Lec-9. 边缘分布、条件分布

主讲教师：吴利苏 **(wulisu@sdust.edu.cn)**
主　　页：wulisu.cn

目录

1. 边缘分布

- 二维离散型随机变量的边缘分布
- 二维连续型随机变量的边缘分布

2. 条件分布

- 二维离散型随机变量的条件分布
- 二维连续型随机变量的条件分布

边缘分布

目标： 已知 (X, Y) 的分布，求 X, Y 的分布？

设 $F(x, y) = P\{X \le x, Y \le y\}$, 令

$$
\begin{aligned}
F_X(x) &= P\{X \le x\} \\
&= P\{X \le x, Y \le \infty\} \\
&= \lim_{y\to\infty} P\{X \le x, Y \le y\} \\
&= \lim_{y\to\infty} F(x, y) = F(x, \infty)
\end{aligned}
$$

设 $F(x, y) = P\{X \leq x, Y \leq y\}$, 令

$$\begin{aligned} F_X(x) &= P\{X \leq x\} \\ &= P\{X \leq x, Y \leq \infty\} \\ &= \lim_{y \to \infty} P\{X \leq x, Y \leq y\} \\ &= \lim_{y \to \infty} F(x, y) = F(x, \infty) \end{aligned}$$

- 称 $F_X(x) = F(x, \infty)$ 为 (X, Y) 关于 X 的边缘分布函数.

设 $F(x, y) = P\{X \le x, Y \le y\}$, 令

$$\begin{aligned} F_X(x) &= P\{X \le x\} \\ &= P\{X \le x, Y \le \infty\} \\ &= \lim_{y \to \infty} P\{X \le x, Y \le y\} \\ &= \lim_{y \to \infty} F(x, y) = F(x, \infty) \end{aligned}$$

- 称 $F_X(x) = F(x, \infty)$ 为 (X, Y) 关于 X 的边缘分布函数.
- 称 $F_Y(y) = F(\infty, y)$ 为 (X, Y) 关于 Y 的边缘分布函数.

离散型随机变量的边缘分布律

设二维离散型随机变量 (X, Y) 的联合分布律为

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

离散型随机变量的边缘分布律

设二维离散型随机变量 (X, Y) 的联合分布律为

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

- $P\{X = x_i\} = P\{X = x_i, \bigcup_{j=1}^{\infty}\{Y = y_j\}\} = \sum_{j=1}^{\infty} p_{ij} \triangleq p_{i\bullet}$, $i = 1, 2, \dots$ 为 (X, Y) 关于 X 的边缘分布律.

离散型随机变量的边缘分布律

设二维离散型随机变量 (X, Y) 的联合分布律为

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

- $P\{X=x_i\}=P\{X=x_i, \bigcup_{j=1}^{\infty}\{Y=y_j\}\}=\sum_{j=1}^{\infty} p_{ij} \triangleq p_{i\bullet}$, $i=1,2,\ldots$ 为 (X, Y) 关于 X 的边缘分布律.
- $P\{Y=y_j\}=P\{\bigcup_{i=1}^{\infty}\{X=x_i\}, Y=y_j\}=\sum_{i=1}^{\infty} p_{ij} \triangleq p_{\bullet j}$, $j=1,2,\ldots$ 为 (X, Y) 关于 Y 的边缘分布律.

X \ Y	y_1	y_2	$\cdots$	y_j	$\cdots$	$P\{X=x_i\}$
x_1	p_{11}	p_{12}	$\cdots$	p_{1j}	$\cdots$	$p_{1\bullet}$
x_2	p_{21}	p_{22}	$\cdots$	p_{2j}	$\cdots$	$p_{2\bullet}$
$\cdots$	$\cdots$	$\cdots$	$\cdots$	$\cdots$	$\cdots$	$\cdots$
x_i	p_{i1}	p_{i2}	$\cdots$	p_{ij}	$\cdots$	$p_{i\bullet}$
$\cdots$	$\cdots$	$\cdots$	$\cdots$	$\cdots$	$\cdots$	$\cdots$
$P\{Y=y_j\}$	$p_{\bullet 1}$	$p_{\bullet 2}$	$\cdots$	$p_{\bullet j}$	$\cdots$	1

