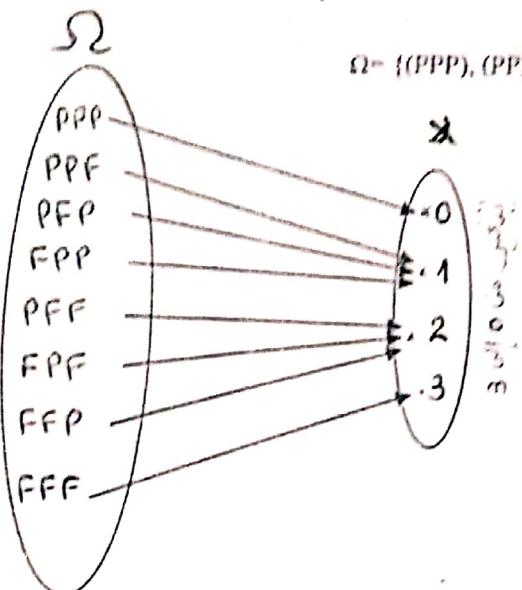


المتغير العشوائي

الفصل الثاني: التوزيعات الاحتمالية

1. المتغير العشوائي: إذا ربما قطعة زجاجية نزلت مرات متتالية في الماء، فإن فضاء العينة Ω يكون كالتالي:



* إذا كان المتغير X هو عدد مرات ظهور الوجه F الذي رأى مراراً بـ ω :

فإن X يأخذ القيم التالية: $x = 0, 1, 2, 3$.

من هنا يتضح أن هناك صلة بين كل قيمة من X و نقاط فضاء العينة Ω .

أو بعبارة أخرى فإن X هي شارة عن دالة نقاط من فضاء العينة Ω و تسمى

في هذه الحالة **المتغير العشوائي**. إذًا إن الكلمة متغير تعني أن يأخذ قيمًا

عددية مختلفة في كل حالة، أما الكلمة عشوائية فتعني أن قيم المتغير في أي تجربة تعتمد على الصدفة.

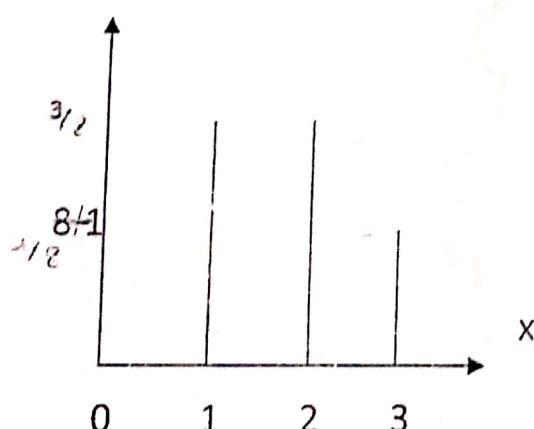
1.1. تعريف: إن المتغير العشوائي X هو مجموعة قيم لنتائج تجربة عشوائية، يكون تحققها مترافقاً باحتمال معين. $X = \Omega \rightarrow \mathbb{N}$

- هو دالة فيها الحقيقة تحدد قيمة لكل عنصر من عناصر فضاء العينة Ω .

في المثال السابق وجدنا بأن عدد مرات ظهور الوجه F هو $\{0, 1, 2, 3\}$.

احتمال عدم ظهور الوجه F هو: $P(X=0) = \frac{1}{8}$ احتلال ظهور الوجه F مرة واحدة هو: $P(X=1) = \frac{3}{8}$ احتلال ظهور الوجه F مرتين هو: $P(X=2) = \frac{3}{8}$ احتلال ظهور الوجه F ثلاثة مرات هو: $P(X=3) = \frac{1}{8}$

3. التمثيل البياني للتوزيع الاحتمالي لـ X :



X	0	1	2	3
$P(X=x)$	$\frac{1}{8}$	$\frac{3}{8}$	$\frac{3}{8}$	$\frac{1}{8}$

متغير بارلولي

مثال 1: صدوق به كريات بيضاء بنسبة p ,

و كريات حمراء بنسبة q ، بحيث $[p+q=1]$.

يسمى هذا المتغير العشوائي متغير بارلولي: **Berloulli**

عناصر فضاء العينة	المتغير العشوائي X	الاحتمال $P(X=x)$
كريبة بيضاء	$x=1$	p
كريبة سوداء	$x=0$	q

المتغيرات العشوائية

الفصل الثاني: التوزيعات الاحتمالية

أ. توزيعات متقطعة

2. التوزيعات المقطعة أو المفصلة:

إن المتغير العشوائي الذي مختلف قيمته الواحدة عن الأخرى بكميات محددة، يدعى بالمتغير العشوائي المتقطع.

