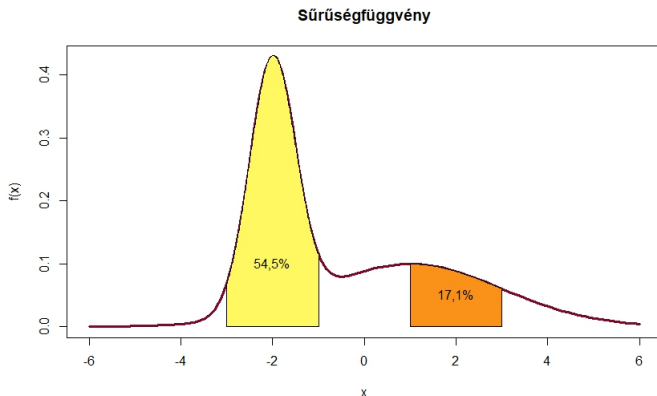


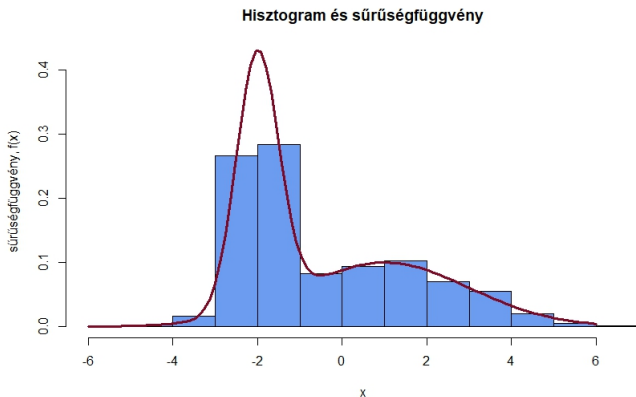
Sűrűségfüggvény (11. előadás)



Ha X sűrűségfüggvénye f (ami most az ábrán látható függvény): $\mathbb{P}(-3 \leq X \leq -1) = \int_{-3}^{-1} f(x)dx = 54,5\%$;

$\mathbb{P}(1 \leq X \leq 3) = \int_1^3 f(x)dx = 17,1\%$.

Sűrűségfüggvény



Egy sűrűségfüggvény és hozzá tartozó ezer elemű független minta hisztogramja;
nagyobb a sűrűségfüggvény \rightarrow nagyobb a gyakoriság;
minta: független valószínűségi változók, melyek mindegyikének f a sűrűségfüggvénye

Sűrűségfüggvény: definíció

Az $X : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ valószínűségi változó **sűrűségfüggvénye** az $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ függvény, ha

$$\mathbb{P}(X \leq t) = \int_{-\infty}^t f(x) dx$$

teljesül minden $t \in \mathbb{R}$ számra.

Nem minden valószínűségi változónak van sűrűségfüggvénye, például a diszkrétnek nincs. Ha X -nek **van sűrűségfüggvénye**, akkor **abszolút folytonos** valószínűségi változónak nevezzük.

Ha az X valószínűségi változó sűrűségfüggvénye f , akkor tetszőleges $a < b$ számokra

$$\mathbb{P}(a < X < b) = \mathbb{P}(a \leq X \leq b) = \int_a^b f(x) dx.$$

A sűrűségfüggvény tulajdonságai

Legyen X abszolút folytonos valószínűségi változó, melynek F az eloszlásfüggvénye.

(a) Ha f az X sűrűségfüggvénye, akkor minden $t \in \mathbb{R}$ számra

$$F(t) = \mathbb{P}(X \leq t) = \int_{-\infty}^t f(x) dx.$$

(b) Az $f(t) = F'(t)$ függvény (azokra a t -kre, ahol F differenciálható) az X sűrűségfüggvénye.

Ha az $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ függvény sűrűségfüggvény, akkor

- ❶ $f(x) \geq 0$ teljesül „majdnem minden” $x \in \mathbb{R}$ -re (például véges vagy megszámlálható sok kivétel lehetséges).
- ❷ $\int_{-\infty}^{\infty} f(x) dx = 1$.

Fordítva: ha f teljesíti ezt a két tulajdonságot, akkor van olyan valószínűségi változó, aminek f a sűrűségfüggvénye.

Diszkrét és abszolút folytonos eset

A **várható értéket** olyan formában nem tudjuk definiálni abszolút folytonos eloszlásokra, mint diszkrét esetben, hiszen $\mathbb{P}(X = x) = 0$ minden x -re. Helyette:

diszkrét

X lehetséges értékei: x_1, x_2, \dots

$$\mathbb{E}(X) = \sum_{j=1}^{\infty} x_j \cdot \mathbb{P}(X = x_j)$$

$$\mathbb{E}(X^2) = \sum_{j=1}^{\infty} x_j^2 \cdot \mathbb{P}(X = x_j)$$

abszolút folytonos

X sűrűségfüggvénye: f .

Diszkrét és abszolút folytonos eset

A **várható értéket** olyan formában nem tudjuk definiálni abszolút folytonos eloszlásokra, mint diszkrét esetben, hiszen $\mathbb{P}(X = x) = 0$ minden x -re. Helyette:

diszkrét

X lehetséges értékei: x_1, x_2, \dots

$$\mathbb{E}(X) = \sum_{j=1}^{\infty} x_j \cdot \mathbb{P}(X = x_j)$$

$$\mathbb{E}(X^2) = \sum_{j=1}^{\infty} x_j^2 \cdot \mathbb{P}(X = x_j)$$

abszolút folytonos

X sűrűségfüggvénye: f .

$$\mathbb{E}(X) = \int_{-\infty}^{\infty} x \cdot f(x) dx$$

$$\mathbb{E}(X^2) = \int_{-\infty}^{\infty} x^2 \cdot f(x) dx$$

Diszkrét és abszolút folytonos eset

A **várható értéket** olyan formában nem tudjuk definiálni abszolút folytonos eloszlásokra, mint diszkrét esetben, hiszen $\mathbb{P}(X = x) = 0$ minden x -re. Helyette:

diszkrét

X lehetséges értékei: x_1, x_2, \dots

$$\mathbb{E}(X) = \sum_{j=1}^{\infty} x_j \cdot \mathbb{P}(X = x_j)$$

$$\mathbb{E}(X^2) = \sum_{j=1}^{\infty} x_j^2 \cdot \mathbb{P}(X = x_j)$$

abszolút folytonos

X sűrűségfüggvénye: f .

$$\mathbb{E}(X) = \int_{-\infty}^{\infty} x \cdot f(x) dx$$

$$\mathbb{E}(X^2) = \int_{-\infty}^{\infty} x^2 \cdot f(x) dx$$

$$D(X) = \sqrt{\mathbb{E}((X - \mathbb{E}(X))^2)} = \sqrt{\mathbb{E}(X^2) - \mathbb{E}(X)^2}$$

