

סטטיסטיקה אקטוארית

פרק 15 - תהליך פואסוני

תוכן העניינים

1. התפלגות סכום התפלגויות פואסוניות בלתי תלויות. 1
2. התפלגות מותנית בסכום התפלגויות פואסוניות בלתי תלויות. 5
3. הקשר בין התפלגות פואסונית להתפלגות מעריכית. 9

התפלגות סכום התפלגויות פואסוניות בלתי תלויות:

רקע:

קיימות n התפלגויות פואסוניות בלתי תלויות זו בזו: $i=1,2,\dots,n$, $X_i \sim P(\lambda_i)$.

ניצור משתנה מקרי חדש שהוא סכום של n ההתפלגויות הללו: $\sum_{i=1}^n X_i$.

משתנה חדש זה מתפלג גם הוא פואסוני עם פרמטר: $\lambda = \sum_{i=1}^n \lambda_i$.

לסיכום, אם: $i=1,2,\dots,n$, $X_i \sim P(\lambda_i)$ והמשתנים בלתי תלויים זה בזה,

אז מתקיים: $\sum_{i=1}^n X_i \sim P\left(\sum_{i=1}^n \lambda_i\right)$.

דוגמה (פתרון בהקלטה):

מפעל ממתקים מייצר סוכריות ג'לי בזרם פואסוני. הסוכריות נוצרות בצבעים כתום, ירוק, אדום וסגול. להלן טבלה אשר מציגה את תוחלת מספר הסוכריות שנוצרות בכל אחד מהצבעים בשניית ייצור במפעל. מספר הסוכריות שנוצרות בשנייה כלשהי בכל אחד מהצבעים בלתי תלוי במספר הסוכריות בצבעים האחרים.

צבע	תוחלת
כתום	4
ירוק	3
אדום	3
סגול	2

א. מה ההסתברות שבשנייה כלשהי ייווצרו בדיוק 14 סוכריות ג'לי במפעל?

ב. מה ההתפלגות של מספר סוכריות הג'לי שמיוצרות בדקה כלשהי במפעל?

ג. מה ההסתברות שבשנייה כלשהי המפעל ייצר 3 סוכריות כתומות

ו-8 סוכריות בצבעים אחרים?

תשובה :



$$. P(T = 14) = e^{-12} \cdot \frac{12^{14}}{14!} = 0.0905 \quad \text{א.}$$

$$. \sum_{j=1}^{60} T_j \sim P(12 \cdot 60 = 720) , \quad j \quad \text{ב.} \quad T_j \sim P(12) \quad \text{מספר סוכריות שמיוצרות בשנייה}$$

$$. P(X_1 = 4 \cap T = 8) - P(X_1 = 4 \cap \sum_{i=2}^4 X_i = 4) = P(X_1 = 4) \cdot P\left(\sum_{i=2}^4 X_i = 4\right) = \frac{e^{-4} \cdot 4^4}{4!} \cdot \frac{e^{-8} \cdot 8^4}{4!} = 0.0112 \quad \text{ג.}$$

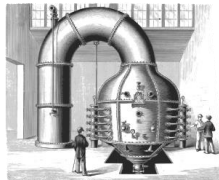
שאלות:

- (1) איזבלה היא רשת של חנויות בגדים. לרשת שלוש חנויות שהרכישות בהן נעשות בזרם פואסוני. בחנות A קצב הרכישות הוא 1 ל-10 דקות, בחנות B קצב הרכישות הוא 1 לשעה, ובחנות C קצב הרכישות הוא 2 לרבע שעה. אין תלות בין מספרי הרכישות בחנויות הרשת השונות.



- א. מהי התוחלת ומהי סטיית התקן של מספר הרכישות בכלל חנויות הרשת בשעה?
 ב. מה ההסתברות שבשעה כלשהי מספר הרכישות בחנויות הרשת יהיה לכל היותר 5?

- (2) במפעל פועלות שתי מכונות. מספר התקלות במכונה א' מתפלג פואסוני עם תוחלת של 2 תקלות ליום, ומספר התקלות במכונה ב' מתפלג פואסוני עם תוחלת של תקלה אחת ביום.



- מספרי התקלות במכונות השונות בלתי תלויים זה בזה.
 א. מה ההתפלגות של מספר התקלות במפעל ביום?
 ב. מה ההסתברות שביומיים מסוימים כלל לא יהיו תקלות במפעל?
 ג. מה ההסתברות שביומיים מסוימים יהיו במפעל בדיוק 5 תקלות, שמהן בדיוק 3 תקלות במכונה א'?

- (3) נתון ש- $X_i \sim P(1)$, $i=1,2,3$ והמשתנים בלתי תלויים זה בזה.

$$Y = \sum_{i=1}^3 X_i \text{ : גודר את } Y \text{ באופן הבא:}$$

- א. מהי התוחלת ומהי השונות של Y ?
 ב. חשבו את: $E|Y-2|$.

