

מבני תורת ההסתברות

Table with 2 columns: Binomial distribution (n trials, p success) and Hypergeometric distribution (N population, D successes, n trials). Includes formulas for probability mass functions and expected values.

אי תלות

מאורעות A, B בתל"א אמ"מ: P(A ∩ B) = P(A) · P(B). מאורעות A1, A2, ..., An בתל"א אמ"מ כל מל זוג, שלשה, n-יה מקיימים: P(Ai ∩ Aj) = P(Ai) · P(Aj)...

שוונות (מדד פיזור)

הגדרת שונות של מ"מ X: Var(X) = E[(X - E(X))^2]. הנוסחה השימושית לחישוב שונות: Var(X) = E(X^2) - E(X)^2. סטיית תקן של מ"מ X: SD(X) = sqrt(Var(X)).

תכונות של שונות

- 1. לכל X > 0: Var(X) > 0.
2. Var(aX + b) = a^2 Var(X).
3. Cov(X, Y) = 0 אם ורק אם X ו-Y קבועים.
4. SD(aX + b) = |a| SD(X).
5. Var(X, Y) = Cov(X, Y) + Cov(Y, X).
6. עבור X1, ..., Xn בתל"א: Var(aX1 + ... + aXn) = a^2 Var(X1) + ... + a^2 Var(Xn).

התפלגות נורמלית

התפלגות נורמלית: X ~ N(mu, sigma^2). פונקציית צפיפות: f\_X(x) = 1/(sigma\*sqrt(2\*pi)) \* exp(-(x-mu)^2/(2\*sigma^2)).

ברמול משתנה נורמלית

אילווצים: f\_X(x) > 0. הערות: א. f\_X לא נותנת הסתברות - לכן יתכן כי f\_X(x) > 1. ב. אין משמעות לחזקת אי השוויון כי ההסתברות בכל נקודה ספציפית היא 0. פונקציית התפלגות מצטברת: F(x) = P(X <= x) = integral from -infinity to x of f\_X(t) dt.

משפט הגבול המרכזי: יהיו X1, X2, ..., Xn משתנים מקריים בתל"א ש"ה עם תוחלת mu ושונות sigma^2 נגדיר X\_bar = (X1 + ... + Xn) / n. נגדיר Sn = sum of Xi. נגדיר Sn ~ N(n\*mu, n\*sigma^2) אזי בקירוב.

הסתברות כללית מאורעות בדידים

כלל ההכלה והפרדה: P(A union B) = P(A) + P(B) - P(A intersection B). הסתברות מותנית: P(A|B) = P(A intersection B) / P(B). כלל הכפל: P(A intersection B) = P(A|B) \* P(B).

כלל ההסתברות השלמה

כלל ההסתברות השלמה: B1, B2, B3, ... Bn חלוקה של המרחב Omega. כלומר זרים וסכומם הוא Omega. אזי: P(A) = sum of P(A|Bi) \* P(Bi). כלל Bayes: באותם נתאים של ההסתברות השלמה, בתוספת המגבלה: P(A) > 0, P(A|Bi) > 0, P(Bi) > 0.

שוונות משותפת

שוונות משותפת מצביעה על תיאום בין מ"מ. Cov(X, Y) > 0: בהינתן ערך X הגבוה E(X) נצפה שגם E(Y) יהיה גבוה. Cov(X, Y) < 0: בהינתן ערך X הנמוך E(X) נצפה שגם E(Y) יהיה גבוה. Cov(X, Y) = 0: X, Y בלתי מתואמים. תכונות של השונות המשותפת: Cov(X, Y) = Var(X) \* rho(X, Y). Cov(aX + b, cY + d) = ac Cov(X, Y). Cov(X, Y + Z) = Cov(X, Y) + Cov(X, Z). Cov(X, const) = 0.

תכונות של מקדם מתאם

- 1. -1 <= Corr(X, Y) <= 1.
2. Corr(X, Y) = 0 <=> Cov(X, Y) = 0.
3. Corr(aX + b, cY + d) = (sign(ac)) \* Corr(X, Y).
4. Corr(X, X) = 1.
5. Corr(X, Y) = 1 <=> Y = aX + b, a > 0.
6. Corr(X, Y) = -1 <=> Y = aX + b, a < 0.

מ"מ רציפים

הגדרות הסתברויות: P(X in [a, a + dx]) = f\_X(x) \* dx.

