

MAT-02500 Todennäköisyyslaskenta

Tentti 14.10.2014 / Kimmo Vattulainen

- Vastaa jokainen tehtävä eri konseptille.
 - Funktiolaskin sallittu.
-

1.a) Oletetaan, että henkilöiden syntymäpäivät ovat jakautuneet tasaisesti vuoden eri päiville. Millä todennäköisyydellä 200 hengen joukosta ainakin yhdellä on tänään syntymäpäivä?

b) Tiedetään, että $P(A) = 0.60$, $P(B | A) = 0.40$ ja $P(B | \bar{A}) = 0.50$.
Laske $P(A \cup B)$. Voivatko A ja B olla riippumattomia tapahtumia?

2. Henkilön tuli olla 60 minuutin päästä töissä. Hänellä on 3 eri matkustustapaa A , B ja C . Millä tavalla matkustaen henkilö ehtii suurimmalla todennäköisyydellä ajoissa töihin? Muut matkaan kuuluvat ajat (kävelyajat pysäkille ym.) sisältyvät ilmoitettuihin aikoihin.

Tapa A: Bussi kulkee säännöllisesti 30 minuutin välein, mutta henkilö ei tiedä aikataulua. Bussimatka kestää 35 minuuttia.

Tapa B: Taksiasemalle tulee keskimäärin 4 taksia tunnissa. Saapuvien taksien lukumäärä noudattaa Poisson-jakaumaa. Taksimatka kestää 30 minuuttia.

Tapa C: Kävelen matka kestää keskimäärin 50 minuuttia, mutta olosuhteista johtuen aika vaihtelee, varianssin ollessa 100. Kävelyaika oletetaan normaalisti jakautuneeksi.

3. Satunnaisvektorin (X, Y) tiheysfunktio on

$$f(x, y) = x + y, \quad \text{kun } 0 < x < 1, 0 < y < 1$$

- Laske $P(X + Y \geq 1)$
- Laske $E(X + Y)$
- Ovatko X ja Y riippumattomia?

4. Opettaja tietää kokemuksesta, että 25% tenttiin ilmoittautuneista opiskelijoista ei saavu paikalle. Tenttiin on ilmoittautunut 220 opiskelijaa. Laske normaaliapproksimaatiota käyttäen kuinka suuri sali tarvitaan, että kaikki paikalle tulevat saavat 99% :n todennäköisyydellä istumapaikan.

MAT-02500 Todennäköisyyslaskenta, kaavoja ja taulukoita

1. $\binom{n}{k} = \frac{n!}{k!(n-k)!}$
2. $P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A \cap B)$
3. $P\left(\bigcup_{i=1}^n A_i\right) = \sum_{i=1}^n P(A_i) - \sum_{i < j} P(A_i \cap A_j) + \sum_{i < j < k} P(A_i \cap A_j \cap A_k) - \dots + (-1)^{n+1} P\left(\bigcap_{i=1}^n A_i\right)$
4. $P(A | B) = \frac{P(A \cap B)}{P(B)}$
5. $P\left(\bigcap_{i=1}^n A_i\right) = P(A_1)P(A_2 | A_1)P(A_3 | A_1 \cap A_2) \dots P\left(A_n | \bigcap_{i=1}^{n-1} A_i\right)$
6. $P(B_k | A) = \frac{P(B_k)P(A | B_k)}{\sum_{i=1}^n P(B_i)P(A | B_i)}$
7. Riippumattomuus: $P(A \cap B) = P(A)P(B)$
8. $F(x) = P(X \leq x) = \int_{-\infty}^x f(t) dt$
9. $E(X) = \int_{-\infty}^{\infty} x f(x) dx = \mu$, $E(X) = \int_{-\infty}^{\infty} x f(x) dx = \mu$
10. $\text{Var}(X) = \sum_{x \in \Omega} (x - \mu)^2 f(x) = \sigma^2$, $\text{Var}(X) = \int_{-\infty}^{\infty} (x - \mu)^2 f(x) dx = \sigma^2$
11. $\text{Var}(X) = E(X^2) - [E(X)]^2$
12. $D(X) = \sqrt{\text{Var}(X)} = \sigma$
13. $X : f(x)$, $Y = h(X)$, $g(y) = f(h^{-1}(y)) \left| \frac{d}{dy} h^{-1}(y) \right|$

14. $E(h(X)) = \sum_{x \in \Omega} h(x)f(x)$, $E(h(X)) = \int_{-\infty}^{\infty} h(x)f(x) dx$
15. $E(aX + b) = aE(X) + b$, $\text{Var}(aX + b) = a^2 \text{Var}(X)$
16. $P(|X - \mu| \geq t) \leq \frac{\sigma^2}{t^2}$, $\forall t > 0$
17. $\text{Exp}(\lambda) : f(x) = \lambda e^{-\lambda x}$, $x \geq 0$, $\lambda > 0$, $E(X) = \frac{1}{\lambda}$, $\text{Var}(X) = \frac{1}{\lambda^2}$
18. $\text{Bin}(n, p) : f(x) = \binom{n}{x} p^x (1-p)^{n-x}$, $x = 0, 1, 2, \dots, n$,
 $E(X) = np$, $\text{Var}(X) = np(1-p)$
19. $\text{Poi}(\lambda) : f(x) = \frac{\lambda^x}{x!} e^{-\lambda}$, $x = 0, 1, 2, \dots$, $E(X) = \lambda$, $\text{Var}(X) = \lambda$
20. Riippumattomuus: $f(x_1, x_2) = f_1(x_1)f_2(x_2)$
21. $\text{Cov}(X, Y) = E((X - \mu_X)(Y - \mu_Y)) = E(XY) - E(X)E(Y) = \sigma_{XY}$
22. $\text{Corr}(X, Y) = \frac{\text{Cov}(X, Y)}{\sqrt{\text{Var}(X)\text{Var}(Y)}} = \rho_{XY}$
23. $\text{Var}(aX + bY) = a^2 \text{Var}(X) + b^2 \text{Var}(Y) + 2ab \text{Cov}(X, Y)$
24. Jos $X \sim N(\mu, \sigma^2)$, niin $z = \frac{X - \mu}{\sigma} \sim N(0, 1)$
25. $\bar{X} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i \sim N\left(\mu, \frac{\sigma^2}{n}\right)$
26. $S^2 = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2 = \frac{1}{n-1} \left(\sum_{i=1}^n X_i^2 - n\bar{X}^2 \right)$
27. $\frac{(n-1)S^2}{\sigma^2} \sim \chi^2(n-1)$
28. $\frac{\bar{X} - \mu}{S/\sqrt{n}} \sim t(n-1)$
29. $F = \frac{S_X^2/\sigma_X^2}{S_Y^2/\sigma_Y^2} \sim F(n_X - 1, n_Y - 1)$

