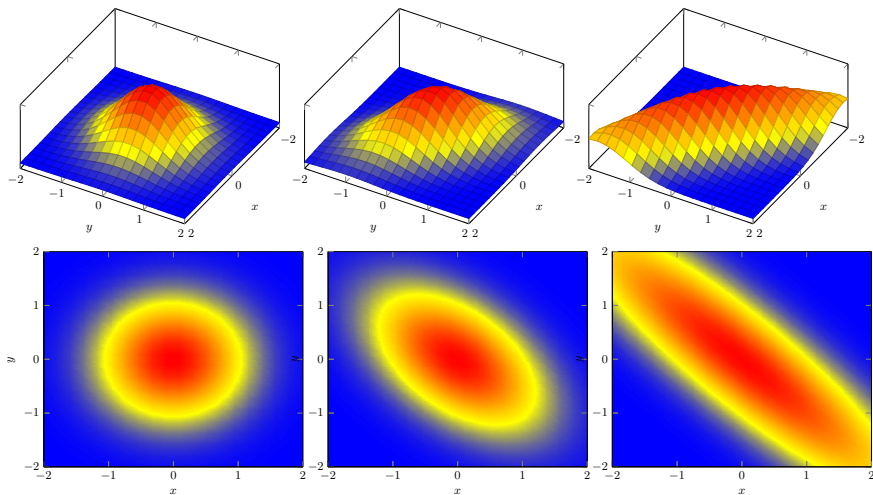
$e_{min} = \text{Var}(Y) \cdot (1 - \rho_{XY}^2)$ 说明:

- $|\rho_{XY}|$ 较大时均方误差 e 较小 $\Rightarrow X, Y$ 之间的线性关系较密切.
- 当 $|\rho_{XY}| = 1$ 时, X, Y 之间以概率 1 为线性关系.
- 当 $|\rho_{XY}|$ 较小时, X, Y 之间的线性关系较弱.

定义

- 当 $0 < \rho_{XY} \leq 1$ 时, 称 X 与 Y **正相关**.
- 当 $-1 \leq \rho_{XY} < 0$ 时, 称 X 与 Y **负相关**.
- 当 $\rho_{XY} = 0$ 时, 称 X 与 Y **不相关**.

$\mu_1 = \mu_2 = 0, \sigma_1 = \sigma_2 = 1$ 的二维正态分布



(a) $\rho = 0$: 不相关

(b) $\rho = -0.5$: 负相关

(c) $\rho = -0.9$: (强) 负相关

例题

设二维随机变量 (X, Y) 的密度函数为

$$f(x, y) = \begin{cases} x + y, & 0 \leq x \leq 1, 0 \leq y \leq 1, \\ 0, & \text{其它.} \end{cases}$$

求 $\mathbb{E}X$, $\mathbb{E}Y$, $\mathbb{E}XY$ 及 $\text{Cov}(X, Y)$.

解

$$\mathbb{E}X = \int_0^1 \int_0^1 x(x+y) dx dy = \frac{7}{12},$$

$$\mathbb{E}Y = \int_0^1 \int_0^1 y(x+y) dx dy = \frac{7}{12},$$

$$\mathbb{E}XY = \int_0^1 \int_0^1 xy(x+y) dx dy = \frac{1}{3},$$

$$\mathbb{E}XY = \mathbb{E}XY - \mathbb{E}X \cdot \mathbb{E}Y = -\frac{1}{144}.$$

例题

(X, Y) 在 D 上服从均匀分布, 求 $\text{Cov}(X, Y)$, ρ_{XY} .

解

区域 D 的面积为 $\frac{1}{2}$. 所以 (X, Y) 的联合密度为 $f(x, y) = 2 \cdot \mathbb{1}_D(x, y)$. 易得

$$\mathbb{E}X = \int_0^1 dy \int_0^{1-y} 2x dx = \frac{1}{3} = \mathbb{E}Y, \quad (\text{对称性})$$

$$\mathbb{E}XY = \int_0^1 y \cdot dy \int_0^{1-y} 2x dx = \frac{1}{4},$$

$$\text{Cov}(X, Y) = \mathbb{E}XY - \mathbb{E}X \cdot \mathbb{E}Y = -\frac{1}{36},$$

$$\mathbb{E}X^2 = \int_0^1 dy \int_0^{1-y} 2x^2 dx = \frac{1}{6},$$

$$\text{Var}(X) = \mathbb{E}X^2 - (\mathbb{E}X)^2 = \frac{1}{18} = \text{Var}(Y), \quad (\text{对称性}),$$

$$\rho_{XY} = \frac{\text{Cov}(X, Y)}{\sqrt{\text{Var}(X) \cdot \text{Var}(Y)}} = -\frac{1}{2}.$$

例题

设随机变量 (X, Y) 具有概率密度函数 $f(x, y) = \mathbb{1}_{(0,2)^2}(x, y) \frac{1}{8}(x + y)$. 求 $\mathbb{E}X$, $\mathbb{E}Y$ 及 ρ_{XY} .