Diszkrét és abszolút folytonos eset

A **várható értéket** olyan formában nem tudjuk definiálni abszolút folytonos eloszlásokra, mint diszkrét esetben, hiszen $\mathbb{P}(X = x) = 0$ minden x -re. Helyette:

diszkrét

X lehetséges értékei: x_1, x_2, \dots

$$\mathbb{E}(X) = \sum_{j=1}^{\infty} x_j \cdot \mathbb{P}(X = x_j)$$

$$\mathbb{E}(X^2) = \sum_{j=1}^{\infty} x_j^2 \cdot \mathbb{P}(X = x_j)$$

$$D(X) = \sqrt{\mathbb{E}((X - \mathbb{E}(X))^2)} = \sqrt{\mathbb{E}(X^2) - \mathbb{E}(X)^2}$$

$$\mathbb{E}(X^k) = \sum_{j=1}^{\infty} x_j^k \cdot \mathbb{P}(X = x_j)$$

$$\mathbb{E}(g(X)) = \sum_{j=1}^{\infty} g(x_j) \cdot \mathbb{P}(X = x_j)$$

abszolút folytonos

X sűrűségfüggvénye: f .

$$\mathbb{E}(X) = \int_{-\infty}^{\infty} x \cdot f(x) dx$$

$$\mathbb{E}(X^2) = \int_{-\infty}^{\infty} x^2 \cdot f(x) dx$$

$$\mathbb{E}(X^k) = \int_{-\infty}^{\infty} x^k f(x) dx$$

$$\mathbb{E}(g(X)) = \int_{-\infty}^{\infty} g(x) f(x) dx$$

Momentumok

Az X valószínűségi változók **k . momentuma** a k . hatványának várható értéke:

$$\mathbb{E}(X^k).$$

Általában igaz, hogy ha X abszolút folytonos valószínűségi változó, f a sűrűségfüggvénye, és $\mathbb{E}(g(X))$ létezik, akkor

$$\mathbb{E}(g(X)) = \int_{-\infty}^{\infty} g(x)f(x) dx.$$

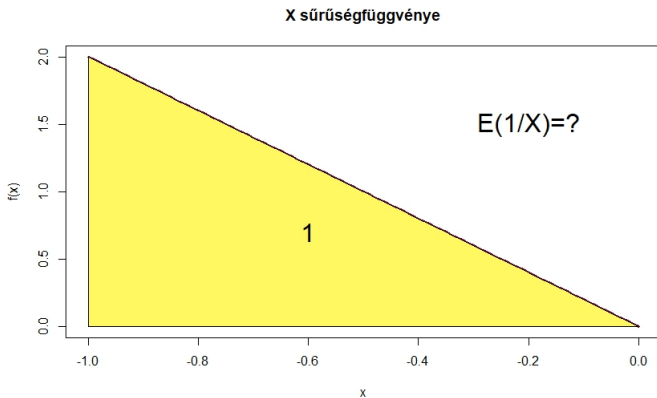
Ezért a k . momentum kiszámítása:

$$\mathbb{E}(X^k) = \int_{-\infty}^{\infty} x^k f(x) dx.$$

Következmény: a **szórásnégyzetet** a következőképpen számíthatjuk ki abszolút folytonos X valószínűségi változó esetén:

$$D^2(X) = \mathbb{E}(X^2) - [\mathbb{E}(X)]^2 = \int_{-\infty}^{\infty} x^2 f(x) dx - \left[\int_{-\infty}^{\infty} x \cdot f(x) dx \right]^2.$$

Várható érték abszolút folytonos esetben: példa



Várható érték abszolút folytonos esetben: példa

Legyen az X valószínűségi változó sűrűségfüggvénye $f(x) = 2|x|$, ha $-1 < x < 0$, és 0 különben. Mennyi az $1/X$ valószínűségi változó várható értéke?

Mivel X sűrűségfüggvénye azonosan 0, ha $x > 0$, ezért $X < 0$ és $1/X < 0$ biztosan teljesül. Így $\mathbb{E}(X) < 0$ teljesülni fog.

Pontosabban, mivel

$$\mathbb{E}(g(X)) = \int_{-\infty}^{\infty} g(x)f(x) dx,$$

a $g(x) = 1/x$ függvénnyel:

$$\mathbb{E}(1/X) = \int_{-\infty}^{\infty} \frac{1}{x} \cdot f(x) dx = \int_{-1}^0 \frac{2|x|}{x} dx = \int_{-1}^0 (-2) dx = -2.$$

Várható érték abszolút folytonos esetben: példa

Tegyük fel, hogy a holnap hulló csapadék mennyiségének sűrűségfüggvénye az alábbi:

$$f(x) = \begin{cases} 0,2, & \text{ha } 0 \leq x \leq 1; \\ 0,4, & \text{ha } 1 < x \leq 3; \\ 0 & \text{ha } x < 0 \text{ vagy } x > 3. \end{cases}$$

Jelölje a csapadékmennyiséget X . A csapadékmennyiség **várható értéke**:

$$\begin{aligned} \mathbb{E}(X) &= \int_{-\infty}^{\infty} x \cdot f(x) dx = \int_0^1 x \cdot 0,2 dx + \int_1^3 x \cdot 0,4 dx = \\ &= 0,2 \cdot \left(\frac{1^2}{2} - \frac{0^2}{2} \right) + 0,4 \cdot \left(\frac{3^2}{2} - \frac{1^2}{2} \right) = 1,7. \end{aligned}$$

Szórás abszolút folytonos esetben: példa

Tegyük fel, hogy a holnap hulló csapadék mennyiségének sűrűségfüggvénye az alábbi:

$$f(x) = \begin{cases} 0,2, & \text{ha } 0 \leq x \leq 1; \\ 0,4, & \text{ha } 1 < x \leq 3; \\ 0 & \text{ha } x < 0 \text{ vagy } x > 3. \end{cases}$$

Már láttuk, hogy $\mathbb{E}(X) = 1,7$.

A csapadékmennyiség négyzetének várható értéke:

$$\begin{aligned} \mathbb{E}(X^2) &= \int_{-\infty}^{\infty} x^2 \cdot f(x) \, ds = \int_0^1 x^2 \cdot 0,2 \, dx + \int_1^3 x^2 \cdot 0,4 \, dx = \\ &= 0,2 \cdot \left(\frac{1^3}{3} - \frac{0^3}{3} \right) + 0,4 \cdot \left(\frac{3^3}{3} - \frac{1^3}{3} \right) = 3,53. \end{aligned}$$

Ez alapján a csapadékmennyiség szórása:

$$D(X) = \sqrt{\mathbb{E}(X^2) - (\mathbb{E}(X))^2} = \sqrt{3,53 - 1,7^2} = 0,8.$$

Az egyenletes eloszlás várható értéke

Az $[a, b]$ intervallumon egyenletes eloszlás sűrűségfüggvénye:

$$f(s) = \begin{cases} \frac{1}{b-a}, & \text{ha } a \leq s \leq b; \\ 0, & \text{különben.} \end{cases}$$

Ha X egyenletes eloszlású az $[a, b]$ intervallumon, akkor várható értéke

$$\begin{aligned} \mathbb{E}(X) &= \int_{-\infty}^{\infty} s \cdot f(s) ds = \int_a^b s \cdot \frac{1}{b-a} ds = \frac{1}{b-a} \left[\frac{s^2}{2} \right]_{s=a}^b = \\ &= \frac{1}{b-a} \cdot \frac{b^2 - a^2}{2} = \frac{a+b}{2}, \end{aligned}$$

hiszen az x függvény primitív függvénye $\frac{x^2}{2}$, és $b^2 - a^2 = (b-a)(b+a)$.

