

Rachunek prawdopodobieństwa i statystyka

Mateusz Podmokły III rok Informatyka WI

semestr zimowy 2025

Spis treści

1	Podstawy rachunku prawdopodobieństwa	2
1.1	Przestrzeń probabilistyczna	2
1.2	Prawdopodobieństwo warunkowe	4
1.3	Niezależność zdarzeń	4
2	Zmienne losowe jednowymiarowe	5
2.1	Zmienna losowa	5
2.2	Zmienne losowe rzeczywiste	5
2.3	Parametry zmiennej losowej	7
3	Wybrane rozkłady prawdopodobieństwa	10
3.1	Rozkłady dyskretne	10
3.1.1	Rozkład jednopunktowy	10
4	Literatura	10

1 Podstawy rachunku prawdopodobieństwa

1.1 Przestrzeń probabilistyczna

Definicja 1.1.1. Przestrzeń zdarzeń elementarnych.

Niepusty zbiór Ω wszystkich możliwych wyników doświadczenia losowego. Jego elementy to zdarzenia elementarne.

Definicja 1.1.2. σ -algebra zdarzeń.

Podrodzina Σ w rodzinie wszystkich podzbiorów Ω o następujących właściwościach:

1. $\Omega \in \Sigma$
2. Jeśli $A \in \Sigma$ to $A' = \Omega \setminus A \in \Sigma$
3. Dla dowolnego ciągu zbiorów A_1, A_2, \dots takiego, że $A_i \in \Sigma$ dla $i \in \mathbb{N}$, zachodzi

$$\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i \in \Sigma$$

Jej elementy to zdarzenia losowe.

Własności zdarzeń:

1. $\emptyset \in \Sigma$
2. Jeśli $A_1, A_2, \dots, A_n \in \Sigma$, to $A_1 \cup A_2 \cup \dots \cup A_n \in \Sigma$
3. Dla dowolnego ciągu A_1, A_2, \dots takiego, że $A_i \in \Sigma$ dla $i \in \mathbb{N}$, zachodzi

$$\bigcap_{i=1}^{\infty} A_i \in \Sigma$$

4. Jeśli $A, B \in \Sigma$ to $A \setminus B \in \Sigma$

Określmy niezbędną terminologię:

\emptyset – zdarzenie niemożliwe

Ω – zdarzenie pewne

$A' = \Omega \setminus A$ – dopełnienie zdarzenia A

$A \cap B = \emptyset$ – zdarzenia wzajemnie się wykluczają.

Definicja 1.1.3. Miara probabilistyczna (rozkład prawdopodobieństwa).

W przestrzeni Ω z σ -algebrą zdarzeń Σ dowolne odwzorowanie

$$P : \Sigma \rightarrow [0, 1]$$

spełniające warunki:

1. $P(\Omega) = 1$
2. Dla dowolnego ciągu zdarzeń A_1, A_2, \dots takiego, że $A_i \in \Sigma$ dla $i \in \mathbb{N}$ oraz $A_i \cap A_j = \emptyset$ dla $i \neq j$ zachodzi

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

Własności prawdopodobieństwa:

1. $P(\emptyset) = 0$
2. Jeśli skończony ciąg zdarzeń A_1, A_2, \dots, A_n spełnia warunek

$$A_i \cap A_j = \emptyset \text{ dla } i \neq j$$

to

$$P(A_1 \cup A_2 \cup \dots \cup A_n) = P(A_1) + P(A_2) + \dots + P(A_n)$$

3. Dla dowolnego zdarzenia A zachodzi

$$P(A') = 1 - P(A)$$

4. Dla dowolnych zdarzeń A i B zachodzi

$$P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A \cap B)$$

5. Jeśli $A \subset B$ to $P(A) \leq P(B)$

6. Jeśli zdarzenia A_1, A_2, \dots tworzą ciąg wstępujący, tzn.

$$A_1 \subset A_2 \subset \dots$$

to

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

7. Jeśli zdarzenia A_1, A_2, \dots tworzą ciąg zstępujący, tzn.

$$A_1 \supset A_2 \supset \dots$$

to

$$P\left(\bigcap_{i=1}^{\infty} A_i\right) = \lim_{i \rightarrow \infty} P(A_i)$$

Definicja 1.1.4. Przestrzeń probabilistyczna.

Trójka (Ω, Σ, P) , gdzie:

Ω – niepusty zbiór,

Σ – σ -algebra w Ω ,

P – miara probabilistyczna.

