Sandsynlighedsregning 11. forelæsning

Bo Friis Nielsen

Matematik og Computer Science

Danmarks Tekniske Universitet

2800 Kgs. Lyngby – Danmark

Email: bfni@imm.dtu.dk

Dagens nye emner afsnit 6.3 (og 6.4)

- Betingede kontinuerte fordelinger $f(y|X=x) = \frac{f(x,y)}{f_X(x)}$
- Integralformel for gennemsnit af betingede sandsynligheder $\mathsf{P}(A) = \int \mathsf{P}(A|X=x) f_X(x) \mathrm{d}x$
- Betinget forventning $\mathsf{E}(Y) = \mathsf{E}(\mathsf{E}(Y|X))$
- Kovarians $\mathsf{Cov}(X,Y) = \mathsf{E}[(X - \mathsf{E}(X))(Y - \mathsf{E}(Y))] = \mathsf{E}(XY) - \mathsf{E}(X)\mathsf{E}(Y)$,
- Korellation $Corr(X,Y) = \frac{\mathsf{Cov}(X,Y)}{\mathsf{SD}(X)\mathsf{SD}(Y)}$
- Varians af sum af variable $\mathsf{Var}\left(\sum_{k=1}^{N} X_k\right) = \sum_{k=1}^{n} \mathsf{Var}(X_k) + 2\sum_{1 \le j < k \le n} \mathsf{Cov}(X_j, X_k)$
- Bilinearitet af kovariansen $\mathsf{Cov}\left(\sum_{i=1}^{n} a_i X_i, \sum_{j=1}^{m} b_j Y_j\right) = \sum_{i=1}^{n} \sum_{j=1}^{m} a_i b_j \mathsf{Cov}(X_i, Y_j)$

Betingede fordelinger i det kontinuerte tilfælde

Første skud kunne være at se på de betingede sandsynligheder:

$$\mathsf{P}(Y \leq y | X = x)$$

... men de er ikke veldefinerede fordi den hændelse vi betinger med, $X = x$, har sandsynlighed 0.

I stedet betinger vi på $X \in dx$, og lader intervallet dx gå mod punktet x.

Grænsen er veldefineret når (X, Y) har simultan tæthed $f_{XY}(x, y)$ og den marginale tæthed af X er forskellig for 0 i x:

$$\mathsf{P}(Y \in dy | X \in dx) = \frac{f_{XY}(x, y)\mathrm{d}x\mathrm{d}y}{f_X(x)\mathrm{d}x} + o(dy) = \frac{f_{XY}(x, y)\mathrm{d}y}{f_X(x)} + o(dy)$$

Det geometriske billede på s. 412 er meget nyttigt!

Kontinuerte betingede fordelinger

Maskineriet kører som i det diskrete tilfælde; erstat summer med integraler.

F.eks. multiplikationsreglen:

$$f_{XY}(x,y) = f_X(x) f_Y(y|X=x)$$

Betinget forventningsværdi af en funktion:

Kontinuerte betingede fordelinger

Maskineriet kører som i det diskrete tilfælde; erstat summer med integraler.

F.eks. multiplikationsreglen:

$$f_{XY}(x,y) = f_X(x) f_Y(y|X=x)$$

Betinget forventningsværdi af en funktion:

$$\mathsf{E}(g(Y)|X=x)$$

Kontinuerte betingede fordelinger

Maskineriet kører som i det diskrete tilfælde; erstat summer med integraler.

F.eks. multiplikationsreglen:

$$f_{XY}(x,y) = f_X(x) f_Y(y|X=x)$$

Betinget forventningsværdi af en funktion:

$$\mathsf{E}(g(Y)|X=x) = \int g(y)$$

Kontinuerte betingede fordelinger

Maskineriet kører som i det diskrete tilfælde; erstat summer med integraler.

F.eks. multiplikationsreglen:

$$f_{XY}(x,y) = f_X(x) f_Y(y|X=x)$$

Betinget forventningsværdi af en funktion:

$$\mathsf{E}(g(Y)|X=x) = \int g(y) f_Y(y|X=x) \mathsf{d}y$$

Ubetingede forventningsværdier:

Kontinuerte betingede fordelinger

Maskineriet kører som i det diskrete tilfælde; erstat summer med integraler.

F.eks. multiplikationsreglen:

$$f_{XY}(x,y) = f_X(x) f_Y(y|X=x)$$

Betinget forventningsværdi af en funktion:

$$\mathsf{E}(g(Y)|X=x) = \int g(y) f_Y(y|X=x) \mathsf{d}y$$

Ubetingede forventningsværdier:

$$\mathsf{E}(g(Y))$$

Kontinuerte betingede fordelinger

Maskineriet kører som i det diskrete tilfælde; erstat summer med integraler.

F.eks. multiplikationsreglen:

$$f_{XY}(x, y) = f_X(x) f_Y(y|X = x)$$

Betinget forventningsværdi af en funktion:

$$\mathsf{E}(g(Y)|X = x) = \int g(y) f_Y(y|X = x) \mathsf{d}y$$

Ubetingede forventningsværdier:

$$\mathsf{E}(g(Y)) = \int \mathsf{E}(g(Y)|X = x)$$

Kontinuerte betingede fordelinger

Maskineriet kører som i det diskrete tilfælde; erstat summer med integraler.

F.eks. multiplikationsreglen:

$$f_{XY}(x,y) = f_X(x) f_Y(y|X=x)$$

Betinget forventningsværdi af en funktion:

$$\mathsf{E}(g(Y)|X=x) = \int g(y) f_Y(y|X=x)\mathsf{d}y$$

Ubetingede forventningsværdier:

$$\mathsf{E}(g(Y)) = \int \mathsf{E}(g(Y)|X=x) f_X(x)\mathsf{d}x$$

Antag at (X, Y) er ligefordelt over området $\{(x, y) \in \mathbf{R} \times \mathbf{R} : 0 < |y| < x < 1\}$.

