## Verjetnost 1 - definicije, trditve in izreki Oskar Vavtar 2020/21

### Kazalo

1	DEFINICIJA VERJETNOSTI1.1Neformalni uvod v verjetnost1.2Aksiomična definicija verjetnosti	
2	POGOJNA VERJETNOST	7
3	ZAPOREDJA NEODVISNIH PONOVITEV POSKUSA	9
4	SLUČAJNE SPREMENLJIVKE	10

#### 1 DEFINICIJA VERJETNOSTI

#### 1.1 Neformalni uvod v verjetnost

**Definicija 1.1** (Verjetnost). Izvajamo poskus. Opazujemo določen pojav, ki ga imenujemo dogodek. Poskus ponovimo n - krat.

Definirajmo frekvenco dogodka  $k_n(A)$  kot število ponovitev, pri katerih se dogodek zgodi.

Relativna frekvenca je definirana kot  $f_n(A) = \frac{k_n(A)}{n}$ . Zaporedje  $\{f_n(A)\}_{n \in \mathbb{N}}$  konvergira k nekem številu  $p \in [0, 1]$ .

STATISTIČNA DEFINICIJA VERJETNOSTI je definirana kot

$$\mathbb{P}(A) = \lim_{n \to \infty} \{ f_n(A) \}.$$

Klasična definicija verjetnosti je definirana kot

$$\mathbb{P}(A) = \frac{\text{št. ugodnih izidov A}}{\text{št. vseh izidov A}}.$$

Če je izidov neskončno mnogo uporabimo geometrijsko definicijo verjetnosti.

#### 1.2 Aksiomična definicija verjetnosti

**Definicija 1.2.** Imamo prostor vseh izidov oz. vzorčni prostor  $\Omega$ . Dogodki so nekatere (ne nujno vse) podmnožice  $\Omega$ .

Definicija 1.3 (Operacije na dogodkih).

1. VSOTA oz. UNIJA dogodkov:

$$A + B = A \cup B$$

je dogodek, ki se zgodi, če se zgodi vsaj eden od dogodkov A in B.

2. Produkt oz. Presek dogodkov:

$$A \cdot B = A \cap B$$

je dogodek, ki se zgodi, če se zgodita oba dogodka A in B hkrati.

3. Nasprotni dogodek oz. komplement dogodkov:

$$\bar{A} = A^C$$

je dogodek, ki se zgodi, če se dogodek A ne zgodi.

Opomba. Pravila za računanje z dogodki:

1. Idempotentnost:

$$A \cup A = A = A \cap A$$

2. Komutativnost:

$$A \cup B = B \cup A$$

$$A \cap B = B \cap A$$

3. Asociativnost:

$$(A \cup B) \cup C = A \cup (B \cup C)$$

$$(A \cap B) \cap C = A \cap (B \cap C)$$

4. Distributivnost:

$$(A \cup B) \cap C = (A \cap C) \cup (B \cap C)$$

$$(A \cap B) \cup C = (A \cup C) \cap (B \cup C)$$

5. de Morganova zakona:

$$(A \cap B)^C = A^C \cup B^C$$

$$(A \cup B)^C = A^C \cap B^C$$

Še več:

$$\left(\bigcup_{i} A_{i}\right)^{C} = \bigcap_{i} A_{i}^{C}$$

$$\left(\bigcap_{i} A_{i}\right)^{C} = \bigcup_{i} A_{i}^{C}$$

$$\left(\bigcap_{i} A_{i}\right)^{C} = \bigcup_{i} A_{i}^{C}$$

**Opomba.** V splošnem ni vsaka podmnožica  $A \subset \Omega$  dogodek.

**Definicija 1.4** ( $\sigma$ -algebra). *Neprazna* družina podmnožic (dogodkov)  $\mathcal{F}$  v  $\Omega$  je  $\sigma$ -algebra, če velja:

1. Zaprtost komponente:

$$A \in \mathcal{F} \Rightarrow A^C \in \mathcal{F}$$

2. Zaprtost števne unije:

$$A_1, A_2, A_3, \ldots \in \mathcal{F} \Rightarrow \bigcup_{i=1}^{\infty} A_i \in \mathcal{F}$$

Opomba. Če v (2) zahtevamo manj:

$$A, B \in \mathcal{F} \Rightarrow A \cup B \in \mathcal{F}$$
,

je  $\mathcal{F}$  algebra. V algebri imamo torej zaprtost za končne unije in končne preseke, medtem ko je  $\sigma$ -algebra zaprta celo za števne preseke.