Az egyenletes eloszlás szórása

Az $[a, b]$ intervallumon egyenletes eloszlás sűrűségfüggvénye:

$$f(s) = \begin{cases} \frac{1}{b-a}, & \text{ha } a \leq s \leq b; \\ 0, & \text{különben.} \end{cases}$$

Ha X egyenletes eloszlású az $[a, b]$ intervallumon, akkor várható értéke

$$\begin{aligned} \mathbb{E}(X^2) &= \int_{-\infty}^{\infty} s^2 \cdot f(s) ds = \int_a^b s^2 \cdot \frac{1}{b-a} ds = \frac{1}{b-a} \left[\frac{s^3}{3} \right]_{s=a}^b \\ &= \frac{1}{b-a} \cdot \frac{b^3 - a^3}{3} = \frac{a^2 + ab + b^2}{3}, \end{aligned}$$

hiszen az x^2 függvény primitív függvénye $\frac{x^3}{3}$, és $b^3 - a^3 = (b-a)(a^2 + ab + b^2)$.

Az egyenletes eloszlás szórása

Az $[a, b]$ intervallumon egyenletes eloszlás sűrűségfüggvénye:

$$f(s) = \begin{cases} \frac{1}{b-a}, & \text{ha } a \leq s \leq b; \\ 0, & \text{különben.} \end{cases}$$

Ha X egyenletes eloszlású az $[a, b]$ intervallumon, akkor várható értéke

$$\begin{aligned} \mathbb{E}(X^2) &= \int_{-\infty}^{\infty} s^2 \cdot f(s) ds = \int_a^b s^2 \cdot \frac{1}{b-a} ds = \frac{1}{b-a} \left[\frac{s^3}{3} \right]_{s=a}^b \\ &= \frac{1}{b-a} \cdot \frac{b^3 - a^3}{3} = \frac{a^2 + ab + b^2}{3}, \end{aligned}$$

hiszen az x^2 függvény primitív függvénye $\frac{x^3}{3}$, és $b^3 - a^3 = (b-a)(a^2 + ab + b^2)$.

$$\begin{aligned} D^2(X) &= \mathbb{E}(X^2) - \mathbb{E}(X)^2 = \frac{a^2 + ab + b^2}{3} - \left(\frac{a+b}{2} \right)^2 \\ &= \frac{a^2 + ab + b^2}{3} - \frac{a^2 + 2ab + b^2}{4} = \frac{4a^2 + 4ab + 4b^2 - 3a^2 - 6ab - 3b^2}{12} = \frac{a^2 - 2ab + b^2}{12}. \end{aligned}$$

Egyenletes eloszlás (uniform distribution)

Az X valószínűségi változó **egyenletes eloszlású** az $[a, b]$ intervallumon, ha sűrűségfüggvénye

$$f(x) = \begin{cases} \frac{1}{b-a}, & \text{ha } a \leq x \leq b; \\ 0, & \text{különben.} \end{cases}$$

Ekkor

i) X eloszlásfüggvénye:

$$F(t) = \mathbb{P}(X \leq t) = \begin{cases} 0, & \text{ha } t \leq a; \\ \frac{t-a}{b-a}, & \text{ha } a < t < b; \\ 1, & \text{ha } t \geq b. \end{cases}$$

ii) Ha $a \leq c \leq d \leq b$, akkor

$$\mathbb{P}(c \leq X \leq d) = \int_c^d f(x) dx = \int_c^d \frac{1}{b-a} dx = \frac{d-c}{b-a}.$$

iii) Az X valószínűségi változó **várható értéke** és **szórása**:

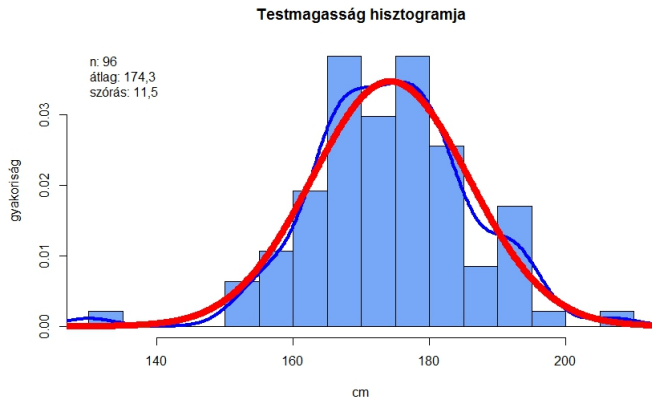
$$\mathbb{E}(X) = \frac{a+b}{2}; \quad D(X) = \frac{b-a}{\sqrt{12}}.$$

Normális eloszlás: bevezetés

Ha egy, a valóságban megfigyelhető valószínűségi változó eloszlását, pontosabban a **sűrűségfüggvényét** szeretnénk meghatározni:

- az adatokból készíthetünk hisztogramot;
- a hisztogram és a sűrűségfüggvény alakja sok független megfigyelés esetén „közel” van egymáshoz;
- megfigyelhetjük, hogy különféle mennyiségek esetén a hisztogramok gyakran **hasonló alakúak** → a gyakran előforduló sűrűségfüggvény-típusokat érdemes külön megérteni;
- az egyik ilyen a **normális eloszlás**, melynek sűrűségfüggvénye az e^{-x^2} függvényből származtatható
- például különféle *mérési eredmények* (a mérési hibák következtében), illetve élőlények *biológiai jellemzői* gyakran normális eloszlást követnek (például: testmagasság)
- a normális eloszlás a **statisztikában** is kulcsfontosságú

Testmagasság



Testmagasság histogramja $n = 96$ elemű mintából (valós adatokból), és az $m = \bar{X} = 174,3$ várható értékű és $\sigma = 11,5$ szórású normális eloszlás sűrűségfüggvénye (pirossal): $f(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi} \cdot 11,5} \exp\left(-\frac{(x - 174,3)^2}{2 \cdot 11,5^2}\right)$

Normális eloszlás: definíció

Legyen m valós, σ pedig pozitív szám. Azt mondjuk, hogy az Y valószínűségi változó **normális eloszlású** m várható értékkel és σ^2 szórásnégyzettel, ha **sűrűségfüggvénye**

$$f(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi} \cdot \sigma} \exp\left(-\frac{(x-m)^2}{2\sigma^2}\right) \quad (x \in \mathbb{R}).$$