Spørgsmål 1

Den betingede tæthed af X givet Y $f(x|Y = y)$ findes til

1 ☐ $f(x|Y = y) = 2, \qquad 0 < |y| < x < 1$

2 ☐ $f(x|Y = y) = 1, \qquad 0 < x < 1$

3 ☐ $f(x|Y = y) = x|y|, \qquad 0 < |y| < x < 1$

4 ☐ $f(x|Y = y) = \frac{2x}{1-|y|^2}, \qquad 0 < |y| < x < 1$

5 ☐ $f(x|Y = y) = \frac{1}{1-|y|}, \qquad 0 < |y| < x < 1$

6 ☐ Ved ikke

Eksempel på betinget fordeling

Eksempel på betinget fordeling

- For givet $X = x$ er $Y \in exponential(x)$

Eksempel på betinget fordeling

- For givet $X = x$ er $Y \in exponential(x)$, hvor $X \in exponential(1)$

Eksempel på betinget fordeling

- For givet $X = x$ er $Y \in exponential(x)$, hvor $X \in exponential(1)$
- Vi finder den marginale tæthed af Y ved

Eksempel på betinget fordeling

- For givet $X = x$ er $Y \in exponential(x)$, hvor $X \in exponential(1)$
- Vi finder den marginale tæthed af Y ved

$$f_Y(y)$$

Eksempel på betinget fordeling

- For givet $X = x$ er $Y \in exponential(x)$, hvor $X \in exponential(1)$
- Vi finder den marginale tæthed af Y ved

$$f_Y(y) = \int_0^{\infty} f(x, y)\mathrm{d}x =$$

Eksempel på betinget fordeling

- For givet $X = x$ er $Y \in exponential(x)$, hvor $X \in exponential(1)$
- Vi finder den marginale tæthed af Y ved

$$f_Y(y) = \int_0^{\infty} f(x,y)\mathrm{d}x = \int_0^{\infty} f_Y(y|X=x)f_X(x)\mathrm{d}x$$

Eksempel på betinget fordeling

- For givet $X = x$ er $Y \in exponential(x)$, hvor $X \in exponential(1)$
- Vi finder den marginale tæthed af Y ved

$$f_Y(y) = \int_0^\infty f(x,y)\mathsf{d}x = \int_0^\infty f_Y(y|X=x)f_X(x)\mathsf{d}x$$

$$= \int_0^\infty xe^{-xy}1 \cdot e^{-x}\mathsf{d}x = \frac{1}{y+1}\int_0^\infty x(y+1)e^{-(y+1)x}\mathsf{d}x$$

Eksempel på betinget fordeling

- For givet $X = x$ er $Y \in exponential(x)$, hvor $X \in exponential(1)$
- Vi finder den marginale tæthed af Y ved

$$f_Y(y) = \int_0^\infty f(x,y)\mathrm{d}x = \int_0^\infty f_Y(y|X=x)f_X(x)\mathrm{d}x$$

$$= \int_0^\infty xe^{-xy}1 \cdot e^{-x}\mathrm{d}x = \frac{1}{y+1}\int_0^\infty x(y+1)e^{-(y+1)x}\mathrm{d}x$$

- Integralet er middelværdien af en eksponentialfordelt variabel med middelværdi $\frac{1}{y+1}$.

Eksempel på betinget fordeling

- For givet $X = x$ er $Y \in exponential(x)$, hvor $X \in exponential(1)$
- Vi finder den marginale tæthed af Y ved

$$f_Y(y) = \int_0^\infty f(x,y)\mathrm{d}x = \int_0^\infty f_Y(y|X=x)f_X(x)\mathrm{d}x$$

$$= \int_0^\infty xe^{-xy}1 \cdot e^{-x}\mathrm{d}x = \frac{1}{y+1}\int_0^\infty x(y+1)e^{-(y+1)x}\mathrm{d}x$$

- Integralet er middelværdien af en eksponentialfordelt variabel med middelværdi $\frac{1}{y+1}$. Vi finder

Eksempel på betinget fordeling

- For givet $X = x$ er $Y \in exponential(x)$, hvor $X \in exponential(1)$
- Vi finder den marginale tæthed af Y ved

$$f_Y(y) = \int_0^\infty f(x,y)\mathrm{d}x = \int_0^\infty f_Y(y|X=x)f_X(x)\mathrm{d}x$$

$$= \int_0^\infty xe^{-xy}1 \cdot e^{-x}\mathrm{d}x = \frac{1}{y+1}\int_0^\infty x(y+1)e^{-(y+1)x}\mathrm{d}x$$

- Integralet er middelværdien af en eksponentialfordelt variabel med middelværdi $\frac{1}{y+1}$. Vi finder

$$f_Y(y) = \frac{1}{(1+y)^2}$$

Integralformel for gennemsnit af betingede sandsynligheder

$$\mathsf{P}(A)$$

Integralformel for gennemsnit af betingede sandsynligheder

$$\mathsf{P}(A) = \int \mathsf{P}(A|X = x) f_X(x) \mathsf{d}x$$

Integralformel for gennemsnit af betingede sandsynligheder

$$\mathsf{P}(A) = \int \mathsf{P}(A|X=x) f_X(x) \mathrm{d}x$$

- Betragt (Π, Y)

Integralformel for gennemsnit af betingede sandsynligheder

$$\mathsf{P}(A) = \int \mathsf{P}(A|X = x) f_X(x) \mathsf{d}x$$

- Betragt (Π, Y) hvor Π er ligefordelt (0,1) og

Integralformel for gennemsnit af betingede sandsynligheder

$$\mathsf{P}(A) = \int \mathsf{P}(A|X=x) f_X(x) \mathsf{d}x$$

- Betragt (Π, Y) hvor Π er ligefordelt (0,1) og $\mathsf{P}(Y=y|\Pi=p) =$

Integralformel for gennemsnit af betingede sandsynligheder

$$\mathsf{P}(A) = \int \mathsf{P}(A|X = x) f_X(x) \mathsf{d}x$$

- Betragt (Π, Y) hvor Π er ligefordelt (0,1) og $\mathsf{P}(Y = y|\Pi = p) = \binom{n}{y} p^y (1-p)^{n-y}$