- (4) לצומת נכנסות מכוניות מ-3 כיוונים שונים. מספר המכוניות הנכנסות מכיוון i הוא משתנה מקרי שמתפלג פואסוני עם פרמטר i מכוניות לשעה כש- $i=1,2,3$. אין תלות בין מספרי המכוניות המגיעות לצומת מכיוונים שונים. W הוא משתנה מקרי שמייצג את מספר המכוניות המגיעות לצומת בשעה משלושת הכיוונים יחד.



- א. חשבו את: $P(W=k|W>0)$, $k=1,2,3,\dots$.
 ב. חשבו את: $E\left(\frac{1}{1+W}\right)$.

(5) ענו על הסעיפים הבאים :

א. הוכיחו שאם : $X_1 \sim P(\lambda_1)$ ו- $X_2 \sim P(\lambda_2)$ והמשתנים בלתי תלויים זה

בזה, אז מתקיים : $X_1 + X_2 \sim P(\lambda_1 + \lambda_2)$.

ב. הוכיחו שאם : $X_i \sim P(\lambda_i)$, $i=1,2,\dots,n$ והמשתנים בלתי תלויים זה

בזה, אז מתקיים : $\sum_{i=1}^n X_i \sim P\left(\sum_{i=1}^n \lambda_i\right)$.

תשובות סופיות:

(1) א. תוחלת: 15, סטיית תקן: $\sqrt{15}$. ב. 0.0028.

(2) א. פואסונית עם פרמטר 3. ב. 0.0025. ג. 0.0529.

(3) א. תוחלת: 3, שונות: 3. ב. $1 + \frac{10}{e^3}$.

(4) א. $\frac{e^{-6} \cdot 6^k}{k! (1 - e^{-6})}$. ב. $\frac{e^{-6} \cdot (e^6 - 1)}{6}$.

(5) שאלת הוכחה.

התפלגות מותנית בסכום התפלגויות פואסוניות בלתי תלויות:

רקע:

אם X ו- Y הם משתנים מקריים בלתי-תלויים המתפלגים פואסוני עם הפרמטרים λ_1 ו- λ_2 בהתאמה, אז ההתפלגות של המשתנה המקרי המותנה X

בהינתן $X + Y = n$ היא בינומית עם הפרמטרים n ו- $\frac{\lambda_1}{\lambda_1 + \lambda_2}$.

דוגמה:



מספר בני האדם הנכנסים לבית קפה מסוים בשעה מתפלג פואסוני עם ממוצע 6. מספר הכלבים הנכנסים לבית הקפה בשעה מתפלג פואסוני עם שונות 1. נניח שאין תלות בין השניים. מה הסיכוי שבשעה האחרונה נכנסו לבית הקפה בדיוק שני כלבים, אם ידוע שבסך הכול נכנסו שבעה בני אדם וכלבים?

תשובה:

$X \sim P(\lambda_1 = 1)$ - מספר הכלבים הנכנסים בשעה.

$Y \sim P(\lambda_2 = 6)$ - מספר בני האדם הנכנסים בשעה.

X, Y ב"ת.

$$X \sim P(\lambda_1)$$

$$Y \sim P(\lambda_2)$$

$\Downarrow$

$$X | X + Y = n \sim B\left(n, \frac{\lambda_1}{\lambda_1 + \lambda_2}\right)$$

$$X | X + Y = 7 \sim B\left(7, \frac{1}{7}\right)$$

$$P(X = 2 | X + Y = 7) = \binom{7}{2} \cdot \left(\frac{1}{7}\right)^2 \cdot \left(\frac{6}{7}\right)^5 = 0.1983$$

שאלות:

- 1) מספר הפסקות החשמל היוזמות במפעל זורקס מתפלג פואסוני עם תוחלת של 2 בחודש. מספר הפסקות החשמל הלא-יוזמות במפעל מתפלג פואסוני עם תוחלת של 3 בחודש. מספר הימים בחודש כלשהו זניח. אין תלות בין מספר ההפסקות היוזמות למספר ההפסקות שאינן יוזמות.



א. מה הסיכוי שברבעון הראשון של השנה יהיו בדיוק 5 הפסקות חשמל במפעל וגם שבחודש ינואר של אותה שנה תהיה בדיוק הפסקה אחת?

ב. מהי התוחלת של מספר החודשים שיעברו מינואר 2020 ועד החודש הראשון שבו לא יהיו כלל הפסקות חשמל?

ג. אם בחודש מרץ הבא יהיו בדיוק 6 הפסקות חשמל במפעל זורקס, מה התוחלת של מספר ההפסקות היוזמות שיהיו באותו החודש?