التوزيع الاحتمالي المتقطع هو جدول أو قانون يعطي جميع قيم المتغير مع جميع الإحتمالات المرفقة. $P(X=x)$

مثال 2: خلال تجربة قمنا برمي زهرتي نرد، وقمنا بحساب مجموع العددين المكتوب على وجهي الزهرتين، فتحصلنا على المتغير العشوائي المتقطع

X و توزيعه الاحتمالي المدون في الجدول الموالي:

x	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
$P(X=x)$	1/36	2/36	3/36	4/36	5/36	6/36	5/36	4/36	3/36	2/36	1/36

$$\begin{aligned} \text{عدد الحالات} \\ \text{الكلية} &= 6 \times 6 = \\ 36 &= \end{aligned}$$

1.2. دالة التوزيع المجمع:

$$F(x) = P(X \leq x)$$

إن دالة التوزيع المجمع هي الدالة التي تلخص أو تجمع التوزيع الاحتمالي، وبالتالي

تعطينا احتمالات $[X_i \leq x]$ بحيث أن x تمثل أي قيمة من قيم المتغير العشوائي X

$$F(x) = P(X \leq x_i) = \sum_{i=1}^n P(X=x_i) \quad x_i \leq x$$

$$\text{مثال 2:} \quad F(8) = P(x \leq 8) = \sum_{i=1}^n P(X=x_i) \quad x_i \leq 8$$

$$F(x) = \begin{cases} 0 & \text{إذا } x < 2 \\ 1/36 & \text{إذا } 2 \leq x < 3 \\ 3/36 & \text{إذا } 3 \leq x < 4 \\ 6/36 & \text{إذا } 4 \leq x < 5 \\ 10/36 & \text{إذا } 5 \leq x < 6 \\ 15/36 & \text{إذا } 6 \leq x < 7 \\ 21/36 & \text{إذا } 7 \leq x < 8 \\ 26/36 & \text{إذا } 8 \leq x < 9 \\ 30/36 & \text{إذا } 9 \leq x < 10 \\ 33/36 & \text{إذا } 10 \leq x < 11 \\ 35/36 & \text{إذا } 11 \leq x < 12 \\ 1 & \text{إذا } x \geq 12 \end{cases}$$

* خصائص دالة التوزيع المجمع:

(1) موجبة و غير متقارلة، (مسايدة)

(2) $0 \leq F(x) \leq 1$.

$\lim_{x \rightarrow -\infty} F(x) = 0$.

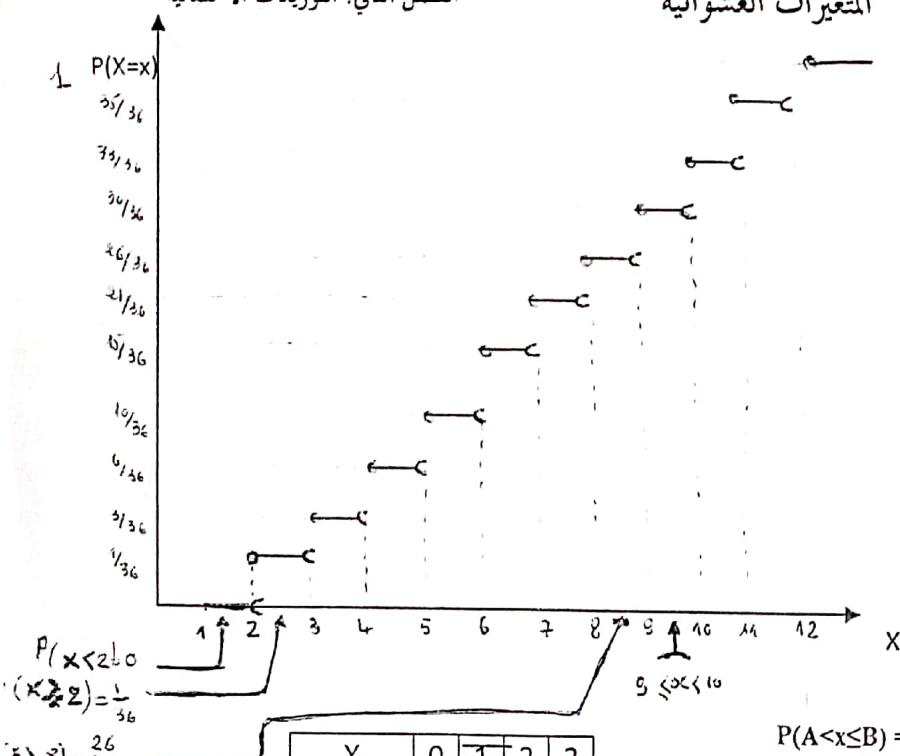
$\lim_{x \rightarrow +\infty} F(x) = 1$.