Integralformel for gennemsnit af betingede sandsynligheder

$$\mathsf{P}(A) = \int \mathsf{P}(A|X=x) f_X(x) \mathsf{d}x$$

- Betragt (Π, Y) hvor Π er ligefordelt (0,1) og $\mathsf{P}(Y=y|\Pi=p) = \binom{n}{y} p^y (1-p)^{n-y}$
- Hvad er $\mathsf{P}(Y=y)$?

$$\mathsf{P}(Y=y)$$

Integralformel for gennemsnit af betingede sandsynligheder

$$\mathsf{P}(A) = \int \mathsf{P}(A|X = x) f_X(x) \mathrm{d}x$$

- Betragt (Π, Y) hvor Π er ligefordelt (0,1) og $\mathsf{P}(Y = y|\Pi = p) = \binom{n}{y} p^y (1-p)^{n-y}$
- Hvad er $\mathsf{P}(Y = y)$?

$$\mathsf{P}(Y = y) = \int^1$$

Integralformel for gennemsnit af betingede sandsynligheder

$$\mathsf{P}(A) = \int \mathsf{P}(A|X=x) f_X(x) \mathrm{d}x$$

- Betragt (Π, Y) hvor Π er ligefordelt (0,1) og $\mathsf{P}(Y=y|\Pi=p) = \binom{n}{y} p^y (1-p)^{n-y}$
- Hvad er $\mathsf{P}(Y=y)$?

$$\mathsf{P}(Y=y) = \int_0^1$$

Integralformel for gennemsnit af betingede sandsynligheder

$$\mathsf{P}(A) = \int \mathsf{P}(A|X = x) f_X(x) \mathrm{d}x$$

- Betragt (Π, Y) hvor Π er ligefordelt (0,1) og $\mathsf{P}(Y = y|\Pi = p) = \binom{n}{y} p^y (1-p)^{n-y}$
- Hvad er $\mathsf{P}(Y = y)$?

$$\mathsf{P}(Y = y) = \int_0^1 \binom{n}{y} p^y (1-p)^{n-y}$$

Integralformel for gennemsnit af betingede sandsynligheder

$$\mathsf{P}(A) = \int \mathsf{P}(A|X = x) f_X(x) \mathrm{d}x$$

- Betragt (Π, Y) hvor Π er ligefordelt (0,1) og $\mathsf{P}(Y = y|\Pi = p) = \binom{n}{y} p^y (1-p)^{n-y}$
- Hvad er $\mathsf{P}(Y = y)$?

$$\mathsf{P}(Y = y) = \int_0^1 \binom{n}{y} p^y (1-p)^{n-y} \cdot 1$$

Integralformel for gennemsnit af betingede sandsynligheder

$$\mathsf{P}(A) = \int \mathsf{P}(A|X=x) f_X(x) \mathsf{d}x$$

- Betragt (Π, Y) hvor Π er ligefordelt (0,1) og $\mathsf{P}(Y=y|\Pi=p) = \binom{n}{y} p^y (1-p)^{n-y}$
- Hvad er $\mathsf{P}(Y=y)$?

$$\mathsf{P}(Y=y) = \int_0^1 \binom{n}{y} p^y (1-p)^{n-y} \cdot 1 \cdot \mathsf{d}p$$

$$= \frac{1}{n+1} \int_0^1 \frac{(n+1)!}{y!(n-y)!} p^y (1-p)^{n-y} \mathsf{d}p$$

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

$\mathsf{P}(Y = y)$

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

$$\mathsf{P}(Y = y) \;=\; \int_0^\infty$$

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

$$\mathsf{P}(Y = y) \;=\; \int_0^{\infty} \mathsf{P}(Y = y | X = x)$$

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

$$
\begin{aligned}
\mathsf{P}(Y = y) &= \int_0^\infty \mathsf{P}(Y = y | X = x) f_X(x) \mathsf{d}x \\
&= \int_0^\infty
\end{aligned}
$$

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

$$\begin{aligned}
\mathsf{P}(Y = y) &= \int_0^\infty \mathsf{P}(Y = y | X = x) f_X(x) \mathrm{d}x \\
&= \int_0^\infty \frac{x^y}{y!} e^{-x}
\end{aligned}$$

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

$$
\begin{aligned}
\mathsf{P}(Y = y) &= \int_0^\infty \mathsf{P}(Y = y | X = x) f_X(x) \mathsf{d}x \\
&= \int_0^\infty \frac{x^y}{y!} e^{-x} \lambda^2 x e^{-\lambda x} \mathsf{d}x
\end{aligned}
$$

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

$$
\begin{aligned}
\mathsf{P}(Y = y) &= \int_0^\infty \mathsf{P}(Y = y | X = x) f_X(x) \mathsf{d}x \\
&= \int_0^\infty \frac{x^y}{y!} e^{-x} \lambda^2 x e^{-\lambda x} \mathsf{d}x = \frac{\lambda^2}{y!}
\end{aligned}
$$

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

$$\begin{aligned}
\mathsf{P}(Y = y) &= \int_0^\infty \mathsf{P}(Y = y | X = x) f_X(x) \mathsf{d}x \\
&= \int_0^\infty \frac{x^y}{y!} e^{-x} \lambda^2 x e^{-\lambda x} \mathsf{d}x = \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty x^{y+1} e^{-(\lambda+1)x} \mathsf{d}x \\
&= \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty
\end{aligned}$$

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

$$
\begin{aligned}
\mathsf{P}(Y = y) &= \int_0^\infty \mathsf{P}(Y = y | X = x) f_X(x) \mathsf{d}x \\
&= \int_0^\infty \frac{x^y}{y!} e^{-x} \lambda^2 x e^{-\lambda x} \mathsf{d}x = \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty x^{y+1} e^{-(\lambda+1)x} \mathsf{d}x \\
&= \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty (\lambda + 1)
\end{aligned}
$$

