

3. DISKRETNE SLUČAJNE VARIJABLE

3.1. DEFINICIJE I OSNOVNA SVOJSTVA

→ neka je $S = \{x_1, x_2, \dots, x_n\}$ konačan ili prebrojiv skup
te neka varijabla X svakom elementarnom događaju pridružuje
neku vrijednost iz S .

Kolika je vjerojatnost da X poprimi neku vrijednost iz tog
skupa? $P(X=x_k) = ?$

!
def.

Preslikavanje $X: \Omega \rightarrow S$ je **DISKRETNA SLUČAJNA VARIJABLA** ako
za $\forall x_k \in S$ je skup $A_k = \{\omega \in \Omega: X(\omega) = x_k\}$ događaj.

→ oznake: $p_k = P(X=x_k)$, $p_k > 0$ $\sum p_k = 1$ ČESTO KORISTITI!

→ ZAKON RAZDIOBE SLUČAJNE VARIJABLE:

$$X \sim \begin{pmatrix} x_1 & x_2 & x_3 & \dots & x_k & \dots \\ p_1 & p_2 & p_3 & \dots & p_k & \dots \end{pmatrix}$$

Zad.) Bacamo 3 kocke. Neka je slučajna varijabla broj šestica.
 Odredi razdiobu od X i izračunaj vjerojatnost $P(X \geq 2) = ?$

$$X \sim \begin{pmatrix} 0 & 1 & 2 & 3 \\ \underbrace{\left(\frac{5}{6}\right)^3}_{p_0} & \underbrace{\binom{3}{1} \frac{1}{6} \left(\frac{5}{6}\right)^2}_{p_1} & \underbrace{\binom{3}{1} \left(\frac{1}{6}\right)^2 \frac{5}{6}}_{p_2} & \underbrace{\left(\frac{1}{6}\right)^3}_{p_3} \end{pmatrix}$$

→ mogući broj šestica
 → vjerojatnost da padne taj br. šestica

!! ODABRATI NA KOJOJ KOCKI JE PALA ŠESTICA !!

SAVIJET!

NE ZABORAVI — NAJKOMPLICIRANIJU SLUČAJ RAČUNAJ
 KAO 1 MINUS SUMA OSTALIH !

$$P(X \geq 2) = P(X=2) + P(X=3) = p_2 + p_3 = \binom{3}{1} \left(\frac{1}{6}\right)^2 \left(\frac{5}{6}\right) + \left(\frac{1}{6}\right)^3$$

→ vjerojatnost da padne 2 ili više šestica

2.DZ-2.) U urni se nalazi n -kuglica numeriranih s brojevima 1- n . Izvlačimo 3. Neka je X vrijednost najvećeg od ta 3 broja. Odredi zakon razdiobe ove slučajne varijable.

jer smo najmanje mogli izvući kombinaciju 123^{max}

$$X \sim \begin{pmatrix} 3 & 4 & 5 & \dots & k & \dots & n \\ \frac{1}{\binom{n}{3}} & \frac{\binom{3}{2}}{\binom{n}{3}} & \frac{\binom{4}{2}}{\binom{n}{3}} & \dots & \frac{\binom{k-1}{2}}{\binom{n}{3}} & \dots & \frac{\binom{n-1}{2}}{\binom{n}{3}} \end{pmatrix}$$

točno kombin.
123
manji

od 3 manja
broja izvuč još 2 br.
koja su manja od 4 koji je fiksiran

(11)

$$P(X=k) = \frac{\binom{k-1}{2}}{\binom{n}{3}}, \quad k=3, \dots, n$$

↑

NE ZABORAVI !!

→ službeno rješenje u knjižici..

Zad.)
 $x = \text{broj na prvoj kocki}$
 $y = \text{broj na drugoj kocki}$

$$P(x \leq 2, y = 3) = ?$$

$$P(x \leq 2, y = 3) = \frac{2}{6} \cdot \frac{1}{6} = \frac{2}{36} \quad \leadsto \text{pretpostavili da su NEZAVISNI}$$

↓ ↓
1 ili 2 SAMO 3

def.

SLUČAJNE VARIJABLE $x, y: \Omega \rightarrow S$ su NEZAVISNE ako za sve $x_k, y_j \in S$ vrijedi

$$P(x = x_k, y = y_j) = P(x = x_k) \cdot P(y = y_j)$$

def.