دالة التوزيع المجمع للمثال 2 مبينة في الشكل المقابل.

الفصل الثاني: العزومات الاحتمالية

المتغيرات العشوائية

2.2. التمثيل البياني للدالة التوزيع المجمع: 15



3.2 حساب الاحتمالات:

ليكن A و B عدوان حقيقيان بحيث: $P(A < x \leq B) = F(B) - F(A)$

مثال 3: ليكن المتغير العشوائي X معرف كالتالي في الجدول المقابل: $\sum P(X=x) = 1$

$$1/ P(X \leq 2) = F(2) = \frac{7}{8} = P(X=0) + P(X=1) + P(X=2)$$

$$2/ P(X > 2) = P(X=3) = \frac{1}{8} = 1 - P(X \leq 2).$$

$$3/ P(1 < X \leq 3) = P(X \leq 3) - P(X \leq 1) = F(3) - F(1) = 1 - \frac{4}{8} = \frac{4}{8}$$

$$4/ P(1 < X < 3) = P(X=2) = \frac{3}{8}$$

$$= P(X < 3) - P(X \leq 1) = P(X \leq 2) - P(X \leq 1)$$

$$= F(2) - F(1) = \frac{7}{8} - \frac{4}{8} = \frac{3}{8}.$$

$$F(x) = \begin{cases} 0 & \text{Si } x < 0 \\ \frac{1}{8} & \text{Si } 0 \leq x < 1 \\ \frac{4}{8} & \text{Si } 1 \leq x < 2 \\ \frac{7}{8} & \text{Si } 2 \leq x < 3 \\ 1 & \text{Si } 3 \leq x < 4 \end{cases}$$

4. التربيع الرياضي والبيان: (القيم الخاصة للمتغيرات العشوائية المتقطعة)

1.4.2 التربيع الرياضي: ($E(x)$) التربيع الرياضي لمتغير عشوائي متقطع هو الوسط الحسابي لكل القيم الممكنة مرحلة باحتمالاتها.

X	0	1	2	3
P(X=x)	$\frac{1}{8}$	$\frac{3}{8}$	$\frac{3}{8}$	$\frac{1}{8}$

لدينا التوزيع الإحتمالي التالي: $E(x) = \sum_{i=1}^n P(X = xi)$

$$E(x) = \left(0 \cdot \frac{1}{8}\right) + \left(1 \cdot \frac{3}{8}\right) + \left(2 \cdot \frac{3}{8}\right) + \left(3 \cdot \frac{1}{8}\right) = 1.5$$

خصائصه:

$$E(ax + b) = a \cdot E(x) + b$$

1/ ليكن A و B عددان ثابتان و X متغير عشوائي:

$$E(x+y) = E(x) + E(y)$$

2/ التربيع الرياضي لمجموع متغيرين عشوائيين يساوي مجموع التربيعات الرياضية لهذين المتغيرين:

$$E(xy) = E(x) \cdot E(y)$$

3/ إذا كان X و Y متغيران عشوائيان مستقلان فإننا يمكننا كتابة العلاقة التالية:

المتغيرات العشوائية

الفصل الثاني: التوزيعات الاحتمالية

2.4.2. التباع: $V(x)$ نعرف تباين متغير عشوائي بالتوقع الرياضي، مربع فرق هذا المتغير و توقع الرياضي. $V(x) = E[x - E(x)]^2$

$$V(x) = E[x^2 - 2x \cdot E(x) + E^2(x)]$$

خصائصه:

$$V(x) = E(x^2) - 2E(x) \cdot E(x) + E^2(x)$$

$$. V(ax) = a^2 \cdot V(x) / 1$$

$$V(x) = E(x^2) - 2E^2(x) + E^2(x)$$

$$V(x+y) \neq V(x) + V(y) / 2$$

$$V(x) = E(x^2) - E^2(x) = \frac{24}{8} - \left(\frac{12}{3}\right)^2 = 0.75$$

للمتغير

3. التوزيعات الاحتمالية المستمرة أو المتصلة:

هو التوزيع الذي يأخذ فيه المتغير العشوائي قيمةً داخل حددين (مجال)

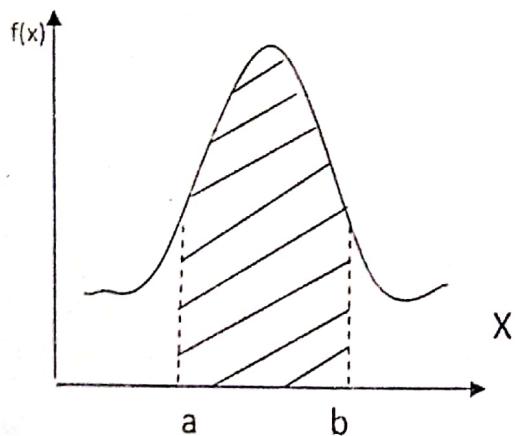
إذا كانت دالة التوزيع المتجمع $F(x)$ مستمرة و تقبل الإشتقاق، نقول أن المتغير العشوائي مستمر تماماً.