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

$$\begin{aligned}
\mathsf{P}(Y = y) &= \int_0^\infty \mathsf{P}(Y = y | X = x) f_X(x) \mathsf{d}x \\
&= \int_0^\infty \frac{x^y}{y!} e^{-x} \lambda^2 x e^{-\lambda x} \mathsf{d}x = \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty x^{y+1} e^{-(\lambda+1)x} \mathsf{d}x \\
&= \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty (\lambda + 1) \frac{((\lambda + 1)x)^{y+1}}{}
\end{aligned}$$

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

$$
\begin{aligned}
\mathsf{P}(Y = y) &= \int_0^\infty \mathsf{P}(Y = y | X = x) f_X(x) \mathsf{d}x \\
&= \int_0^\infty \frac{x^y}{y!} e^{-x} \lambda^2 x e^{-\lambda x} \mathsf{d}x = \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty x^{y+1} e^{-(\lambda+1)x} \mathsf{d}x \\
&= \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty (\lambda + 1) \frac{((\lambda + 1)x)^{y+1}}{(y+1)!}
\end{aligned}
$$

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

$$\begin{aligned}
\mathsf{P}(Y = y) &= \int_0^\infty \mathsf{P}(Y = y | X = x) f_X(x) \mathsf{d}x \\
&= \int_0^\infty \frac{x^y}{y!} e^{-x} \lambda^2 x e^{-\lambda x} \mathsf{d}x = \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty x^{y+1} e^{-(\lambda+1)x} \mathsf{d}x \\
&= \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty (\lambda + 1) \frac{((\lambda + 1)x)^{y+1}}{(y+1)!} e^{-(\lambda+1)x} \mathsf{d}x
\end{aligned}$$

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

$$\begin{aligned}
\mathsf{P}(Y = y) &= \int_0^\infty \mathsf{P}(Y = y | X = x) f_X(x) \mathsf{d}x \\
&= \int_0^\infty \frac{x^y}{y!} e^{-x} \lambda^2 x e^{-\lambda x} \mathsf{d}x = \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty x^{y+1} e^{-(\lambda+1)x} \mathsf{d}x \\
&= \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty (\lambda + 1) \frac{((\lambda + 1)x)^{y+1}}{(y+1)!} e^{-(\lambda+1)x} \mathsf{d}x \frac{(y+1)!}{(\lambda + 1)^{y+2}}
\end{aligned}$$

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

$$
\begin{aligned}
\mathsf{P}(Y = y) &= \int_0^\infty \mathsf{P}(Y = y | X = x) f_X(x) \mathsf{d}x \\
&= \int_0^\infty \frac{x^y}{y!} e^{-x} \lambda^2 x e^{-\lambda x} \mathsf{d}x = \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty x^{y+1} e^{-(\lambda+1)x} \mathsf{d}x \\
&= \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty (\lambda + 1) \frac{((\lambda+1)x)^{y+1}}{(y+1)!} e^{-(\lambda+1)x} \mathsf{d}x \frac{(y+1)!}{(\lambda+1)^{y+2}} \\
&= \frac{\lambda^2 (y+1)!}{(\lambda+1)^{y+2} y!}
\end{aligned}
$$

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

$$
\begin{aligned}
\mathsf{P}(Y = y) &= \int_0^\infty \mathsf{P}(Y = y | X = x) f_X(x) \mathsf{d}x \\
&= \int_0^\infty \frac{x^y}{y!} e^{-x} \lambda^2 x e^{-\lambda x} \mathsf{d}x = \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty x^{y+1} e^{-(\lambda+1)x} \mathsf{d}x \\
&= \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty (\lambda+1) \frac{((\lambda+1)x)^{y+1}}{(y+1)!} e^{-(\lambda+1)x} \mathsf{d}x \frac{(y+1)!}{(\lambda+1)^{y+2}} \\
&= \frac{\lambda^2 (y+1)!}{(\lambda+1)^{y+2} y!} = y \left(\frac{\lambda}{\lambda+1} \right)^2 \left(\frac{1}{\lambda+1} \right)^y
\end{aligned}
$$

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er fordelingen af Y?

Svar:

$$
\begin{aligned}
\mathsf{P}(Y = y) &= \int_0^\infty \mathsf{P}(Y = y|X = x) f_X(x) \mathsf{d}x \\
&= \int_0^\infty \frac{x^y}{y!} e^{-x} \lambda^2 x e^{-\lambda x} \mathsf{d}x = \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty x^{y+1} e^{-(\lambda+1)x} \mathsf{d}x \\
&= \frac{\lambda^2}{y!} \int_0^\infty (\lambda + 1) \frac{((\lambda+1)x)^{y+1}}{(y+1)!} e^{-(\lambda+1)x} \mathsf{d}x \frac{(y+1)!}{(\lambda+1)^{y+2}} \\
&= \frac{\lambda^2 (y+1)!}{(\lambda+1)^{y+2} y!} = y \left(\frac{\lambda}{\lambda+1} \right)^2 \left(\frac{1}{\lambda+1} \right)^y
\end{aligned}
$$

En negativ binomialfordeling

Den kontinuerte stokastiske variabel $0 \leq Y \leq 1$ har tætheden $f_Y(y) = 6y(1-y)$, yderligere har man at den betingede fordeling af X givet $Y = y$ er $binomial(3, y)$.