$$P\{X=x_i\}=\sum_{j=1}^{\infty}p_{ij},\ i=1,2,\ldots\ \text{横向之和};$$

$$P\{Y=y_j\}=\sum_{i=1}^{\infty}p_{ij},\ j=1,2,\ldots\ \text{纵向之和}.$$

Y \ X	x_1	x_2	$\dots$	x_i	$\dots$	$P\{Y=y_j\}$
y_1	p_{11}	p_{21}	$\dots$	p_{i1}	$\dots$	$p_{\bullet 1}$
y_2	p_{12}	p_{22}	$\dots$	p_{i2}	$\dots$	$p_{\bullet 2}$
$\dots$	$\dots$	$\dots$	$\dots$	$\dots$	$\dots$	$\dots$
y_j	p_{1j}	p_{2j}	$\dots$	p_{ij}	$\dots$	$p_{\bullet j}$
$\dots$	$\dots$	$\dots$	$\dots$	$\dots$	$\dots$	$\dots$
$P\{X=x_i\}$	$p_{1\bullet}$	$pe_{2\bullet}$	$\dots$	$p_{i\bullet}$	$\dots$	1

$$P\{X=x_i\}=\sum_{j=1}^{\infty}p_{ij},\ i=1,2,\dots \text{纵向之和};$$

$$P\{Y=y_j\}=\sum_{i=1}^{\infty}p_{ij},\ j=1,2,\dots \text{横向之和}.$$

离散型随机变量的边缘分布函数

$$F_X(x) = F(x, \infty) = \sum_{x_i \le x} \sum_{j=1}^{\infty} p_{ij}.$$

$$F_Y(y) = F(\infty, y) = \sum_{y_j \le y} \sum_{i=1}^{\infty} p_{ij}.$$

例

X \ Y	0	1
0	$\frac{16}{49}$	$\frac{12}{49}$
1	$\frac{12}{49}$	$\frac{9}{49}$

求其边缘分布律.

例

X \ Y	0	1
0	$\frac{16}{49}$	$\frac{12}{49}$
1	$\frac{12}{49}$	$\frac{9}{49}$

求其边缘分布律.

解: $P\{X=0\}=\frac{4}{7}$, $P\{X=1\}=\frac{3}{7}$,
$P\{Y=0\}=\frac{4}{7}$, $P\{Y=1\}=\frac{3}{7}$. □

例

X \ Y	0	1
0	$\frac{16}{49}$	$\frac{12}{49}$
1	$\frac{12}{49}$	$\frac{9}{49}$

求其边缘分布律.

解: $P\{X=0\}=\frac{4}{7}$, $P\{X=1\}=\frac{3}{7}$,
$P\{Y=0\}=\frac{4}{7}$, $P\{Y=1\}=\frac{3}{7}$. $\square$

注: 联合分布 $\Rightarrow$ 边缘分布, 反之不成立.

例

一整数 N 等可能地在 $1, 2, 3, \cdots, 10$ 个值中取一个值，设 $D = D(N)$ 是能整除 N 的正整数的个数，$F = F(N)$ 是能整除 N 的素数的个数，试写出 D 和 F 的联合分布律，并求边缘分布律.

例

一整数 N 等可能地在 $1, 2, 3, \cdots, 10$ 个值中取一个值, 设 $D = D(N)$ 是能整除 N 的正整数的个数, $F = F(N)$ 是能整除 N 的素数的个数, 试写出 D 和 F 的联合分布律, 并求边缘分布律.

解: 写出 D, F 的可能取值.

样本点	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
D	1	2	2	3	2	4	2	4	3	4
F	0	1	1	1	1	2	1	1	1	2

D 可能取值 1, 2, 3, 4; F 可能取值 0, 1, 2.

$$P\{D=1, F=0\} = \frac{1}{10} \qquad P\{D=2, F=1\} = \frac{4}{10}$$

$$P\{D=3, F=1\} = \frac{2}{10} \qquad P\{D=4, F=1\} = \frac{1}{10}$$

$$P\{D=4, F=2\} = \frac{2}{10}$$

D \ F	0	1	2	$P\{D=i\}$
1	$\frac{1}{10}$	0	0	$\frac{1}{10}$
2	0	$\frac{4}{10}$	0	$\frac{4}{10}$
3	0	$\frac{2}{10}$	0	$\frac{2}{10}$
4	0	$\frac{1}{10}$	$\frac{2}{10}$	$\frac{3}{10}$
$P\{F=j\}$	$\frac{1}{10}$	$\frac{7}{10}$	$\frac{2}{10}$	1

连续型随机变量的边缘分布

设连续型随机变量 (X, Y) 的概率密度为 $f(x, y)$,

$$F_X(x) = F(x, \infty) = \int_{\infty}^{x} \left[\int_{-\infty}^{+\infty} f(x, y)\, dy \right] dx$$

则

- $f_X(x) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x, y)\, dy$ 为 (X, Y) 关于 X 的边缘概率密度.
- $f_Y(y) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x, y)\, dx$ 为 (X, Y) 关于 Y 的边缘概率密度.