SLUČAJNE VARIJABLE x_1, \dots, x_n definirane na istom vjerojatnosnom prostoru Ω su nezavisne ako za sve A_1, \dots, A_n (dogadjaji) $\in S$ vrijedi $P(x_1 \in A_1, \dots, x_n \in A_n) = P(x_1 \in A_1) \cdot \dots \cdot P(x_n \in A_n)$.

... FUNKCIJE DISKRETNIH SLUČAJNIH VARIJABLI ...

\leadsto Neka je x neka slučajna varijabla, $\psi: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$.
Koliko je razdioba od varijable $y = \psi(x)$?

npr. $y = \sin x$

$$y = x^2$$

...

Primer.

$$X \sim \begin{pmatrix} -1 & 0 & 1 & 2 \\ 0.2 & 0.3 & 0.1 & 0.4 \end{pmatrix}$$

a) Odredi razdiobu od $y = x^2$.

$$y \sim \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 & 4 \\ 0.2 & 0.3 & 0.1 & 0.4 \end{pmatrix} \sim \begin{pmatrix} 0 & 1 & 4 \\ 0.3 & 0.3 & 0.4 \end{pmatrix}$$

\leadsto X-eri se kvadriraju, VJEROJATNOSTI OSTANU ISTE!

b) Odredi razdiobu $y = x_1 \cdot x_2$ gdje x_1 i x_2 imaju razdiobu kao x i nezavisne su.

$$y \sim \begin{pmatrix} -2 & -1 & 0 & 1 & 2 & 4 \\ 0.16 & 0.04 & 0.51 & 0.05 & 0.08 & 0.16 \end{pmatrix} \rightarrow \begin{matrix} \text{MNOŽIMO} \\ \text{SVAKI SA} \\ \text{SVAKIM IZ} \\ \text{RAZDIOBE} \end{matrix}$$

\leadsto KAKO RAČUNAMO VJEROJATNOSTI? :

$$P(y = -2) = P(x_1 = -1, x_2 = 2) + P(x_1 = 2, x_2 = -1)$$

$$\stackrel{\text{def.}}{\rightarrow} \stackrel{\text{nezavisne}}{=} P(x_1 = -1) \cdot P(x_2 = 2) + P(x_1 = 2) \cdot P(x_2 = -1) =$$

$$= 0.2 \cdot 0.4 + 0.4 \cdot 0.2 = 0.08 + 0.08$$

$$= 0.16$$

ITD. ZA OSTALE ...

ZAKLJUČAK:

$$x_1 \cdot x_2 \neq x^2$$

IAKO x_1 i x_2 IMAJU ISTU
RAZDIOBU ?

3.2. NUMERIČKE KARAKTERISTIKE SLUČAJNIH VARIJABLI

def.

OČEKIVANJE (OČEKIVANI ISHOD SLUČAJNE VARIJABLE) definiramo kao

$$E(x) = \sum_k x_k \cdot p_k$$

ako konvergira.

\leadsto oznake još i $m_x, \mu_x, \bar{x}, E_x \dots$

\leadsto za prethodni primjer vrijedi $E(x) = -1 \cdot 0.2 + 0 \cdot 0.3 + 1 \cdot 0.1 + 2 \cdot 0.4$
 $E(x) = 0.7$

Primjer 2.

$$X \sim \begin{pmatrix} 1 & 2 & 4 & 8 & \dots \\ \frac{1}{2} & \frac{1}{4} & \frac{1}{8} & \frac{1}{16} & \dots \end{pmatrix}$$

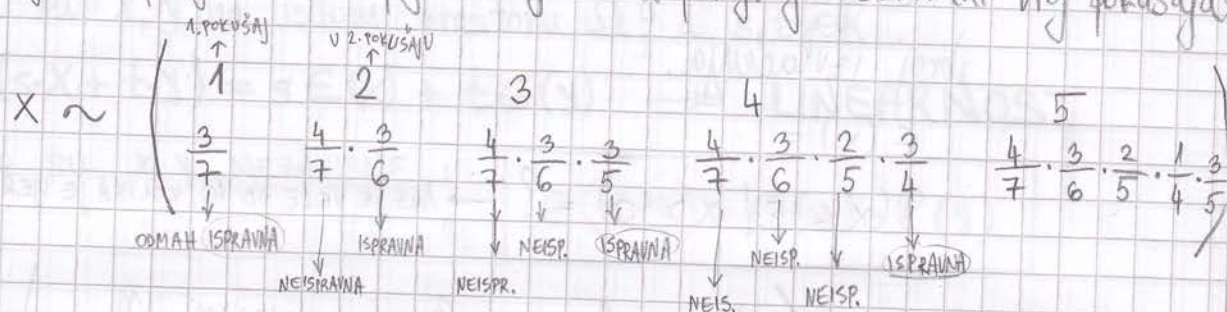
$$E(x) = 1 \cdot \frac{1}{2} + 2 \cdot \frac{1}{4} + 4 \cdot \frac{1}{8} + 8 \cdot \frac{1}{16} + \dots =$$

