

Valószínűségszámítás

Survey statisztika és adattudomány mesterszak

Backhausz Ágnes

`keresztnev.vezeteknev@ttk.elte.hu`

2019/2020. őszi félév

A valószínűségszámítás kurzus céljai

- **a statisztika megalapozása**: a véletlen mintavételből származó adatok elemzésére alkalmazott módszerekhez szükséges alapfogalmak megismerése
- a valószínűségszámítás alapjai, szemlélete
- feladatmegoldási készség fejlesztése (gyakorlaton)
- az alkalmazási lehetőségek bemutatása

A valószínűségszámítás kurzus céljai

- **a statisztika megalapozása**: a véletlen mintavételből származó adatok elemzésére alkalmazott módszerekhez szükséges alapfogalmak megismerése
- a valószínűségszámítás alapjai, szemlélete
- feladatmegoldási készség fejlesztése (gyakorlaton)
- az alkalmazási lehetőségek bemutatása

Számonkérés: írásbeli vizsga (ponthatárok: 30, 49, 68, 86); legalább elégséges gyakorlati jegyen a félév során beadható házi feladatokkal lehet javítani, **legfeljebb egy jegyet**.

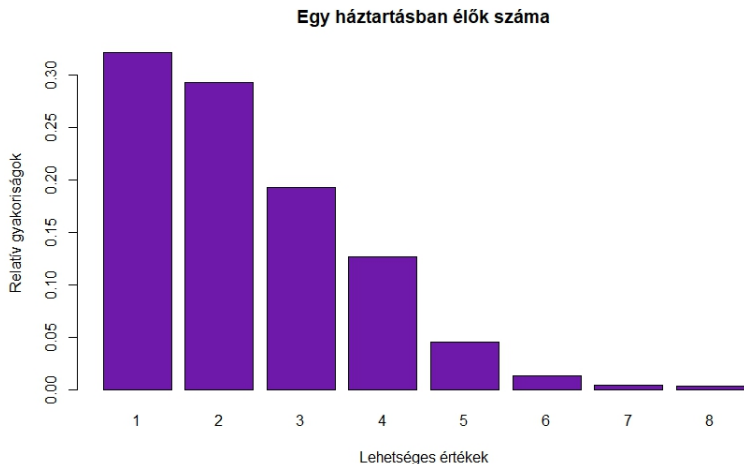
A házi feladat önálló munka. Minden házi feladat 3 pontot ér.

tematika, mintafeladatsor, elméleti összefoglaló, házi feladat, gyakorló feladatok:
moodle.elte.hu

Ajánlott irodalom

- Denkinger: Valószínűségszámítás
- Prékopa: Valószínűségelmélet
- Ross: A first course in probability
- Solt: Valószínűségszámítás
- Arató Miklós, Prokaj Vilmos és Zempléni András: Bevezetés a valószínűség-számításba és alkalmazásaiba: példákkal, szimulációkkal
<http://elte.prompt.hu/sites/default/files/tananyagok/valszam/zempleni.pdf>
- Bognárné, Mogyoródi, Prékopa, Rényi, Szász: Valószínűség-számítási feladatgyűjtemény
- Fazekas: Valószínűség-számítás és statisztika jegyzet
<https://gyires.inf.unideb.hu/KMITT/b21/valseg.pdf>

Megfigyelések



Egy háztartásban élők számának hisztogramja (forrás: KSH, 2011)
($n = 4105698$ a háztartások száma)

A valószínűségszámításról és statisztikáról

Célok:

- felmérésekből, kísérletekből származó adatok elemzése
- ismeretlen mennyiségek becslése a mérések alapján
- hipotézisek ellenőrzése vagy cáfolata
- véletlen folyamatok modellezése
- múltbeli adatok alapján a jövőbeli folyamatok előrejelzése

A valószínűségszámításról és statisztikáról

Célok:

- felmérésekből, kísérletekből származó adatok elemzése
- ismeretlen mennyiségek becslése a mérések alapján
- hipotézisek ellenőrzése vagy cáfolata
- véletlen folyamatok modellezése
- múltbeli adatok alapján a jövőbeli folyamatok előrejelzése

Alkalmazási területek:

- statisztika a társadalomtudományokban: felmérések értékelése, elemzése
- statisztika a természettudományokban: mérések, kísérleti eredmények értelmezése
- előrejelzés: társadalmi, gazdasági, pénzügyi folyamatok
- biztosításmatematika

A valószínűségszámításról

- a matematika egy területe
- axiomatikus felépítés (Kolmogorov, 1933)
- alkalmazható gyakorlati feladatokban (például: ha egy érmével 1000 dobásból 550 fej lett, és azt állítjuk, hogy az érme nem szabályos, 99,9% valószínűséggel helyes az állításunk)
- az alkalmazásnál **a modell kiválasztása, felépítése** kulcsfontosságú, ettől függ a végeredmény
- **mennyi a valószínűsége, hogy egy véletlenszerűen választott magyar háztartásban négyen élnek?** – ez attól függ, hogy **melyik háztartást mennyi valószínűséggel** választjuk („találjuk meg”)

A valószínűségszámításról

- a matematika egy területe
- axiomatikus felépítés (Kolmogorov, 1933)
- alkalmazható gyakorlati feladatokban (például: ha egy érmével 1000 dobásból 550 fej lett, és azt állítjuk, hogy az érme nem szabályos, 99,9% valószínűséggel helyes az állításunk)
- az alkalmazásnál **a modell kiválasztása, felépítése** kulcsfontosságú, ettől függ a végeredmény
- **mennyi a valószínűsége, hogy egy véletlenszerűen választott magyar háztartásban négyen élnek?** – ez attól függ, hogy **melyik háztartást mennyi valószínűséggel** választjuk („találjuk meg”)
- **mennyi a valószínűsége, hogy holnap Budapesten lesz csapadék?**