例

设 X, Y 具有联合概率密度

$$f(x, y) = \begin{cases} 6 & x^2 \le y \le x; \\ 0 & \text{其他}. \end{cases}$$

求边缘概率密度 $f_X(x), f_Y(y)$.

解:

$$f_X(x) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x, y)\, dy = \begin{cases} \int_{x^2}^{x} 6\, dy & 0 \le x \le 1; \\ 0 & \text{其他}. \end{cases}$$

$$= \begin{cases} 6(x - x^2) & 0 \le x \le 1; \\ 0 & \text{其他}. \end{cases}$$

$$f_Y(y) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x, y)\, dx = \begin{cases} \int_{y}^{\sqrt{y}} 6\, dx & 0 \le y \le 1; \\ 0 & \text{其他}. \end{cases}$$

$$= \begin{cases} 6(\sqrt{y} - y) & 0 \le x \le 1; \\ 0 & \text{其他}. \end{cases}$$

□

例

设二维正态随机变量 (X, Y) 的概率密度为

$$f(x, y) = \frac{1}{2\pi\sigma_1\sigma_2\sqrt{1-\rho^2}} e^{-\frac{1}{2(1-\rho^2)}\left[\frac{(x-\mu_1)^2}{\sigma_1^2} - \frac{2\rho(x-\mu_1)(y-\mu_2)}{\sigma_1\sigma_2} + \frac{(y-\mu_2)^2}{\sigma_2^2}\right]},$$

其中 $x, y \in \mathbb{R}, \mu_1, \mu_2, \sigma_1, \sigma_2, \rho$ 均为常数，$\sigma_1 > 0$，$\sigma_2 > 0, -1 < \rho < 1$. 求 (X, Y) 的边缘概率密度.

解:

$$f_X(x) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x, y)\, dy$$

$$= \frac{1}{2\pi\sigma_1\sigma_2\sqrt{1-\rho^2}} e^{-\frac{1}{2(1-\rho)^2}\frac{(x-\mu_1)^2}{\sigma_1^2}} \int_{-\infty}^{+\infty} e^{-\frac{1}{2(1-\rho^2)}\left[\frac{(y-\mu_2)^2}{\sigma_2^2} - \frac{2\rho(x-\mu_1)(y-\mu_2)}{\sigma_1\sigma_2}\right]} dy$$

$$= \frac{1}{2\pi\sigma_1\sigma_2\sqrt{1-\rho^2}} e^{-\frac{(x-\mu_1)^2}{2\sigma_1^2}} \int_{-\infty}^{+\infty} e^{-\frac{1}{2(1-\rho^2)}\left(\frac{y-\mu_2}{\sigma_2} - \rho\frac{x-\mu_1}{\sigma_1}\right)^2} dy$$

令 $t = \frac{1}{\sqrt{1-\rho^2}}\left(\frac{y-\mu_2}{\sigma_2} - \rho\frac{x-\mu_1}{\sigma_1}\right)$, 则上式

$$= \frac{1}{2\pi\sigma_1} e^{-\frac{(x-\mu_1)^2}{2\sigma_1^2}} \int_{-\infty}^{+\infty} e^{-\frac{t^2}{2}}\, dt = \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma_1} e^{-\frac{(x-\mu_1)^2}{2\sigma_1^2}}.$$

即, $f_X(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma_1} e^{-\frac{(x-\mu_1)^2}{2\sigma_1^2}}$, $x \in \mathbb{R}$.

同理, $f_Y(y) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma_2} e^{-\frac{(y-\mu_2)^2}{2\sigma_2^2}}$, $y \in \mathbb{R}$. $\square$

- 二维正态分布的两个边缘分布都是一维正态分布，并且不依赖参数 ρ.

即对于给定的 $\mu_1, \mu_2, \sigma_1, \sigma_2$，取不同的 ρ 对应不同的二维正态分布，而边缘分布是一样的.

