

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
3.2	Rozkłady ciągłe	17
4	Literatura	18

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. Niezależność 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

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

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

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

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

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

określoną 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. Dystrybucja zmiennej losowej.**

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

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

określoną 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

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

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

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

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

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

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

$$\begin{aligned}\mu'_k &= \sum_{i: x_i \in \mathcal{S}} x_i^k \cdot p(x_i) \\ \mu_k &= \sum_{i: x_i \in \mathcal{S}} (x_i - \mu)^k \cdot p(x_i)\end{aligned}$$

Dla rozkładów ciągłych

$$\begin{aligned}\mu'_k &= \int_{-\infty}^{\infty} x^k f(x) dx \\ \mu_k &= \int_{-\infty}^{\infty} (x - \mu)^k f(x) dx\end{aligned}$$

Definicja 2.3.4. Wariancja.

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

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

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. $Var(X + Y) = Var(X) + Var(Y) + 2Cov(X, Y)$
4. $Var(X) = 0$ wtedy i tylko wtedy, gdy X jest stała z prawdopodobieństwem 1, tzn. istnieje $x_0 \in \mathbb{R}$ takie, że

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

Definicja 2.3.5. Odchylenie standardowe.

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

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

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

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

natomiast **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 dystrybucie 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 kwantylem**, a kwantyl rzędu $\frac{3}{4}$ nazywamy **górnym kwantylem**.

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

Definicja 3.1.1. Rozkład jednopunktowy.

Jeśli $\mathcal{S} = \{x_0\}$ i $p(x_0) = 1$, to mówimy, że zmienna losowa ma **rozkład jednopunktowy**. Wtedy przyjmuje parametry:

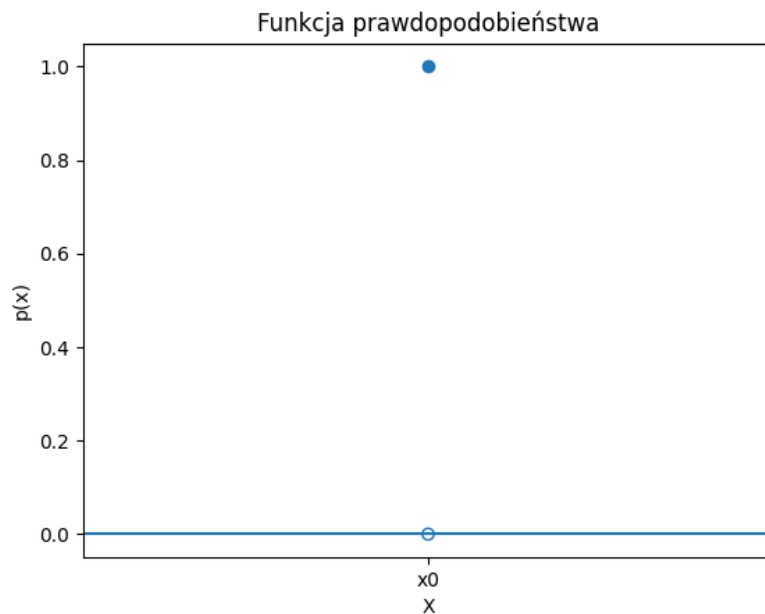
$$\mu = x_0$$

$$\sigma^2 = 0$$

$$A = 0$$

$$K = 0$$

$$\gamma_2 = -3$$



Rysunek 1: Funkcja prawdopodobieństwa w rozkładzie jednopunktowym.

Definicja 3.1.2. Rozkład dwupunktowy.