$$= \frac{1}{2} + \frac{1}{2} + \frac{1}{2} + \frac{1}{2} + \dots$$

$$= +\infty \rightarrow \text{SUMA DIVERGIRA!}$$

\Rightarrow OČEKIVANJE NE POSTOJI !!

2.D2-5.) Imamo 1 grlo i 7 žarulja. 3 su ispravne i 4 neispravne. Ako isprobavamo jednu po jednu do pojave svjetlosti, koji je očekivani broj pokušaja?



$$E(X) = 1 \cdot \frac{3}{7} + 2 \cdot \frac{4}{7} \cdot \frac{3}{6} + 3 \cdot \frac{4}{7} \cdot \frac{3}{6} \cdot \frac{3}{5} + 4 \cdot \frac{4}{7} \cdot \frac{3}{6} \cdot \frac{2}{5} \cdot \frac{3}{4} + 5 \cdot \frac{4}{7} \cdot \frac{3}{6} \cdot \frac{2}{5} \cdot \frac{1}{4} \cdot \frac{3}{3}$$

$$E(X) = \dots = 2$$

Zad.) U nekom kasinu igrač na ruletu igra opciju par/nepar (0, 1-36). Kolika je očekivana dobit ako je uložio 100 kn na par?

$$X \sim \begin{pmatrix} -100 & 100 \\ \frac{19}{37} & \frac{18}{37} \end{pmatrix}$$

↓ ↓
NEPARNI PARNI

$$E(X) = -100 \cdot \frac{19}{37} + 100 \cdot \frac{18}{37} = -100 \cdot \left(\frac{19}{37} - \frac{18}{37} \right) = -2.7 \text{ kn}$$

Zad.) Koliko treba nositi negativan odgovor u testu na zaokruživanje ako ima 5 ponuđenih odgovora, a pitanja nose po 2 boda, da očekivanje nasumično zaokruženih odgovora bude 0?

$$X \sim \begin{pmatrix} X & 2 \\ \frac{4}{5} & \frac{1}{5} \end{pmatrix}$$

↳ bodovi za netočnu ↳ točan odgovor (samo jedan)
4 su netočna

$$E(X) = \frac{4}{5}X + \frac{2}{5} = 0$$

$$X = -0.5$$

1.11-10-4.) a) Iz kutije u kojoj je 1 B i 4 C izvlačimo jednu po jednu kuglicu s vraćanjem u kutiju dok ne izvučemo B. Neka varijabla x bude broj izvlačenja.

$$e(x) = ?$$

$$P(X \leq 15 | X > 10) = ? \rightarrow \text{"Ako je veće od 10, kolika je vjer. da je } \leq 15? \text{"}$$

$$X \sim \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 & \dots & n \\ \frac{1}{5} & \frac{4}{5} \cdot \frac{1}{5} & \frac{4}{5} \cdot \frac{4}{5} \cdot \frac{1}{5} & \dots & \left(\frac{4}{5}\right)^{n-1} \cdot \frac{1}{5} \end{pmatrix}$$

$$E(x) = \sum_{n=1}^{\infty} n \cdot \left(\frac{4}{5}\right)^{n-1} \cdot \frac{1}{5} = \frac{1}{5} \cdot \frac{1}{\left(1 - \frac{4}{5}\right)^2} = 5$$

$$\sum_{n=1}^{\infty} x^n = \frac{1}{1-x}$$

$$\sum_{n=1}^{\infty} nx^{n-1} = \frac{1}{(1-x)^2}$$

$$P(X \leq 15 | X > 10) = \frac{P(10 < X \leq 15)}{P(X > 10)} = \frac{\left(\frac{4}{5}\right)^{10} \cdot \frac{1}{5} + \left(\frac{4}{5}\right)^{11} \cdot \frac{1}{5} + \dots + \left(\frac{4}{5}\right)^{14} \cdot \frac{1}{5}}{\left(\frac{4}{5}\right)^{10} \cdot \frac{1}{5} + \left(\frac{4}{5}\right)^{11} \cdot \frac{1}{5} + \dots}$$