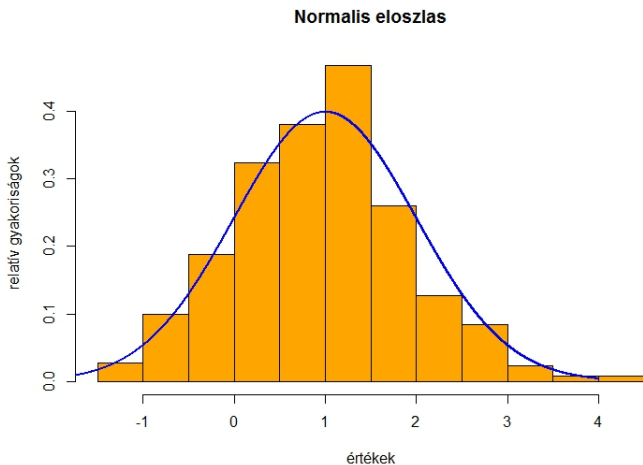
Jelölése: $Y \sim N(m, \sigma^2)$.

Ha $Y \sim N(m, \sigma^2)$, akkor $\mathbb{E}(Y) = m$, $D(Y) = \sigma$.

Standard normális eloszlás: az $m = 0$ várható értékű és $\sigma = 1$ szórásu normális eloszlás. **Eloszlásfüggvénye:** Φ , sűrűségfüggvénye φ , ahol

$$\Phi(t) = \int_{-\infty}^t \varphi(x) dx; \quad \varphi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp\left(-\frac{x^2}{2}\right).$$

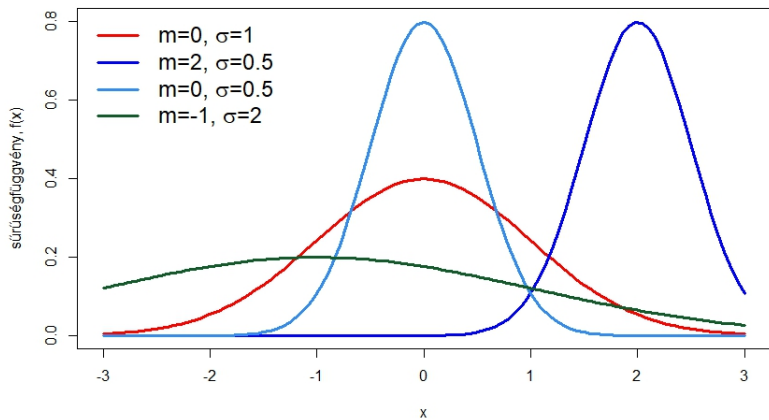
Normális eloszlás



Normális eloszlás ($m = 1, \sigma = 1$) sűrűségfüggvénye és 500 darab független, $N(1, 1)$ eloszlású valószínűségi változóból álló minta hisztogramja

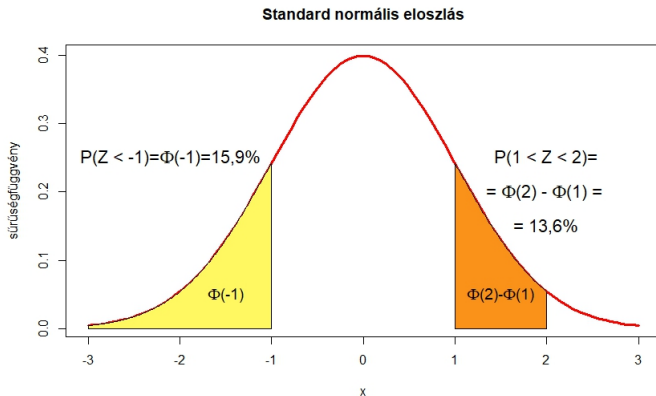
Normális eloszlás

Normális eloszlások sűrűségfüggvényei



Különböző várható értékű (m) és szórású (σ) normális eloszlások sűrűségfüggvényei

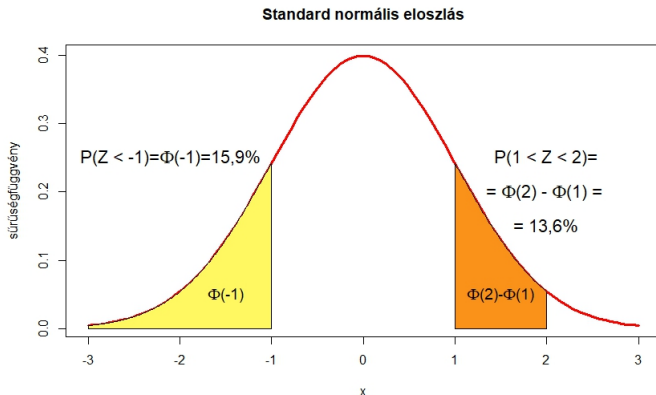
A Φ függvény



A Φ függvény a standard normális eloszlás eloszlásfüggvénye: ha $Z \sim N(0, 1)$, akkor

$$\mathbb{P}(Z \leq t) = \Phi(t) = \int_{-\infty}^t \varphi(x) dx = \int_{-\infty}^t \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-x^2/2} dx.$$

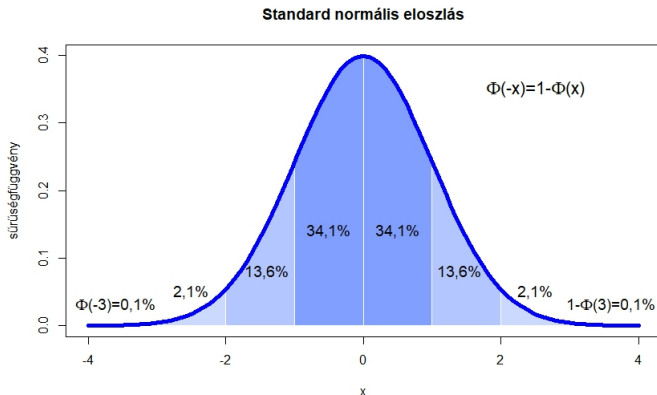
Standard normális eloszlás



A Φ függvény a standard normális eloszlás eloszlásfüggvénye: ha $Z \sim N(0, 1)$, akkor

$$\mathbb{P}(a \leq Z \leq b) = \Phi(b) - \Phi(a) = \int_a^b \varphi(x) dx = \int_a^b \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-x^2/2} dx.$$

Standard normális eloszlás



A Φ függvény a standard normális eloszlás eloszlásfüggvénye: ha $Z \sim N(0, 1)$, akkor

$$\mathbb{P}(a \leq Z \leq b) = \Phi(b) - \Phi(a) = \int_a^b \varphi(x) dx = \int_a^b \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-x^2/2} dx.$$