מ"מ רציפים

אילווצים: f\_X(x) > 0. הערות: א. f\_X לא נותנת הסתברות - לכן יתכן כי f\_X(x) > 1. ב. אין משמעות לחזקת אי השוויון כי ההסתברות בכל נקודה ספציפית היא 0. פונקציית התפלגות מצטברת: F(x) = P(X <= x) = integral from -infinity to x of f\_X(t) dt. עבור מ"מ רציף: F(x) = integral from -infinity to x of f\_X(t) dt, f\_X(x) = dF\_X(x)/dx. P(a <= X <= b) = F(b) - F(a).

קירוב פואסוני לתפלגות בינומית

אם X ~ Bin(n, p) ו np < 5 אזי בקירוב X ~ Pois(np). אם X ~ Bin(n, p) ו np > 5 ו nq > 5 אזי בקירוב X ~ N(np, npq).

התפלגות משותפת של מ"מים בדידים

התפלגות משותפת של מ"מים בדידים: P(X = x, Y = y) = P(X = x) \* P(Y = y) (תפלגות שולית). P\_X(x) = sum of P\_XY(x, y). P\_Y(y) = sum of P\_XY(x, y). תכונות מותנית משותפת: P\_XY(x, y | X = x) = P\_Y(y). נוסחת ההסתברות השלמה: P\_X(x) = sum of P(X = x | Y = y) \* P(Y = y). אמינות מערכת: a - ההסתברות שהמערכת תעבוד - P\_i ההסתברות שרכיב i יעבוד. טוריות: a = (P1 \* P2 \* ... \* Pn). מקבילית: a = 1 - ((1 - P1) \* (1 - P2) \* ... \* (1 - Pn)).

תוחלת מ"מ בדידי

תוחלת מ"מ בדידי: E(X) = sum of x \* P(X = x). נוסחת תוחלת שלמה: E(X) = sum of g(x) \* P(X = x). תוחלת מ"מ בדידי: E(XY) = E(X) \* E(Y) (אם X ו-Y בלתי תלויים). נוסחת התחלקות: E(Y|X) = g(X) או E(Y) = E(E(Y|X)). נוסחאות נוספות: E(X + Y) = E(X) + E(Y). E(X \* Y) = E(X) \* E(Y) (אם X ו-Y בלתי תלויים). תוחלת מותנית: E(X|A) = sum of x \* P(X = x | A).

תוחלת משותפת

תוחלת משותפת: E(XY) = sum of xy \* P\_XY(x, y). תוחלת מותנית: E(X|A) = sum of x \* P(X = x | A).

תוחלת של מ"מ רציף

תוחלת של מ"מ רציף: E(X) = integral from -infinity to infinity of x \* f\_X(x) dx. נוסחת הזנב: E(g(X)) = integral of g(x) \* f\_X(x) dx. תוחלת קיימת רק כאשר: integral of |x \* f\_X(x)| dx < infinity. כל תכונות התוחלת של מ"מ בדידי מתקיימות למ"מ רציף. שונות: Var(X) = E(X^2) - E(X)^2. תוחלת מותנית במקרה הרציף: E(X|Y = y) = integral of x \* f\_XY(x|y) dx. הערה: E(X|Y = y) = g(y) <=> E(X|Y) = g(Y). משפט ההחלקה: E(X) = E(E(X|Y)) = integral of E(X|Y = y) \* f\_Y(y) dy.

תוחלת מותנית במקרה הרציף

תוחלת מותנית במקרה הרציף: E(X|Y = y) = integral of x \* f\_XY(x|y) dx. הערה: E(X|Y = y) = g(y) <=> E(X|Y) = g(Y). משפט ההחלקה: E(X) = E(E(X|Y)) = integral of E(X|Y = y) \* f\_Y(y) dy.

התפלגות היפר-גאומטרית

התפלגות היפר-גאומטרית: X ~ HG(N, D, n). תוחלת מ"מ בדידי: E(X) = sum of x \* P(X = x). נוסחת הזנב: עבור מ"מ המקבל ערכים שלמים אי שליליים: E(X) = sum of P(X >= x). תכונות של תוחלות: E(X1 + X2 + ... + Xn) = sum of E(Xi). כלל הכפל: עבור X, Y בתל"א: E(XY) = E(X) \* E(Y). אם מ"מ מקבל ערכים בין b ל-a אזי a <= E(X) <= b. ליניאריות: E(aX + b) = aE(X) + b. תוחלת של פונקציה של מ"מ: E(g(X)) = sum of g(x) \* P(X = x).

תחרות בין מ"מים פואסונים

תחרות בין מ"מים פואסונים: Y ~ Pois(lambda\_y), X ~ Pois(lambda\_x). אזי: P(Y < X) = lambda\_y / (lambda\_x + lambda\_y).