Jeśli

$$\mathcal{S} = \{x_1, x_2\}$$

oraz

$$p(x_1) = \theta$$

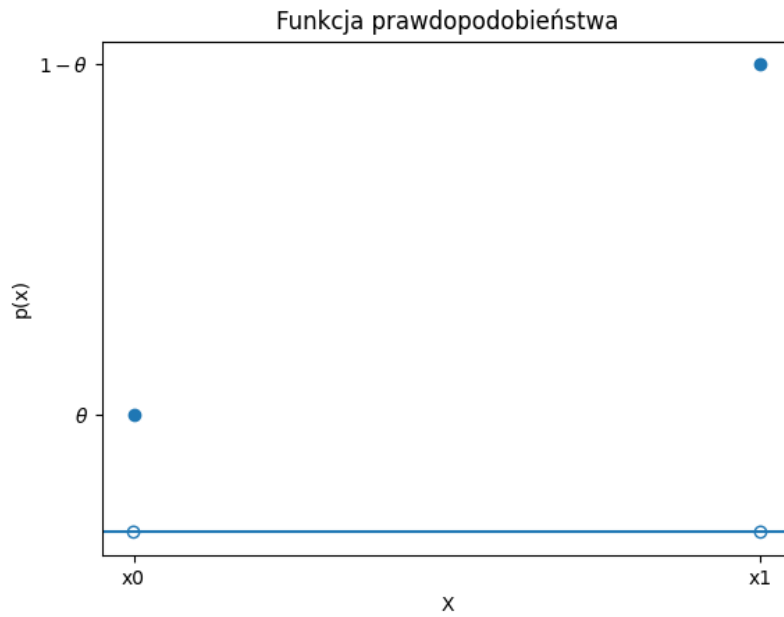
$$p(x_2) = 1 - \theta$$

dla pewnego $\theta \in (0, 1)$, to mówimy, że zmienna losowa ma **rozkład dwupunktowy** z parametrem θ . Wtedy przyjmuje parametry:

$$\mu = \theta x_1 + (1 - \theta)x_2$$

$$\sigma^2 = \theta(1 - \theta)(x_1 - x_2)^2$$

$$A = \operatorname{sgn}(x_1 - x_2) \frac{1 - 2\theta}{\sqrt{\theta(1 - \theta)}}$$



Rysunek 2: Funkcja prawdopodobieństwa w rozkładzie dwupunktowym.

Definicja 3.1.3. Rozkład Bernoulli’ego.

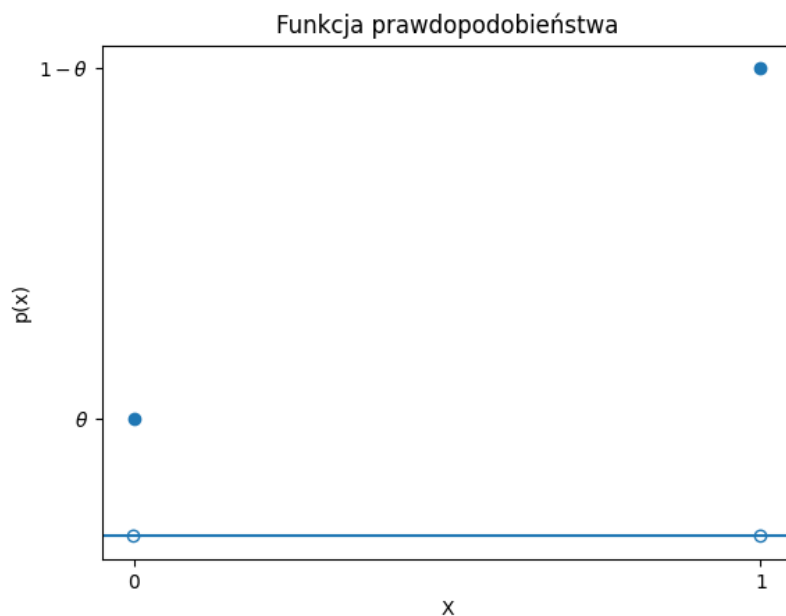
Rozkład dwupunktowy, w którym $x_1 = 1$ i $x_2 = 0$ nazywa się **rozkładem Bernoulli’ego** z parametrem θ

