

5. cvičení

Pravděpodobnost a statistika 1, 13. 3. 2023

<https://iuuk.mff.cuni.cz/~chmel/2223/past/>

Na zahřátí

Úloha 1 (Náhodný řez)

Mějme neorientovaný graf $G = (V, E)$. Vybereme náhodně podmnožinu vrcholů $V' \subseteq V$ tak, že pro každý vrchol si nezávisle hodíme (spravedlivou) mincí, zda ho dáme do V' . Jaká je střední hodnota počtu hran, které vedou mezi V' a $V \setminus V'$?

Úloha 2 (Tři kostky)

Hodíme třemi šestistěnnými kostkami a výsledek přečteme jako tříciferné číslo (kostky jsou odlišitelné, a předem víme, že např. žlutá kostka bude na pozici stovek, červená na pozici desítek a modrá na pozici jednotek). Jaká je jeho střední hodnota?

Úloha 3 (Dvě kostky)

Hodíme dvěma kostkami a výsledek přečteme jako dvojciferné číslo, přičemž kostku s větší hodnotou použijeme pro řád desítek. Jaká je teď střední hodnota?

Zacházení se střední hodnotou a rozptylem

Úloha 4 (Rozptyl a jeho (ne)linearita)

Nechť X, Y jsou diskrétní náhodné veličiny a $\alpha \in \mathbb{R}$.

- Ukažte, že $\text{var}(X + \alpha) = \text{var}(X)$.
- Vyjádřete $\text{var}(\alpha X)$ pomocí $\text{var}(X)$.
- Ukažte, že $\text{var}(X + Y) = \text{var}(X) + \text{var}(Y)$, pokud X, Y jsou nezávislé.

Podmíněná střední hodnota

Úloha 5 (Testujeme)

V testu je 20 otázek s volbami $\{a, b, c, d\}$, vždy je správná právě jedna odpověď. Za správnou odpověď dostanete 1 bod, za špatnou $-1/4$ bodu, za nevyplněnou otázku nula. Každá otázka je s pravděpodobností p jednou z těch, co se Kvído naučil, a tedy zná správnou odpověď. Pokud správnou odpověď nezná, ví o tom a může se rozhodnout, zda tipovat.

- Jaká je střední hodnota počtu bodů, které Kvído získá, pokud bude odpovídat jenom na otázky, u kterých zná odpověď?
- A co když bude tipovat, když nezná správnou odpověď?
- Jak by se musela změnit penalizace za chybnou odpověď, aby byly odpovědi v částech a, b stejné?

Úloha 6 (Člověče, nezlob se)

Házíme běžnou kostkou, při šestce házíme znovu, a to i opakovaně. Spočítejte střední hodnotu součtu všech hozených čísel (není potřeba ručně vyčíslovat).

Úloha 7 (Nezávislost jevů a indikátorů)

Ukažte, že jevy A, B jsou nezávislé, právě když jsou nezávislé jejich indikátorové veličiny.

Bonusové úlohy

Úloha 8 (Velký lov)

Velký hon: n myslivců se snaží ulovit n lišek. Míří náhodně: každý myslivce strefí rovnoměrně náhodně vybranou lišku. Spočítejte střední počet lišek, které hon přežijí (nikdo je netrefil).

Úloha 9 (Počty levých maxim)

Mějme náhodnou permutaci π na množině $\{1, \dots, n\}$. Prvek i je *levým maximem*, pokud $\pi(j) < \pi(i)$ pro všechna $j < i$ (tj. všechny hodnoty nalevo jsou menší). Jaká je střední hodnota počtu levých maxim? Analogie: různé vysokí lidé stojí ve frontě, kolik z nich vidí na začátek fronty?

Úloha 10 (Indikátory a PIE)

Připomeňte si definici indikátorové náhodné veličiny I_A .

- a) Nechť $A = A_1 \cup A_2 \cup \dots \cup A_n$. Ověřte rovnost

$$1 - I_A = \prod_{i=1}^n (1 - I_{A_i}).$$

- b) Roznásobte a použijte větu o linearitě střední hodnoty, abyste získali princip inkluze a exkluze.

Úloha 11 (Střední hodnota a rozptyl podruhé)

Dokažte:

- a) Pokud $\mathbb{E}(X^2) = 0$, tak $P(X = 0) = 1$.
- b) Předpokládejme, že $\text{var}(X) = 0$, dále že $\mathbb{E}(X)$ existuje a je konečná.
Pak $X = \mathbb{E}(X)$ skoro jistě, neboli $P[X = \mathbb{E}(X)] = 1$.

Úloha 12 (Nezávislost pro jevy $\leq k$)

Ukažte, že pro diskrétní nezávislé n.v. X, Y platí

$$P[X \leq x \wedge Y \leq y] = P[X \leq x] \cdot P[Y \leq y].$$

Pro jednoduchost můžete předpokládat, že $\text{Supp}(X) = \text{Supp}(Y) = \{1, 2, \dots, n\}$ pro nějaké n .

Tahák

- *Střední hodnota* veličiny X : $\mathbb{E}(X) = \sum_t t \cdot P(X = t)$.
- *Linearita střední hodnoty*: $\mathbb{E}(X + Y) = \mathbb{E}(X) + \mathbb{E}(Y)$, $\mathbb{E}(\alpha X) = \alpha \mathbb{E}(X)$.
- *Podmíněná střední hodnota* veličiny X za podmínky jevu B : $\mathbb{E}(X|B) = \sum_t t \cdot P(X = t|B)$.
- *Rozbor případů*: $\mathbb{E}(X) = \mathbb{E}(X|A) \cdot P(A) + \mathbb{E}(X|A^c) \cdot P(A^c)$.
- *LOTUS (pravidlo naivního statistika)*: $\mathbb{E}(g(X)) = \sum_a g(a) \cdot P(X = a)$.
- *Indikátorová náhodná veličina* I_A jevu A nabývá hodnot 0 a 1, přičemž $I_A = 1 \Leftrightarrow A$ nastane. Platí, že $\mathbb{E}(I_A) = P(A)$.
- *Rozptyl* $\text{var}(X) = \mathbb{E}((X - \mathbb{E}(X))^2) = \mathbb{E}(X^2) - (\mathbb{E}(X))^2$.
- Veličiny X a Y jsou *nezávislé* $\Leftrightarrow P(X = a \wedge Y = b) = P(X = a) \cdot P(Y = b)$.
- Pro X, Y nezávislé platí $\mathbb{E}(XY) = \mathbb{E}(X)\mathbb{E}(Y)$.

Domácí úkol 5

<https://iuuk.mff.cuni.cz/~chmel/2223/past/>
Pravděpodobnost a statistika 1

Zadáno 13. 3. 2023
Odevzdejte do 20. 3. 2023 9:00 přes Poštovní sovu

Úloha 1 (Výzkum)

Na přednášce „Jak vystudovat matfyz“ se přednášející poněkud oddálil od tématu, protože začal mluvit o počtu gumovacích per, které průměrný student během studia potřebuje. Zároveň prohlásil, že empiricky se zdá, že tento počet lze modelovat náhodnou veličinou X , která mimo jiné splňuje $\mathbb{E}[X] = 5, \mathbb{E}[X^2] = 20$. V ten okamžik jste jako studenti obeznámení s pravděpodobností a statistikou zbystrili – co je na jeho tvrzení podezřelé?