

Valószínűségszámítás

2021. szeptember 29.
Mészáros Szabolcs

Tárgyhonlap:
cs.bme.hu/valszam

A prezentáció anyagát és az abból készült videofelvételt a tárgy hallgatói jogosultak használni, kizárólag saját célra. A felvétel másolása, videómegosztókra való feltöltése részben vagy egészben tilos, illetve csak a tantárgyfelelős előzetes engedélyével történhet.

Copyright © 2021, BME VIK

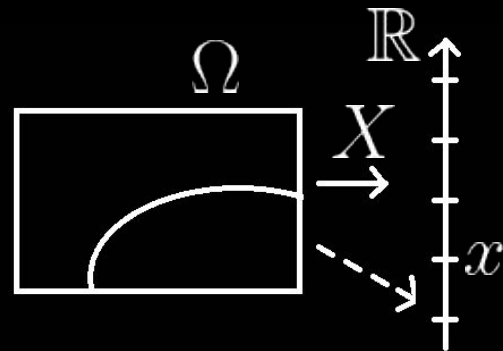
Véletlen mennyiség, példák

Valószínűségi mező	Véletlen mennyiség
két kockadobás	<ul style="list-style-type: none">• második dobás értéke• két dobás értékének összege• dobott egyesek száma
pakli kártya véletlen fele	<ul style="list-style-type: none">• kapott királyok száma• egyszínű lapok maximális száma
múlt heti mail-ek, és feladók	<ul style="list-style-type: none">• összes bejövő• spam mailek száma - Neptuntól jövő mailek száma

Valószínűségi változó

Definíció: Egy $X : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ függvényt valószínűségi változónak hívunk, ha minden $x \in \mathbb{R}$ esetén a következő halmaz esemény:

$$\{X < x\} \stackrel{\text{def}}{=} \{\omega \in \Omega \mid X(\omega) < x\}$$



Q1: *Hogyan kell érteni ezt a feltételt? Miért van rá szükség?*

Q2: *És miért nem “kisebb-egyenlő”, vagy “nagyobb” van a definícióban?*

Val. változó, Q&A

Q1: Hogyan kell érteni ezt a feltételt?

Miért van rá szükség?

A1: Esemény \Leftrightarrow aminek értelmes a valószínűsége. Azaz,

a $\mathbb{P}(\{X < x\})$ valószínűség értelmes szám.

Q2: És miért nem “kisebb-egyenlő”, vagy “nagyobb” van a definícióban?

A2: Ekvivalens definíciót eredményez. $\overline{\{X < x\}} = \{X \geq x\}$

$$\bigcap_{n=1}^{\infty} \left\{ X < x + \frac{1}{n} \right\} = \{X \leq x\}$$

Val. változó, példák

1. Egy (szabályos) dobókockával dobunk.
Jelölje X a dobott szám 4-es maradékát.

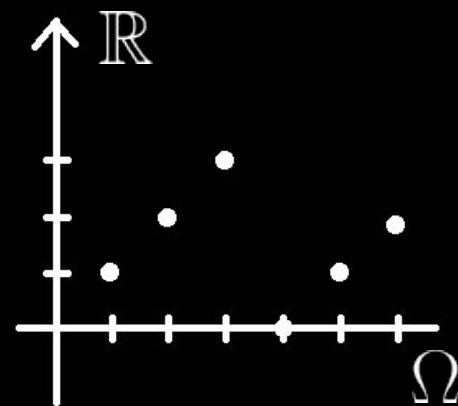
A valószínűségi mező a szokásos:

$$\Omega = \{1, 2, 3, 4, 5, 6\} \quad \mathcal{F} = \{\text{összes részhalmaz}\}$$

$$\mathbb{P}(A) = \text{kedvező}/\text{összes}$$

A valószínűségi változó pedig a következő függvény:

ω	1	2	3	4	5	6
$X(\omega)$	1	2	3	0	1	2



Val. változó, példák

2. példa: két pénzérmével dobunk.

X : 1, ha egyformát dobunk, 0 egyébként.

Elnevezés: indikátor valószínűségi változó.