A valószínűségszámításról

- a matematika egy területe
- axiomatikus felépítés (Kolmogorov, 1933)
- alkalmazható gyakorlati feladatokban (például: ha egy érmével 1000 dobásból 550 fej lett, és azt állítjuk, hogy az érme nem szabályos, 99,9% valószínűséggel helyes az állításunk)
- az alkalmazásnál **a modell kiválasztása, felépítése** kulcsfontosságú, ettől függ a végeredmény
- **mennyi a valószínűsége, hogy egy véletlenszerűen választott magyar háztartásban négyen élnek?** – ez attól függ, hogy **melyik háztartást mennyi valószínűséggel** választjuk („találjuk meg”)
- **mennyi a valószínűsége, hogy holnap Budapesten lesz csapadék?**
egy megfelelő matematikai modellben van értelme a kérdésnek, de a válasz **különböző modellekben különböző**

A valószínűségszámításról

- a matematika egy területe
- axiomatikus felépítés (Kolmogorov, 1933)
- alkalmazható gyakorlati feladatokban (például: ha egy érmével 1000 dobásból 550 fej lett, és azt állítjuk, hogy az érme nem szabályos, 99,9% valószínűséggel helyes az állításunk)
- az alkalmazásnál **a modell kiválasztása, felépítése** kulcsfontosságú, ettől függ a végeredmény
- **mennyi a valószínűsége, hogy egy véletlenszerűen választott magyar háztartásban négyen élnek?** – ez attól függ, hogy **melyik háztartást mennyi valószínűséggel** választjuk („találjuk meg”)
- **mennyi a valószínűsége, hogy holnap Budapesten lesz csapadék?**
egy megfelelő matematikai modellben van értelme a kérdésnek, de a válasz **különböző modellekben különböző**
- cél: **minél jobb modell illesztése** a statisztika segítségével (jól illeszkedik a megfigyelt adatokra, egyszerű, interpretálható, de más szempontok is lehetségesek)

A valószínűségszámítás történetéről

- **osztzkodási probléma**, 1494: egy félbehagyott játékban az aktuális állás alapján hogyan osszák el a tétet (megoldás: Pascal, 1656)
- Cardano könyve a kockajátékokról, 1564 (amit 1663-ban adtak ki)
- életjáradék-számítás, de Witt, Haley, 1671
- nagy számok törvénye, Jacob Bernoulli, 1713
- XIX. század első fele: de Moivre, Bayes, Gauss, Poisson, Buffon
- XIX. század vége: Csebisev, Markov, Ljapunov
- **axiomatikus felépítés**: Kolmogorov, 1933

A valószínűségszámítás történetéről

XX. századi alkalmazások és kezdetük

- sztochasztikus folyamatok (Wiener, 1923)
- matematikai statisztika (Fisher, 1925)
- játékelmélet (Neumann, 1928)
- információelmélet (Shannon, 1948)
- idősorok
- pénzügyi folyamatok (Black–Scholes, 1973)
- hierarchikus tanulási algoritmusok → mesterséges intelligencia

Események és valószínűségük

Cél: véletlen jelenségek matematikai modellezése

Mennyi lehet egy **esemény** valószínűsége?

Események és valószínűségük

Cél: véletlen jelenségek matematikai modellezése

Mennyi lehet egy **esemény** valószínűsége?

holnap Budapesten esik az eső



egy véletlenül választott ember balkezes



egy véletlenül választott felnőtt diplomás



júliusban csökken az infláció



A esemény



Események és valószínűségük

Cél: véletlen jelenségek matematikai modellezése

Mennyi lehet egy **esemény** valószínűsége?

holnap Budapesten esik az eső



egy véletlenül választott ember balkezes



egy véletlenül választott felnőtt diplomás



júliusban csökken az infláció



A esemény



**az események valószínűsége attól függ, hogy
milyen modellt választunk**

Események és valószínűségük

Cél: véletlen jelenségek matematikai modellezése

Mennyi lehet egy **esemény** valószínűsége?

holnap Budapesten esik az eső



egy véletlenül választott ember balkezes



egy véletlenül választott felnőtt diplomás



júliusban csökken az infláció



A esemény



**az események valószínűsége attól függ, hogy
milyen modellt választunk**

attól, hogy hogyan vesszük figyelembe a méréseket, megfigyeléseket

Események és valószínűségük

Cél: véletlen jelenségek matematikai modellezése

Mennyi lehet egy **esemény** valószínűsége?