1.3. دالة كثافة الإحتمال: لنعتبر المتغير العشوائي X و دالة توزيعه المتجمع قابلة للإشتقاق، فإن دالة كثافة الإحتمال هي المشتقة الأولى لدالة التوزيع المتجمع، أي $f(x) = F'(x)$. تُحسب دالة كثافة الإحتمال بالنسبة للمتغيرات العشوائية المستمرة فقط على أساس تعريف دالة التوزيع

$$F'(x) = f(x) \Rightarrow F(x) = \int_{-\infty}^x f(x) dx$$

المتجمع. نستنتج ما يلي:

$$F(x) = P(X \leq x) \quad \text{et} \quad X \leq x \Rightarrow x \in]-\infty, x]$$



إن احتمال أن المتغير العشوائي المستمر X

$$\int_a^b f(x) dx$$

يأخذ قيمةً داخل المجال $[a, b]$ هو:

$$P(a <= x <= b) = \int_a^b f(x) dx$$

تفسر هذه النتيجة من خلال التمثيل البياني المقابل.

تعمل أحجاماً على يتحمّل المتغير العشوائي X إلى المجال $[a, b]$ (٢٦) في توزع التوزيع الكثافي

2.3. خصائص دالة كثافة الإحتمال:

النوعية

$$\int_{-\infty}^{+\infty} f(x) dx = 1 \quad \forall x \in IR \quad f(x) \geq 0$$

كثافة الإحتمال غير سالبة [٠]

$$f(x) = \begin{cases} 100/x^2 & x \geq 100 \\ 0 & x < 100 \end{cases}$$

مثال: مدة الإشتغال المتوسطة ل نوع خاص من المصايد بالساعات، متغير عشوائي كثافة إحتماله:

أحسب ما يلي:

1/ احتمال أن مصباح لا يعرض خلال 150 سا من الإشتغال.

المتغيرات العشوائية

2/ احتمال أنه من بين 3 مصابيح لا يعرض ولا واحد خلال 150 سا من الإشتغال.

3/ إذا علمت أن مصباح يشتغل أكثر من 200 سا، أحسب احتمال أن هذا المصباح لا يشتغل أكثر من 300 سا؟

$$P(X > 150) = \int_{150}^{+\infty} f(x) dx = \int_{150}^{+\infty} \frac{100}{x^2} dx \quad \text{الحل: } X: \text{مدة إشتغال المصابيح المتوسط بالساعات هي:}$$

$$100 \int_{150}^{+\infty} \frac{1}{x^2} dx = 100 \left[-\frac{1}{x} \right]_{150}^{+\infty} = 100 \cdot \left[0 + \frac{1}{150} \right] = \frac{100}{150} = \frac{2}{3} \quad /1$$

$$P(X > 150) = \frac{2}{3} = 100 \left[-\frac{1}{x} \right]_{150}^{+\infty} \quad /2$$

احتمال أن لا يعرض المصباح خلال 150 سا.

A₁: المصباح الأول لا يعرض خلال 150 سا.

A₂: المصباح الثاني لا يعرض خلال 150 سا.

A₃: المصباح الثالث لا يعرض خلال 150 سا.

$$P[X > 200 \text{ مثلاً } 300]$$

$$P(A/B) = ? \quad \swarrow$$

$$P(A/B) = \frac{P(A \cap B)}{P(B)} = \frac{P(200 < x \leq 300)}{P(x > 200)} \quad A: \text{المصباح لا يشتغل أكثر من 300 سا}$$

$$\begin{aligned} P(200 < x \leq 300) &= \int_{200}^{300} \frac{100}{x^2} dx \\ &= 100 \left[-\frac{1}{x} \right]_{200}^{300} \\ &= 100 \left[-\frac{1}{300} + \frac{1}{200} \right] \\ &= -\frac{1}{3} + \frac{1}{2} = \frac{1}{6} \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} P(x > 200) &= \int_{200}^{+\infty} \frac{100}{x^2} dx \\ &= 100 \left[-\frac{1}{x} \right]_{200}^{+\infty} = \frac{1}{2} \end{aligned}$$

$$P(A/B) = \frac{\frac{1}{6}}{\frac{1}{2}} = \frac{1}{6} \cdot (2) = \frac{1}{3}$$