Liczbę $P(A)$ nazywamy prawdopodobieństwem zdarzenia A .

1.2 Prawdopodobieństwo warunkowe

Definicja 1.2.1. Prawdopodobieństwo warunkowe.

Liczba określona wzorem

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

gdzie

$A, B \subset \Omega$ – zdarzenia,

$$P(B) > 0.$$

Jest to prawdopodobieństwo A pod warunkiem B .

Definicja 1.2.2. Układ zupełny zdarzeń.

Skończony lub nieskończony ciąg zdarzeń A_1, A_2, \dots jeśli zdarzenia w ciągu parami wzajemnie się wykluczają, tzn.

$$A_i \cap A_j = \emptyset, \quad i \neq j$$

oraz zachodzi

$$\Omega = \bigcup_i A_i$$

Twierdzenie 1.2.1. Twierdzenie o prawdopodobieństwie całkowitym.

Jeśli zdarzenia A_1, A_2, \dots tworzą układ zupełny oraz $P(A_i) > 0$ dla $i \in \mathbb{N}$, to dla dowolnego zdarzenia B zachodzi

$$P(B) = \sum_i P(B | A_i)P(A_i)$$

Twierdzenie 1.2.2. Twierdzenie Bayesa.

Jeśli zdarzenia A_i tworzą układ zupełny taki, że $P(A_i) > 0$ dla $i \in \mathbb{N}$, a B jest zdarzeniem takim, że $P(B) > 0$, to dla dowolnego k zachodzi

$$P(A_k | B) = \frac{P(B | A_k)P(A_k)}{\sum_i P(B | A_i)P(A_i)}$$

1.3 Niezależność zdarzeń

Definicja 1.3.1. Niekorelacyjność zdarzeń.

Zdarzenia A i B nazywamy niezależnymi jeśli

$$P(A, B) = P(A) \cdot P(B)$$

Zdarzenia A_1, A_2, \dots, A_k nazywamy niezależnymi jeśli dla każdego układu indeksów i_1, i_2, \dots, i_k oraz dla każdego $k \in \{1, 2, \dots, m\}$ zachodzi

$$P(A_{i_1}, A_{i_2}, \dots, A_{i_k}) = P(A_{i_1}) \cdot P(A_{i_2}) \cdot \dots \cdot P(A_{i_k})$$

Definicja 1.3.2. Niezależność warunkowa.

Zdarzenia A i B są warunkowo niezależne względem C dla $P(C) > 0$ jeśli

$$P(A, B | C) = P(A | C) \cdot P(B | C)$$

Zdarzenia A_1, A_2, \dots, A_k są warunkowo niezależne względem C dla $P(C) > 0$ jeśli dla każdego układu indeksów i_1, i_2, \dots, i_k oraz dla każdego $k \in \{1, 2, \dots, m\}$ zachodzi

$$P(A_{i_1}, A_{i_2}, \dots, A_{i_k} | C) = P(A_{i_1} | C) \cdot P(A_{i_2} | C) \cdot \dots \cdot P(A_{i_k} | C)$$

2 Zmienne losowe jednowymiarowe

2.1 Zmienna losowa

Definicja 2.1.1. Zmienna losowa.

Zmienna losowa to odwzorowanie

$$X : \Omega \rightarrow \mathcal{X}$$

takie, że dla każdego $A \in \Sigma_{\mathcal{X}}$ zachodzi

$$X^{-1}(A) \in \Sigma$$

gdzie (Ω, Σ, P) jest przestrzenią probabilistyczną, \mathcal{X} dowolnym niepustym zbiorem, a $\Sigma_{\mathcal{X}}$ σ -algebrą podzbiorów \mathcal{X} .

Definicja 2.1.2. Rozkład prawdopodobieństwa zmiennej losowej.

Funkcję

$$P_X : \Sigma_{\mathcal{X}} \rightarrow [0, 1]$$

określającą następująco

$$P_X(A) = P(X^{-1}(A))$$

gdzie (Ω, Σ, P) jest przestrzenią probabilistyczną, \mathcal{X} niepustym zbiorem, $\Sigma_{\mathcal{X}}$ σ -algebrą w \mathcal{X} , a $X : \Omega \rightarrow \mathcal{X}$ zmienną losową.

2.2 Zmienne losowe rzeczywiste

Definicja 2.2.1. Dystrybuanta zmiennej losowej.