משפט Wald

משפט Wald: יהי Xi סדרת מ"מ בתל"א עם E(Xi) = mu. יהי N מ"מ המקבל ערכים טבעיים. אזי: E(SN) = mu \* E(N).

מומנטים ופונקציית צורת מומנטים

מומנטים ופונקציית צורת מומנטים: M\_X(t) = E(e^{tX}). עבור מ"מ רציף: M\_X(t) = E(e^{tX}) = integral of e^{tx} \* f\_X(x) dx. פ"מ של סכום מ"מ בתל"א: M\_{X+Y}(t) = M\_X(t) \* M\_Y(t). נוסחה נוספת: יהי X מ"מ b-1 קבועים, אזי M\_{aX+b}(t) = e^{bt} \* M\_X(at).

תוחלת מותנית

תוחלת מותנית: E(X|A) = sum of x \* P(X = x | A). תוחלת מותנית במקרה הרציף: E(X|Y = y) = integral of x \* f\_XY(x|y) dx. הערה: E(X|Y = y) = g(y) <=> E(X|Y) = g(Y). משפט ההחלקה: E(X) = E(E(X|Y)) = integral of E(X|Y = y) \* f\_Y(y) dy.

התפלגות אחידה

התפלגות אחידה: f\_X(x) = 1/(b-a) for x in [a, b]. E(X) = (a+b)/2. Var(X) = (b-a)^2/12. תכונות חוסר הזיכרון: P(X > t + s | X > t) = P(X > s) = e^{-lambda \* s}.

התפלגות מעריכית

התפלגות מעריכית: f\_X(x) = lambda \* e^{-lambda \* x} for x >= 0. E(X) = 1/lambda. Var(X) = 1/lambda^2. תכונות חוסר הזיכרון: P(X > t + s | X > t) = P(X > s) = e^{-lambda \* s}.

תוחלת מותנית במקרה הרציף

תוחלת מותנית במקרה הרציף: E(X|Y = y) = integral of x \* f\_XY(x|y) dx. הערה: E(X|Y = y) = g(y) <=> E(X|Y) = g(Y). משפט ההחלקה: E(X) = E(E(X|Y)) = integral of E(X|Y = y) \* f\_Y(y) dy.

**התפלגות משותפת רציפה של זוג מ"מים:**

הגדרה:  $P((X, Y) \in B) = \int_B f_{X,Y}(t, s) dt ds$   
 ומתקיים:  $P(x \leq X \leq x + dx, y \leq Y \leq y + dy) = f_{X,Y}(x, y) dx dy$   
 התפלגות מצטברת משותפת:  
 $F_{X,Y}(x, y) = P(X \leq x, Y \leq y) = \int_{-\infty}^y \int_{-\infty}^x f_{X,Y}(u, v) du dv$   
 ומתקיים:  $f_{X,Y}(x, y) = \frac{\partial^2}{\partial x \partial y} [F_{X,Y}(x, y)]$   
 פונקציות צפיפות שוליות:  
 $f_X(x) = \int_{-\infty}^{\infty} f_{X,Y}(x, y) dy$   
 $f_Y(y) = \int_{-\infty}^{\infty} f_{X,Y}(x, y) dx$

**קונבולוציה**

יהי  $X, Y$  מ"מ ויהי  $Z = X + Y$

עבור מ"מ רציפים:  
 אם  $X, Y$  ב"ת אזי

$$f_Z(z) = \int_{-\infty}^{\infty} f_X(x) f_Y(z-x) dx$$

$$f_Z(z) = \int_{-\infty}^{\infty} f_{X,Y}(x, z-x) dx$$

עבור מ"מ בדידים:

אם  $X, Y$  תלויים  
 אם  $X, Y$  ב"ת אזי  $P(Z = z) = \sum_x P_X(x) \cdot P_Y(z-x)$   
 אם  $X, Y$  תלויים אזי  $P(Z = z) = \sum_x P_{X,Y}(x, z-x)$

**טרנספורמציה חח"ע של מ"מ רציף:** תהיה  $g: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$  פונקציה גזירה ועולה

(יורדת) ב  $[a, b]$ . אזי למ"מ  $Y$  המוגדר  $Y = g(X)$  יש את פונ' הצפיפות:

הערה: ניתן במקום:  $\left| \frac{1}{g'(g^{-1}(y))} \right|$  :  $g(a) \leq y \leq g(b)$   
 לרשום:  $f_Y(y) = \begin{cases} f_X(g^{-1}(y)) \cdot \left| \frac{1}{g'(g^{-1}(y))} \right| & : g(a) \leq y \leq g(b) \\ 0 & : \text{Otherwise} \end{cases}$

