

A, B xung khắc $P(A+B)=P(A)+P(B)$
 A, B, C là hệ đầy đủ $P(A)+P(B)+P(C)=1$
 $P(A+B) = P(A) + P(B) - P(AB)$
 $P(A+B) = 1 - P(\overline{AB})$

A, B độc lập $\Leftrightarrow P(AB) = P(A) \cdot P(B)$

$$P(\overline{AB}) = P(B) - P(AB) \quad P(\overline{AB}) = P(A) - P(AB)$$

$$P(A+B+C) = P(A) + P(B) + P(C) - P(AB) - P(BC) - P(AC) + P(ABC)$$

$$A, B, C \text{ xung khắc} \Rightarrow P(AB) = P(BC) = P(AC) = P(ABC) = 0$$

$$\Rightarrow P(A+B+C) = P(A) + P(B) + P(C) \quad P(A+B+C) = 1 - P(\overline{ABC})$$

$$P(AB) = P(A) \times P(B|A) \Rightarrow A, B \text{ độc lập}$$

$$P(AB)=P(a)P(b)$$

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

$$P(H) = \sum_{i=1}^n P(A_i)P(H|A_i)$$

$$\begin{cases} P(X = i) = 0 \\ P(a \leq X \leq b) = P(a < X \leq b) = P(a \leq X < b) = P(a < X < b) = \int_a^b f(x) dx \end{cases}$$

Tính XS bằng hàm PPXS

$$\begin{cases} P(X = i) = 0 \\ P(a \leq X \leq b) = P(a < X \leq b) = P(a \leq X < b) \end{cases} \quad P(a < X < b) = \int_a^b f(x) dx$$

$$f(x) \rightarrow F(x) \quad \begin{cases} f(x) \geq 0 \\ \int_{-\infty}^{+\infty} f(x) dx = 1 \end{cases} \quad \begin{cases} P(X < b) = P(-\infty < X < b) = \int_{-\infty}^b f(x) dx \\ P(X > a) = P(a < X < +\infty) = \int_a^{+\infty} f(x) dx \end{cases}$$

Tính các thông số đặc trưng của BNN

$$\bullet \text{ Kỳ vọng: } E(X) = \int_{-\infty}^{+\infty} xf(x)dx \Rightarrow E(X^2) = \int_{-\infty}^{+\infty} x^2f(x)dx$$

$$\bullet \text{ Phương sai: } D(X) = V(X) = E(X^2) - [E(X)]^2$$

$$\bullet \text{ Độ lệch chuẩn: } \sigma(X) = \sqrt{V(X)}$$

$$\bullet \text{ Mod: } f(x) \text{ đạt max tại } x = k \Rightarrow \text{mod } X = k$$

$$\bullet \text{ Trung vị: } \begin{cases} P(X \leq \text{Med}(X)) = 0,5 \\ \text{Med}X \text{ là nghiệm của pt } F(x) = 0,5 \end{cases}$$

$$\begin{aligned} X &\sim H(N, N_A, n) & \bullet E(X) &= np & \text{N bóng đèn} \\ & & \bullet V(X) &= npq & \text{N_A bóng tốt} \\ & & & & \text{lấy ra n bóng} \\ & & & & \text{X = số bóng tốt trong n bóng lấy ra} \end{aligned}$$

$$\bullet P(X = k) = \frac{C_n^{N_A} C_{n-N_A}^{n-N_A}}{C_n^n}$$

$$\bullet P(X = k) = \frac{C_n^{N_A} C_{n-N_A}^{n-N_A}}{C_n^n}$$

$$\bullet P(X = k) = \frac{C_n^{N_A} C_{n-N_A}^{n-N_A}}{C_n^n}$$

TÓM TẮT BIẾN NGẪU NHIÊN RỜI RẠC

$$\text{Bảng PPXS} \quad \begin{cases} p_i > 0 \\ \sum p_i = 1 \end{cases} \Rightarrow F(x) = P(X \leq x) = \begin{cases} 0 & , \text{ nếu } x < x_1 \\ p_1 & , \text{ nếu } x_1 \leq x < x_2 \\ p_1 + p_2 & , \text{ nếu } x_2 \leq x < x_3 \\ \dots & \dots \\ 1 & , \text{ nếu } x_n \leq x \end{cases}$$