解

$$\mathbb{E}X = \mathbb{E}Y = \int_0^2 dx \int_0^2 dy \cdot \frac{1}{8}x(x + y) = \frac{7}{6},$$

$$\mathbb{E}X^2 = \mathbb{E}Y^2 = \int_0^2 dx \int_0^2 dy \cdot \frac{1}{8}x^2(x + y) = \frac{5}{3},$$

$$\text{Var}(X) = \text{Var}(Y) = \frac{5}{3} - \left(\frac{7}{6}\right)^2 = \frac{11}{36},$$

$$\mathbb{E}XY = \int_0^2 dx \int_0^2 dy \cdot \frac{1}{8}xy(x + y) = \frac{4}{3}$$

$$\text{Cov}(X, Y) = \frac{4}{3} - \left(\frac{7}{6}\right)^2 = -\frac{1}{36},$$

$$\rho_{XY} = \frac{\text{Cov}(X, Y)}{\sqrt{\text{Var}(X) \cdot \text{Var}(Y)}} = -\frac{1}{11}.$$

例题

设随机变量 (X, Y) 服从圆域 $G: x^2 + y^2 \leq 1$ 上的均匀分布. 试讨论 X, Y 的独立性与相关性.

解

我们已求得

$$f_X(t) = f_Y(t) = \frac{2}{\pi} \sqrt{1-t^2} \cdot \mathbb{1}_{(-1,1)}(t),$$

而 $f(x, y) = \mathbb{1}_G(x, y) \cdot \frac{1}{\pi}$. 因此 X, Y 不独立. 又由积分区域和被积函数的对称性,

$$\mathbb{E}X = \mathbb{E}Y = \int_{-1}^1 x f_X(x) dx = 0,$$

$$\mathbb{E}XY = \int_{x^2+y^2 \leq 1} \frac{xy}{\pi} dxdy = 0.$$

因此 $\text{Cov}(X, Y) = 0$, $\rho_{XY} = 0$, 故 X, Y 不相关.

例题

设 (X, Y) 相互独立, 且都服从 $\mathcal{N}(\mu, \sigma^2)$. 令 $U = aX + bY$, $V = aX - bY$, a, b 为非零常数. 求 ρ_{UV} .

解

$$\text{Cov}(U, V) = \mathbb{E}UV - \mathbb{E}U \cdot \mathbb{E}V = a^2 \mathbb{E}X^2 - b^2 \mathbb{E}Y^2 - \left[a^2 (\mathbb{E}X)^2 - b^2 (\mathbb{E}Y)^2 \right].$$

对于正态分布, 由于 $\mathbb{E}X^2 = \text{Var}(X) + (\mathbb{E}X)^2 = \mu^2 + \sigma^2 = \mathbb{E}Y^2$, 代入得

$$\text{Cov}(U, V) = (a^2 - b^2)(\mu^2 + \sigma^2) - \left[a^2 \mu^2 - b^2 \mu^2 \right] = (a^2 - b^2)\sigma^2.$$

又 $\text{Var}(U) = \text{Var}(V) = a^2 \text{Var}(X) + b^2 \text{Var}(Y) = (a^2 + b^2)\sigma^2$, 因此

$$\rho_{XY} = \frac{a^2 - b^2}{a^2 + b^2}.$$

要善用协方差的线性性!

$$\text{Cov}(aX + bY, aX - bY) = a^2 \text{Cov}(X, X) - b^2 \text{Cov}(Y, Y) = (a^2 - b^2)\sigma^2.$$

二维正态分布的相关系数

设 $(X, Y) \sim \mathcal{N}(\mu_1, \mu_2, \sigma_1^2, \sigma_2^2, \rho)$. 则 $\rho_{XY} = \rho$.

证明

不失一般性, 我们可以假设 $\mu_1 = \mu_2 = 0, \sigma_1^2 = \sigma_2^2 = 1$. 此时 $\rho_{XY} = \mathbb{E}XY$. 我们有

$$f(x, y) = \frac{1}{2\pi\sqrt{1-\rho^2}} \cdot e^{-\frac{1}{2(1-\rho^2)}(x^2+y^2-\rho xy)} = \frac{1}{2\pi\sqrt{1-\rho^2}} \cdot e^{-\frac{1}{2(1-\rho^2)}[(y-\rho x)^2+(1-\rho^2)x^2]}.$$