- 2) מספר המכירות המתרחשות בשעה בחנות הצעצועים טויזים מתפלג פואסוני עם תוחלת של 6 בשעה. החנות פתוחה בכל יום במשך שמונה שעות, מהשעה 11:00.



א. מה ההסתברות שבשעה מסוימת יהיו לפחות 3 מכירות בחנות הצעצועים טויזים?

ב. מה ההסתברות שבשעה הראשונה שלאחר פתיחת החנות יהיו 4 מכירות, אם באותו היום יהיו בסך הכול 50 מכירות?

ג. בכל יום מנהל החנות מקבל דוח ובו פירוט של מספר הרכישות שהיו בכל שעה שלמה מאז פתיחת החנות. מה ההסתברות שמחר, מתוך שמונה השעות שבהן החנות פתוחה, תהיה בדיוק שעה אחת שבה יהיו בדיוק 5 רכישות?

- 3) מספר הגברים המגיעים לטיפול בחדר המיון של בית החולים סורוקה מתפלג פואסוני בקצב של 2 לשעה. מספר הנשים המגיעות לטיפול באותו חדר מיון מתפלג פואסוני בקצב של 1 לשעה. אין תלות בין מספר הגברים המגיעים לחדר המיון ובין מספר הנשים המגיעות אליו.



א. מה ההסתברות שבשעה מסוימת יגיע לפחות אדם אחד לטיפול בחדר המיון של בית החולים סורוקה?

ב. אם בשעה מסוימת הגיעו לטיפול בחדר המיון של בית החולים סורוקה בדיוק 5 אנשים, מה ההסתברות שמתוכם יש בדיוק 2 נשים?

ג. אם ביממה מסוימת הגיעו לטיפול בחדר המיון של בית החולים סורוקה בדיוק 60 אנשים, מהי השונות של מספר הגברים שהגיעו לטיפול בחדר המיון באותה היממה?

(4) בסניף דואר מסוים יש שלושה אשנבים (1, 2 ו-3). מספר האנשים הפונים לאשנב 1 במשך דקה הוא משתנה מקרי המתפלג פואסוני עם הפרמטר 2, מספר האנשים הפונים לאשנב 2 במשך דקה הוא משתנה מקרי המתפלג פואסוני עם הפרמטר 3, ומספר האנשים הפונים לאשנב 3 במשך דקה הוא משתנה מקרי המתפלג פואסוני עם הפרמטר 4.



אין תלות בין מספרי האנשים הנכנסים לסניף בדקות שונות, ואין תלות בין מספרי האנשים שפונים לאשנבים השונים. כל אדם שנכנס לסניף הדואר פונה בהכרח לאחד מן האשנבים.

א. מהי ההסתברות שבין 8:00 ל-8:01 ייכנסו תשעה אנשים לסניף הדואר?

ב. אם ידוע שבין 8:00 ל-8:01 נכנסו תשעה אנשים לסניף הדואר, מהי ההסתברות ששלושה מהם פנו לאשנב 1?

ג. אם ידוע שבין 8:00 ל-8:01 נכנסו לסניף הדואר שלושה אנשים שפנו לאשנב 1, מהי ההסתברות שבסך הכול נכנסו לסניף הדואר באותה הדקה תשעה אנשים?

(5) הוכיחו את הטענה שאם X ו- Y הם משתנים מקריים בלתי-תלויים המתפלגים פואסוני עם הפרמטרים λ_1 ו- λ_2 בהתאמה, אז ההתפלגות של המשתנה המקרי

המותנה X , בהינתן $X + Y = n$, היא בינומית עם הפרמטרים n ו- $\frac{\lambda_1}{\lambda_1 + \lambda_2}$.

(6) $X_1, X_2, \dots, X_{100}$ הם משתנים מקריים בלתי-תלויים.

נניח כי לכל: $i = 1, \dots, 100$ ההתפלגות של המשתנה המקרי X_i היא פואסונית

עם הפרמטר $\frac{i}{50}$.

א. מצאו את ההתפלגות המותנית של $\sum_{i=1}^{100} X_i$ בתנאי ש: $X_{100} = n$.

ב. מצאו את ההתפלגות המותנית של X_{100} בתנאי ש: $\sum_{i=1}^{100} X_i = n$.

תשובות סופיות:

- (1) א. 0.0946 ב. 148.4 ג. 2.4
- (2) א. 0.938 ב. 0.1209 ג. 0.3772
- (3) א. 0.9502 ב. $\frac{80}{243}$ ג. $13\frac{1}{3}$
- (4) א. 0.1318 ב. 0.2041 ג. 0.149
- (5) שאלה הוכחה.
- (6) א. $k \geq n$ ב. $B\left(n, \frac{2}{101}\right)$ $\frac{e^{-99} \cdot 99^{k-n}}{(k-n)!}$

הקשר בין התפלגות פואסונית להתפלגות מעריכית:

רקע:

אם מספר המופעים ביחידת זמן כלשהי מתפלג פואסונית בקצב λ , אז הזמן החולף מתחילת מרווח הזמן עד להתרחשות המופע הראשון הוא משתנה מקרי שמתפלג מעריכית עם הפרמטר λ לאותה יחידת זמן.