holnap Budapesten esik az eső

→ 15%

egy véletlenül választott ember balkezes

→ 10%

egy véletlenül választott felnőtt diplomás

→ 22%

júliusban csökken az infláció

→ 44%

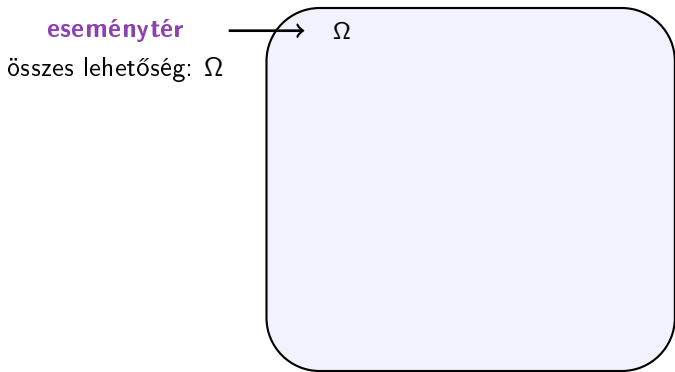
A esemény

→ $P(A)$

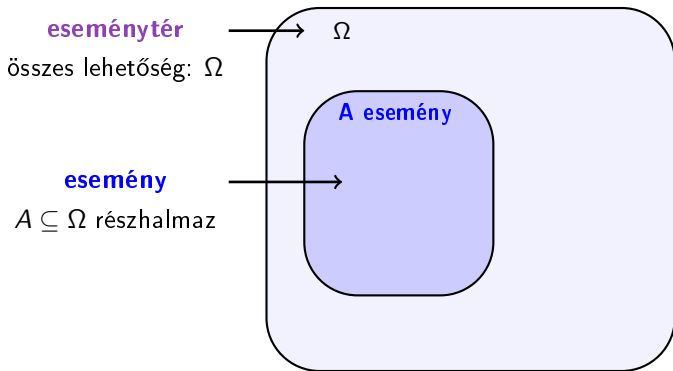
**az események valószínűsége attól függ, hogy
milyen modellt választunk**

attól, hogy hogyan vesszük figyelembe a méréseket, megfigyeléseket
ha más modellt választunk, az értékek is másképp alakulnak