$$\begin{aligned} \text{Tính XS bằng bảng PPXS} & \quad \begin{cases} P(X = i) = p_i \\ P(a \leq X \leq b) = P(X = a) + \dots + P(X = b) \end{cases} \\ \text{Tính XS bằng hàm PPXS} & \quad \begin{cases} P(a < X \leq b) = F(b) - F(a) \quad \forall a \leq b \\ P(a \leq X \leq b) = F(b) - F(a-) \quad \forall a \leq b \\ P(X = a) = F(a) - F(a-1) \quad (a \text{ là số nguyên}) \\ P(a \leq X \leq b) = F(b) - F(a-1) \quad (a, b \text{ là các số nguyên}) \end{cases} \\ \text{Tính các thông số đặc trưng của BNN} & \quad \begin{cases} \bullet \text{ Kỳ vọng: } E(X) = \sum x_i p_i \Rightarrow E(X^2) = \sum x_i^2 p_i \\ \bullet \text{ Phương sai: } D(X) = V(X) = E(X^2) - [E(X)]^2 \\ \bullet \text{ Độ lệch chuẩn: } \sigma(X) = \sqrt{V(X)} \\ \bullet \text{ Mod: } P(X = k) \text{ max} \Rightarrow \text{mod } X = k \\ \bullet \text{ Trung vị: } \begin{cases} P(X \leq \text{med}X) \geq 0,5 \\ P(X \geq \text{med}X) \geq 0,5 \end{cases} \end{cases} \end{aligned}$$

2) BIẾN NGẪU NHIÊN LIÊN TỤC

Hàm MĐXS \Rightarrow Hàm PPXS

$$f(x) = \begin{cases} \varphi(x) & , \text{ nếu } a \leq x \leq b \\ 0 & , \text{ nếu } x \notin [a, b] \end{cases} \rightarrow F(x) = P(X \leq x) = \begin{cases} 0 & , \text{ nếu } x < a \\ \int_a^x \varphi(t) dt & , \text{ nếu } a \leq x \leq b \\ 1 & , \text{ nếu } b < x \end{cases}$$

$$f(x) = \begin{cases} 0 & , \text{ nếu } x < a \\ \varphi(x) & , \text{ nếu } x \geq a \end{cases} \rightarrow F(x) = P(X \leq x) = \begin{cases} 0 & , \text{ nếu } x < a \\ \int_a^x \varphi(t) dt & , \text{ nếu } x \geq a \end{cases}$$

$$f(x) = \begin{cases} \varphi(x) & , \text{ nếu } x \leq a \\ 0 & , \text{ nếu } x > a \end{cases} \rightarrow F(x) = P(X \leq x) = \begin{cases} \int_{-\infty}^x \varphi(t) dt & , \text{ nếu } x \leq a \\ 1 & , \text{ nếu } x > a \end{cases}$$

$$\text{Tính chất của hàm MĐXS} \quad \begin{cases} f(x) \geq 0 \\ \int_{-\infty}^{+\infty} f(x) dx = 1 \end{cases}$$

$$\bullet E(c) = c$$

$$\bullet E(aX + bY - cZ) = E(aX + bY + (-c)Z) = E(aX) + E(bY) + E(-cZ) = aE(X) + bE(Y) - cE(Z)$$

$$\rightarrow E(aX + bY - cZ) = aE(X) + bE(Y) - cE(Z)$$

$$\bullet E(XY) = E(X)E(Y), \text{ nếu } X, Y \text{ độc lập}$$

$$\bullet V(c) = 0$$

$$\bullet V(X + Y) = V(X) + V(Y), \text{ nếu } X, Y \text{ độc lập}$$

$$\bullet V(aX + bY - cZ) = V(aX + bY + (-c)Z) = V(aX) + V(bY) + V(-cZ) = a^2V(X) + b^2V(Y) + c^2V(Z)$$

$$\rightarrow V(aX + bY - cZ) = a^2V(X) + b^2V(Y) + c^2V(Z) \text{ nếu } X, Y \text{ độc lập}$$

TÍNH CHẤT KỈ VONG

$$\begin{aligned} X &\sim B(n, p) & \bullet E(X) &= np \\ & & \bullet V(X) &= npq \\ & & \bullet np - q \leq \text{mod}(X) \leq np - q + 1 & \text{ với } q = 1 - p \end{aligned}$$