- 二维正态分布的两个边缘分布都是一维正态分布，并且不依赖参数 ρ.

即对于给定的 $\mu_1, \mu_2, \sigma_1, \sigma_2$，取不同的 ρ 对应不同的二维正态分布，而边缘分布是一样的.

- 联合分布 $\Rightarrow$ 边缘分布，
  边缘分布 $\not\Rightarrow$ 联合分布.

问题: 边缘分布均为正态分布的随机变量, 其联合分布一定是二维正态分布吗?

问题: 边缘分布均为正态分布的随机变量, 其联合分布一定是二维正态分布吗?

答: 不一定.

例 (反例)

设 (X, Y) 的联合概率密度为

$$f(x,y) = \frac{1}{2\pi} e^{\frac{x^2+y^2}{2}} (1 + \sin x \sin y),$$

不服从正态分布. 但 $f_X(x) = \frac{1}{2\pi} e^{-\frac{x^2}{2}}$, $f_Y(y) = \frac{1}{2\pi} e^{-\frac{y^2}{2}}$, X 和 Y 服从正态分布.

条件分布

对于事件 A, B, 若 $P(A) > 0$, 可考虑条件概率

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

条件分布

对于事件 A, B, 若 $P(A) > 0$, 可考虑条件概率

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

下面引入随机变量的条件分布:

- 二维离散型随机变量的条件分布;
- 二维连续型随机变量的条件分布. (下节课)

二维离散型随机变量的条件分布

对于二维离散型随机变量 (X, Y), 设其分布律为

$$P\{X = x_i, Y = y_j\} = p_{ij},$$

若 $P\{Y = y_j\} = p_{\bullet j} > 0$, 则由条件概率公式

$$P\{X = x_i | Y = y_j\} = \frac{P\{X = x_i, Y = y_j\}}{P\{Y = y_j\}} = \frac{p_{ij}}{p_{\bullet j}}$$

当 X 取遍所有可能值, 就得到了条件分布律.

设 (X, Y) 是二维离散型随机变量. 则

- 对于固定的 y_j, 若 $P\{Y=y_j\}>0$, 则称

$$P\{X=x_i|Y=y_j\}=\frac{P\{X=x_i, Y=y_j\}}{P\{Y=y_j\}}=\frac{p_{ij}}{p_{\bullet j}}$$

为在 $Y=y_j$ 条件下, X 的条件分布律.

设 (X, Y) 是二维离散型随机变量. 则

- 对于固定的 y_j, 若 $P\{Y = y_j\} > 0$, 则称

$$P\{X = x_i | Y = y_j\} = \frac{P\{X = x_i, Y = y_j\}}{P\{Y = y_j\}} = \frac{p_{ij}}{p_{\bullet j}}$$

为在 $Y = y_j$ 条件下, X 的条件分布律.

- 对于固定的 x_i, 若 $P\{X = x_i\} > 0$, 则称

$$P\{Y = y_j | X = x_i\} = \frac{P\{X = x_i, Y = y_j\}}{P\{X = x_i\}} = \frac{p_{ij}}{p_{i\bullet}}$$

为在 $X = x_i$ 条件下, Y 的条件分布律.

例

盒中装有 3 只红球, 4 只黑球, 3 只白球, 不放回取 2 只球. 以 X 表示取到红球的只数, Y 表示取到黑球的只数. 求

(1) (X, Y) 的联合分布律.

(2) $X = 1$ 时 Y 的条件分布律.

解: (1) (X, Y) 的取值

$(0,0),(0,1),(0,2),(1,0),(1,2),(1,1),(2,0),(2,1),(2,2)$.

$$P\{X=i,\ Y=j\}=p_{ij}=\frac{C_3^i C_4^j C_3^{2-i-j}}{C_{10}^2},$$

$i,j=1,2,\ i+j\leq 2$.

X \ Y	0	1	2
0	$\frac{1}{15}$	$\frac{4}{15}$	$\frac{2}{15}$
1	$\frac{3}{15}$	$\frac{4}{15}$	0
2	$\frac{1}{15}$	0	0

(2)

$$P\{X=1\}=\frac{7}{15} \qquad P\{Y=0|X=1\}=\frac{3}{7}$$

$$P\{Y=1|X=1\}=\frac{4}{7} \qquad P\{Y=2|X=1\}=0$$

Y	0	1	2
$P\{Y=j\|X=1\}$	$\frac{3}{7}$	$\frac{4}{7}$	0

例

已知 (X, Y) 的联合分布律

X \ Y	-1	0	1
1	a	0.2	0.2
2	0.1	0.1	b

已知 $P\{Y \leq 0 | X < 2\} = 0.5$, 求

(1) a, b 的值.