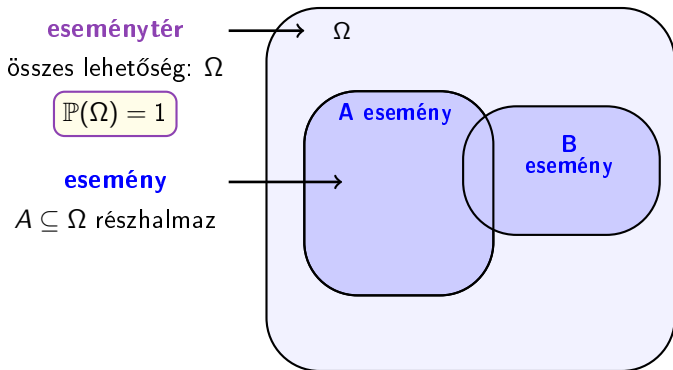
A Kolmogorov-féle valószínűségi mező



A Kolmogorov-féle valószínűségi mező

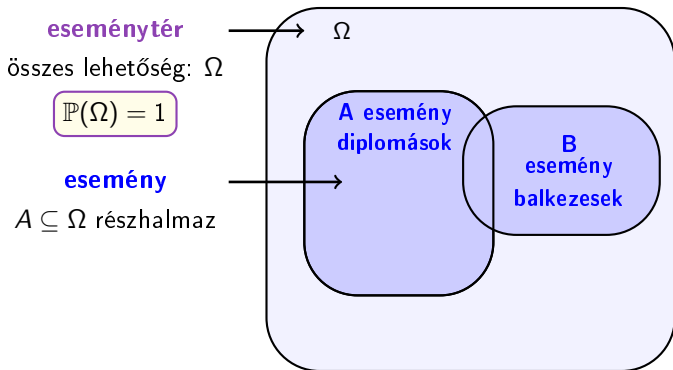


A Kolmogorov-féle valószínűségi mező



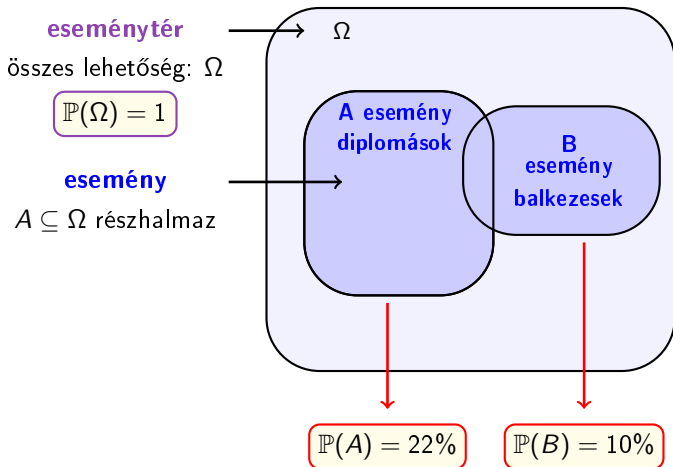
A Kolmogorov-féle valószínűségi mező

Ω : (magyar) **felnőtt emberek**



A Kolmogorov-féle valószínűségi mező

Ω : (magyar) **felnőtt emberek**



A Kolmogorov-féle valószínűségi mező

Ω : (magyar) **felnőtt emberek**

eseménytér

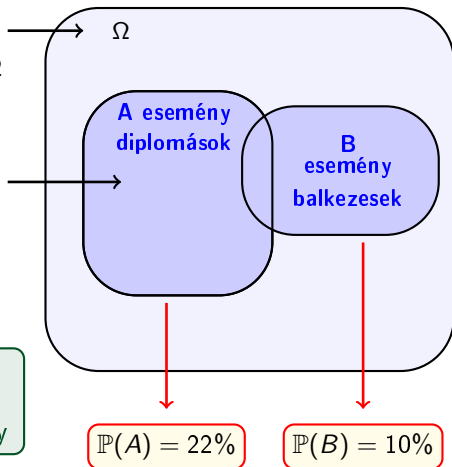
összes lehetőség: Ω

$$\mathbb{P}(\Omega) = 1$$

esemény

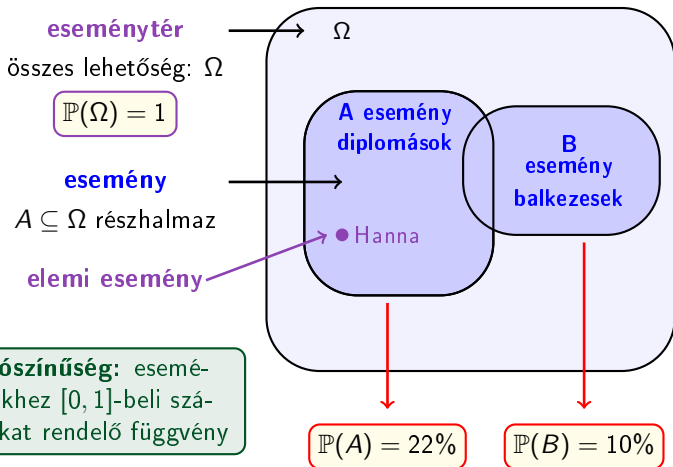
$A \subseteq \Omega$ részhalmaz

valószínűség: eseményekhez $[0, 1]$ -beli számokat rendelő függvény



A Kolmogorov-féle valószínűségi mező

Ω : (magyar) **felnőtt emberek**



Eseménytér

- **eseménytér**: az összes lehetőség halmaza, Ω (például a magyar felnőttek)

Eseménytér

- **eseménytér**: az összes lehetőség halmaza, Ω (például a magyar felnőttek)
- **elemi esemény**: a kísérlet egy lehetséges kimenetele, Ω egy eleme (például Hanna vagy Gábor)

Eseménytér

- **eseménytér**: az összes lehetőség halmaza, Ω (például a magyar felnőttek)
- **elemi esemény**: a kísérlet egy lehetséges kimenetele, Ω egy eleme (például Hanna vagy Gábor)
- **esemény**: az eseménytér egy részhalmaza, $A \subseteq \Omega$
például: diplomások (A) vagy a balkezesek (B)

Eseménytér

- **eseménytér**: az összes lehetőség halmaza, Ω (például a magyar felnőttek)
- **elemi esemény**: a kísérlet egy lehetséges kimenetele, Ω egy eleme (például Hanna vagy Gábor)
- **esemény**: az eseménytér egy részhalmaza, $A \subseteq \Omega$
például: diplomások (A) vagy a balkezesek (B)
- **valószínűség**: eseményekhez $[0, 1]$ -beli számokat rendelő függvény (például:
 $\mathbb{P}(A) = 22\%$)

Eseménytér

- **eseménytér**: az összes lehetőség halmaza, Ω (például a magyar felnőttek)
- **elemi esemény**: a kísérlet egy lehetséges kimenetele, Ω egy eleme (például Hanna vagy Gábor)
- **esemény**: az eseménytér egy részhalmaza, $A \subseteq \Omega$
például: diplomások (A) vagy a balkezesek (B)
- **valószínűség**: eseményekhez $[0, 1]$ -beli számokat rendelő függvény (például: $\mathbb{P}(A) = 22\%$)

További példák:

- eseménytér: magyar férfiak; esemény: 50 évesnél idősebbek
- két érmedobásnál az eseménytér $\{FF, FI, IF, II\}$, esemény: különbözőt dobunk, azaz $\{FI, IF\}$
- egy érmével addig dobunk, amíg fejet nem kapunk, ekkor az eseménytér: $\{F, IF, IIF, IIIF, \dots, \text{minden dobás írás}\}$

Események valószínűsége

1) Egy esemény valószínűsége mindig 0 és 1 közé esik:

$$0 \leq \mathbb{P}(A) \leq 1$$

Események valószínűsége

1) Egy esemény valószínűsége mindig 0 és 1 közé esik:

$$0 \leq \mathbb{P}(A) \leq 1$$

2) Egy találkozóra öt embert hívtak.

Mennyi a valószínűsége, hogy legalább négyen eljönnek?

Események valószínűsége

1) Egy esemény valószínűsége mindig 0 és 1 közé esik:

$$0 \leq \mathbb{P}(A) \leq 1$$

2) Egy találkozóra öt embert hívtak.

Mennyi a valószínűsége, hogy legalább négyen eljönnek?

mindenki eljön

egy ember
hiányzik

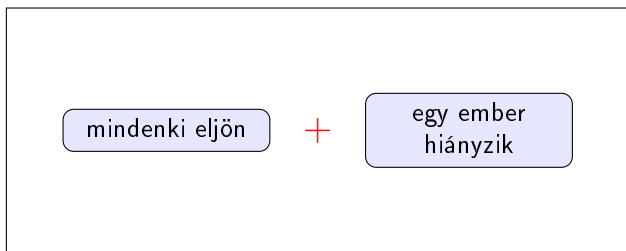
Események valószínűsége

1) Egy esemény valószínűsége mindig 0 és 1 közé esik:

$$0 \leq \mathbb{P}(A) \leq 1$$

2) Egy találkozóra öt embert hívtak.

Mennyi a valószínűsége, hogy legalább négyen eljönnek?



$\mathbb{P}(\text{legalább négyen vannak}) =$

$= \mathbb{P}(\text{mindenki eljön})$

$\mathbb{P}(\text{egy ember hiányzik})$

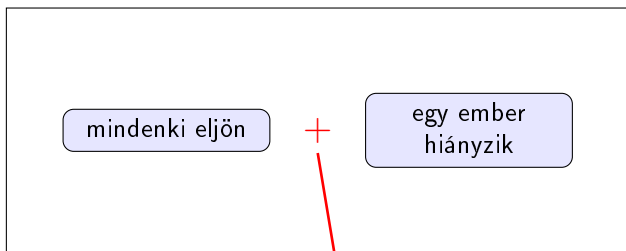
Események valószínűsége

1) Egy esemény valószínűsége mindig 0 és 1 közé esik:

$$0 \leq \mathbb{P}(A) \leq 1$$

2) Egy találkozóra öt embert hívtak.