Standard normális eloszlás

A Z valószínűségi változó **standard normális eloszlású**, azaz $Z \sim N(0,1)$, ha sűrűségfüggvénye

$$\varphi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp\left(-\frac{x^2}{2}\right).$$

Ekkor **eloszlásfüggvénye** Φ , azaz

$$\Phi(t) = \mathbb{P}(Z \leq t) = \mathbb{P}(Z < t) = \int_{-\infty}^t \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp\left(-\frac{x^2}{2}\right) dx.$$

Továbbá

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(a < Z < b) &= \mathbb{P}(a \leq Z \leq b) = \mathbb{P}(Z \leq b) - \mathbb{P}(Z < a) = \\ &= \int_a^b \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp\left(-\frac{x^2}{2}\right) dx = \Phi(b) - \Phi(a). \end{aligned}$$

Más normális eloszlások esetén ezeket a valószínűségeket a Φ függvényre vezetjük vissza. A Φ függvény az R-ben: pnorm

A normális eloszlás tulajdonságai

Tegyük fel, hogy Y normális eloszlású m várható értékkel és σ^2 szórásnégyzettel, azaz $Y \sim N(m, \sigma^2)$. Ekkor tetszőleges $a \leq b$ valós számokra

$$\mathbb{P}(Y < b) = \mathbb{P}(Y \leq b) = \mathbb{P}\left(\frac{Y - m}{\sigma} \leq \frac{b - m}{\sigma}\right) = \Phi\left(\frac{b - m}{\sigma}\right)$$

$$\mathbb{P}(Y > a) = \mathbb{P}(Y \geq a) = 1 - \Phi\left(\frac{a - m}{\sigma}\right)$$

$$\mathbb{P}(a < Y < b) = \mathbb{P}(a \leq Y \leq b) = \Phi\left(\frac{b - m}{\sigma}\right) - \Phi\left(\frac{a - m}{\sigma}\right)$$

$$\mathbb{P}(|Y - m| \leq b) = 2\Phi\left(\frac{b}{\sigma}\right) - 1$$

Normális eloszlás: példa

Tegyük fel, hogy az Y valószínűségi változó normális eloszlású $m = 4$ várható értékkel és $\sigma = 3$ szórással. Ekkor

$$\mathbb{P}(Y \leq 7) = \Phi\left(\frac{7 - m}{\sigma}\right) = \Phi\left(\frac{7 - 4}{3}\right) = \Phi(1) = 84,1\%.$$

$$\begin{aligned}\mathbb{P}(1 < Y \leq 7) &= \mathbb{P}(Y \leq 7) - \mathbb{P}(Y \leq 1) = \Phi\left(\frac{7 - m}{\sigma}\right) - \Phi\left(\frac{1 - m}{\sigma}\right) \\ &= \Phi\left(\frac{7 - 4}{3}\right) - \Phi\left(\frac{1 - 4}{3}\right) = \Phi(1) - \Phi(-1) = \\ &= 2\Phi(1) - 1 = 68,2\%,\end{aligned}$$

mert

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

minden valós x -re érvényes a sűrűségfüggvény 0-ra való szimmetriája miatt.

A normális eloszlás tulajdonságai

Lineáris transzformáció. Legyen Y normális eloszlású valószínűségi változó m várható értékkel és σ szórással, és a, b valós számok. Ekkor az $aY + b$ valószínűségi változó normális eloszlású $am + b$ várható értékkel és $a^2\sigma^2$ szórásnégyzettel, azaz

$$Y \sim N(m, \sigma^2) \quad \Rightarrow \quad aY + b \sim N(am + b, a^2\sigma^2).$$

Független összeg. Ha Y_1, Y_2 **független, normális eloszlású** valószínűségi változók, akkor $Y_1 + Y_2$ is **normális eloszlású**, várható értéke $m_1 + m_2$, szórásnégyzete $\sigma_1^2 + \sigma_2^2$, ahol $Y_1 \sim N(m_1, \sigma_1^2)$ és $Y_2 \sim N(m_2, \sigma_2^2)$

Példa. Ha Y és Z függetlenek, normális eloszlásúak, $Y \sim N(2, 3^2)$ és $Z \sim N(1, 4^2)$, akkor

$$Y + Z \sim N(3, 5^2); \quad Y - Z \sim N(1, 5^2); \quad Y + 3Z \sim N(5, 57).$$

A normális eloszlás tulajdonságai

Legyenek Y_1, Y_2, \dots, Y_n **független normális eloszlású** valószínűségi változók, melyek várható értéke m , szórásuk σ . Ekkor az **összegük** és **az átlaguk is normális eloszlású**, és

$$Y_1 + Y_2 + \dots + Y_n \sim N(nm, n\sigma^2);$$

$$\frac{Y_1 + Y_2 + \dots + Y_n}{n} \sim N\left(m, \frac{\sigma^2}{n}\right).$$

A normális eloszlás tulajdonságai

Legyenek Y_1, Y_2, \dots, Y_n **független normális eloszlású** valószínűségi változók, melyek várható értéke m , szórásuk σ . Ekkor az **összegük** és **az átlaguk is normális eloszlású**, és

$$Y_1 + Y_2 + \dots + Y_n \sim N(nm, n\sigma^2);$$

$$\frac{Y_1 + Y_2 + \dots + Y_n}{n} \sim N\left(m, \frac{\sigma^2}{n}\right).$$

Példa. Tegyük fel, hogy az emberek testmagassága 176 cm várható értékű és 7 szórású valószínűségi változó. Ekkor

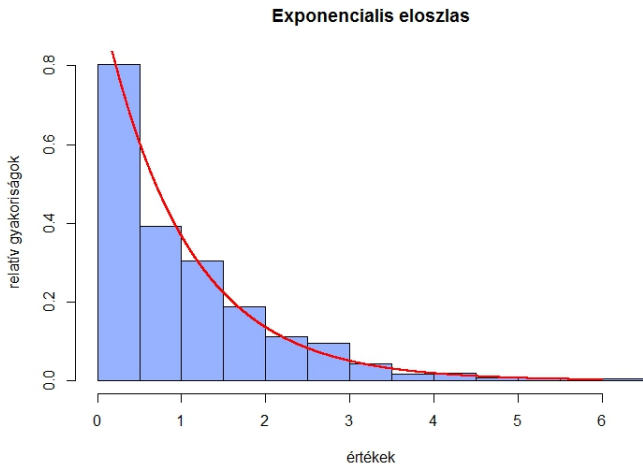
- 100 ember testmagasságának átlaga szintén normális eloszlású, 176 várható értékkel és $7/\sqrt{100} = 0,7$ szórással;
- 10000 ember testmagasságának átlaga normális eloszlású, 176 várható értékkel és $7/\sqrt{10000} = 0,07$ szórással.