(2) $\{X = 2\}$ 条件下, Y 的条件分布律.

(3) $\{X + Y = 2\}$ 条件下, X 的条件分布律.

解: (1)

$$\begin{cases} a+b=0.4 \\ P\{Y\le 0|X<2\}=0.5 \end{cases} \Rightarrow \begin{cases} a=0, \\ b=0.4. \end{cases}.$$

其中

$$\begin{aligned} P\{Y\le 0|X<2\} &= \frac{P\{X<2,\, Y\le 0\}}{P\{X<2\}} \\ &= \frac{P\{X=1,\, Y=-1\text{或}\, Y=0\}}{P\{X=1\}} \\ &= \frac{a+0.2}{a+0.4}=0.5 \end{aligned}$$

(2) $P\{X=2\}=0.6$,

$$P\{Y=j|X=2\}=\frac{P\{X=2,Y=j\}}{P\{X=2\}}=\begin{cases}\frac{1}{6} & j=-1;\\ \frac{1}{6} & j=0;\\ \frac{2}{3} & j=1.\end{cases}$$

Y	-1	0	1
$P\{Y=j\|X=2\}$	$\frac{1}{6}$	$\frac{1}{6}$	$\frac{2}{3}$

(3)

$$
\begin{aligned}
&P\{X+Y=2\}\\
=&P\{X=1,\,Y=1\}+P\{X=2,\,Y=0\}\\
=&0.3
\end{aligned}
$$

$$
\begin{aligned}
P\{X=i|X+Y=2\} &= \frac{P\{X+Y=2, X=i\}}{P\{X+Y=2\}}\\
&= \frac{P\{X=i,\,Y=2-i\}}{P\{X+Y=2\}}\\
&= \begin{cases} \frac{2}{3} & i=1;\\ \frac{1}{3} & i=2. \end{cases}
\end{aligned}
$$

X	1	2
$P\{X=i\vert X+Y=2\}$	$\frac{2}{3}$	$\frac{1}{3}$

例

一射手进行射击，击中目标概率为 $p(0 < p < 1)$，射击直至击中目标两次为止．设 X 表示首次击中目标所进行的射击次数，Y 表示总共射击的次数．试求 X 和 Y 的联合分布律和条件分布律．

解: $Y=n$ 表示" 第 n 次击中目标, 且前 $n-1$ 射击中恰有一次击中". 各次射击相互独立. $X=m$ 表示" 第 m 次为首次击中目标 “.

$m \leq n-1$ 即 n 和 m 可能取值为：$n=2,3,...;$
$m=1,2,...,n-1.$

$$P\{X=m, Y=n\}=(1-p)^{n-2}p^2$$

$$P\{Y=n\}=\sum_{m=1}^{n-1}P\{X=m, Y=n\}$$
$$=\sum_{m=1}^{n-1}(1-p)^{n-2}p^2=(n-1)p^2(1-p)^{n-2}$$

$$P\{X=m|Y=n\}=\frac{P\{X=m,\,Y=n\}}{P\{Y=n\}}$$

$$=\frac{(1-p)^{n-2}p^2}{(n-1)p^2(1-p)^{n-2}}=\frac{1}{n-1}$$

$$P\{X=m\}=\sum_{n=m+1}^{\infty}p^2(1-p)^{n-2}=p(1-p)^{m-1}.$$

$$P\{Y=n|X=m\}=\frac{P\{X=m,\,Y=n\}}{P\{X=m\}}$$

$$=\frac{p^2(1-p)^{n-2}}{p(1-p)^{m-1}}=p(1-p)^{n-m-1}.$$

二维连续型随机变量的条件分布

对于连续型随机变量 X, Y,

$$P\{X=x\}=0, \quad P\{Y=y\}=0, \qquad \forall x, y.$$

所以不能直接用条件概率引入条件分布函数.

二维连续型随机变量的条件分布

对于连续型随机变量 X, Y,

$$P\{X = x\} = 0, \quad P\{Y = y\} = 0, \quad \forall x, y.$$

所以不能直接用条件概率引入条件分布函数.

下次课学习：二维连续型随机变量的条件分布.