Spørgsmål 2

I X værdimængde finder man $\mathsf{P}(X = x)$ til

1 ☐ $\frac{1}{4}$

2 ☐ $\frac{1}{20}(x+1)(4-x)$

3 ☐ $\frac{x}{10}$

4 ☐ $\binom{3}{x}\frac{1}{8}$

5 ☐ $\binom{3}{x}y^x(1-y)^{3-x}$

6 ☐ Ved ikke

Betinget forventning

$$\mathsf{E}(Y|X = x)$$

Betinget forventning

$$\mathsf{E}(Y|X = x) = \int_y y$$

Betinget forventning

$$\mathsf{E}(Y|X=x) = \int_y y f(y|X=x)\mathsf{d}y$$

Regneregler for betinget forventning er uændret fra det diskrete tilfælde

Man har stadig fortolkningen af $\mathsf{E}(Y|X)$ som en stokastisk variabel, og

$$\mathsf{E}(Y)$$

Betinget forventning

$$\mathsf{E}(Y|X=x) = \int_y y f(y|X=x)\mathsf{d}y$$

Regneregler for betinget forventning er uændret fra det diskrete tilfælde

Man har stadig fortolkningen af $\mathsf{E}(Y|X)$ som en stokastisk variabel, og

$$\mathsf{E}(Y) = \mathsf{E}(\mathsf{E}(Y|X))$$

Betinget forventning

Man har den ligefordelte ([0;1]) kontinuerte stokastiske variabel X,

Betinget forventning

Man har den ligefordelte ([0;1]) kontinuerte stokastiske variabel X, og den stokastiske variabel Y,

Betinget forventning

Man har den ligefordelte ([0;1]) kontinuerte stokastiske variabel X, og den stokastiske variabel Y, der givet $X = x$,

Betinget forventning

Man har den ligefordelte ([0;1]) kontinuerte stokastiske variabel X, og den stokastiske variabel Y, der givet $X = x$, følger en $normal\,(x^3 - x, x)$ fordeling.

Betinget forventning

Man har den ligefordelte ([0;1]) kontinuerte stokastiske variabel X, og den stokastiske variabel Y, der givet $X = x$, følger en $normal\,(x^3 - x, x)$ fordeling.

Spm: Hvad er middelværdien $\mathsf{E}(Y)$ af Y?

Svar:

Betinget forventning

Man har den ligefordelte ([0;1]) kontinuerte stokastiske variabel X, og den stokastiske variabel Y, der givet $X = x$, følger en $normal\,(x^3 - x, x)$ fordeling.

Spm: Hvad er middelværdien $\mathsf{E}(Y)$ af Y?

Svar: Vi har $\mathsf{E}(Y|X = x) = x^3 - x$ så

Betinget forventning

Man har den ligefordelte ([0;1]) kontinuerte stokastiske variabel X, og den stokastiske variabel Y, der givet $X = x$, følger en $normal\,(x^3 - x, x)$ fordeling.

Spm: Hvad er middelværdien $\mathsf{E}(Y)$ af Y?

Svar: Vi har $\mathsf{E}(Y|X = x) = x^3 - x$ så $\mathsf{E}(Y|X) = X^3 - X$

Betinget forventning

Man har den ligefordelte ([0;1]) kontinuerte stokastiske variabel X, og den stokastiske variabel Y, der givet $X = x$, følger en $normal\,(x^3 - x, x)$ fordeling.

Spm: Hvad er middelværdien $\mathsf{E}(Y)$ af Y?

Svar: Vi har $\mathsf{E}(Y|X = x) = x^3 - x$ så $\mathsf{E}(Y|X) = X^3 - X$

$$\mathsf{E}(Y)$$

Betinget forventning

Man har den ligefordelte ([0;1]) kontinuerte stokastiske variabel X, og den stokastiske variabel Y, der givet $X = x$, følger en $normal\,(x^3 - x, x)$ fordeling.

Spm: Hvad er middelværdien $\mathsf{E}(Y)$ af Y?

Svar: Vi har $\mathsf{E}(Y|X = x) = x^3 - x$ så $\mathsf{E}(Y|X) = X^3 - X$

$$\mathsf{E}(Y) = \mathsf{E}(\mathsf{E}(Y|X))$$

Betinget forventning

Man har den ligefordelte ([0;1]) kontinuerte stokastiske variabel X, og den stokastiske variabel Y, der givet $X = x$, følger en $normal\,(x^3 - x, x)$ fordeling.

Spm: Hvad er middelværdien $\mathsf{E}(Y)$ af Y?

Svar: Vi har $\mathsf{E}(Y|X = x) = x^3 - x$ så $\mathsf{E}(Y|X) = X^3 - X$

$$\mathsf{E}(Y) = \mathsf{E}(\mathsf{E}(Y|X)) = \mathsf{E}(X^3 - X)$$

Betinget forventning

Man har den ligefordelte ([0;1]) kontinuerte stokastiske variabel X, og den stokastiske variabel Y, der givet $X = x$, følger en $normal\,(x^3 - x, x)$ fordeling.

Spm: Hvad er middelværdien $\mathsf{E}(Y)$ af Y?

Svar: Vi har $\mathsf{E}(Y|X = x) = x^3 - x$ så $\mathsf{E}(Y|X) = X^3 - X$

$$\mathsf{E}(Y) = \mathsf{E}(\mathsf{E}(Y|X)) = \mathsf{E}(X^3 - X) = \frac{1}{4} - \frac{1}{2}$$

Betinget forventning

Man har den ligefordelte ([0;1]) kontinuerte stokastiske variabel X, og den stokastiske variabel Y, der givet $X = x$, følger en $normal\,(x^3 - x, x)$ fordeling.

Spm: Hvad er middelværdien $\mathsf{E}(Y)$ af Y?

Svar: Vi har $\mathsf{E}(Y|X = x) = x^3 - x$ så $\mathsf{E}(Y|X) = X^3 - X$

$$\mathsf{E}(Y) = \mathsf{E}(\mathsf{E}(Y|X)) = \mathsf{E}(X^3 - X) = \frac{1}{4} - \frac{1}{2} = -\frac{1}{4}$$

Antag at (X, Y) er ligefordelt over området $\{(x, y) \in \mathbf{R} \times \mathbf{R} : 0 < |y| < x < 1\}$.