Jel: $\mathbf{1}_A$ ahol $A = \{\text{egyformát dobunk}\}$

3. példa: megpróbálunk beledobni egy papírgalacsint a szemeteskosárba.

X : a papír távolsága a cél középpontjától

$$\{\text{siker}\} = \{X < 0,2\}$$

Val. változó, műveletek

Mit tudunk tenni a valószínűségi változókkal?

Legyen X és Y valószínűségi változó. Ekkor a következők is val. változók:

$$3,6 \cdot X \quad c \cdot X \quad (c \in \mathbb{R}) \quad X + 42$$

$$X + Y \quad X - Y \quad \frac{X}{Y}, \text{ ha } Y \text{ sehol sem nulla}$$
$$X^2 \quad X \cdot Y$$

Vagyis beszélhetünk a következő eseményekről:

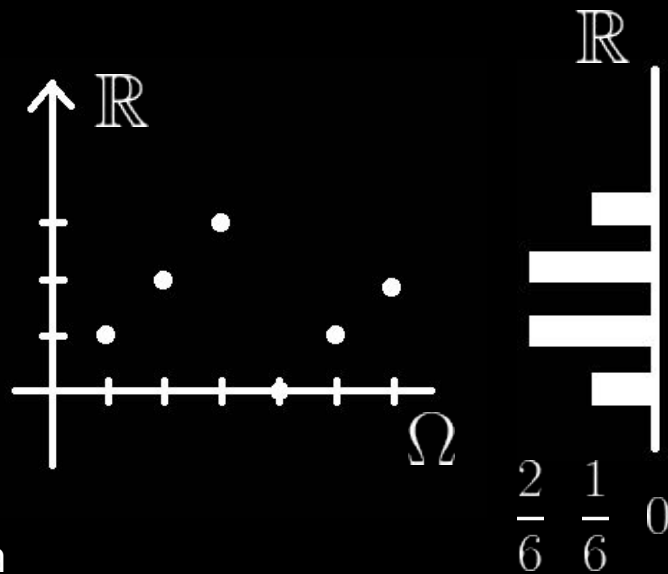
$$\{X + 42 < 0\} \quad \{X - Y \geq 10\} \quad \text{etc.}$$

Egyszerű val. változó, eloszlás

Definíció: Egy valószínűségi változó *egyszerű*, ha értékkészlete véges.

Definíció: Egy egyszerű val. változó *eloszlása*:

$$\left\{ \mathbb{P}(X = x) \mid x \in \text{Ran}(X) \right\}$$



Példa: X két kockával a dobott egyesek száma

$$\mathbb{P}(X = 0) = \frac{25}{36} \quad \mathbb{P}(X = 1) = \frac{10}{36} \quad \mathbb{P}(X = 2) = \frac{1}{36}$$

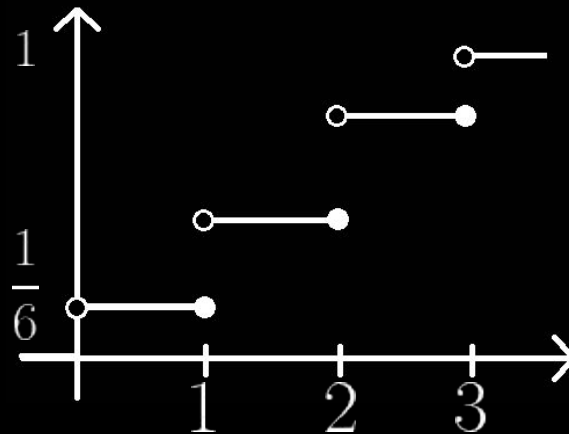
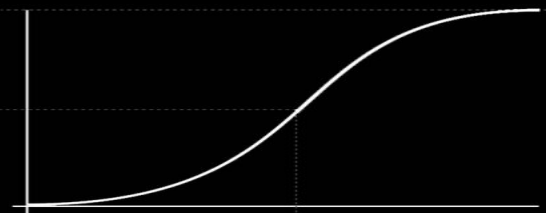
Eloszlásfüggvény

Definíció: Az X val. változó *eloszlásfüggvénye*:

$$F_X : \mathbb{R} \rightarrow [0, 1] \quad F_X(x) = \mathbb{P}(X < x)$$

Példa: kockadobás négyes maradék, lásd ábra.