Exponenciális eloszlás

Az **exponenciális eloszlás** sokszor használható véletlen időtartamok modellezésére, például

- egy művelet elvégzésének ideje: egy ember kiszolgálása egy boltban, vagy egy számítás elvégzése egy számítógépen
- egy ember reakcióideje
- két esemény bekövetkezése között eltelt idő, például egy üzletben két ügyfél érkezése közötti idő
- járványterjedés modellezésénél: a fertőzés átadásának vagy a gyógyulásnak az ideje
- radioaktív részecske bomlási ideje

Exponenciális eloszlás



$\lambda = 1$ paraméterű exponenciális eloszlás sűrűségfüggvénye és 500 darab független, 1 paraméterű exponenciális eloszlású valószínűségi változóból álló minta hisztogramja

Exponenciális eloszlás: definíció és tulajdonságok

Legyen $\lambda > 0$ valós szám. Az X valószínűségi változó **exponenciális eloszlású** λ paraméterrel, ha sűrűségfüggvénye

$$f(x) = \begin{cases} \lambda e^{-\lambda x}, & \text{ha } x > 0; \\ 0, & \text{különben.} \end{cases}$$

Ekkor

❶ X eloszlásfüggvénye:

$$F(t) = \mathbb{P}(X \leq t) = \int_{-\infty}^t f(x) dx = \begin{cases} 1 - e^{-\lambda t}, & \text{ha } t > 0; \\ 0 & \text{különben.} \end{cases}$$

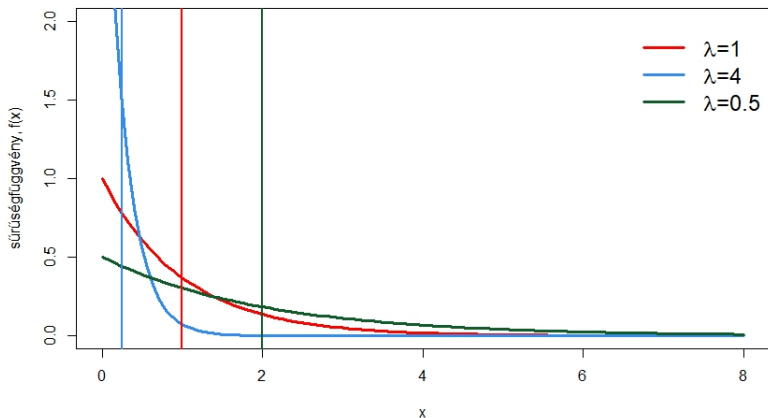
❷ X várható értéke: $\mathbb{E}(X) = \frac{1}{\lambda}$, szórása: $D(X) = \frac{1}{\lambda^2}$.

❸ **Örökifjú tulajdonság.** Legyenek s, t pozitív számok. Ekkor

$$\mathbb{P}(X \geq s + t | X \geq s) = \mathbb{P}(X \geq t).$$

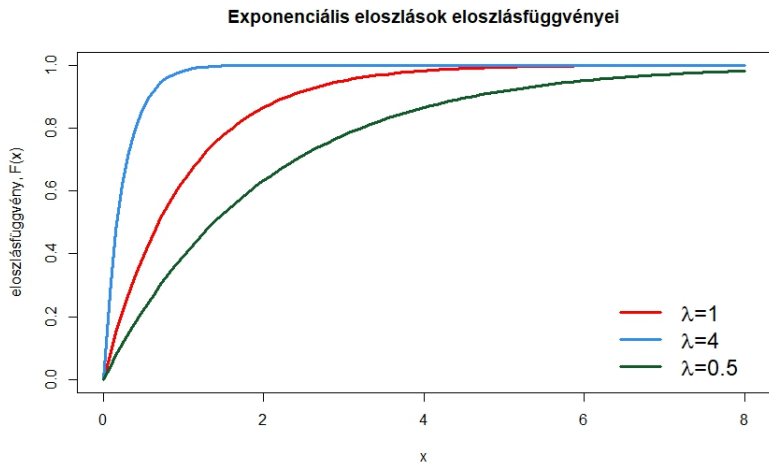
Exponenciális eloszlás

Exponenciális eloszlások sűrűségfüggvényei



Különböző paraméterű ($\lambda = \frac{1}{2}, 1$, illetve 4) exponenciális eloszlások sűrűségfüggvényei és a várható értékeik: $\mathbb{E}(X) = \frac{1}{\lambda} = 2, 1$ illetve $\frac{1}{4}$

Exponenciális eloszlás



Különböző paraméterű ($\lambda = \frac{1}{2}, 1$, illetve 4) exponenciális eloszlások eloszlásfüggvényei

További nevezetes eloszlások

Az alábbi eloszlások többek között **statisztikai alkalmazásokban** fordulnak elő:

- Pareto-eloszlás: végtelen momentumokkal rendelkező eloszlások modellezésére (például jövedelmek, kárnagyságok)
- t -eloszlás: például két eloszlás **várható értékének** összehasonlítására
- F -eloszlás: például két eloszlás **szórásának** összehasonlítására
- χ^2 -eloszlás: például annak eldöntésére, hogy két tulajdonság között van-e **összefüggés**
- gamma-eloszlás: nemnegatív valószínűségi változók modellezésére
- beta-eloszlás: $[0, 1]$ -értékű valószínűségi változók modellezésére

t-eloszlás

Legyenek X_1, X_2, \dots, X_f és Y független standard normális eloszlású valószínűségi változók. Ekkor a

$$Z = \frac{Y}{\sqrt{(X_1^2 + X_2^2 + \dots + X_f^2)/f}}$$

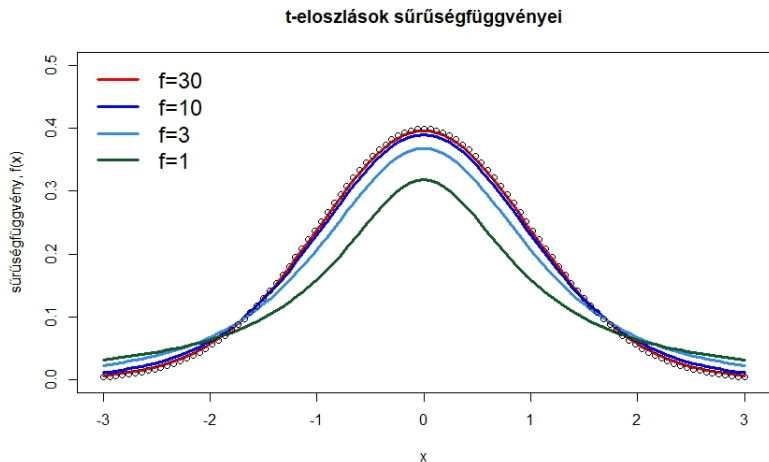
valószínűségi változó eloszlását f szabadsági fokú **t-eloszlásnak** (vagy Student-eloszlásnak) nevezzük.