Spørgsmål 3

Den betingede forventning af X givet Y $\mathsf{E}(X|Y = y)$ findes til

1 ☐ $\frac{1}{2}$

2 ☐ $\frac{1+2|y|}{1+|y|}$

3 ☐ $\frac{1}{2(1-|y|)}$

4 ☐ $\frac{1+|y|}{2}$

5 ☐ $\frac{1+|y|}{1-|y|}$

6 ☐ Ved ikke

Kontinuerte og diskrete variable

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er E(Y)?

Svar:

Kontinuerte og diskrete variable

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er E(Y)?

Svar: Vi kan benytte resultatet fra før,

Kontinuerte og diskrete variable

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er E(Y)?

Svar: Vi kan benytte resultatet fra før, at Y følger en negativ binomialfordeling.

Kontinuerte og diskrete variable

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er $\mathsf{E}(Y)$?

Svar: Vi kan benytte resultatet fra før, at Y følger en negativ binomialfordeling. Eller:

$$\mathsf{E}(Y|X)$$

Kontinuerte og diskrete variable

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er E(Y)?

Svar: Vi kan benytte resultatet fra før, at Y følger en negativ binomialfordeling. Eller:

$$\mathsf{E}(Y|X) = X, \text{ så } \mathsf{E}(Y)$$

Kontinuerte og diskrete variable

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er E(Y)?

Svar: Vi kan benytte resultatet fra før, at Y følger en negativ binomialfordeling. Eller:

$$\mathsf{E}(Y|X) = X, \text{ så } \mathsf{E}(Y) = \mathsf{E}(\mathsf{E}(Y|X))$$

Kontinuerte og diskrete variable

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er $\mathsf{E}(Y)$?

Svar: Vi kan benytte resultatet fra før, at Y følger en negativ binomialfordeling. Eller:

$$\mathsf{E}(Y|X) = X, \text{ så } \mathsf{E}(Y) = \mathsf{E}(\mathsf{E}(Y|X)) = \mathsf{E}(X)$$

Kontinuerte og diskrete variable

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er $\mathsf{E}(Y)$?

Svar: Vi kan benytte resultatet fra før, at Y følger en negativ binomialfordeling. Eller:

$$\mathsf{E}(Y|X) = X, \text{ så } \mathsf{E}(Y) = \mathsf{E}(\mathsf{E}(Y|X)) = \mathsf{E}(X) = \frac{2}{\lambda}$$

Kontinuerte og diskrete variable

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er E(Y)?

Svar: Vi kan benytte resultatet fra før, at Y følger en negativ binomialfordeling. Eller:

$$\mathsf{E}(Y|X) = X, \text{ så } \mathsf{E}(Y) = \mathsf{E}(\mathsf{E}(Y|X)) = \mathsf{E}(X) = \frac{2}{\lambda}$$

Ved det sidste lighedstegn har vi udnyttet, at X følger en $gamma(2, \lambda)$ fordeling.

Kontinuerte og diskrete variable

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er $\mathsf{E}(Y)$?

Svar: Vi kan benytte resultatet fra før, at Y følger en negativ binomialfordeling. Eller:

$$\mathsf{E}(Y|X) = X, \text{ så } \mathsf{E}(Y) = \mathsf{E}(\mathsf{E}(Y|X)) = \mathsf{E}(X) = \frac{2}{\lambda}$$

Ved det sidste lighedstegn har vi udnyttet, at X følger en $gamma(2, \lambda)$ fordeling. Som kontrol kan vi beregne middelværdien i den negative binomialfordeling

$$\mathsf{E}(Y) = \frac{2q}{p}$$

Kontinuerte og diskrete variable

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er $\mathsf{E}(Y)$?

Svar: Vi kan benytte resultatet fra før, at Y følger en negativ binomialfordeling. Eller:

$$\mathsf{E}(Y|X) = X, \text{ så } \mathsf{E}(Y) = \mathsf{E}(\mathsf{E}(Y|X)) = \mathsf{E}(X) = \frac{2}{\lambda}$$

Ved det sidste lighedstegn har vi udnyttet, at X følger en $gamma(2, \lambda)$ fordeling. Som kontrol kan vi beregne middelværdien i den negative binomialfordeling

$$\mathsf{E}(Y) = \frac{2q}{p} = \frac{2\frac{1}{\lambda+1}}{\frac{\lambda}{\lambda+1}}$$

Kontinuerte og diskrete variable

Man har den stokastiske variabel $X \geq 0$ med tæthed $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}$ samt den betingede fordeling af Y givet $X = x$, der er Poisson(x).

Spm: Hvad er E(Y)?

Svar: Vi kan benytte resultatet fra før, at Y følger en negativ binomialfordeling. Eller:

$$\mathsf{E}(Y|X) = X, \text{ så } \mathsf{E}(Y) = \mathsf{E}(\mathsf{E}(Y|X)) = \mathsf{E}(X) = \frac{2}{\lambda}$$

Ved det sidste lighedstegn har vi udnyttet, at X følger en $gamma(2, \lambda)$ fordeling. Som kontrol kan vi beregne middelværdien i den negative binomialfordeling

$$\mathsf{E}(Y) = \frac{2q}{p} = \frac{2\frac{1}{\lambda+1}}{\frac{\lambda}{\lambda+1}} = \frac{2}{\lambda}$$

Nøgletal for fordelinger

Nøgletal for fordelinger

- Vi har middelværdi og varians som nøgletal for marginale fordelinger $f_X(x)$ og $f_Y(y)$.

Nøgletal for fordelinger

- Vi har middelværdi og varians som nøgletal for marginale fordelinger $f_X(x)$ og $f_Y(y)$.
  - Mål for fordelingens placering og variation,

Nøgletal for fordelinger

- Vi har middelværdi og varians som nøgletal for marginale fordelinger $f_X(x)$ og $f_Y(y)$.
  - Mål for fordelingens placering og variation, med varierende informationsindhold.