$$X \sim \operatorname{Bern}(\theta)$$

Wówczas

$$\mu = \theta$$

$$\sigma^2 = \theta(1 - \theta)$$



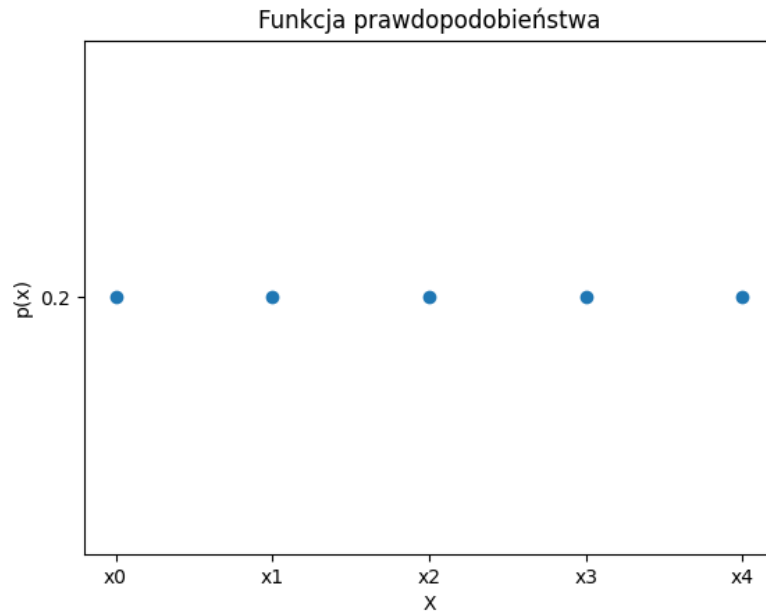
Rysunek 3: Funkcja prawdopodobieństwa w rozkładzie Bernoulli'ego.

Definicja 3.1.4. Dyskretny rozkład jednostajny.

Jeśli $\mathcal{S} = \{x_1, x_2, \dots, x_n\}$ i $p(x_i) = \frac{1}{n}$ dla każdego $i \in \{1, 2, \dots, n\}$, to mówimy, że zmienna losowa ma **dyskretny rozkład jednostajny** na n punktach. Wówczas

$$\mu = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i$$

$$\sigma^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \mu)^2$$



Rysunek 4: Funkcja prawdopodobieństwa w dyskretnym rozkładzie jednostajnym.

Definicja 3.1.5. Próba Bernoulli’ego.

Rozważmy doświadczenie losowe o dwu możliwych wynikach:

- **sukces** z prawdopodobieństwem $\theta \in (0, 1)$
- **porażka** z prawdopodobieństwem $1 - \theta$

Doświadczenie tego rodzaju nazywamy **próbą Bernoulli’ego**.

Definicja 3.1.6. Schemat dwumianowy.

Schemat doświadczenia określony jako n -krotne powtórzenie próby Bernoulli’ego w ten sposób, że poszczególne próby są niezależne. Długość schematu może być skończona lub nieskończona.

Definicja 3.1.7. Rozkład dwumianowy.

Niech X będzie zmienną losową, której wartością jest liczba sukcesów w schemacie dwumianowym o długości n z prawdopodobieństwem sukcesu θ . Wówczas X ma rozkład dyskretny, w którym

$$\mathcal{S} = \{0, 1, \dots, n\}$$

oraz

$$p(k) = \binom{n}{k} \theta^k (1 - \theta)^{n-k}$$

Jeśli zmienna X ma rozkład dwumianowy o parametrach $n \in \mathbb{N}$ i $\theta \in (0, 1)$, to zapisujemy

$$X \sim \text{Binom}(n, \theta)$$

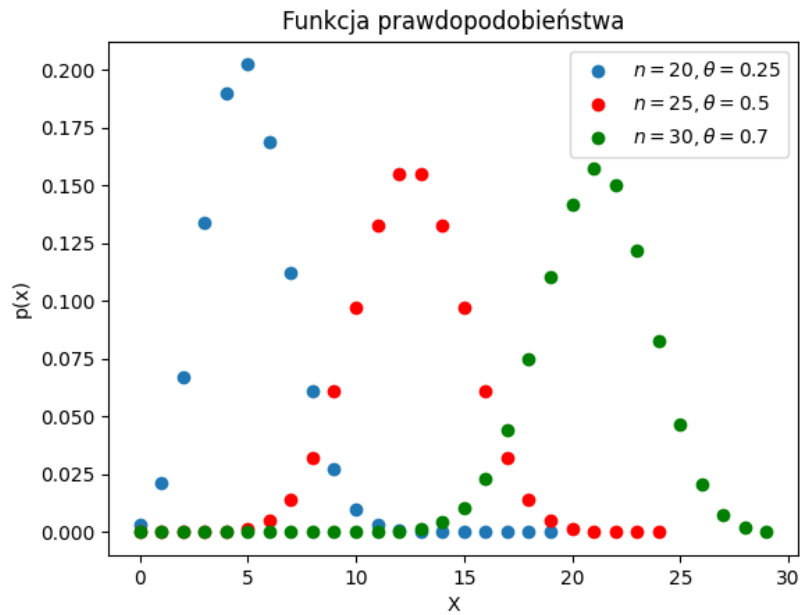
oraz

$$\mu = n\theta$$

$$\sigma^2 = n\theta(1 - \theta)$$

Łatwo zauważyć, że

$$\text{Binom}(1, \theta) = \text{Bern}(\theta).$$



Rysunek 5: Funkcja prawdopodobieństwa w rozkładzie dwumianowym.