Az $f = 1$ szabadsági fokú t-eloszlás, vagyis Y/X eloszlása a **Cauchy-eloszlás**. Ennek sűrűségfüggvénye:

$$f(x) = \frac{1}{\pi} \cdot \frac{1}{1 + x^2}.$$

A Cauchy-eloszlásnak sem várható értéke, sem szórása nem létezik: $\int_{-\infty}^{\infty} x \cdot f(x) dx$ nem értelmezhető, mert $\int_0^{\infty} \frac{1}{x} dx$ integrál nem véges.

A t -eloszlás sűrűségfüggvénye



Különböző szabadsági fokú t -eloszlások sűrűségfüggvényei. A pöttyözött vonal a standard normális eloszlás sűrűségfüggvényét jelöli, ez közel van a t -eloszlás sűrűségfüggvényéhez, ha f nagy.

F-eloszlás

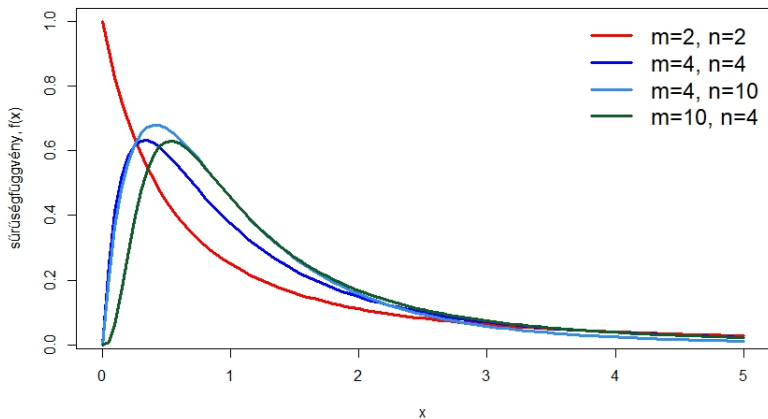
Legyenek m, n pozitív egészek, $X_1, \dots, X_m, Y_1, Y_2, \dots, Y_n$ pedig független standard normális eloszlású valószínűségi változók. Ekkor az

$$F = \frac{n(X_1^2 + X_2^2 + \dots + X_m^2)}{m(Y_1^2 + Y_2^2 + \dots + Y_n^2)}$$

valószínűségi változó eloszlását m, n szabadsági fokú **F-eloszlásnak** nevezzük.

Az F -eloszlás sűrűségfüggvénye

F-eloszlások sűrűségfüggvényei



Különböző szabadsági fokú F -eloszlások sűrűségfüggvényei

χ^2 -eloszlás

Legyenek X_1, X_2, \dots, X_q független standard normális eloszlású valószínűségi változók. Az

$$Y = X_1^2 + X_2^2 + \dots + X_q^2$$

valószínűségi változó eloszlását q szabadsági fokú **χ^2 -eloszlásnak** nevezzük. Ennek sűrűségfüggvénye:

$$f(t) = \begin{cases} \frac{t^{q/2-1}}{2^{q/2}\Gamma(q/2)} e^{-t/2}, & t \geq 0; \\ 0, & t < 0. \end{cases}$$

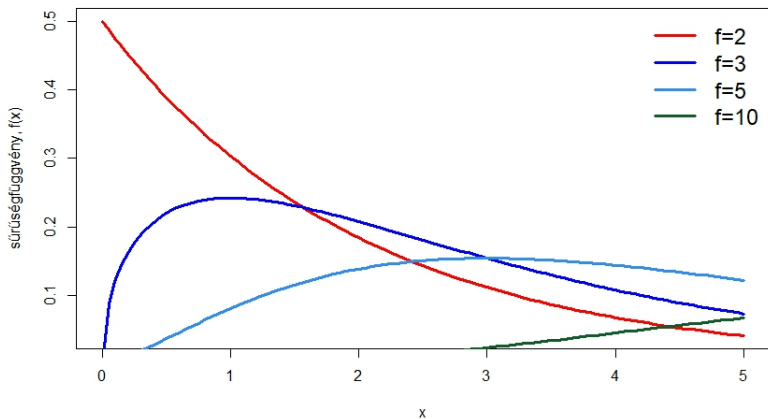
Gamma-függvény. Ha $a > 0$ pozitív szám, legyen

$$\Gamma(a) = \int_0^{\infty} t^{a-1} e^{-t} dt.$$

Parciális integrálással belátható, hogy $\Gamma(a) = (a-1)\Gamma(a-1)$ minden $a > 1$ -re, és így $\Gamma(n) = (n-1)!$, ha n pozitív egész.

A χ^2 -eloszlás sűrűségfüggvénye

χ^2 -eloszlások sűrűségfüggvényei



Különböző szabadsági fokú χ^2 -eloszlások sűrűségfüggvényei

Gamma-eloszlás

Gamma-függvény. Ha $a > 0$ pozitív szám, legyen

$$\Gamma(a) = \int_0^{\infty} t^{a-1} e^{-t} dt.$$

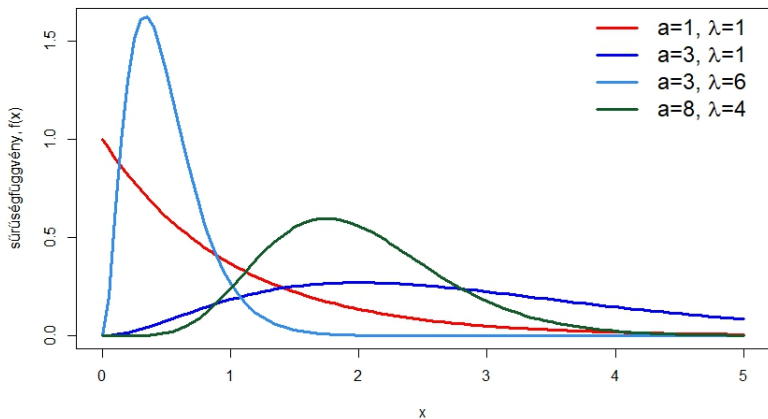
Parciális integrálással belátható, hogy $\Gamma(a) = (a-1)\Gamma(a-1)$ minden $a > 1$ -re, és így $\Gamma(n) = (n-1)!$, ha n pozitív egész.