b) $= 11 = \text{dok DVA POTA ne izručimo B.}$

$$X \sim \left(\begin{array}{c} 2 \\ \frac{1}{5} \cdot \frac{1}{5} \\ \downarrow \downarrow \\ B \quad B \end{array} \right) \quad \begin{array}{c} 3 \\ \frac{4}{5} \cdot \frac{1}{5} \cdot \frac{1}{5} \cdot \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix} \\ \downarrow \downarrow \downarrow \\ C \quad B \quad B \\ \quad \quad \downarrow \\ \quad \quad B \end{array} \quad \begin{array}{c} 4 \\ \frac{4}{5} \cdot \frac{4}{5} \cdot \frac{1}{5} \cdot \frac{1}{5} \cdot \begin{pmatrix} 3 \\ 1 \end{pmatrix} \dots \dots \dots \begin{pmatrix} n \\ \left(\frac{4}{5}\right)^{n-2} \cdot \left(\frac{1}{5}\right)^2 \cdot \underbrace{\begin{pmatrix} n-1 \\ 1 \end{pmatrix}}_{=(n-1)} \end{array}$$

$$E(x) = \sum_{n=2}^{\infty} n \cdot (n-1) \cdot \left(\frac{4}{5}\right)^{n-2} \cdot \left(\frac{1}{5}\right)^2 =$$

$$= \left(\frac{1}{5}\right)^2 \cdot \left[\frac{2}{\left(1 - \frac{4}{5}\right)^3} - 0 \right] =$$

$$= 10$$

PRVI ČLAN, $n=1$!!

TM "SVOJSTVO OČEKIVANJA"

→ Neka su x, y na istom prostoru Ω , a $s, t \in \mathbb{R}$

i) $E(s \cdot x + t \cdot y) = s E(x) + t E(y) \rightarrow$ LINEARNOST

ii) ako su x, y NEZAVISNE:

$$E(x \cdot y) = E(x) \cdot E(y)$$

! DOKAZ:

$$E(s \cdot x) = \sum_k s \cdot x_k \cdot p_k = s \cdot \sum_k x_k \cdot p_k = s \cdot E(x)$$

$$\begin{aligned} E(x+y) &= \sum_{j,k} (x_j + y_k) \cdot p_{jk} = \sum_{j,k} x_j \cdot p_{jk} + \sum_{j,k} y_k \cdot p_{jk} = \\ &= \sum_j x_j \underbrace{\sum_k p_{jk}}_{p_j} + \sum_k y_k \underbrace{\sum_j p_{jk}}_{p_k} = \sum_j x_j p_j + \sum_k y_k p_k = E(x) + E(y) \quad \parallel \end{aligned}$$

$$E(x \cdot y) = \sum_{j,k} x_j \cdot y_k \cdot p_{jk} = \sum_{j,k} x_j \cdot y_k \cdot p_j \cdot p_k = \sum_j x_j p_j \sum_k y_k p_k = E(x) \cdot E(y) \quad \parallel$$

→ Ako znamo razdiobu od x , koliko je očekivanje od $y = \psi(x)$?

⇒ prethodni primjeri: $y = x^2 \Rightarrow E(x) = E(x^2) = -2 \cdot 0.16 + \dots + 4 \cdot 0.16 = 1.9$

! $E(x^2) \neq E(x)^2$! $E(x^2) = \sum_k x_k^2 p_k$

OPĆENITO:

$$E(\psi(x)) = \sum_k \psi(x_k) \cdot p_k$$

def. ISHODIŠNI MOMENT REDA n od slučajne varijable x definira se kao

$$E(x^n) = \sum_k x_k^n p_k$$

def. CENTRALNI MOMENT REDA n definiramo sa

$$E[(x - \underbrace{E(x)}_{mx})^n] = \sum_k (x_k - mx)^n p_k$$

$$mx = E(x)$$

def. DISPERZIJA ILI VARIJANCA ILI RASIPANJE slučajne varijable x je (za $n=2$)

$$D(x) = E[(x - E(x))^2] \quad E(x) = mx$$

→ DISPERZIJA je mjera raspršenosti neke varijable.