Nøgletal for fordelinger

- Vi har middelværdi og varians som nøgletal for marginale fordelinger $f_X(x)$ og $f_Y(y)$.
  - Mål for fordelingens placering og variation, med varierende informationsindhold.
- Kovarians, korrelation er et tilsvarende første mål for en eventuel sammenhæng/afhængighed af to variable.

Kovarians/korellation

$$\mathsf{Cov}(X,Y) = \mathsf{E}[(X-\mathsf{E}(X))(Y-\mathsf{E}(Y))] = \mathsf{E}(XY) - \mathsf{E}(X)\mathsf{E}(Y)$$

Kovarians/korellation

$$\text{Cov}(X,Y) = \mathsf{E}[(X - \mathsf{E}(X))(Y - \mathsf{E}(Y))] = \mathsf{E}(XY) - \mathsf{E}(X)\mathsf{E}(Y)$$

- hvor (for kontinuerte variable)

$$\mathsf{E}(XY) = \int_x \int_y x \cdot y f(x,y) \mathsf{d}y \mathsf{d}x$$

Kovarians/korellation

$$\text{Cov}(X,Y) = \text{E}[(X - \text{E}(X))(Y - \text{E}(Y))] = \text{E}(XY) - \text{E}(X)\text{E}(Y)$$

- hvor (for kontinuerte variable)

$$\text{E}(XY) = \int_x \int_y x \cdot y f(x,y) \text{d}y \text{d}x$$

- Generel regel for varians af sum

$$\text{Var}(X+Y) = \text{Var}(X) + \text{Var}(Y) + 2\text{Cov}(X,Y)$$

$$Corr(X,Y) = \frac{\text{Cov}(X,Y)}{\text{SD}(X)\text{SD}(Y)}$$

Kovarians/korellation

$$\text{Cov}(X, Y) = \text{E}[(X - \text{E}(X))(Y - \text{E}(Y))] = \text{E}(XY) - \text{E}(X)\text{E}(Y)$$

- hvor (for kontinuerte variable)

$$\text{E}(XY) = \int_x \int_y x \cdot y f(x, y) \text{d}y \text{d}x$$

- Generel regel for varians af sum

$$\text{Var}(X + Y) = \text{Var}(X) + \text{Var}(Y) + 2\text{Cov}(X, Y)$$

$$Corr(X, Y) = \frac{\text{Cov}(X, Y)}{\text{SD}(X)\text{SD}(Y)}$$

- En slags mål for afhængigheden mellem X og Y

Relative andele

Antal beboere	0	1	2	3	4	5	6
1 værelse	0.011	0.085	0.007	0.001	0.000	0.000	0.000
2 værelser	0.017	0.264	0.096	0.014	0.003	0.001	0.001
3 værelser	0.009	0.112	0.104	0.032	0.013	0.003	0.002
4 værelser	0.005	0.044	0.052	0.023	0.016	0.004	0.002
5 værelser	0.002	0.010	0.016	0.009	0.007	0.002	0.001
6 værelser	0.002	0.006	0.010	0.006	0.006	0.002	0.002

$$\mathsf{E}(XY) = 1 \cdot 1 \cdot 0.085 + 1 \cdot 2 \cdot 0.007 + \cdots + 6 \cdot 6 \cdot 0.002 = 4.9711$$

$$\mathsf{E}(XY) = 1 \cdot 1 \cdot 0.085 + 1 \cdot 2 \cdot 0.007 + \cdots + 6 \cdot 6 \cdot 0.002 = 4.9711$$

- For korrelationskoefficienten finder vi

$$Corr(X,Y) = \frac{\mathsf{E}(XY) - \mathsf{E}(X)\mathsf{E}(Y)}{\mathsf{SD}(X)\mathsf{SD}(Y)} = 0.4257$$

Positiv/negativ afhængighed

Positiv/negativ afhængighed

- For to hændelser A og B har vi defineret

Positiv/negativ afhængighed

- For to hændelser A og B har vi defineret uafhægighed, hvis $\mathsf{P}(A|B)$

Positiv/negativ afhængighed

- For to hændelser A og B har vi defineret uafhægighed, hvis $\mathsf{P}(A|B) = \mathsf{P}(A|B^c)$

Positiv/negativ afhængighed

- For to hændelser A og B har vi defineret uafhægighed, hvis $\mathsf{P}(A|B) = \mathsf{P}(A|B^c) = \mathsf{P}(A)$, der er ensbetydende med $\mathsf{P}(A \cap B) = \mathsf{P}(A)\mathsf{P}(B)$.

Positiv/negativ afhængighed

- For to hændelser A og B har vi defineret uafhægighed, hvis $\mathsf{P}(A|B) = \mathsf{P}(A|B^c) = \mathsf{P}(A)$, der er ensbetydende med $\mathsf{P}(A \cap B) = \mathsf{P}(A)\mathsf{P}(B)$.
- Når dette ikke er tilfældet, kan vi have $\mathsf{P}(A \cap B) > \mathsf{P}(A)\mathsf{P}(B)$

Positiv/negativ afhængighed

- For to hændelser A og B har vi defineret uafhægighed, hvis $\mathsf{P}(A|B) = \mathsf{P}(A|B^c) = \mathsf{P}(A)$, der er ensbetydende med $\mathsf{P}(A \cap B) = \mathsf{P}(A)\mathsf{P}(B)$.
- Når dette ikke er tilfældet, kan vi have $\mathsf{P}(A \cap B) > \mathsf{P}(A)\mathsf{P}(B)$ positiv afhængighed,

Positiv/negativ afhængighed

- For to hændelser A og B har vi defineret uafhægighed, hvis $\mathsf{P}(A|B) = \mathsf{P}(A|B^c) = \mathsf{P}(A)$, der er ensbetydende med $\mathsf{P}(A \cap B) = \mathsf{P}(A)\mathsf{P}(B)$.
- Når dette ikke er tilfældet, kan vi have $\mathsf{P}(A \cap B) > \mathsf{P}(A)\mathsf{P}(B)$ positiv afhængighed, eller $\mathsf{P}(A \cap B) < \mathsf{P}(A)\mathsf{P}(B)$

Positiv/negativ afhængighed

- For to hændelser A og B har vi defineret uafhægighed, hvis $\mathsf{P}(A|B) = \mathsf{P}(A|B^c) = \mathsf{P}(A)$, der er ensbetydende med $\mathsf{P}(A \cap B) = \mathsf{P}(A)\mathsf{P}(B)$.
- Når dette ikke er tilfældet, kan vi have $\mathsf{P}(A \cap B) > \mathsf{P}(A)\mathsf{P}(B)$ positiv afhængighed, eller $\mathsf{P}(A \cap B) < \mathsf{P}(A)\mathsf{P}(B)$ negativ afhængighed.