Legyenek a és λ pozitív számok. Az X valószínűségi változó **gamma-eloszlású** a renddel és λ paraméterrel, ha sűrűségfüggvénye

$$f(x) = \begin{cases} \frac{\lambda^a x^{a-1}}{\Gamma(a)} e^{-\lambda x}, & x \geq 0; \\ 0, & x < 0. \end{cases}$$

A gamma-eloszlás sűrűségfüggvénye

Gamma-eloszlások sűrűségfüggvényei



Különböző szabadsági fokú gamma-eloszlások sűrűségfüggvényei

A gamma-eloszlás tulajdonságai

Az X valószínűségi változó **gamma-eloszlású** a renddel és λ paraméterrel, ha sűrűségfüggvénye

$$f(x) = \begin{cases} \frac{\lambda^a x^{a-1}}{\Gamma(a)} e^{-\lambda x}, & x \geq 0; \\ 0, & x < 0. \end{cases}$$

- **Kapcsolat az exponenciális eloszlással:** ha $a = 1$, akkor a sűrűségfüggvény $\lambda e^{-\lambda x}$, ha $x \geq 0$, és az exponenciális eloszlást kapjuk vissza.
- **Exponenciális eloszlások összege:** ha X_1, X_2, \dots, X_n független λ paraméterű exponenciális eloszlású valószínűségi változók, akkor $X_1 + X_2 + \dots + X_n$ gamma-eloszlású $a = n$ renddel és λ paraméterrel.
- **Kapcsolat a χ^2 -eloszlással:** ha $a = q/2$ és $\lambda = 1/2$, akkor a q szabadsági fokú χ^2 -eloszlást kapjuk vissza.
- **Várható érték** és **szórás:**

$$\mathbb{E}(X) = \frac{a}{\lambda}; \quad D(X) = \frac{\sqrt{a}}{\lambda}.$$

Beta-eloszlás

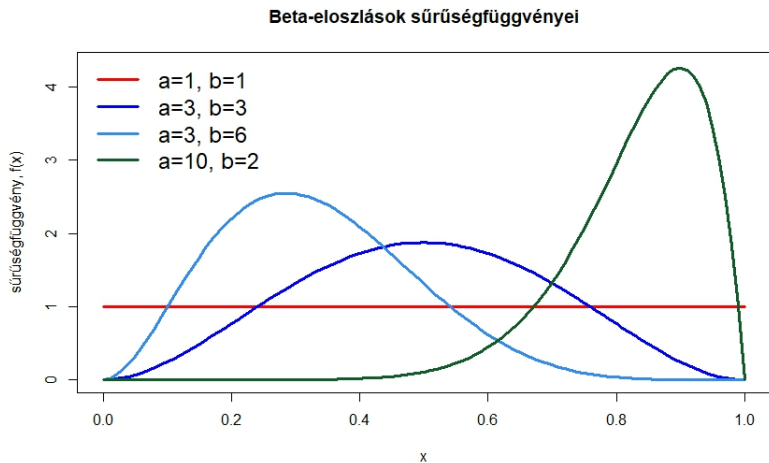
Legyenek $a, b > 1$ számok. Az X valószínűségi változó **beta-eloszlású** a és b paraméterekkel, ha sűrűségfüggvénye

$$f(x) = \begin{cases} \frac{\Gamma(a+b)}{\Gamma(a)\Gamma(b)} x^{a-1}(1-x)^{b-1}, & t \in [0, 1]; \\ 0, & x < 0 \text{ vagy } x > 1. \end{cases}$$

Ha X_1, X_2, \dots, X_n független, a $[0, 1]$ intervallumon egyenletes eloszlású valószínűségi változók, és X_k^* jelöli ebben a mintában a k . legnagyobb számot, akkor X_k^* eloszlása beta-eloszlás $a = k$ és $b = n - k + 1$ paraméterekkel.

Az $a = 1$ és $b = 1$ választással az **egyenletes eloszlást** kapjuk vissza.

A beta-eloszlás sűrűségfüggvénye



Különböző szabadsági fokú beta-eloszlások sűrűségfüggvényei

Pareto-eloszlás

Az X valószínűségi változó Pareto-eloszlású, ha sűrűségfüggvénye

$$f(x) = \begin{cases} \frac{\beta}{\alpha^{\beta+1}} \cdot x^{-\beta}; & \text{ha } x \leq \alpha \\ 0, & \text{ha } x > \alpha. \end{cases}$$

Itt $\alpha > 0, \beta > 1$ rögzített számok. Ekkor X eloszlásfüggvénye:

$$F(t) = \mathbb{P}(X \leq t) = \begin{cases} 1 - \left(\frac{t}{\alpha}\right)^{-\beta+1}; & \text{ha } t \leq \alpha \\ 0, & \text{ha } t > \alpha. \end{cases}$$

Pareto-eloszlás

Az X valószínűségi változó Pareto-eloszlású, ha sűrűségfüggvénye

$$f(x) = \begin{cases} \frac{\beta}{\alpha^{\beta+1}} \cdot x^{-\beta}; & \text{ha } x \leq \alpha \\ 0, & \text{ha } x > \alpha. \end{cases}$$

Itt $\alpha > 0, \beta > 1$ rögzített számok. Ekkor X eloszlásfüggvénye:

$$F(t) = \mathbb{P}(X \leq t) = \begin{cases} 1 - \left(\frac{t}{\alpha}\right)^{-\beta+1}; & \text{ha } t \leq \alpha \\ 0, & \text{ha } t > \alpha. \end{cases}$$

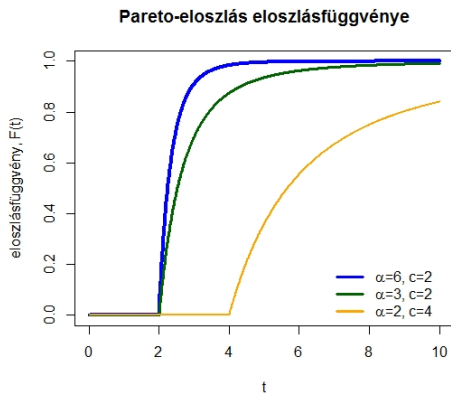
Az X valószínűségi változó k . momentuma:

$$\mathbb{E}(X^k) = \int_{-\infty}^{\infty} x^k \cdot f(x) dx = \frac{\beta}{\alpha^{\beta+1}} \int_0^{\infty} x^{k-\beta} dx < \infty \Leftrightarrow k - \beta < -1.$$

Tehát a Pareto-eloszlásnak csak $\beta - 1$ -nél kisebb k -ra véges a k . momentuma.

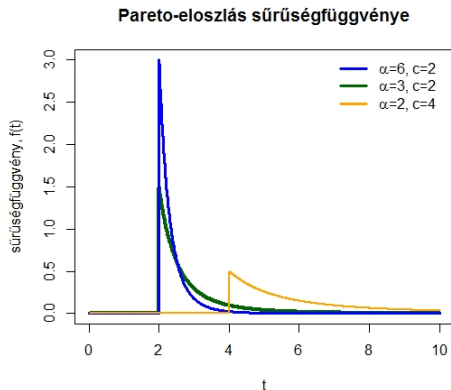
Például ha $\beta = 2,5$, akkor a várható érték létezik és véges, de szórása nem létezik.

Pareto-eloszlás



Különböző paraméterű Pareto-eloszlások eloszlásfüggvénye

Pareto-eloszlás



Különböző paraméterű Pareto-eloszlások sűrűségfüggvénye

Az $\alpha = 1, \beta = 2,5$ paraméterű Pareto-eloszlás sűrűségfüggvénye: $f(x) = 2,5 \cdot x^{-2,5}$, ha $x \geq 1$, és 0 különben. A **várható értéke véges**, a **szórása végtelen**.