Definicja 3.1.8. Rozkład geometryczny.

Zmienna losowa T ma rozkład geometryczny z parametrem $\theta \in (0, 1)$

$$T \sim \text{Geom}(\theta),$$

jeśli

$$\mathcal{S} = \mathbb{N} \setminus \{0\},$$

a funkcja prawdopodobieństwa ma postać

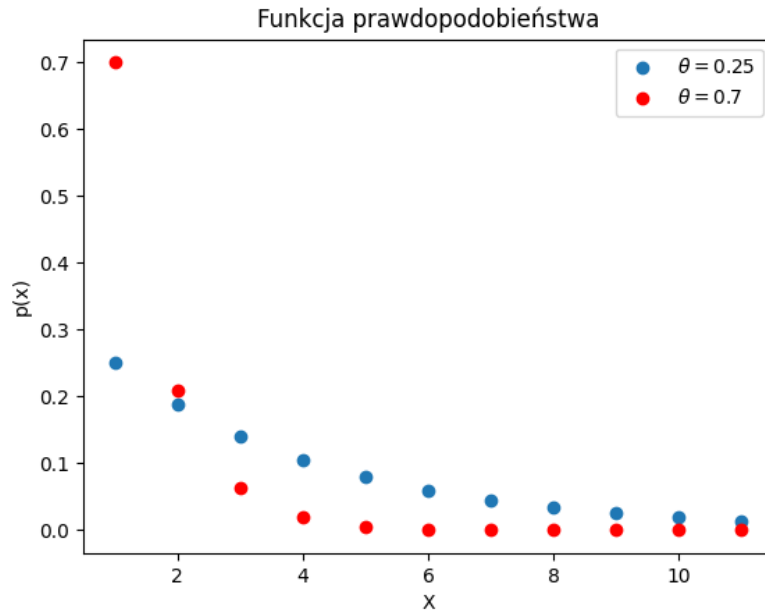
$$p(k) = (1 - \theta)^{k-1} \theta$$

$$k \in \mathcal{S}$$

Zmienna T opisuje czas oczekiwania na pierwszy sukces w schemacie dwumianowym (o nieskończonej długości). Wówczas

$$\mu = \frac{1}{\theta}$$

$$\sigma^2 = \frac{1 - \theta}{\theta^2}$$



Rysunek 6: Funkcja prawdopodobieństwa w rozkładzie geometrycznym.

Definicja 3.1.9. Rozkład Poissona.

Jeśli zmienna N o wartościach w \mathbb{N} opisuje liczbę wystąpień pewnego powtarzalnego zdarzenia w przedziale czasowym $[0, t]$, przy czym spełnione są założenia:

- powtórzenia zdarzenia występują niezależnie od siebie,
- intensywność wystąpień $r > 0$, czyli średnia liczba wystąpień w jednostce czasu jest stała,
- w danej chwili może zajść co najwyżej jedno powtórzenie,

to zmienna ma rozkład Poissona z parametrem $\lambda = rt > 0$

$$N \sim Pois(\lambda).$$

Wówczas

$$\mathcal{S} = \mathbb{N} \cup \{0\}$$

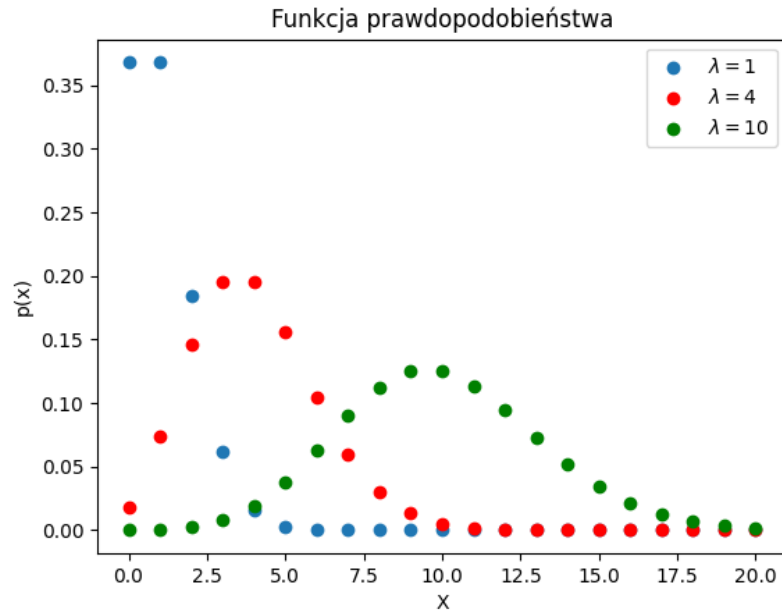
$$p(k) = \frac{e^{-\lambda} \lambda^k}{k!}$$