(Eloszlásfüggvénye nem csak egyszerű valószínűségi változónak van.)



Várható érték, def.

Definíció: Legyen X egyszerű val. változó. Ekkor

$$\mathbb{E}(X) = \sum_{k \in \text{Ran}(X)} k \cdot \mathbb{P}(X = k)$$

Értelmezések:

- a véletlen mennyiség átlagos értéke (!= tipikus érték)
- értékek súlyozott közepe, ahol a súlyok a valószínűségek

Példa: kockadobás 4-es maradéka

$$\mathbb{E}(X) = 0 \cdot \frac{1}{6} + 1 \cdot \frac{2}{6} + 2 \cdot \frac{2}{6} + 3 \cdot \frac{1}{6} = \frac{3}{2}$$

Várható érték, példák

$$\mathbb{E}(X) = \sum_{k \in \text{Ran}(X)} k \cdot \mathbb{P}(X = k)$$

1. Kockadobás

$$\mathbb{E}(X) = 1 \cdot \frac{1}{6} + 2 \cdot \frac{1}{6} + 3 \cdot \frac{1}{6} + 4 \cdot \frac{1}{6} + 5 \cdot \frac{1}{6} + 6 \cdot \frac{1}{6} = 3,5$$

2. Az előző val. változó négyzete

$$\mathbb{E}(X^2) = (1^2 + 2^2 + 3^2 + 4^2 + 5^2 + 6^2) \frac{1}{6} = \frac{91}{6}$$

Várható érték, példák

$$\mathbb{E}(X) = \sum_{k \in \text{Ran}(X)} k \cdot \mathbb{P}(X = k)$$

3. Egy urnában 2 piros, 3 fehér golyó van. Visszatevés nélkül húzunk, amíg fehéret nem kapunk. Jelölje Z a kihúzott piros golyók számát.

$$\mathbb{E}(Z) = 0 \cdot \frac{2}{5} + 1 \cdot \frac{3}{5} \cdot \frac{2}{4} + 2 \cdot \frac{3}{5} \cdot \frac{2}{4} \cdot \frac{2}{3} + 3 \cdot \frac{3}{5} \cdot \frac{2}{4} \cdot \frac{1}{3} \cdot \frac{2}{2} = 1$$

4. Indikátor val. változó:

$$\mathbb{E}(\mathbf{1}_A) = 0 \cdot \mathbb{P}(\mathbf{1}_A = 0) + 1 \cdot \mathbb{P}(\mathbf{1}_A = 1) = \mathbb{P}(A)$$

Várható érték additivitása

Legyen X és Y egyszerű valószínűségi változó.

Állítás: Tetszőleges $c \in \mathbb{R}$ esetén $\mathbb{E}(c \cdot X) = c \cdot \mathbb{E}(X)$

Állítás: $\mathbb{E}(X + Y) = \mathbb{E}(X) + \mathbb{E}(Y)$

Ez nem nyilvánvaló, pl. két kockadobás összegének eloszlására:



Megjegyzés: Az additivitás nem csak egyszerű val. változóra lesz igaz.

Poincaré-formula, biz.

Állítás: $\mathbb{P}(A_1 \cup A_2 \cup A_3) =$

$$\sum_{i=1}^3 \mathbb{P}(A_i) - \sum_{1 \leq i < j \leq 3} \mathbb{P}(A_i \cap A_j) + \mathbb{P}(A_1 \cap A_2 \cap A_3)$$

Bizonyítás:

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(A_1 \cup A_2 \cup A_3) &= 1 - \mathbb{P}\left(\bigcap_i \overline{A_i}\right) = 1 - \mathbb{E}\left(1_{\bigcap_i \overline{A_i}}\right) \\ &= 1 - \mathbb{E}\left(\prod_i 1_{\overline{A_i}}\right) = 1 - \mathbb{E}\left(\prod_i (1 - 1_{A_i})\right) \end{aligned}$$