Mod là số lan thanh cong co kha nang nhât

Bài toán xác suất hình học: $P(A) = \frac{\text{Độ đo của miền } A}{\text{Độ đo của miền } \Omega}$
 Bài toán mạch điện: xác suất linh kiện hoạt động là p, xác suất linh kiện hỏng là q
 Mắc nối tiếp: $P(\text{hoạt động}) = p_1 \cdot p_2$; $P(\text{hỏng}) = 1 - p_1 \cdot p_2$; Mắc song song: $P(\text{hoạt động}) = 1 - q_1 \cdot q_2$; $P(\text{hỏng}) = q_1 \cdot q_2$
 Bài toán lá thư:

$$\text{Số cách bỏ n lá thư cho n người mà không lá nào gửi đúng: } n! \left(1 - \frac{1}{1!} + \frac{1}{2!} - \dots + \frac{(-1)^n}{n!} \right)$$

$$\text{Bài toán tạo tàu tổng quát: Có n toa tàu, có k hành khách (k \geq n), tính xác suất mỗi toa đều có hành khách.}$$

$$P = 1 - \frac{C_n^1(n-1)^k - C_n^2(n-2)^k + C_n^3(n-3)^k - \dots + (-1)^{n-2}C_n^{n-1}(n-n+1)^k + C_n^n(n-n)^k}{n^k}$$

$$\text{Bài toán xác định số phép thử thực hiện: } P(\text{có ít nhất một lần bắn có A xảy ra trong n phép thử}) \geq \epsilon$$

$$\Leftrightarrow 1 - P(\text{biên có A không xảy ra trong n phép thử}) \geq \epsilon \Leftrightarrow 1 - q^n \geq \epsilon \Leftrightarrow n \geq \log_q(1 - \epsilon) \quad (n \text{ là số nguyên nhỏ nhất})$$

$$\text{Bài toán tìm số phần tử mang dấu hiệu A của một nhóm n phần tử cho trước: Tính tỉ lệ phần tử mang}$$

$$\text{dấu hiệu A. Sau đó lấy tỷ lệ vừa tìm được nhân với n phần tử cho trước (làm tròn kết quả thành số nguyên gần nhất)}$$

Giải sử rằng số lượng xe đi qua một vạch đi bộ trong mỗi khoảng thời gian một phút là biến ngẫu nhiên Poisson với trung bình 2,49 (xe/giây). Một người đến vạch đi bộ vào thời điểm t0. Giả sử rằng người này chỉ có thể băng qua được đường nếu không có xe nào ngang qua vạch đi bộ trong khoảng thời gian tối thiểu là 13 giây, ngược lại người này sẽ phải đứng đợi.

3. Tính trung bình số xe ngang qua vạch đi bộ cho đến khi người này băng qua được đường.

$$\text{Gọi } Y = \sum_{k=0}^{\infty} k a^k = \frac{a}{(1-a)^2}, \text{ với } a < 1.$$

$$\text{Đáp số: } \frac{1}{0,58305782889129} \text{ (giây)}$$

Một công ty mua một chính sách để đảm bảo doanh thu của nó trong trường hợp có bão tuyết lớn mà làm ngừng hoạt động kinh doanh. Chính sách không chỉ trả gì cho trận bão đầu tiên trong năm và 24.000 cho mỗi trận bão sau đó cho đến cuối năm. Số lượng các trận bão tuyết lớn hàng năm làm ngừng hoạt động kinh doanh được cho là có phân phối Poisson với trung bình 1,9. Số tiền trung bình phải trả cho công ty theo chính sách này trong thời gian một năm là bao nhiêu?

$$\text{Đáp số} = e^{0.49 \times 13} - 1 = 24000 \times (e^{-1.9} + 1.9 - 1) = 25189.64686$$

$X =$ số SV đến PĐT trong 1 giờ $\rightarrow X \sim P(\lambda)$ $X \sim P(\lambda)$ $E(X) = \lambda$
 $\lambda = E(X) =$ số SV trung bình đến PĐT trong 1 giờ $P(X = k) = \frac{e^{-\lambda} \lambda^k}{k!}$ $V(X) = \lambda$
 $\lambda - 1 \leq \text{mod}(X) \leq \lambda$

PHÂN PHỐI MŨ

$X \sim \exp(\lambda)$

$$f(x) = \begin{cases} \lambda e^{-\lambda x}, & x \geq 0 \\ 0, & x < 0 \end{cases} \Rightarrow F(x) = \begin{cases} 1 - e^{-\lambda x}, & x \geq 0 \\ 0, & x < 0 \end{cases}$$

$$P(X \leq k) = F(k) = 1 - e^{-\lambda k}$$

$$P(X \geq k) = e^{-\lambda k}$$

$$P(a \leq X \leq b) = F(b) - F(a) = P(X \leq b) - P(X \leq a)$$

$$E(X) = \frac{1}{\lambda}$$

$$V(X) = \frac{1}{\lambda^2} \Rightarrow \sigma(X) = \frac{1}{\lambda}$$

$$\text{mod}(X) = 0, \text{ med}(X) = \frac{\ln 2}{\lambda}$$

Quan hệ giữa mũ và poisson:

Số xe trung bình đến trong 1 dvtg là a xe thì P(a) tương đương

Khoảng tg giữa 2 lần xe đến trạm là exp(a)

$X \sim N(\mu, \sigma^2)$

$$\text{Hàm mật độ } f(x) = \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}$$

$$E(X) = \mu$$

$$V(X) = \sigma^2 \Rightarrow \sigma(X) = \sigma$$

$$\text{mod}(X) = \text{med}(X) = \mu$$

$$\Phi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^x e^{-\frac{t^2}{2}} dt$$

Tính xác suất của phân phối chuẩn theo Φ

$$P(a < X < b) = \Phi\left(\frac{b-\mu}{\sigma}\right) - \Phi\left(\frac{a-\mu}{\sigma}\right)$$

$$P(X < b) = \Phi\left(\frac{b-\mu}{\sigma}\right)$$

$$P(X > a) = 1 - \Phi\left(\frac{a-\mu}{\sigma}\right)$$

$$P(|X - \mu| < \varepsilon) = 2\Phi\left(\frac{\varepsilon}{\sigma}\right) - 1$$

XẤP XỈ CÁC PHÂN PHỐI

$$X \sim H(N, N_A, n) \sim B\left(n, \frac{N_A}{N}\right) \text{ khi } n \ll N \left(\frac{n}{N} \leq 5\%\right)$$

$$X \sim B(n, p) \sim P(np) \text{ khi } n \text{ lớn, } p \text{ gần } 0 \left(n > 50, p < 0,1\right)$$

$$X \sim B(n, p) \sim N(np, npq) \text{ khi } n \text{ lớn, } p \text{ KHÔNG gần } 0 \left(n > 50, p \geq 0,1\right)$$

Chú ý: Công thức tính xác suất của PP chuẩn khi xấp xỉ từ PP nhị thức sai

$$P(X = k) = \frac{1}{\sigma} \phi\left(\frac{k-\mu}{\sigma}\right) \text{ với } \phi(z) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{z^2}{2}}$$

$$P(a \leq X \leq b) = \Phi\left(\frac{b+0.5-\mu}{\sigma}\right) - \Phi\left(\frac{a-0.5-\mu}{\sigma}\right)$$

$$\Phi(-a) = 1 - \Phi(a)$$

$$\Phi \in R$$

PHÂN PHỐI ĐỀU

X là 1 giá trị bất kỳ trong (a, b) hoặc $[a, b]$

$$\Rightarrow X \sim U(a, b)$$

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

$$P(X \leq n) = F(n)$$

$$P(m \leq X \leq n) = F(n) - F(m)$$

$$E(X) = \frac{a+b}{2}$$

$$V(X) = \frac{(b-a)^2}{12} \Rightarrow \sigma(X) = \sqrt{\frac{(b-a)^2}{12}}$$

XẤP XỈ CÁC PHÂN PHỐI THÀNH PHÂN PHỐI CH

$$X \sim \begin{cases} B(n, p) \\ P(\lambda) \\ \exp(\lambda) \\ U(a, b) \\ \dots \\ \text{bảng PPXS} \end{cases} \sim N(\mu, \sigma^2) \text{ với } \begin{cases} \mu = E(X) \\ \sigma^2 = V(X) \end{cases}$$

$$X_i \sim N(\mu; \sigma^2)$$

$$Z = X_1 + X_2 + \dots + X_n \sim N(n\mu; n\sigma^2)$$

Nếu $\begin{cases} Z \text{ nguyên} \\ k_1, k_2 \text{ nguyên và có dấu bằng ở } k_1, k_2 \end{cases}$

$$\begin{aligned} P(k_1 \leq Z \leq k_2) &= \Phi\left(\frac{k_2 + 0.5 - n\mu}{\sqrt{n\sigma^2}}\right) - \Phi\left(\frac{k_1 - 0.5 - n\mu}{\sqrt{n\sigma^2}}\right) \\ \Rightarrow P(Z \leq k_2) &= \Phi\left(\frac{k_2 + 0.5 - n\mu}{\sqrt{n\sigma^2}}\right) \\ P(Z \geq k_1) &= 1 - \Phi\left(\frac{k_1 - 0.5 - n\mu}{\sqrt{n\sigma^2}}\right) \end{aligned}$$