Mennyi a valószínűsége, hogy legalább négyen eljönnek?



$\mathbb{P}(\text{legalább négyen vannak}) =$

$= \mathbb{P}(\text{mindenki eljön}) + \mathbb{P}(\text{egy ember hiányzik})$

Események valószínűsége

1) Egy esemény valószínűsége mindig 0 és 1 közé esik:

$$0 \leq \mathbb{P}(A) \leq 1$$

2) Általában:

Ha az A és B események kizáróak, azaz metszetük üres, akkor annak valószínűsége, hogy legalább az egyik bekövetkezik, a valószínűségük összege:

Események valószínűsége

1) Egy esemény valószínűsége mindig 0 és 1 közé esik:

$$0 \leq \mathbb{P}(A) \leq 1$$

2) Általában:

Ha az A és B események kizáróak, azaz metszetük üres, akkor annak valószínűsége, hogy legalább az egyik bekövetkezik, a valószínűségük összege:

$$A \cap B = \emptyset \Rightarrow \mathbb{P}(A \cup B) = \mathbb{P}(A) + \mathbb{P}(B)$$

Események valószínűsége

1) Egy esemény valószínűsége mindig 0 és 1 közé esik:

$$0 \leq \mathbb{P}(A) \leq 1$$

2) Általában:

Ha az A és B események kizáróak, azaz metszetük üres, akkor annak valószínűsége, hogy legalább az egyik bekövetkezik, a valószínűségük összege:

$$A \cap B = \emptyset \Rightarrow \mathbb{P}(A \cup B) = \mathbb{P}(A) + \mathbb{P}(B)$$

kizáróak: egyszerre nem következhetnek be

unió: legalább az egyik bekövetkezik

A valószínűség alaptulajdonságai

- 1 **Egy esemény valószínűsége mindig 0 és 1 közé esik:**

A valószínűség alaptulajdonságai

- 1 **Egy esemény valószínűsége mindig 0 és 1 közé esik:**

$$0 \leq \mathbb{P}(A) \leq 1$$

bármely A eseményre,

A valószínűség alaptulajdonságai

- 1 **Egy esemény valószínűsége mindig 0 és 1 közé esik:**

$$0 \leq \mathbb{P}(A) \leq 1$$

bármely A eseményre, **és a biztos esemény valószínűsége 1.**

A valószínűség alaptulajdonságai

- 1 **Egy esemény valószínűsége mindig 0 és 1 közé esik:**

$$0 \leq \mathbb{P}(A) \leq 1$$

bármely A eseményre, **és a biztos esemény valószínűsége 1.**

- 2 **Additivitás:** ha A_1, A_2, \dots események, és semelyik kettő nem következhet be egyszerre, azaz

A valószínűség alaptulajdonságai

- ① **Egy esemény valószínűsége mindig 0 és 1 közé esik:**

$$0 \leq \mathbb{P}(A) \leq 1$$

bármely A eseményre, **és a biztos esemény valószínűsége 1.**

- ② **Additivitás:** ha A_1, A_2, \dots események, és semelyik kettő nem következhet be egyszerre, azaz

$$A_i \cap A_j = \emptyset \quad \text{minden } i, j \geq 1\text{-re,}$$

akkor annak valószínűsége, hogy legalább az egyik bekövetkezik, a valószínűségük összege:

A valószínűség alaptulajdonságai

- ① **Egy esemény valószínűsége mindig 0 és 1 közé esik:**

$$0 \leq \mathbb{P}(A) \leq 1$$

bármely A eseményre, **és a biztos esemény valószínűsége 1.**

- ② **Additivitás:** ha A_1, A_2, \dots események, és semelyik kettő nem következhet be egyszerre, azaz

$$A_i \cap A_j = \emptyset \quad \text{minden } i, j \geq 1\text{-re,}$$

akkor annak valószínűsége, hogy legalább az egyik bekövetkezik, a valószínűségük összege:

$$\mathbb{P}(A_1 \cup A_2 \cup A_3 \cup \dots) = \mathbb{P}(A_1) + \mathbb{P}(A_2) + \mathbb{P}(A_3) + \dots$$

A valószínűség alaptulajdonságai

- 1 **Egy esemény valószínűsége mindig 0 és 1 közé esik:**

$$0 \leq \mathbb{P}(A) \leq 1$$

bármely A eseményre, **és a biztos esemény valószínűsége 1.**

- 2 **Additivitás:** ha A_1, A_2, \dots események, és semelyik kettő nem következhet be egyszerre, azaz

$$A_i \cap A_j = \emptyset \quad \text{minden } i, j \geq 1\text{-re,}$$

akkor annak valószínűsége, hogy legalább az egyik bekövetkezik, a valószínűségük összege:

$$\mathbb{P}(A_1 \cup A_2 \cup A_3 \cup \dots) = \mathbb{P}(A_1) + \mathbb{P}(A_2) + \mathbb{P}(A_3) + \dots$$

Ugyanez más jelöléssel:

$$\mathbb{P}\left(\bigcup_{j=1}^{\infty} A_j\right) = \sum_{j=1}^{\infty} \mathbb{P}(A_j).$$

A valószínűség tulajdonságai

- Egy **esemény valószínűsége** mindig 0 és 1 közé esik:

$$0 \leq \mathbb{P}(A) \leq 1$$

- A **biztos esemény** (összes lehetőség, ezek halmaza Ω) valószínűsége 1:

$$\mathbb{P}(\Omega) = 1; \quad \mathbb{P}(\emptyset) = 0,$$

míg a **lehetetlen esemény** (üres halmaz) valószínűsége 0.