Primer:

$$X \sim \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ \frac{1}{6} & \frac{2}{3} & \frac{1}{6} \end{pmatrix}$$

$$D(X) = \frac{1}{3}$$



$$\underline{D(X) < D(Y)}$$

$$Y \sim \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ \frac{1}{4} & \frac{1}{2} & \frac{1}{4} \end{pmatrix}$$

$$D(Y) = \frac{1}{2}$$



! Uoč!: $D(X) \geq 0$

def.

STANDARDNA DEVIJACIJA ILI ODSTUPANJE

$$\sigma = \sqrt{D(X)}$$



$$D(X) \geq 0$$

1.11-09-5.) Neka je x maksim. vrijednost od 2 broja ^{izabrana} iz skupa $\{1, \dots, 7\}$. Isti broj može biti 2 puta odabran. Odredite disperziju od x .

$$X \sim \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 & 4 & 5 & 6 & 7 \\ \frac{1}{49} & \frac{3}{49} & \frac{5}{49} & \frac{7}{49} & \frac{9}{49} & \frac{11}{49} & \frac{13}{49} \end{pmatrix}$$

Diagram showing combinations for each value of x :

- $x=1$: (1,1)
- $x=2$: (1,2), (2,1), (2,2)
- $x=3$: (1,3), (2,2), (3,1), (3,2), (3,3)
- $x=4$: (1,4), (2,3), (3,2), (4,1), (4,2), (4,3), (4,4)
- $x=5$: (1,5), (2,4), (3,3), (4,2), (5,1), (5,2), (5,3), (5,4), (5,5)
- $x=6$: (1,6), (2,5), (3,4), (4,3), (5,2), (6,1), (6,2), (6,3), (6,4), (6,5), (6,6)
- $x=7$: (1,7), (2,6), (3,5), (4,4), (5,3), (6,2), (7,1), (7,2), (7,3), (7,4), (7,5), (7,6), (7,7)

$$E(X) = \frac{1}{49} \cdot 1 + \frac{3}{49} \cdot 2 + \dots + 7 \cdot \frac{13}{49} = 5.143 //$$

$$D(X) = \sum_{k=1}^7 (x_k - E(X))^2 p_k = 2.69 // \rightarrow \text{po definiciji!}$$

"BILO JEDNE GODINE NA ISPITU:"

Izvedite formulu za

$$D(X) = E(X^2) - E(X)^2 = \sum_k x_k^2 p_k - m^2$$

DOKAZ IČ
IZVOD IČ

$$\begin{aligned} D(X) &= E[X^2 - 2XE(X) + E(X)^2] \\ &= E(X^2) - 2E(X)E(X) + E(X)^2 = \\ &= E(X^2) - E(X)^2 // \end{aligned}$$

koristili svojstvo linearnosti
i da konst. može ići
van

krenuli po definiciji

$$\text{da vrijedi } D(X) = E[(X - E(X))^2]$$

TM "SVOJSTVO DISPERZIJE"

i) $D(sx) = s^2 D(x)$ [OČIGLEDNO]

ii) ako su x i y NEZAVISNE tada

$$D(x+y) = D(x) + D(y)$$

DOKAZIC: (ISTO BILO NA ISPITU)

$$D(x+y) = E((x+y)^2) - [E(x+y)]^2 =$$

$$= E(x^2) + 2E(xy) + E(y^2) - (E(x) + E(y))^2 =$$

$$= \underbrace{E(x^2) - E(x)^2}_{D(x)} + \underbrace{E(y^2) - E(y)^2}_{D(y)} + \underbrace{2E(xy) - 2E(x)E(y)}_{=0 \text{ AKO SU NEZAVISNI}} =$$

PRESKOČILI CIJELO 3.2 I IZ 3.3 STR. 103, 104, 105 → U 2. CIKLUSU RADIMO

1. MI-11-4.) a) DOKAZITE SVOJSTVO DISPERZIJE ↑ Π

b) Ako je $D(x)=2$, $D(y)=4$ i x, y su nezavisni izračunajte $D(2x-y)$.

$$D(2x-y) = 4D(x) + D(y) = 4 \cdot 2 + 4 = 12$$

ILKOV ZADATAK! TIPICNE ILKOVE FORE!!

Π PAZI! JER (-1) IDE ISPRED NA KVADRAT!