Poincaré-formula, biz.

$$= 1 - \mathbb{E}\left(\prod_i (1 - \mathbf{1}_{A_i})\right)$$

$$= 1 - \mathbb{E}\left(1 - \mathbf{1}_{A_1} - \mathbf{1}_{A_2} - \mathbf{1}_{A_3} + \mathbf{1}_{A_1}\mathbf{1}_{A_2} + \mathbf{1}_{A_1}\mathbf{1}_{A_3} + \mathbf{1}_{A_2}\mathbf{1}_{A_3} - \mathbf{1}_{A_1}\mathbf{1}_{A_2}\mathbf{1}_{A_3}\right)$$

\Rightarrow állítás

Binomiális eloszlás, def.

Definíció: Egy X valószínűségi változó *binomiális eloszlású* az $n \in \mathbb{N}$ és $p \in [0, 1]$ paraméterekkel, ha

$$\mathbb{P}(X = k) = \binom{n}{k} p^k (1 - p)^{n-k} \quad (\forall k : 0 \leq k \leq n)$$

Jelölés: $X \sim B(n, p)$

Példa: n kosárra dobásból hány megy be?

Általánosan, azonos kísérletekből hány “siker”?

Binomiális eloszlás, v. é.

Állítás: $X \sim B(n, p) \Rightarrow \mathbb{E}(X) = n \cdot p$

Bizonyítás:

Legyenek A_1, \dots, A_n együttesen független események, amik valószínűsége mind p . Nézzük a következő val. változót:

$$Y = \mathbf{1}_{A_1} + \dots + \mathbf{1}_{A_n}$$

Az additivitás miatt:

$$\begin{aligned} \mathbb{E}(Y) &= \mathbb{E}(\mathbf{1}_{A_1} + \dots + \mathbf{1}_{A_n}) \\ &= \mathbb{E}(\mathbf{1}_{A_1}) + \dots + \mathbb{E}(\mathbf{1}_{A_n}) = n \cdot p \end{aligned}$$

A várható érték csak az eloszlástól függ, viszont X és Y eloszlása ugyanaz.

Diszkrét egyenletes eloszlás

Definíció: Egy X valószínűségi változó *diszkrét egyenletes eloszlású* az n elemű S halmazon, ha

$$\mathbb{P}(X = k) = \frac{1}{n} \quad (\forall k \in S)$$

Megjegyzés: Ha $S = \{1, 2, \dots, n\}$

akkor

$$\mathbb{E}(X) = \frac{1 + 2 + \dots + n}{n} = \frac{n + 1}{2}$$

Geometriai eloszlás

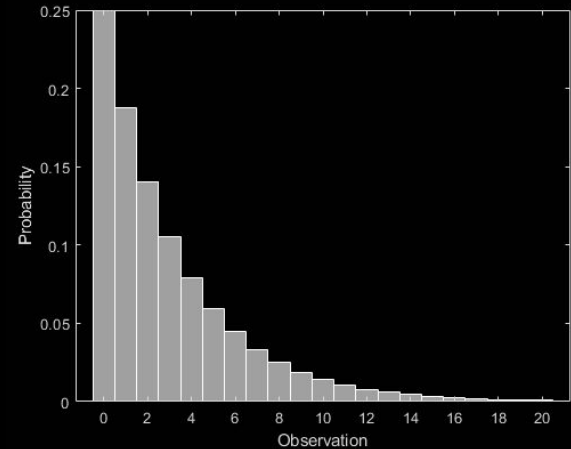
Példák:

- Célnát próbálunk befűzni, hányadszorra sikerül.
- Addig jár a korsó a kútra...
- Független kísérletek, első siker sorszáma.