$$k \in \mathcal{S}$$

oraz

$$\mu = \lambda$$

$$\sigma^2 = \lambda$$



Rysunek 7: Funkcja prawdopodobieństwa w rozkładzie Poissona.

Twierdzenie 3.1.1. Twierdzenie Poissona.

Niech X_n będzie ciągiem zmiennych losowych takich, że

$$X_n \sim \text{Binom}(n, \theta_n),$$

gdzie θ_n jest takim ciągiem, że

$$\lim_{n \rightarrow \infty} n\theta_n = \lambda$$

dla pewnej liczby $\lambda > 0$. Wówczas

$$\lim_{n \rightarrow \infty} P(X_n = k) = \frac{e^{-\lambda} \lambda^k}{k!}.$$

3.2 Rozkłady ciągłe

Definicja 3.2.1. Rozkład jednostajny.

Mówimy, że zmienna losowa X ma rozkład jednostajny na przedziale $[a, b]$ jeśli jej gęstość wyraża się wzorem

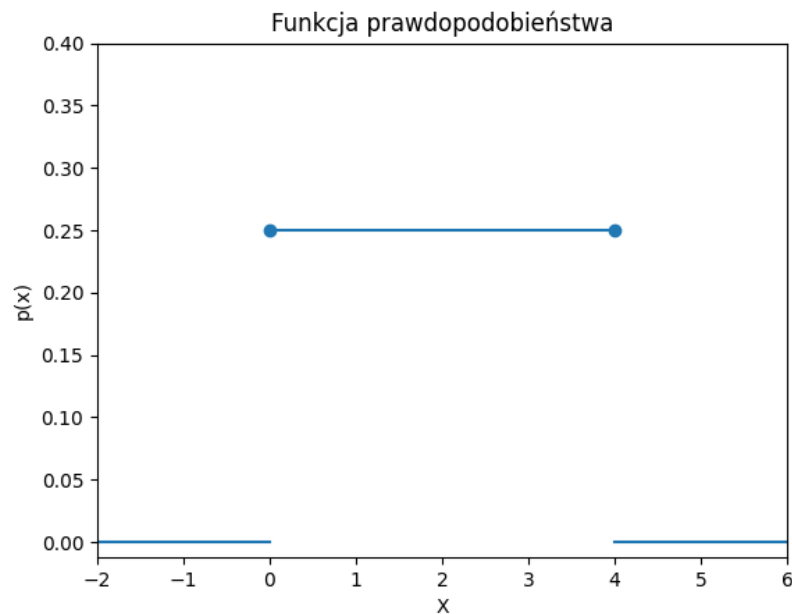
$$f(x) = \begin{cases} \frac{1}{b-a} & , x \in [a, b] \\ 0 & , x \notin [a, b] \end{cases}$$

zapisujemy

$$X \sim \mathcal{U}(a, b).$$

Wówczas

$$\mu = \frac{a+b}{2}$$
$$\sigma^2 = \frac{(b-a)^2}{12}$$



Rysunek 8: Funkcja prawdopodobieństwa w rozkładzie jednostajnym.

Definicja 3.2.2. Rozkład wykładniczy.

Niech T będzie zmienną modelującą czas oczekiwania na pierwsze zdarzenie w ciągu zdarzeń takim, że ich liczba w przedziale $[0, 5]$ opisana jest przez zmienną X o rozkładzie Poissona z parametrem λ . Mówimy wtedy, że T ma rozkład wykładniczy z parametrem λ

$$T \sim \text{Exp}(\lambda)$$

Gęstość ma postać

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

Wówczas

$$\mu = \frac{1}{\lambda}$$
$$\sigma^2 = \frac{1}{\lambda^2}$$

4 Literatura

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