Niech $X : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ będzie zmienną losową rzeczywistą. Dystrybuantą zmiennej losowej rzeczywistej X nazywamy funkcję

$$F_X : \mathbb{R} \rightarrow [0, 1]$$

określającą wzorem

$$F_X(x) = P(X \leq x) = P_X((-\infty, x])$$

Własności dystrybuanty:

1. Jeśli $a < b$, to $F_X(b) - F_X(a) = P(a < X \leq b)$
2. F_X jest niemalejąca
3. $\lim_{x \rightarrow -\infty} F_X(x) = 0$ i $\lim_{x \rightarrow +\infty} F_X(x) = 1$
4. F_X jest prawostronnie ciągła, tzn. dla dowolnego $x_0 \in \mathbb{R}$ zachodzi

$$\lim_{x \rightarrow x_0^+} F_X(x) = F_X(x_0)$$

5. $F_X(x_0-) = \lim_{x \rightarrow x_0^-} F_X(x) = P(X < x_0)$
6. $P(X = x) = F_X(x) - F_X(x-)$
7. F_X jest ciągła w $x_0 \in \mathbb{R}$ wtedy i tylko wtedy, gdy

$$P(X = x_0) = 0$$

Definicja 2.2.2. Funkcja prawdopodobieństwa.

Rozkład dyskretny zmiennej X jest wyznaczony przez funkcję

$$p : \mathcal{S} \rightarrow [0, 1]$$

określona następująco:

$$p(x_k) = P_X(x_k) = P(X = x_k)$$

Funkcję p nazywamy funkcją prawdopodobieństwa rozkładu zmiennej X .

Definicja 2.2.3. Funkcja gęstości.

Gęstość zmiennej losowej X to funkcja

$$f : \mathbb{R} \rightarrow [0, +\infty)$$

taka, że dla dowolnych $a, b \in \mathbb{R} \cup \{-\infty, +\infty\}$ takich, że $a < b$ zachodzi

$$P(a < X < b) = \int_a^b f(x) dx$$

2.3 Parametry zmiennej losowej

Definicja 2.3.1. Wartość oczekiwana.

Wartością oczekiwana zmiennej losowej rzeczywistej X o rozkładzie dyskretnym z funkcją prawdopodobieństwa p nazywamy liczbę określoną wzorem

$$\mu = \mathbb{E}(X) = \sum_{k:x_k \in S} x_k \cdot p(x_k)$$

Jeśli X jest zmienną o rozkładzie ciągłym z gęstością f , to

$$\mu = \int_{-\infty}^{\infty} xf(x)dx$$

Własności wartości oczekiwanej:

1. $\mathbb{E}c = c$
2. $\mathbb{E}(aX + bY + c) = a\mathbb{E}X + b\mathbb{E}Y + c$

Definicja 2.3.2. Moment zwykły.

Momentem zwykłym rzędu k zmiennej losowej X dla $k \in \mathbb{N} \setminus \{0\}$ nazywamy liczbę

$$\mu'_k = \mathbb{E}(X^k)$$

Definicja 2.3.3. Moment centralny.

Momentem centralnym rzędu k zmiennej losowej X nazywamy liczbę

$$\mu_k = \mathbb{E}((X - \mu)^k)$$

Dla rozkładów dyskretnych

$$\mu'_k = \sum_{i:x_i \in S} x_i^k \cdot p(x_i)$$

$$\mu_k = \sum_{i:x_i \in S} (x_i - \mu)^k \cdot p(x_i)$$

Dla rozkładów ciągłych

$$\mu'_k = \int_{-\infty}^{\infty} x^k f(x)dx$$

$$\mu_k = \int_{-\infty}^{\infty} (x - \mu)^k f(x)dx$$

Definicja 2.3.4. Wariancja.

Wariancją zmiennej losowej X nazywamy jej drugi moment centralny, tzn.

$$Var(X) = \sigma^2 = \mu_2 = \mathbb{E}((X - \mu)^2)$$

Definicja 2.3.5. Odchylenie standardowe.

Odchyleniem standardowym zmiennej losowej X nazywamy pierwiastek jej wariancji, tzn.