2. KP2 - 12 - 2)

$$X \sim \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 & 4 & \dots \\ p & p^2 & p^3 & p^4 & \dots \end{pmatrix}$$

Odredite p , $E(x)$, $D(x)$.

suma svih p -ova mora biti 1!

$$\sum_{n=1}^{\infty} p^n = \frac{1}{1-p} - 1 = 1$$

PAZI !! FALI PRVI (NULTI) ČLAN !!
 $p^0 = 1$

$$\Rightarrow p = \frac{1}{2}$$

$$E(x) = \sum_{n=1}^{\infty} n p^n$$

$$\Rightarrow E(x) = p \frac{1}{(1-p)^2} = 2$$

$$D(x) = \sum_{n=1}^{\infty} n^2 p^n - 2^2 =$$

$$= p \frac{1+p}{(1-p)^3} - 4 = 2$$

$$\left\{ D(x) = \sum_k x_k^2 p_k - m x^2 = E(x^2) - E(x)^2 \right\} = \frac{1+x}{(1-x)^3} \quad | \cdot x$$

PODSJETNIK:

$$\sum x^n = \frac{1}{1-x} \quad |'$$

$$\sum_{n=1}^{\infty} n x^{n-1} = \frac{1}{(1-x)^2} \quad | \cdot x$$

$$\sum_{n=1}^{\infty} n x^n = \frac{x}{(1-x)^2} \quad |'$$

$$\sum n^2 x^{n-1} = \frac{(1-x)^2 + x \cdot 2 \cdot (1-x)}{(1-x)^4} =$$

$$= \frac{(1-x)[1-x+2x]}{(1-x)^4} =$$

$$\Rightarrow \sum n^2 x^n = x \cdot \frac{1+x}{(1-x)^3}$$

... KARAKTERISTIČNE FUNKCIJE ...

"VRLO VAŽNE! SKORO SVAKE GODINE NA ISPITU!"

def.

KARAKTERISTIČNU FUNKCIJU varijable x definiramo s

$$\varphi_x(t) = E[e^{itx}] = \sum_k e^{itx_k} \cdot p_k$$

pri čemu je " i " imaginarna jedinica.

TM "SVOJSTVA"

i) KARAKTERISTIČNA FUNKCIJA JEDNOZNACNO ODREĐUJE SLUČAJNU VARIJABLU
↳ NAJBITNIJE SVOJSTVO??

ii) Ako su x_1, \dots, x_n nezavisne, tada je

$$\varphi_{x_1 + \dots + x_n}(t) = \varphi_{x_1}(t) \cdot \dots \cdot \varphi_{x_n}(t)$$

iii)

$$E(x^n) = \frac{\varphi^{(n)}(0)}{i^n}$$

→ NAJS NAJS !!

→ posebno za $n=1$:

$$E(x) = -i \varphi'(0)$$



$$\leadsto D(x) = -v''(0) + v'(0)^2$$

2.D2-11.) Slučajna varijabla x poprima vrijednosti iz $\{-2, -1, 0, 1, 2\}$ s jednakom razdiobom. Izračunaj $D(x)$, $E(x)$

$$X \sim \begin{pmatrix} -2 & -1 & 0 & 1 & 2 \\ \frac{1}{5} & \frac{1}{5} & \frac{1}{5} & \frac{1}{5} & \frac{1}{5} \end{pmatrix}$$

$$v_x(t) = e^{-2it} \cdot \frac{1}{5} + e^{-it} \cdot \frac{1}{5} + e^{0it} \cdot \frac{1}{5} + e^{it} \cdot \frac{1}{5} + e^{2it} \cdot \frac{1}{5} =$$



$$= \frac{1}{5} + \frac{2}{5} \cos t + \frac{2}{5} \cos 2t //$$

$$\left. \begin{array}{l} \text{SIS:} \\ \cos t = \frac{1}{2} (e^{it} + e^{-it}) \end{array} \right\}$$

$$E(x) = 0$$

→ „VIDI SE ODMAH S MJESECA ZBOG DERIVIRANJA / UVRŠTAVANJE NULE !“ ALI I PO DEF. ...

ZAD. IZ 3. POGL. → SAMO OD 1.-13.

OSTALI ZAD SU ZA ONIH 5 PROMILA STUDENATA \Uparrow BUDA RULI

IZ 4. POGL. SVIH 25 ZAD !

U 2. ŠK. ULAZI 2., 3. I 4. POGLAVLJE !