A valószínűség tulajdonságai

- Egy **esemény valószínűsége** mindig 0 és 1 közé esik:

$$0 \leq \mathbb{P}(A) \leq 1$$

- A **biztos esemény** (összes lehetőség, ezek halmaza Ω) valószínűsége 1:

$$\mathbb{P}(\Omega) = 1; \quad \mathbb{P}(\emptyset) = 0,$$

míg a **lehetetlen esemény** (üres halmaz) valószínűsége 0.

- **Komplementer** valószínűsége: ha $A \subseteq \Omega$ esemény, akkor annak valószínűsége, hogy **A nem következik be**:

$$\mathbb{P}(\bar{A}) = \mathbb{P}(\Omega \setminus A) = 1 - \mathbb{P}(A).$$

- **Különbség** valószínűsége:

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

Halmazok és részhalmazok

Legyen $\Omega = \{a_1, a_2, \dots, a_n\}$ egy véges halmaz.

Az Ω elemei: $a_1 \in \Omega$, $a_2 \in \Omega$, stb.

Az Ω részhalmazai: $A \subseteq \Omega$ részhalmaza Ω -nak, ha A egy olyan halmaz, melynek minden eleme Ω -nak is eleme. Például: $A = \{a_2, a_3, a_5\} \subseteq \Omega$.

Például: $\Omega = \{1, 2, 3, 4, 5\}$, ekkor $A = \{2, 4\} \subseteq \Omega$ részhalmaza Ω -nak, de $B = \{2, 4, 6\}$ nem részhalmaza Ω -nak.

Az $\Omega = \{1, 2, 3, 4, 5\}$ részhalmazai: \emptyset (üres halmaz, ez minden halmaznak a részhalmaza), $\{1\}, \{2\}, \dots, \{5\}, \{1, 2\}, \{1, 3\}, \dots, \{1, 3, 4, 5\}, \{2, 3, 4, 5\}, \{1, 2, 3, 4, 5\}$.

Összesen $2^5 = 32$ részhalmaza van: mind az öt elemről külön-külön eldönthetjük, hogy bekerüljön-e a részhalmazba.

Általában, egy n elemű halmaznak 2^n részhalmaza van. Például egy egyeleműnek 2 (az üres és saját maga), egy kételeműnek 4, egy háromeleműnek 8, és így tovább.

Jelölések és műveletek eseményekkel

- Ω az eseménytér, ez a biztos esemény
- \emptyset (üres halmaz) esemény neve: lehetetlen esemény
- az események összessége, halmaza: \mathcal{A} (minden eleme Ω egy részhalmaza)

Jelölések és műveletek eseményekkel

- Ω az eseménytér, ez a biztos esemény
- \emptyset (üres halmaz) esemény neve: lehetetlen esemény
- az események összessége, halmaza: \mathcal{A} (minden eleme Ω egy részhalmaza)
- $A, B \in \mathcal{A}$ események **uniója** azon elemi események halmaza, melyek A és B közül legalább az egyikben benne vannak
- $A, B \in \mathcal{A}$ események **metsete** azon elemi események halmaza, melyek A -ban és B -ben is benne vannak
- $A \in \mathcal{A}$ és $B \in \mathcal{A}$ **kizáró események**, ha $A \cap B = \emptyset$, azaz nincs olyan elemi esemény, mely A -ban és B -ben is benne van
- $A \in \mathcal{A}$ esemény **ellentettje/komplementere**: $\bar{A} = \{\omega \in \Omega : \omega \notin A\}$, azaz azokból az elemi eseményekből áll, melyek nincsenek A -ban

Műveletek eseményekkel

Tulajdonságok

- $A \setminus B = A \cap \overline{B}$, ahol $A \setminus B$ azon elemi eseményekből áll, melyek benne vannak A -ben de nincsenek benne B -ben (ez A és B **különbsége**)
- $\overline{A \cup B} = \overline{A} \cap \overline{B}$ (de Morgan-azonosság)
- $\overline{\overline{A}} = A$ és $\overline{\Omega} = \emptyset$

Példa: egy kockával dobunk, $\Omega = \{1, 2, 3, 4, 5, 6\}$.

- A : páros számot dobunk
- B : legalább 3-ast dobunk
- $A \cup B = \{2, 3, 4, 5, 6\}$ az A és B uniója
- $A \cap B = \{4, 6\}$ az A és B metszete
- $A \setminus B = \{2\}$ az A és B különbsége
- $\overline{A} = \{1, 3, 5\}$ az A ellentettje/komplementere

A valószínűség axiomatikus felépítése

Ω : eseménytér (a lehetséges kimenetek összessége)

\mathcal{A} : az események halmaza

\mathbb{P} : **valószínűség**, amire az alábbiak teljesülnek:

- **eseményekhez rendel nemnegatív számokat**, azaz $A \in \mathcal{A}$ esetén $\mathbb{P}(A) \geq 0$
- **additív**: ha $A_1, A_2, \dots \in \mathcal{A}$ események, és bármely kettő metszete üres, akkor

$$\mathbb{P}(A_1 \cup A_2 \cup A_3 \cup \dots) = \mathbb{P}(A_1) + \mathbb{P}(A_2) + \mathbb{P}(A_3) + \dots$$

- $\mathbb{P}(\Omega) = 1$, azaz a biztos esemény valószínűsége 1

Az $(\Omega, \mathcal{A}, \mathbb{P})$ hármast **valószínűségi mezőnek** nevezzük.