Positiv/negativ afhængighed

- For to hændelser A og B har vi defineret uafhægighed, hvis $\mathsf{P}(A|B) = \mathsf{P}(A|B^c) = \mathsf{P}(A)$, der er ensbetydende med $\mathsf{P}(A \cap B) = \mathsf{P}(A)\mathsf{P}(B)$.
- Når dette ikke er tilfældet, kan vi have $\mathsf{P}(A \cap B) > \mathsf{P}(A)\mathsf{P}(B)$ positiv afhængighed, eller $\mathsf{P}(A \cap B) < \mathsf{P}(A)\mathsf{P}(B)$ negativ afhængighed.
- Sammenhæng med correlationskoefficienten for indikatorvariablene I_A og I_B.

Man har de to hændelser A og B, således at $\mathsf{P}(A) = 0.3$ $\mathsf{P}(B) = 0.4$ og $\mathsf{P}(A \cup B) = 0.5$.

Spørgsmål 4

Hændelserne A og B er

1 ☐ Positivt afhængige

2 ☐ Uafhængige

3 ☐ Negativt afhængige

4 ☐ A afhænger af B, medens B er uafhængig af A

5 ☐ A og B er gensidigt udelukkende.

6 ☐ Ved ikke

Bilinearitet af kovariansen

$$\mathsf{Var}\left(\sum_{k=1}^{N} X_k\right) = \sum_{k=1}^{n} \mathsf{Var}(X_k) + 2\sum_{1\leq j<k\leq n} \mathsf{Cov}(X_j, X_k)$$

$$\mathsf{Cov}\left(\sum_{i=1}^{n} a_i X_i, \sum_{j=1}^{m} b_j Y_j\right) = \sum_{i=1}^{n}\sum_{j=1}^{m} a_i b_j \mathsf{Cov}(X_i, Y_j)$$

Bilinearitet af kovariansen

$$\text{Var}\left(\sum_{k=1}^{N} X_k\right) = \sum_{k=1}^{n} \text{Var}(X_k) + 2 \sum_{1 \le j < k \le n} \text{Cov}(X_j, X_k)$$

$$\text{Cov}\left(\sum_{i=1}^{n} a_i X_i, \sum_{j=1}^{m} b_j Y_j\right) = \sum_{i=1}^{n} \sum_{j=1}^{m} a_i b_j \text{Cov}(X_i, Y_j)$$

- Bemærk iøvrigt: $\text{Cov}(X, X) = \text{Var}(X)$

Bilinearitet af kovariansen

$$\mathsf{Var}\left(\sum_{k=1}^{N} X_k\right) = \sum_{k=1}^{n} \mathsf{Var}(X_k) + 2 \sum_{1\leq j<k\leq n} \mathsf{Cov}(X_j, X_k)$$

$$\mathsf{Cov}\left(\sum_{i=1}^{n} a_i X_i, \sum_{j=1}^{m} b_j Y_j\right) = \sum_{i=1}^{n}\sum_{j=1}^{m} a_i b_j \mathsf{Cov}(X_i, Y_j)$$

- Bemærk iøvrigt: $\mathsf{Cov}(X, X) = \mathsf{Var}(X)$
- Kovariansen kan ses som en generalisering af variansen

Man har de to hændelser A og B, således at $\mathsf{P}(A) = 0.3$ $\mathsf{P}(B) = 0.4$ og $\mathsf{P}(A \cup B) = 0.5$. Lad nu $X = I_A$ og $Y = I_B$, hvor I_C er indikatorfunktionen for hændelsen C.

Spørgsmål 5

Kovariansen $\mathsf{Cov}(X, Y)$ mellem X og Y findes til

1 ☐ -0.16

2 ☐ 0

3 ☐ 0.04

4 ☐ 0.08

5 ☐ 0.16

6 ☐ Ved ikke

Afsnit 6.3 og 6.4

- Betingede kontinuerte fordelinger $f(y|X=x) = \frac{f(x,y)}{f_X(x)}$
- Integralformel for gennemsnit af betingede sandsynligheder $P(A) = \int P(A|X=x) f_X(x) \mathrm{d}x$
- Betinget forventning $\mathsf{E}(Y) = \mathsf{E}(\mathsf{E}(Y|X))$
- Kovarians/korellation

$$Cov(X,Y) = \mathsf{E}[(X-\mathsf{E}(X))(Y-\mathsf{E}(Y))] = \mathsf{E}(XY) - \mathsf{E}(X)\mathsf{E}(Y)$$

$$Corr(X,Y) = \frac{\mathsf{Cov}(X,Y)}{\mathsf{SD}(X)\mathsf{SD}(Y)}$$

- (X,Y) uafhængige $\Rightarrow Corr(X,Y) = 0$
- Varians af sum af variable $\mathsf{Var}\left(\sum_{k=1}^{N} X_k\right) = \sum_{k=1}^{n} \mathsf{Var}(X_k) + 2\sum_{1\le j<k\le n} \mathsf{Cov}(X_j, X_k)$
- Bilinearitet af kovariansen $\mathsf{Cov}\left(\sum_{i=1}^{n} a_i X_i, \sum_{j=1}^{m} b_j Y_j\right) = \sum_{i=1}^{n} \sum_{j=1}^{m} a_i b_j \mathsf{Cov}(X_i, Y_j)$