**Definicija 1.5.** Naj bo  $\mathcal{F}$   $\sigma$ -algebra,  $\Omega$  vzorčni prostor. *Verjetnostna mera* na  $(\mathcal{F}, \Omega)$ , je preslikava  $\mathbb{P} : \mathcal{F} \to \mathbb{R}$  za katero velja:

- 1.  $\mathbb{P} \geq 0$ , za  $\forall A \in \mathbb{F}$
- 2.  $\mathbb{P}(\Omega) = 1$
- 3. Za poljubne paroma nerazdružljive dogodke velja

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

Trojico  $(\mathcal{F}, \Omega, \mathbb{P})$  imenujemo verjetnostni prostor.

Posledica (Posledice verjetnostnih aksiomov).

(a)  $\mathbb{P}(\emptyset) = 0$ **Dokaz:** v (3.) vzamemo  $A_i = \emptyset$ :  $\mathbb{P}(\emptyset) = \mathbb{P}(\emptyset) + \mathbb{P}(\emptyset) + \mathbb{P}(\emptyset) + \dots$  (b) P je končno aditivna, torej za končno mnogo paroma nerazdružljivih dogodkov velja:

$$\mathbb{P}(A_1 \cup \ldots \cup A_n) = \mathbb{P}(A_1) + \ldots + \mathbb{P}(A_n)$$

**Dokaz:** v (3.) vzamemo 
$$A_{n+1} = A_{n+2} = \ldots = \emptyset$$
 in uporabimo (a)

(c)  $\mathbb{P}$  je monotona, torej  $A \subseteq B \Rightarrow \mathbb{P}(A) \subseteq \mathbb{P}(B)$ Še več:  $A \subseteq B \Rightarrow \mathbb{P}(B \setminus A) = \mathbb{P}(B) - \mathbb{P}(A)$ 

**Dokaz:** ker je 
$$B = A \cup (B - A), A \cap (B \setminus A) = \emptyset$$
, zaradi  $(b)$  velja  $\mathbb{P}(B) = \mathbb{P}(A) + \mathbb{P}(B - A)$ 

(d)  $\mathbb{P}(A^C) = 1 - \mathbb{P}(A)$ 

**Dokaz:** v (c) vzamemo 
$$B = \Omega$$

(e)  $\mathbb{P}$  je zvezna:

(i) 
$$A_1 \subseteq A_2 \subseteq A_3 \subseteq ... \Rightarrow \mathbb{P}(\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i) = \lim_{n \to \infty} \mathbb{P}(A_n)$$

(ii) 
$$B_1 \supseteq B_2 \supseteq B_3 \supseteq \ldots \Rightarrow \mathbb{P}(\bigcap_{i=1}^{n-1} B_i) = \lim_{n \to \infty} \mathbb{P}(B_n)$$

#### Dokaz:

(i) Definiramo:  $C_i = A_i \setminus A_{i-1}$  za  $i = 2, 3, ..., C_1 = A_1$ Potem je  $A_n = C_1 \cup \ldots \cup C_n$ ,  $C_i \cap C_j = \emptyset$  za  $i \neq j$ ,

$$\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i = \bigcup_{i=1}^{\infty} C_i$$
Torej je

$$\mathbb{P}(\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i = \mathbb{P}(\bigcup_{i=1}^{\infty} C_i) = \sum_{i=1}^{\infty} \mathbb{P}(C_i) = \sum_{i=1}^{n} \mathbb{P}(C_i) = \sum_{i=1}^{n} \mathbb{P}(C_i) = \mathbb{P}(C_i)$$

$$= \lim_{n \to \infty} \sum_{i=1}^{n} \mathbb{P}(C_i) = \lim_{n \to \infty} \mathbb{P}(\bigcup_{i=1}^{n} C_i) = \lim_{n \to \infty} \mathbb{P}(A_n)$$

