

מבני פונקציות ואלגוריתם

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

אי תלות

המאורעות A, B בת"ל אם: P(A ∩ B) = P(A) · P(B). המאורעות A1, A2, ..., An בת"ל אם כל 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: SD(X) = sqrt(Var(X)).

התפלגות נורמלית

X ~ N(mu, sigma^2) סימון: X ~ N(E(X), Var(X)). פונקציית צפיפות: f\_x(x) = 1/(sigma\*sqrt(2\*pi)) \* exp(-(x-mu)^2/(2\*sigma^2)).

ברמול משתנה נורמלית

X ~ N(mu, sigma^2) => Z = (X - mu) / sigma ~ N(0, 1). P(a <= x <= b) = Phi((b - mu) / sigma) - Phi((a - mu) / sigma).

משפט הגבול המרכזי: יהיו X1, X2, ..., Xn משתנים מקריים בת"ל ש"ע עם תוחלת mu ושונות sigma^2 נגדיר: Xn ~ N(mu, sigma^2/n).

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 ההסתברות השלמה

באותם נאיים של ההסתברות השלמה, בתוספת המגבלה ש: P(A) > 0 מתקיים: P(A|B) = P(A intersection B) / P(B).

שוונות משותפת

בשני תלויים <= בלתי מתואמים (לא בהכרח לכיוון שני) Cov(X, Y) = 0. נוסחת השונות המשותפת: Cov(X, Y) = Var(X) \* Corr(X, Y).

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
Corr(X, Y) = -1 <=> Y = aX + b, a < 0

מ"מ רציפים

הגדרות הסתברויות: P(X in [a, a + dx]) = f\_x(x) \* dx. אלוצים: f\_x(x) >= 0.

פונקציית התפלגות מצטברת

עבור מ"מ רציף: P(a <= X <= b) = F(b) - F(a). F\_x(x) > 1 לא נוגנת הסתברות - לכן יתכן כי f\_x(x) > 1.

קירוב פואסוני להתפלגות בינומית

X ~ Bin(n, p) אם np < 5 ו-nq < 5. X ~ Bin(n, p) אם np > 5 ו-nq > 5.

התפלגות משותפת של מ"מים בדידים

תוחלת מ"מ בדיד: E(X) = sum(x \* P(X=x)). נוסחת הזנב: עבור מ"מ המקבל ערכים שלמים אי שליליים: E(X) = sum(P(X >= x)).

אמינות מערכת

ההסתברות שהמערכת תעבוד a-ההסתברות שרכיב i יעבוד: a = (1 - P1) \* (1 - P2) \* ... \* (1 - Pn).

תחלת משותפת

נתונים מ"מ X, Y התפלגות משותפת f(x, y) מתקיים: E(XY) = sum(x\*y\*f(x,y)). תוחלת מותנית: E(X|Y) = sum(x \* P(X=x|Y=y)).

תכונות מותנית

תוחלת מותנית: E(X) = sum(x \* P(X=x)). תוחלת מותנית בדיד: E(X|A) = sum(x \* P(X=x|A)).

תוחלת של מ"מ רציף

E(X) = integral(x \* f\_x(x) dx). נוסחת הזנב: E(g(X)) = integral(g(x) \* f\_x(x) dx). תוחלת קיימת רק כאשר: integral(|x \* f\_x(x)| dx) < infinity.

תוחלת מותנית במקרה הרציף

E(X|Y=y) = integral(x \* f\_XY(x|y) dx). הערה: E(X|Y=y) = g(y) => E(X|Y) = g(Y).

התפלגות היפר-גאומטרית

N כדורים מוכנסים D שחורים והשאר לבנים. מוציאים n כדורים באקראי. X מ"מ הספר את מספר הכדורים השחורים מבין הכדורים שהוצאו.

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

יהי X\_i סדרת מ"מ ב"ת ש"ע עם E(X\_i) = mu. יהי N מ"מ המקבל ערכים טבעיים. X-1 בלתי תלויים. נגדיר S\_N = sum(X\_i) אזי: E(S\_N) = mu \* E(N).

ממנטים ופונקציה יצירת ממנטים

הגדרה: יהיה X מ"מ, פי"מ של X מוגדרת: M\_x(t) = E(e^{tx}). עבור מ"מ רציף: M\_x(t) = E(e^{tx}) = integral(e^{tx} \* f\_x(x) dx). פי"מ של מספר מ"מ ב"ת: M\_{X+Y}(t) = M\_X(t) \* M\_Y(t).

התפלגות מעריכית

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

תוחלת מותנית במקרה הרציף

E(X|Y=y) = integral(x \* f\_XY(x|y) dx). הערה: E(X|Y=y) = g(y) => E(X|Y) = g(Y).

**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

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

אם  $X, Y$  תלויים

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

עבור מ"מ בדידים:

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

ש לכל  $y$  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 אהיד 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 ותחומיהם השוליים של  $X$  ו- $Y$  אינם תלויים אחד בשני אזי  $X$  ו- $Y$  ב"ת ו- $h(y)$  ו- $g(x)$  הן פונ' הצפיפות של  $X, Y$  **עד כדי קבוע.**

**פונקציות 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  $f_{X,Y}(x, y)$ . תהייה  $u = g_1(x, y)$ ,  $v = g_2(x, y)$  פונקציות על המישור, חח"ע וגזירות, כך שקיימות הפונקציות הפוכות  $x = h_1(u, v)$ ,  $y = h_2(u, v)$  גזירות.

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

נגדיר

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

1. עבור מ"מ  $u = g_1(X, Y)$  ניתן לכתוב  $V=Y$  או  $V=X$  ולבצע טרנספורמציה דו-מימדית עבור  $U, V$  ולמצוא צפיפות שולית של  $U$  ע"י אינטגרציה.

2. קונבולוציה היא מקרה פרטי של טרנספורמציה דו-מימדית:  
 $V=X$  (or  $V=Y$ )  $U=X+Y$