יסודות ההסתברות

פרק 43 - קונבולוציה - התפלגות סכום משתנים בלתי תלויים

תוכן העניינים

1. קונבולוציה - התפלגות סכום משתנים בלתי תלויים..... 1

קונבולוציה – התפלגות סכום משתנים בלתי תלויים:

רקע:

יהיו X ו- Y שני משתנים מקריים בלתי תלויים ונתעניין בהתפלגות סכומם:
$T = X + Y$ - שגם הוא משתנה מקרי.
אם מדובר במשתנים מקריים רציפים עם פונקציות צפיפות f_X ו- f_Y , פונקציית הצפיפות של $T = X + Y$, תינתן על ידי נוסחת הקונבולוציה הבאה:

$$f_{X+Y}(t) = \int_{-\infty}^{\infty} f_X(t-y) \cdot f_Y(y)\,dy \ .$$

דוגמה (פתרון בהקלטה):

נתון: $X \sim \exp(1)$ וכן: $Y \sim \exp(2)$. מצאו את פונקציית הצפיפות של: $T = X + Y$.

© כל הזכויות שמורות לברק קנדל

שאלות:

1) נתון ש-$Y, X \sim \exp(\lambda)$. כמו כן ידוע ש- X ו- Y בלתי תלויים.
מצאו את פונקציית הצפיפות של $X+Y$.

2) נתון ש- X ו- Y משתנים בלתי תלויים המתפלגים נורמלית סטנדרטית.
הוכיחו ש- $T = X+Y$ מתפלג נורמלית עם תוחלת 0 ושונות 2.

3) סוללה מסוג A בעלת אורך חיים המתפלג אחיד בין 1 ל-3 שעות.
כמו כן נתונה סוללה מסוג B בעלת אורח חיים המתפלג מעריכית עם תוחלת חיים של שעה. מכשיר מופעל על ידי סוללה A וברגע שהסוללה מתרוקנת אוטומטית מופעלת סוללה B. נסמן ב- Z את הזמן הכולל של פעילות המכשיר.

א. מצאו את פונקציית הצפיפות של Z.

ב. מה הסיכוי שהמכשיר יפעל פחות מ-4 שעות?

4) X ו- Y משתנים מקריים רציפים ובלתי תלויים בעלי פונקציות הצפיפות

הבאות: $-2 \le x \le 2$ $\quad f_X(x) = \frac{1}{4}$, $f_Y(y) = \begin{cases} y+1 & -1 \le y \le 0 \\ 1-y & 0 \le y \le 1 \\ 0 & else \end{cases}$.

מצאו את פונקציית הצפיפות של $X+Y$.

5) יהיו X ו- Y משתנים מקריים רציפים ובלתי תלויים בעלי התפלגות אחידה: $X \sim U(2,3)$ $Y \sim U(1,5)$.

א. מהי ההתפלגות של סכום המשתנים הללו?

ב. מה הרבעון העליון של סכום המשתנים?

6) יהיו X , Y ו- Z מתפלגים אחיד רציף באופן בלתי תלוי בין 0 ל- 1.
מצאו את פונקציית הצפיפות של: $X+Y+Z$.

7) הוכיחו את נוסחת הקונבולוציה עבור המקרה הרציף.
(רמז: היעזרו בפונקציית הצפיפות המשותפת ובהגדרה של משתנים מקריים רציפים בלתי תלויים).

© כל הזכויות שמורות לברק קנדל

תשובות סופיות:

1) $t \ge 0 \qquad f_T(t) = \lambda^2 \cdot e^{-\lambda t} \cdot t$.

2) שאלת הוכחה.

3) א. $f_z(z) = \begin{cases} \frac{1}{2}\left(1-e^{1-z}\right) & 1 \le z \le 3 \\ \frac{1}{2}\left(e^{3-z}-e^{1-z}\right) & z > 3 \\ 0 & else \end{cases}$. ב. 0.841.

4) $f_T(t) = \begin{cases} \frac{1}{8}(t+3)^2 & -3 \le t \le -2 \\ \frac{1}{8}\left(2-(t+1)^2\right) & -2 < t < -1 \\ \frac{1}{4} & -1 \le t \le 1 \\ \frac{1}{8}\left(2-(t-1)^2\right) & 1 < t < 2 \\ \frac{1}{8}(t-3)^2 & 2 \le t \le 3 \\ 0 & else \end{cases}$.

5) א. $f_T(t) = \begin{cases} \frac{t-3}{4} & 3 \le t \le 4 \\ \frac{1}{4} & 4 < t > 7 \\ \frac{8-t}{4} & 7 \le t \le 8 \end{cases}$ ב. 4.5.

6) $f_W(w) = \begin{cases} \frac{w^2}{2} & 0 \le w \le 1 \\ -w^2+3w-1.5 & 1 < w < 2 \\ \frac{(3-w)^2}{2} & 2 \le w \le 3 \end{cases}$.

7) שאלת הוכחה.

© כל הזכויות שמורות לברק קנדל