(ii) Ker je  $B_1 \supseteq B_2 \supseteq B_3 \supseteq \dots$ , sledi  ${B_1}^C \subseteq {B_2}^C \subseteq {B_3}^C \subseteq \dots$ 

Po 
$$(i)$$
 je  $\mathbb{P}(\bigcup_{i=1}^{\infty} B_i^C) = \lim_{i \to \infty} \mathbb{P}(D_i^C)$ , toda  $\bigcup_{i=1}^{\infty} B_i^C = \left(\bigcap_{i=1}^{\infty} B_i\right)^C$ . Zato je  $1 - \mathbb{P}(\bigcap_{i=1}^{\infty} B_i) = \lim_{i \to \infty} (1 - \mathbb{P}(B_i))$ , od koder sledi želena

neenakost.

#### 2 POGOJNA VERJETNOST

**Definicija 2.1** (Pogojna verjetnost). *Pogojna verjetnost* dogodka A glede na dogodek B,  $\mathbb{P}(A|B)$ , je verjetnost dogodka A če vemo, da se je zgodil dogodek B. Posplošimo:

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

Posledica. Iz definicije sledi

$$\mathbb{P}(A \cap B) = \mathbb{P}(A|B) \cdot \mathbb{P}(B).$$

Če posplošimo na n dogodkov dobimo

$$\mathbb{P}(A_1 \cap A_2 \cap \ldots \cap A_n) = \mathbb{P}(A_1) \cdot \mathbb{P}(A_2 | A_1) \cdot \ldots \cdot \mathbb{P}(A_n | A_1 \cap \ldots \cap A_{n-1}).$$

Če velja  $\mathbb{P}(A) = \mathbb{P}(A|B)$ , sta dogodka neodvisna.

**Izrek 2.1** (Izrek o popolni verjetnosti). Naj bo  $(H_i)_i$  popoln sistem dogodkov. Potem je

$$A = A \cap \Omega = A \cap \left(\bigcup_{i} H_{i}\right) = \bigcup_{i} A \cap H_{i}$$

in iz tega sledi

$$\mathbb{P}(A) = \sum_{i} \mathbb{P}(A \cap H_i) = \sum_{i} \mathbb{P}(H_i) \cdot \mathbb{P}(A|H_i).$$

To je formula za popolno verjetnost.

Posledica (Bayesova formula). Iz definicije pogojne verjetnosti vemo

$$\mathbb{P}(H_i|A) = \frac{\mathbb{P}(H_i \cap A)}{\mathbb{P}(A)} = \frac{\mathbb{P}(H_i) \cdot \mathbb{P}(A|H_i)}{\mathbb{P}(A)}.$$

Če v imenovalec vstavimo izrek o popolni verjetnosti, dobimo Bayesovo formulo:

$$\mathbb{P}(H_i|A) = \frac{\mathbb{P}(H_i) \cdot \mathbb{P}(A|H_i)}{\mathbb{P}(H_1) \cdot \mathbb{P}(A|H_1) + \ldots + \mathbb{P}(H_n) \cdot \mathbb{P}(A|H_n)} = \frac{\mathbb{P}(H_i) \cdot \mathbb{P}(A|H_i)}{\sum_i \mathbb{P}(H_i) \cdot \mathbb{P}(A|H_i)}$$