Definíció: Az X val. változó *geometriai eloszlású* p paraméterrel (ahol $0 < p < 1$), ha

$$\mathbb{P}(X = k) = (1 - p)^{k-1} p \quad (\forall k = 1, 2, \dots)$$

Jelölés: $X \sim \text{Geo}(p)$



Randomized quicksort

Input: n elemű tömb, elemei összehasonlíthatók (pl. számok)

Output: ugyanez sorba rendezve

Algoritmus:

0. Ha $n \leq 1$ akkor csak visszaadjuk.
1. Egyébként veszünk egy P pivot elemet, és ketté osztjuk a tömböt:
 - P -nél kisebbekre, és
 - P -nél nagyobbakra.
2. Hívjuk meg az eredeti függvényt erre a két kisebb tömbre.
3. Konkatenáljuk az eredményeket az alábbi sorrendben:
rendezett(P -nél kisebbek), $[P]$, rendezett(P -nél nagyobbak)

Kérdés: Hogyan válasszuk P -t?

Randomized quicksort, áll.

Megjegyzés: Ha mindig a legnagyobbat választjuk, akkor $\binom{n}{2} \approx n^2$
összehasonlítást kell tegyünk.

Válasszuk a P-t egyenletesen véletlenszerűen. Jelölje X_n egy n elemű tömb sorba rendezése közben az elvégzett összehasonlítások számát.

Állítás: $\mathbb{E}(X_n) \leq 2n \ln(n)$

Randomized quicksort, biz.

Bizonyítás: Legyen $X_{i,j}$ az a val. változó, ami 1, ha az i -edik és j -edik elemet valamikor össze kellett hasonlítanunk, és 0 egyébként. Ekkor

$$X_n = \sum_{1 \leq i < j \leq n} X_{i,j}$$

(Ezek nem függetlenek.)

Az additivitás miatt

$$\mathbb{E}(X_n) = \sum_{1 \leq i < j \leq n} \mathbb{E}(X_{i,j})$$

Randomized quicksort, biz.

Meggondolható: $\mathbb{E}(X_{i,j}) = \frac{2}{j-i+1}$

És tényleg: Legyenek a tömb elemei y_1, \dots, y_n

Nézzük csak az y_i, y_{i+1}, \dots, y_j elemeket. (Ez $j-i+1$ db elem.)

Melyiket választjuk ki legelőször pivot elemnek?

- Ha az y_i vagy az y_j elemet, akkor $X_{i,j} = 1$
- Ha bármi más, akkor ők sose lesznek összehasonlítva, ezért $X_{i,j} = 0$

Az eloszlás egyenletes, ezért $\mathbb{E}(X_{i,j}) = \mathbb{P}(X_{i,j} = 1) = \frac{2}{j-i+1}$

Randomized quicksort, biz.

$$\begin{aligned}\mathbb{E}(X_n) &= \sum_{1 \leq i < j \leq n} \mathbb{E}(X_{i,j}) = \sum_{1 \leq i < j \leq n} \frac{2}{j-i+1} \\ &= \sum_{k=2}^n (n-k+1) \frac{2}{k} = -2(n-1) + 2(n+1) \sum_{k=2}^n \frac{1}{k} \\ &\Rightarrow \begin{array}{c} \text{calc } \dots \\ \text{calc } \dots \\ \text{calc } \dots \end{array} \leq 2n \ln(n)\end{aligned}$$

Várható érték, végtelen eset

Kérdés: mi van ha $\text{Ran}(X)$ nem véges? Akkor is van várható érték?

Ilyenkor az eredeti képlet nem feltétlenül működik. Mi legyen a def?

Definíció: Ha X nemnegatív valószínűségi változó, akkor

$$\mathbb{E}(X) \stackrel{\text{def}}{=} \sup_{\substack{Z \text{ egyszerű,} \\ Z \leq X}} \mathbb{E}(Z)$$

Ez általánosítja a korábbi definíciót.

Várható érték, diszkrét eset

Állítás: Legyen X olyan nemnegatív val. változó, amire $\text{Ran}(X)$ megszámlálhatóan végtelen. Jelölje az elemeit k_1, k_2, \dots . Ekkor

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

Példa: Egy tű fokán próbálunk áthúzni egy szál cérnát. Minden alkalommal p eséllyel sikerül. Legyen X a szükséges próbálkozások száma. Ekkor

$$\mathbb{E}(X) = \sum_{k=1}^{\infty} k \cdot \mathbb{P}(X = k) = \text{(folyt. köv.)}$$

Köszönöm a figyelmet!