A Kolmogorov-féle valószínűségi mező

Az $(\Omega, \mathcal{A}, \mathbb{P})$ hármas **Kolmogorov-féle valószínűségi mező**, ha

- az Ω **eseménytér** egy nem üres halmaz;

A Kolmogorov-féle valószínűségi mező

Az $(\Omega, \mathcal{A}, \mathbb{P})$ hármas **Kolmogorov-féle valószínűségi mező**, ha

- az Ω **eseménytér** egy nem üres halmaz;
- $\mathcal{A} \subseteq \mathcal{P}(\Omega)$ az **az események halmaza**, azaz minden $A \in \mathcal{A}$ -ra $A \subseteq \Omega$ úgy, hogy
 - (i) $\Omega \in \mathcal{A}$;
 - (ii) ha $A_1, A_2, \dots \in \mathcal{A}$, akkor $\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n \in \mathcal{A}$ (azaz megszámlálható sok \mathcal{A} -beli elem uniója is \mathcal{A} -beli);
 - (iii) ha $A \in \mathcal{A}$, akkor $\Omega \setminus A \in \mathcal{A}$ (azaz \mathcal{A} -beli halmazok komplementere is \mathcal{A} -beli).

A Kolmogorov-féle valószínűségi mező

Az $(\Omega, \mathcal{A}, \mathbb{P})$ hármas **Kolmogorov-féle valószínűségi mező**, ha

- az Ω **eseménytér** egy nem üres halmaz;
- $\mathcal{A} \subseteq \mathcal{P}(\Omega)$ az **az események halmaza**, azaz minden $A \in \mathcal{A}$ -ra $A \subseteq \Omega$ úgy, hogy
 - (i) $\Omega \in \mathcal{A}$;
 - (ii) ha $A_1, A_2, \dots \in \mathcal{A}$, akkor $\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n \in \mathcal{A}$ (azaz megszámlálható sok \mathcal{A} -beli elem uniója is \mathcal{A} -beli);
 - (iii) ha $A \in \mathcal{A}$, akkor $\Omega \setminus A \in \mathcal{A}$ (azaz \mathcal{A} -beli halmazok komplementere is \mathcal{A} -beli).
- a **valószínűség** egy $\mathbb{P} : \mathcal{A} \rightarrow [0, 1]$ függvény, melyre
 - (i) $\mathbb{P}(\Omega) = 1$, azaz a biztos esemény valószínűsége 1;
 - (ii) ha $A_1, A_2, \dots \in \mathcal{A}$ és minden $1 \leq i < j$ -re $A_i \cap A_j = \emptyset$, akkor

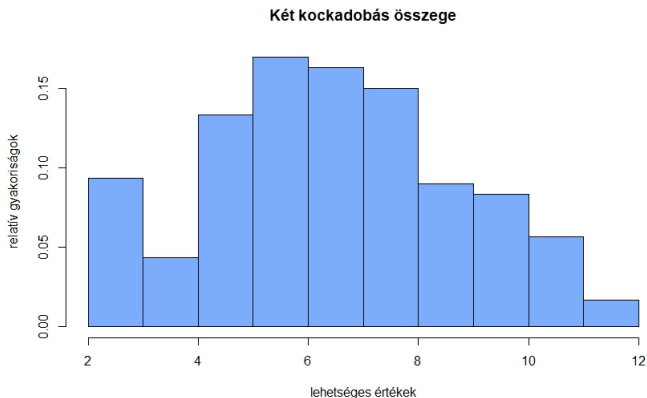
$$\mathbb{P}\left(\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n\right) = \sum_{n=1}^{\infty} \mathbb{P}(A_n),$$

azaz megszámlálható sok kizáró esemény uniójának valószínűsége a valószínűségek összege.

A Kolmogorov-féle valószínűségi mező

- Ω : **eseménytér** vagy elemi események halmaza.
- Ω elemei ($\omega \in \Omega$): **elemi események**.
- \mathcal{A} : **események halmaza** (vagy események σ -algebrája).
- \mathcal{A} elemei ($A \in \mathcal{A}$): **események**.
- \mathbb{P} : **valószínűség** (probability).
- Ω esemény neve: biztos esemény.
- \emptyset (üres halmaz) esemény neve: lehetetlen esemény.
- $A \in \mathcal{A}$ és $B \in \mathcal{A}$ **kizáró események**, ha $A \cap B = \emptyset$, azaz **egyszerre nem következhetnek be**.

Példa: két szabályos kockadobás összege



Kísérlet: két szabályos dobókockával dobva mennyi a dobott számok összege. Ezt 300-szor megismételve az egyes lehetséges értékek **relatív gyakorisága** (előfordulásuk aránya) látható az ábrán.

Példa: két szabályos kockadobás

Két szabályos dobókockával dobunk. Mennyi a valószínűsége, hogy a dobott számok összege 7?

Példa: két szabályos kockadobás

Két szabályos dobókockával dobunk. Mennyi a valószínűsége, hogy a dobott számok összege 7?

A dobókockák, emberek, tárgyak stb. mindig különbözőek.

- **eseménytér**: lehetséges dobássorozatok. Ezek száma:

Példa: két szabályos kockadobás

Két szabályos dobókockával dobunk. Mennyi a valószínűsége, hogy a dobott számok összege 7?

A dobókockák, emberek, tárgyak stb. mindig különbözőek.

- **eseménytér**: lehetséges dobássorozatok. Ezek száma:

$$6 \cdot 6 = 36; \text{ mindkét dobás hatféle lehet.}$$

Példa: két szabályos kockadobás

Két szabályos dobókockával dobunk. Mennyi a valószínűsége, hogy a dobott számok összege 7?