**Definicija 2.2** (Neodvisnost 2 dogodkov). Dogodka A in B sta neodvisna, če je

$$\mathbb{P}(A \cap B) = \mathbb{P}(A) \cdot \mathbb{P}(B).$$

Če je  $\mathbb{P}(B) > 0$  to enakost lahko zapišemo kot

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

**Definicija 2.3** (Neodvisnost k dogodkov). Dogodki  $(A_i)_i$  so *neodvisni*, če za poljuben končen nabor različnih dogodkov  $A_{i_1}, A_{i_2}, \ldots, A_{i_k}$  velja

$$\mathbb{P}(A_{i_1} \cap A_{i_2} \cap \ldots \cap A_{i_k}) = \mathbb{P}(A_{i_1}) \cdot \mathbb{P}(A_{i_2}) \cdot \ldots \cdot \mathbb{P}(A_{i_k}).$$

Če zahtevamo le za k=2, torej  $A_i$  in  $A_j$  sta neodvisna le za  $i\neq j$ , potem rečemo, da so dogodki paroma neodvisni. To je šibkejši pogoj kot neodvisnost.

**Trditev 2.1.** Če sta dogodka A in B neodvisna, potem sta neodvisna tudi dogodka  $A^C$  in B, A in  $B^C$  ter  $A^C$  in  $B^C$ .

# 3 ZAPOREDJA NEODVISNIH PONOVITEV POSKUSA

**Definicija 3.1** (Bernoullijeva formula). Imejmo zaporedje n neodvisnih ponovitev poskusa, določenega z verjetnostnim prostorom  $(\Omega, \mathcal{F}, p)$ , v katerem je možen dogodek A s

 $\mathbb{P}(A) = p$ . Z  $A_n(k)$  označimo dogodek, da se A zgodi natanko k-krat,  $k = 0, 1, 2, \dots, n$ .

 $A_n(k)$  je disjunktivna unija  $\binom{n}{k}$  dogodkov, da se A zgodi na predpisanih k mestih; na ostalih pa  $A^C$ . Verjetnost le teh dogodkov je  $p^k \cdot q^{n-k}$ . Zato velja Bernoullijeva formula

$$\mathbb{P}_n(k) = \binom{n}{k} \cdot p^k \cdot q^{n-k}.$$

Trditev 3.1 (Aproksimativni formuli za  $\mathbb{P}_n(k)$ ).

a) Poissonova formula: če je p blizu 0 in n velik, potem je

$$\mathbb{P}_n(k) \approx \frac{\lambda^k}{k!} \cdot e^{-\lambda}$$
, kjer je  $\lambda = n \cdot p$ 

b) Laplaceova formula: za velike n velja

$$\mathbb{P}_n(k) \approx \frac{1}{\sqrt{2\pi npq}} \cdot e^{-\frac{(k-np)^2}{2npq}}$$

#### 4 SLUČAJNE SPREMENLJIVKE

**Definicija 4.1.** Realna slučajna spremenljivka na verjetnostnem prostoru  $(\Omega, \mathcal{F}, p)$  je funkcija  $X : \Omega \to \mathbb{R}$  z lastnostjo, da je za  $\forall x \in \mathbb{R}$  množica  $\{\omega \in \Omega \mid X(\omega) \leq x\}$  v  $\mathcal{F}$ , se pravi je dogodek.

Oznaka:

$$\{\omega \in \Omega \mid X(\omega) \le x\} \equiv X^{-1}((-\infty, x]) \equiv (X \le x)$$

**Definicija 4.2** (Porazdelitvena funkcija slučajne spremenljivke). Funkcija  $F_X : \mathbb{R} \to \mathbb{R}$ , definirana s $F_X(x) = \mathbb{P}(X \leq x)$  se imenuje porazdelitvena funkcija slučajne spremenljivke x.

**Trditev 4.1** (Lastnosti porazdelitvene funkcije  $F = F_X$ ).

- 1. 0 < F(x) < 1 za  $\forall x \in \mathbb{R}$
- 2. F je naraščajoča funkcija:

$$x_1 < x_2 \Rightarrow F(x_1) \le F(x_2)$$

- 3.  $\lim_{x \to \infty} F(x) = 1$ ,  $\lim_{x \to -\infty} F(x) = 0$
- 4. F je z desne z vezna, torej F(x+) = F(x) za  $\forall x \in \mathbb{R}$ , kjer je  $F(x+) = \lim_{h \searrow 0} F(x+h)$  desna limita.
- 5.  $F(x-) = \mathbb{P}(X < x)$