令 $t = \frac{1}{\sqrt{1-\rho^2}(y-\rho x)^2}, u = x, J = 1$. 则

$$\begin{aligned}\mathbb{E}XY &= \int_{-\infty}^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} xyf(x, y) dx dy = \int_{-\infty}^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} (\sqrt{1-\rho^2}tu + \rho u^2) \frac{1}{2\pi} e^{-\frac{t^2+u^2}{2}} dt du \\ &= \frac{\rho}{2\pi} \int_{-\infty}^{\infty} e^{-t^2} dt \cdot \int_{-\infty}^{\infty} u^2 e^{-u^2/2} + \frac{\sqrt{1-\rho^2}}{2\pi} \int_{-\infty}^{\infty} te^{-t^2/2} dt \cdot \int_{-\infty}^{\infty} ue^{-u^2/2} du \\ &= \frac{\rho}{2\pi} \sqrt{2\pi} \sqrt{2\pi} = \rho\end{aligned}$$

独立与不相关的关系

- X, Y 相互独立 $\Rightarrow X, Y$ 互不相关:
 X, Y 没有任何关系, 当然也没有线性关系.
- X, Y 互不相关 $\nRightarrow X, Y$ 相互独立:
 X, Y 没有线性关系, 但是可能有其它关系.

特例

对于二维正态分布 $(X, Y) \sim \mathcal{N}(\mu_1, \mu_2, \sigma_1^2, \sigma_2^2, \rho)$,

$$\begin{aligned} X, Y \text{ 相互独立} &\Leftrightarrow \rho = 0 \\ &\Leftrightarrow \rho_{XY} = 0 \\ &\Leftrightarrow X, Y \text{ 互不相关.} \end{aligned}$$

矩 (Moment) 的定义

对于随机变量 X, Y 称

- $\mathbb{E}X^k$, $k = 1, 2, \dots$, 为 k 阶原点矩 (k 阶矩);
- $\mathbb{E}(X - \mathbb{E}X)^k$, $k = 2, 3, \dots$, 为 k 阶中心矩;
- $\mathbb{E}X^k Y^l$, $k, l = 1, 2, \dots$, 为 $k + l$ 阶混合矩;
- $\mathbb{E}(X - \mathbb{E}X)^k (Y - \mathbb{E}Y)^l$, $k, l = 1, 2, \dots$, 为 $k + l$ 阶混合中心矩.

例子

- $\mathbb{E}X$: 1 阶原点矩.
- $\text{Var}(X)$: 2 阶中心矩.
- $\text{Cov}(X, Y)$: 2 阶混合中心矩.

协方差矩阵

对于二维随机变量 $X = (X_1, X_2)$, 记

$$c_{11} = \mathbb{E}(X_1 - \mathbb{E}X_1)^2 = \text{Var}(X_1),$$

$$c_{12} = c_{21}$$

$$c_{21} = \mathbb{E}(X_2 - \mathbb{E}X_2)(X_1 - \mathbb{E}X_1) = \text{Cov}(X_2, X_1), \quad c_{22} = \mathbb{E}(X_2 - \mathbb{E}X_2)^2 = \text{Var}(X_2).$$

写作矩阵的形式

$$C := \text{Cov}(X, X) := \begin{bmatrix} c_{11} & c_{12} \\ c_{21} & c_{22} \end{bmatrix}$$

称为 $X = (X_1, X_2)$ 的**协方差矩阵**.

协方差矩阵的性质

- $C^T = C$, 即 C 为对称阵
- $C \geq 0$, 即 C 为正定 (非负定) 方阵

正定性证明

任取 $v = (a, b)^T \in \mathbb{R}^2$, 则

$$v^T C v = \text{Cov}(aX_1 + bX_2, aX_1 + bX_2) = \text{Var}(aX_1 + bX_2) \geq 0.$$

总结: 协方差和相关系数的性质

- ① 对称性: $\text{Cov}(X, Y) = \text{Cov}(Y, X)$
- ② 数乘: $\text{Cov}(aX, bY) = ab \text{Cov}(X, Y)$
- ③ (双) 线性性: $\text{Cov}(X + Y, Z) = \text{Cov}(X, Z) + \text{Cov}(Y, Z)$.
- ④ $\text{Cov}(X, X) = \text{Var}(X)$.
- ⑤ $\text{Var}(X \pm Y) = \text{Var}(X) + \text{Var}(Y) \pm 2 \text{Cov}(X, Y)$.
- ⑥ $|\rho_{XY}| \leq 1$
- ⑦ $|\rho_{XY}| = 1 \iff \text{存在常数 } a \neq 0, b \text{ 使得 } \mathbb{P}(Y = aX + b) = 1.$

- ① 随机变量的期望
- ② 方差和标准差
- ③ 协方差和相关系数
- ④ 条件期望和预测
- ⑤ 矩生成函数
- ⑥ 近似方法

- ① 随机变量的期望
- ② 方差和标准差
- ③ 协方差和相关系数
- ④ 条件期望和预测
- ⑤ 矩生成函数
- ⑥ 近似方法

- ① 随机变量的期望
- ② 方差和标准差
- ③ 协方差和相关系数
- ④ 条件期望和预测
- ⑤ 矩生成函数
- ⑥ 近似方法