A dobókockák, emberek, tárgyak stb. mindig különbözőek.

- **eseménytér**: lehetséges dobássorozatok. Ezek száma:

$$6 \cdot 6 = 36; \text{ mindkét dobás hatféle lehet.}$$

- A dobássorozatok egyformán valószínűek: mindegyiknek $1/36$ a valószínűsége.
- A kedvező dobássorozatok száma:

Példa: két szabályos kockadobás

Két szabályos dobókockával dobunk. Mennyi a valószínűsége, hogy a dobott számok összege 7?

A dobókockák, emberek, tárgyak stb. mindig különbözőek.

- **eseménytér:** lehetséges dobássorozatok. Ezek száma:

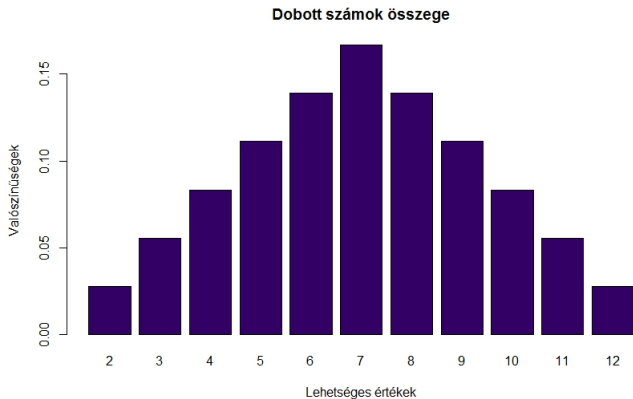
$$6 \cdot 6 = 36; \text{ mindkét dobás hatféle lehet.}$$

- A dobássorozatok egyformán valószínűek: mindegyiknek $1/36$ a valószínűsége.
- A kedvező dobássorozatok száma: 6.

| | | | | | |
|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 |
| 21 | 22 | 23 | 24 | 25 | 26 |
| 31 | 32 | 33 | 34 | 35 | 36 |
| 41 | 42 | 43 | 44 | 45 | 46 |
| 51 | 52 | 53 | 54 | 55 | 56 |
| 61 | 62 | 63 | 64 | 65 | 66 |

Tehát $\mathbb{P}(\text{az összeg } 7) = 6/36 = 1/6$.

Példa: két szabályos kockadobás



Az összeg lehetséges értékei és a valószínűségek

Példa: két szabályos kockadobás

- **elemi esemény:** a kísérlet egy lehetséges kimenetele, egy dobássorozat, például: **15** vagy **22**
- **eseménytér:** az elemi események összessége, az Ω halmaz most az alábbi 36 elemű halmaz: $\Omega = \{11, 12, 13, \dots, 16, 21, \dots, 26, \dots, 61, \dots, 66\}$.

Példa: két szabályos kockadobás

- **elemi esemény:** a kísérlet egy lehetséges kimenetele, egy dobássorozat, például: **15** vagy **22**
- **eseménytér:** az elemi események összessége, az Ω halmaz most az alábbi 36 elemű halmaz: $\Omega = \{11, 12, 13, \dots, 16, 21, \dots, 26, \dots, 61, \dots, 66\}$.
- **esemény:** az eseménytér, azaz Ω részhalmazai
például: a dobott számok összege 7, azaz $A = \{16, 25, 34, 43, 52, 61\}$
vagy: a dobott számok összege legfeljebb 3, azaz $B = \{11, 12, 21\}$
 \mathcal{A} : az események halmaza, ez most Ω összes részhalmaza
az összes esemény száma: $|\mathcal{A}| = 2^{36}$

Példa: két szabályos kockadobás

- **elemi esemény:** a kísérlet egy lehetséges kimenetele, egy dobássorozat, például: **15** vagy **22**
- **eseménytér:** az elemi események összessége, az Ω halmaz most az alábbi 36 elemű halmaz: $\Omega = \{11, 12, 13, \dots, 16, 21, \dots, 26, \dots, 61, \dots, 66\}$.
- **esemény:** az eseménytér, azaz Ω részhalmazai
például: a dobott számok összege 7, azaz $A = \{16, 25, 34, 43, 52, 61\}$
vagy: a dobott számok összege legfeljebb 3, azaz $B = \{11, 12, 21\}$
 \mathcal{A} : az események halmaza, ez most Ω összes részhalmaza
az összes esemény száma: $|\mathcal{A}| = 2^{36}$
- **valószínűség:** $\mathbb{P} : \mathcal{A} \rightarrow [0, 1]$ az eseményekhez $[0, 1]$ -beli számokat rendelő függvény. Például

$$\mathbb{P}(A) = \frac{|A|}{|\Omega|} = \frac{6}{36} = \frac{1}{6}; \quad \mathbb{P}(B) = \frac{|B|}{|\Omega|} = \frac{3}{36} = \frac{1}{12}.$$

Házi feladat szeptember 18., 10:15-ig

Egy dobozban négy kék és két piros golyó van. Kiveszünk egy golyót, mindegyiket azonos valószínűséggel választva, majd még egyet, a megmaradt öt mindegyikét azonos valószínűséggel választva.

Legyen A_j az az esemény, hogy j darab kék golyót húzunk ($j = 0, 1, 2$).

Mennyi a valószínűsége, hogy két kék golyót húzunk? Annak valószínűsége, hogy egy kéket és egy pirosat? És annak valószínűsége, hogy csak pirosat? Azaz mennyi A_0, A_1, A_2 valószínűsége?