**טרנספורמציה לא חח"ע:** יהיה  $X$  מ"מ לא רציף המקבל ערכים בקטע

$[a, b]$ . תהיה  $g: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$  פונקציה גזירה ב  $[a, b]$  (לא בהכרח חח"ע) המקיימת

שכל  $y$  קיים מספר בדיד או בן מניה של  $x$ -ים ב  $[a, b]$  שעבורם  $g(x) = y$ . אזי למ"מ  $Y$  המוגדר להיות  $Y = g(X)$  יש פונ' צפיפות:

$$f_Y(y) = \begin{cases} \sum_{\substack{x: a \leq x \leq b \\ g(x)=y}} f_X(x) \cdot \left| \frac{1}{g'(x)} \right| & : \min_{[a,b]}(g(x)) \leq y \leq \max_{[a,b]}(g(x)) \\ 0 & : \text{otherwise} \end{cases}$$

**התפלגות אחידה דו מימדית:**

$$f_{X,Y}(t, s) = \begin{cases} \frac{1}{\text{Area}(B)} & : (t, s) \in B \\ 0 & : \text{otherwise} \end{cases}$$

עבור  $A \subseteq B$  מתקיים:  $P\{(X, Y) \in A\} = \frac{\text{Area}(A)}{\text{Area}(B)}$   
 הערה: אם  $X \sim U[a, b]$  ו-  $Y \sim U[c, d]$  וגם  $X, Y$  ב"ת אז  $(X, Y)$  מתפלגים במשותף אחיד על המלבן  $a \leq X \leq b, c \leq Y \leq d$

**אי תלות בין שני מ"מ רציפים:**

$X, Y$  ב"ת אם"ל אמ"מ  $f_{X,Y}(x, y) = f_X(x) \cdot f_Y(y)$  לכל  $x, y \in \mathbb{R}$   
 כלל:  $F_{X,Y}(x, y) = F_X(x) \cdot F_Y(y)$   
 אם ניתן להפריד את  $f_{X,Y}(x, y)$  למכפלת 2 פונקציות תלויים אחד בשני אזי  $X$  ו-  $Y$  ב"ת ו-  $g(x)$  ו-  $h(y)$  הן פונ' הצפיפות של  $X, Y$  **עד כדי קבוע.**

**פונקציית צפיפות מותנית:**

$f_{X|Y}(x|y) = \frac{f_{X,Y}(x, y)}{f_Y(y)}$   
 כלל הכפל:  $f_{X,Y}(x, y) = f_X(x) \cdot f_{Y|X}(y|x)$   
 התפלגות מצטברת מותנית:  $F_{X|Y}(x|y) = P(X \leq x | Y = y) = \int_{-\infty}^x f_{X|Y}(t|y) dt$   
 חישוב הסתברות מותנית:  $P(a \leq X \leq b | Y = y) = \int_a^b f_{X|Y}(x|y) dx$   
 צפיפות שולית דרך מותנית:  $f_X(x) = \int_{-\infty}^{\infty} f_{X|Y}(x|y) \cdot f_Y(y) dy$   
 נוסחת בייס:  $f_{Y|X}(y|x) = \frac{f_{X,Y}(x, y) \cdot f_Y(y)}{f_X(x)}$

**טרנספורמציה דו מימדית**

יהי  $(x, y)$  מ"מ דו-מימדי רציף בעל צפיפות משותפת  $f_{X,Y}(x, y)$ . תהינה  $u = g_1(x, y)$ ,  $v = g_2(x, y)$  פונקציות על המישור, חח"ע וגזירות, כך שקיימות הפונקציות הפוכות  $x = h_1(u, v)$ ,  $y = h_2(u, v)$

גזירות נגדיר  $D(u, v) = \det \begin{bmatrix} \frac{\partial h_1}{\partial u} & \frac{\partial h_1}{\partial v} \\ \frac{\partial h_2}{\partial u} & \frac{\partial h_2}{\partial v} \end{bmatrix}$

אזי פונקציית הצפיפות המשותפת של  $u = g_1(x, y)$ ,  $v = g_2(x, y)$  נתונה ע"י  $f_{U,V}(u, v) = f_{X,Y}(h_1(u, v), h_2(u, v)) \cdot |D(u, v)|$

- עבור מ"מ  $u = g_1(X, Y)$  ניתן לכתוב  $V = X$  או  $V = Y$  ולבצע טרנספורמציה דו-מימדית עבור  $U, V$  ולמצוא צפיפות שולית של  $U$  ע"י אינטגרציה.
- קונבולוציה היא מקרה פרטי של טרנספורמציה דו-מימדית:  $V = X$  (or  $V = Y$ )  $U = X + Y$