TỔNG CỦA CÁC BIẾN NGẪU NHIÊN

$$\begin{cases} X_1 \sim N(\mu_1, \sigma_1^2) \\ X_2 \sim N(\mu_2, \sigma_2^2) \end{cases} \Rightarrow X_1 \pm X_2 \sim N(\mu_1 \pm \mu_2, \sigma_1^2 \pm \sigma_2^2)$$

$$\begin{cases} X_1 \sim N(\mu_1; \sigma_1^2) \\ X_2 \sim N(\mu_2; \sigma_2^2) \\ X_3 \sim N(\mu_3; \sigma_3^2) \end{cases} \Rightarrow aX_1 + bX_2 - cX_3 \sim N(a\mu_1 + b\mu_2 - c\mu_3; a^2\sigma_1^2 + b^2\sigma_2^2 + c^2\sigma_3^2)$$

$$X_i \sim N(\mu; \sigma^2) \Rightarrow \begin{cases} X_1 + \dots + X_n \sim N(n\mu; n\sigma^2) \\ \bar{X} = \frac{X_1 + \dots + X_n}{n} \sim N\left(\mu; \frac{1}{n}\sigma^2\right) \end{cases}$$

$$X_i \sim P(\lambda_i) \Rightarrow X_1 + \dots + X_n \sim P\left(\sum_{i=1}^n \lambda_i\right)$$

$$\text{Tính chất: } \begin{cases} p_i \geq 0 \\ \sum p_i = 1 \end{cases} F(2,3) = P(X \leq 2, Y \leq 3) \begin{cases} E(X) = \sum x_i p_i = 0,7 \\ E(Y) = \sum y_i p_i = 1,8 \end{cases}$$

$$P(X = x_i; Y = y_j) = P(X = x_i)P(Y = y_j) \forall i, j \begin{cases} V(X) = E(X^2) - [E(X)]^2 \\ V(Y) = E(Y^2) - [E(Y)]^2 \end{cases} \begin{cases} E(XY) = \sum x_i y_j p_i = 1,1 \\ E(X^2) = \sum x_i^2 p_i = 0,7 \\ E(Y^2) = \sum y_i^2 p_i = 4,8 \end{cases}$$

Nhận xét 3.7. Hiệp phương sai được dùng làm độ đo quan hệ giữa hai biến X và Y :

(a) $\text{cov}(X, Y) > 0$ cho thấy xu thế Y tăng khi X tăng.

(b) $\text{cov}(X, Y) < 0$ cho thấy xu thế Y giảm khi X tăng.

Tính chất 3.5. (a) $|\rho_{XY}| \leq 1$.

(b) Nếu $\rho_{XY} = \pm 1$ ta nói hai biến ngẫu nhiên X và Y có quan hệ tuyến tính (tức là tồn tại a và b sao cho $Y = aX + b$).

(c) Nếu $\rho_{XY} = 0$ ta nói hai biến ngẫu nhiên X và Y là không tương quan.

$$\text{Hiệp phương sai (covarian, momen tương quan)} \text{cov}(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y) = -0,16$$

$$\text{Hệ số tương quan } \rho_{XY} = \frac{\text{cov}(X, Y)}{\sqrt{V(X)V(Y)}} = -0,2795$$

$$\text{Ma trận hiệp phương sai (Ma trận tương quan)} \Gamma = D(X, Y) = \begin{bmatrix} V(X) & \text{cov}(X, Y) \\ \text{cov}(X, Y) & V(Y) \end{bmatrix}$$

$$\begin{cases} E(X) = \bar{x} = 0,7 \\ E(Y) = \bar{y} = 1,8 \\ E(XY) = \sum x_i y_i = 1,1 \end{cases}$$

$$V(X) = \sigma_x^2 = 0,21$$

$$V(Y) = \sigma_y^2 = 1,56$$

$$\rho_{XY} = r = -0,2795$$

$$\text{cov}(X, Y) = r \times \sigma_x \times \sigma_y = -0,16$$

$$X, Y \text{ độc lập} \Leftrightarrow P(X = x_i; Y = y_j) = P(X = x_i)P(Y = y_j) \forall i, j$$

$$X, Y \text{ độc lập} \rightarrow \begin{cases} E(XY) = E(X)E(Y) \\ V(X \pm Y) = V(X) + V(Y) \end{cases}$$

$$X, Y \text{ ko độc lập} \rightarrow \begin{cases} E(XY) = E(X)E(Y) - \text{cov}(X, Y) \\ V(X + Y) = V(X) + V(Y) + 2\text{cov}(X, Y) \\ V(X - Y) = V(X) + V(Y) - 2\text{cov}(X, Y) \end{cases}$$

$$X, Y \text{ độc lập} \Rightarrow \text{cov}(X, Y) = 0 \Rightarrow \rho_{XY} = 0$$

$$\rho_{XY} = \frac{\text{cov}(X, Y)}{\sqrt{V(X)V(Y)}}$$