אפשר לומר גם ההפך: אם הזמן החולף מתחילת מרווח זמן מסוים עד למופע הראשון הוא משתנה מקרי שמתפלג מעריכית עם הפרמטר λ ליחידת זמן, אז מספר המופעים ביחידת הזמן מתפלג פואסונית בקצב λ .

דוגמה (פתרון בהקלטה):

בשדה התעופה סכיפהול שבאמסטרדם הזמן החולף בין טיסה נכנסת אחת לזו שאחריה מתפלג מעריכית עם תוחלת של חצי דקה.



א. מה ההתפלגות של מספר הטיסות הנכנסות בדקה?

ב. מה ההתפלגות של מספר הטיסות הנכנסות בשעה?

ג. מה ההסתברות שבדקה כלשהי ייכנסו פחות משתי טיסות לשדה התעופה?

תשובות:

$$E(Y) = \frac{1}{2} = \frac{1}{\lambda} \Rightarrow \lambda = 2$$

$Y \sim \exp(\lambda = 2)$ הזמן בין טיסות נכנסות בדקות.

א. $X \sim P(\lambda = 2)$ מספר הטיסות הנכנסות בדקה.

ב. $W \sim P(\lambda = 2 \cdot 60 = 120)$ מספר הטיסות הנכנסות בשעה.

$$P(X < 2) = P(X \leq 1) = P(X = 0) + P(X = 1) = \frac{e^{-2} \cdot 2^0}{0!} + \frac{e^{-2} \cdot 2^1}{1!}$$

$$e^{-2} + 2e^{-2} = 3e^{-2} = \frac{3}{e^2} = 0.406$$

שאלות:

- (1) מספר המיילים שגל מקבלת ביממה מתפלג פואסוני עם תוחלת של 10 מיילים.



- א. מה ההסתברות שמחר גל תקבל בדיוק 12 מיילים?
 ב. מה תוחלת הזמן שיעבור מהרגע שבו גל תפתח את המחשב ועד שתקבל את המייל הראשון?

- (2) מספר השיעולים בתיאטרון בזמן הצגה מתפלג פואסוני בקצב של שני שיעולים לדקה. משך ההצגה הוא שתיים.



- א. מה התוחלת של מספר הדקות בהצגה שבהן יש לפחות שיעול אחד?
 ב. מה התוחלת של מספר השיעולים בהצגה?
 ג. מה תוחלת הזמן בין שיעול לשיעול בהצגה?

- (3) הזמן בין תקלה אחת לבאה אחריה במערכת חשמלית מתפלג מעריכית עם תוחלת של 50 שעות.



- א. מהו העשירון העליון של הזמן בין תקלה אחת לבאה אחריה במערכת?
 ב. מה ההסתברות שביממה מסוימת יהיו שתי תקלות במערכת?

- (4) מספר הפניות למונית של דוד בשעות הערב הוא משתנה מקרי שמתפלג פואסוני. בממוצע דוד מקבל בשעות הערב פנייה אחת בשתי דקות. משמרת הערב שלו אורכת חמש שעות.



- א. מה ההסתברות שבמשך ארבע דקות כלשהן במשמרת יקבל דוד לפחות שתי פניות?
 ב. אם נכנסת למונית של דוד בשעות הערב, מה ההסתברות שמרגע כניסתך יעברו לפחות חמש דקות עד שתתקבל הפנייה הבאה למונית?
 ג. דוד עובד שש משמרות בשבוע. מה ההסתברות שרק במשמרת אחת בשבוע הוא יקבל בדיוק 12 פניות בין 20:21 ל-21:30?
 ד. נניח שחלפה דקה מאז הפנייה האחרונה למונית ועדיין לא הגיעה אף פנייה נוספת. מה ההסתברות שעד להגעת פנייה נוספת יחלפו עוד שתי דקות לפחות?

- (5) הוכיחו שאם מספר המופעים ליחידת זמן מתפלג פואסוני בקצב λ , אז הזמן החולף מזמן 0 עד למופע הראשון הוא משתנה מקרי שמתפלג מעריכית עם פרמטר λ .

תשובות סופיות:

- (1) א. 0.0948 ב. 0.1
- (2) א. 103.7 ב. 240 ג. 0.5
- (3) א. 115.13 ב. 0.0713
- (4) א. 0.59399 ב. 0.0821 ג. 0.0200 ד. 0.3679
- (5) שאלת הוכחה.