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

Własności wariancji:

1. $Var(X) = \mathbb{E}(X^2) - (\mathbb{E}X)^2$
2. Jeśli zmienna X ma skończoną wariancję, to dla dowolnych $a, b \in \mathbb{R}$ zachodzi

$$Var(aX + b) = a^2 Var(X)$$

3. $Var(X) = 0$ wtedy i tylko wtedy, gdy X jest stała z prawdopodobieństwem 1, tzn. istnieje $x_0 \in \mathbb{R}$ takie, że

$$P(X \neq x_0) = 0$$

4. Funkcja $\phi(c) = \mathbb{E}((X - c)^2)$ przyjmuje wartość najmniejszą dla $c = \mathbb{E}(X)$

Definicja 2.3.6. Funkcja tworząca momenty (MGF).

Funkcją tworzącą momenty rzeczywistej zmiennej losowej X nazywa się funkcję określoną wzorem

$$M_X(t) = \mathbb{E}(e^{tX})$$

Jeśli X ma rozkład dyskretny z funkcją prawdopodobieństwa p , to funkcja tworząca momenty wyraża się wzorem

$$M_X(t) = \sum_{x_k \in \mathcal{S}} e^{tx_k} p(x_k)$$

Jeśli X ma rozkład ciągły o gęstości f , to funkcja tworząca momenty ma postać

$$M_X(t) = \int_{-\infty}^{+\infty} e^{tx} f(x) dx$$

Niech $a, b \in \mathbb{R}$. Własności MGF:

1. $M_{aX}(t) = M_X(at)$
2. $M_{X+b}(t) = e^{bt} M_X(t)$
3. $M_{aX+b}(t) = e^{bt} M_X(at)$
4. $M^{(k)}(0) = \mathbb{E}(X^k)$

Definicja 2.3.7. Współczynnik asymetrii (skośność).

Współczynnikiem skośności rozkładu zmiennej X nazywamy liczbę

$$A = \gamma_1 = \frac{\mu_3}{\sigma^3}$$

Rozkład, dla którego:

- $A = 0$ nazywa się **symetrycznym**
- $A > 0$ nazywa się **prawostronnie skośnym**
- $A < 0$ nazywa się **lewostronnie skośnym**

Definicja 2.3.8. Kurtoza.

Kurtozą nazywamy liczbę

$$Kurt(X) = K = \frac{\mu_4}{\sigma^4}$$

natomaiast **kurtozą nadwyżkową** nazywamy liczbę

$$\gamma_3 = Kurt(X) - 3$$

Definicja 2.3.9. Standaryzacja.

Zmienną o wartości średniej 0 i wariancji 1 nazywa się zmienną standaryzowaną. Jeśli X jest dowolną zmienną o niezerowej wariancji, to

$$Z = \frac{X - \mu}{\sigma}$$

jest zmienną standaryzowaną.

Twierdzenie 2.3.1. Nierówność Czebyszewa.

Jeśli zmienna losowa X ma skończoną wartość średnią μ i skończoną wariancję σ^2 , to dla dowolnego $\epsilon > 0$ zachodzi

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

Jeśli w miejsce ϵ podstawimy $\epsilon\sigma$, to otrzymamy

$$P(|X - \mu| \geq \epsilon\sigma) \leq \frac{1}{\epsilon^2}$$

Definicja 2.3.10. Kwantyl.

Kwantylem rzędu $p \in (0, 1)$ zmiennej losowej X o dystrybuancie F nazywamy dowolną liczbę $q_p \in \mathbb{R}$ taką, że

$$F(q_p^-) \leq p \leq F(q_p)$$

Kwantyl $q_{0.5}$ rzędu $\frac{1}{2}$ nazywamy **medianą**, kwantyl rzędu $\frac{1}{4}$ nazywamy **dolnym kwartylem**, a kwantyl rzędu $\frac{3}{4}$ nazywamy **górnym kwartylem**.

Jeśli X ma rozkład ciągły, to kwantylem q_p rzędu p jest dowolne q_p spełniające równanie

$$F(q_p) = p$$

Definicja 2.3.11. Moda.

Modą zmiennej losowej o rozkładzie dyskretnym nazywa się dowolne maksimum funkcji prawdopodobieństwa tego rozkładu. Jeżeli zmienna ma rozkład ciągły to modą jest dowolne maksimum lokalne gęstości tego rozkładu.

3 Wybrane rozkłady prawdopodobieństwa

3.1 Rozkłady dyskretne

3.1.1 Rozkład jednopunktowy

4 Literatura

- [1] Smołka, M. (2025). Rachunek prawdopodobieństwa i statystyka. *Wykłady prowadzone na Akademii Górnictwo-Hutniczej w Krakowie*.