$$\mathbb{P}(x_1 < X \le x_2) = F(x_2) - F(x_1)$$

$$\mathbb{P}(x_1 < X < x_2) = F(x_2) - F(x_1)$$

$$\mathbb{P}(x_1 \le X \le x_2) = F(x_2) - F(x_1)$$

$$\mathbb{P}(x_1 \le X < x_2) = F(x_2) - F(x_1)$$

**Definicija 4.3** (Diskretne slučajne spremenljivke). Slučajna spremenljivka je diskretno porazdeljena, če je njena zaloga vrednosti končna ali števna končna množica. Naj bo  $\{x_1, x_2, \ldots\}$  zaloga vrednosti. Vpeljemo verjetnostno funkcijo  $p_k = \mathbb{P}(X = x_k), \ k = 1, 2, 3, \ldots$  Ker so  $\{(X = x_k)\}_k$  poln sistem dogodkov, je

$$\sum_{k} p_k = 1.$$

X lahko zapišemo s shemo  $X:\begin{pmatrix}x_1&x_2&\cdots&x_n\\p_1&p_2&\cdots&p_n\end{pmatrix}$ . Porazdelitvena funkcija:

$$F(x) = \mathbb{P}(X \le x) = \mathbb{P}\left(\bigcup_{k \mid x_k \le x} (X = x_k)\right) = \sum_{k \mid x_k \le x} p_k.$$

Pogoste diskretne porazdelitve:

1. ENAKOMERNA PORAZDELITEV na n točkah  $x_1, \ldots, x_n$ :

$$X: \begin{pmatrix} x_1 & x_2 & \cdots & x_n \\ \frac{1}{n} & \frac{1}{n} & \cdots & \frac{1}{n} \end{pmatrix}$$

2. Bernoullijeva porazdelitev,  $Ber(p), p \in (0,1)$ :

$$X: \begin{pmatrix} 0 & 1\\ (1-p) & p \end{pmatrix}$$

Indikatorska funkcija:

$$1_A(\omega) = \begin{cases} 1; \ \omega \in A \\ 0; \ \omega \notin A \end{cases}$$

3. Binomska porazdelitev,  $Bin(n,p), n \in \mathbb{R}, p \in (0,1)$ :

$$X:\begin{pmatrix}0&1&2&\cdots&n\\p_0&p_1&p_2&\cdots&p_n\end{pmatrix},$$

kjer za  $k = 0, 1, \dots, n$  velja

$$p_k = \mathbb{P}(X=k) = \binom{n}{k} p^k (1-p)^{n-k}.$$

4. Poisonnova porazdelitev,  $Poi(\lambda)$ ,  $\lambda = n \cdot p > 0$ :

$$p_k = \mathbb{P}(X = k) = \mathbb{P}_n(k) = \frac{\lambda^k}{k!} \cdot e^{-\lambda}, \ k = 0, 1, \dots$$

Sledi:

$$\sum_{k=0}^{\infty} = e^{-\lambda} \sum_{k=0}^{\infty} \frac{\lambda^k}{k!} = e^{-\lambda} \cdot e^{\lambda} = 1.$$

5. GEOMETRIJSKA PORAZDELITEV:  $geo(p), p \in (0,1)$ . (X = k) je dogodek, da se A zgodi prvič v k-ti ponovitvi:

$$p_k = \mathbb{P}(X = k) = p \cdot q^{k-1}, \ k = 1, 2, 3, \dots$$

Torej  $\underbrace{A^C \cdot \ldots \cdot A^C}_{k-1} \cdot A = \underbrace{q \cdot \ldots \cdot q}_{k-1} \cdot p = p \cdot q^{k-1}$ . Velja:

$$\sum_{k=1}^{\infty} p_k = p \sum_{k=1}^{\infty} q^{k-1} = \frac{p}{1-q} = 1$$

6. PASCALOVA PORAZDELITEV:  $Pas(m, p), m \in \mathbb{N}, p \in (0, 1).$  (X = k) je dogodek, da se A zgodi m-tič pri k-ti ponovitvi:

$$p_k = {k-1 \choose m-1} \cdot p^m \cdot q^{k-m}, \quad k = m, m+1, \dots$$

7. HIPERGEOMETRIJSKA PORAZDELITEV: Hip(n; M, N),  $n \leq \min\{M, N - M\}$  V posodi je M belih in (N - M) črnih kroglic. Slučajno izvlečemo n kroglic. X naj pomeni število belih kroglic med izvlečenimi, kjer za  $k = 0, 1, \ldots, n$  velja:

$$p_k = \mathbb{P}(X = k) = \frac{\binom{M}{k} \binom{N-M}{n-k}}{\binom{N}{n}}$$

Ker je  $[(X=k)]_{k=0}^n$  popoln sistem dogodkov je  $\sum_{k=0}^n p_k = 1$ , torej je

$$\sum_{k=0}^{n} \binom{M}{n} \cdot \binom{N-M}{n-k} = \binom{N}{n}.$$

**Definicija 4.4** (Zvezno porazdeljene slučajne spremenljivke). Slučajna spremenljivka X je zvezno porazdeljena, če obstaja nenegativna integrabilna funkcija  $p_x$ , imenovana gostota verjetnosti, da za  $\forall x \in \mathbb{R}$  velja

$$F_X(x) = \int_{-\infty}^x p_x(t) \ dt.$$

Tedaj je  $F_X = F$  zvezna funckija, toda obstajajo zvezno porazdeljene funkcije, ki nimajo gostote (torej jih ni mogoče zapisati s tistim integralom).

Ker je  $\lim_{n\to\infty} F(x) = 1$ , je  $\int_{-\infty}^{\infty} p(t) = 1$ . Če je *p zvezna* v točki *x*, potem je *F odvedljiva* v *x* in velja F'(x) = p(x).

Za  $\forall x \in \mathbb{R}$  velja  $\mathbb{P}(X = x) = F(x) - F(x) = 0$ . Če je  $x_1 < x_2$ , potem je

$$\mathbb{P}(x_1 \le X \le x_2) = F(x_2) - F(x_1 -) = \int_{x_1}^{x_2} p(t) dt.$$

Nekatere pomembnejše zvezne porazdelitve:

1. ENAKOMERNA ZVEZNA PORAZDELITEV na [a, b]:

$$p(x) = \begin{cases} \frac{1}{b-a} & ; \text{ \'e } a \le x \le b \\ 0 & ; \text{ sicer} \end{cases}$$

$$F(x) = \int_{-\infty}^{x} p(t) dt = \begin{cases} 0 & ; \text{ \'e } x \le a \\ \frac{x-a}{b-a} & ; \text{ \'e } a \le x \le b \\ 1 & ; \text{ \'e } x \ge b \end{cases}$$

2. Normalna ali Gaussova porazdelitev:  $N(\mu, \sigma), \ \mu \in \mathbb{R}, \ \sigma > 0$ 

$$p(x) = \frac{1}{\sigma \sqrt{2\pi}} \cdot e^{-\frac{1}{2} \left(\frac{x-\mu}{\sigma}\right)^2}$$

V vseh primerih je ploščina pod grafom enaka 1.

N(0,1): standardna normalna porazdelitev

$$f(x) = \frac{1}{\pi\sqrt{2}} \cdot e^{-\frac{x^2}{2}}$$

Laplaceova formula: za velike n je  $Bin(n,p) \approx N(np, \sqrt{npq})$ 

3. Eksponentna porazdelitev:  $Exp(\lambda), \ \lambda > 0$ 

$$p(x) = \begin{cases} \lambda \cdot e^{-\lambda x} & ; \text{ \'e } x \ge 0\\ 0 & ; \text{ sicer} \end{cases}$$

$$F(x) = \begin{cases} 1 - e^{-\lambda x} & \text{; če } x \le 0\\ 0 & \text{; sicer} \end{cases}$$