3.3. القيم الخاصة بالمتغيرات العشوائية المستمرة:

$$\text{التوقع الرياضي: } E(x) = \int_{-\infty}^{+\infty} xi f(x) dx$$

نذكر أنها المتغيرات العشوائية المدروزة

$$E(x) = \sum [x_i \cdot P(x=x_i)]$$

$\boxed{x^2 - E(x)^2}$

البيان: $V(x) = E(x^2) - E^2(x)$

بعض المعلمات

$E(x^2) = \int x^2 f(x) dx$

$V(x) = E(x^2) - E^2(x)$

الوزيارات الإحتمالية

4. التوزيارات الإحتمالية المفصلة الشهيرة:

1.4. توزيع ذي الحدين (الثنائي): $X \sim B(n, p)$ Binomiale

إذا كان لدينا تجربة ما تتكرر n مرة، و كان احتمال ظهور حدث ما مرتا واحدة (النجاح) هو p ، و احتمال عدم ظهور الحدث مرتا واحدة (الفشل) هو q ، فإن احتمال ظهور الحدث X مرتا من بين التكرار n ، يُسمى توزيع ذي الحدين الذي دالة احتماليته هي:

$$X \sim B(n, p) \quad P(X=xi) = C_n^x \cdot p^x \cdot q^{n-x} ; \quad x = 0, 1, 2, \dots, n.$$

1.4.1. مواصفات التوزيع: هو توزيع متقطع يستخدم في حالة الأحداث المستقلة، و يتوقف على قيمة الإحتمال:

$$* \sum P(X=xi) = C_n^x \cdot p^x \cdot q^{n-x} = 1. \quad * p + q = 1$$

2.1.4. خصائص التوزيع:

$$\delta = \sqrt{n \cdot p \cdot q} \quad * \text{ الإنحراف المعياري:} \quad \delta^2 = n \cdot p \cdot q \quad * \text{البيان:} \quad \mu = n \cdot p \quad * \text{المتوسط عدد النجاحات:}$$

مثال 1: باع صاحب معرض بخاري 5 سيارات للرثائب، و قدم لهم ضمانات فحواها أن احتمال عدم وقوع السيارات التي باعهم إياها بطبع خلال الخمس السنوات المقبلة هو 80%. نعرف المتغير العشوائي الذي يمثل عدد السيارات التي لا يقع بها عطب.

1. ما هو التوزيع الاحتمالي لعدد السيارات التي لا يقع بها عطب.

2. أحسب متوسط التوزيع، تباينه، و إنحرافه المعياري.

3. ما هو احتمال أن لا يقع عطب على الأقل بـ 3 سيارات؟

$$n=5, \quad p=\frac{4}{5}, \quad q=1-p=1-\frac{4}{5}=\frac{1}{5}. \quad \underline{\text{الحل:}}$$

1. $X \sim B(5, \frac{4}{5})$ ، $P(X=xi) = C_n^x \cdot p^x \cdot q^{n-x}$: عدد السيارات التي لا يقع لها عطب تبع توزيع ذي الحدين دالته هي:

$$\delta = \sqrt{n \cdot p \cdot q} = \sqrt{5 \cdot \frac{4}{5} \cdot \frac{1}{5}} = 0.894427 * \quad \delta^2 = n \cdot p \cdot q = 5 \cdot \frac{4}{5} \cdot \frac{1}{5} = \frac{14}{5} * \quad \mu = n \cdot p = 5 \cdot \frac{4}{5} = 4 * .2$$

3. ما هو احتمال أن لا يقع عطب على الأقل بـ 3 سيارات: $P(X \geq 3)$

$$P(X \geq 3) = P(X=3) + P(X=4) + P(X=5) = C_5^3 \cdot (\frac{4}{5})^3 \cdot (\frac{1}{5})^2 + C_5^4 \cdot (\frac{4}{5})^4 \cdot (\frac{1}{5})^1 + C_5^5 \cdot (\frac{4}{5})^5 \cdot (\frac{1}{5})^0 = 0.94008$$

التوزيعات الاحتمالية

$$X \sim P(\lambda)$$

2.4. توزيع بواسون: Poisson

هو توزيع منفصل يستخدم في حالة الأحداث المستقلة، و يهتم بالحوادث النادرة: مثل حدوث الحوادث في إحدى المدن، حوادث المرور، الأخطاء المطبعية في إحدى صفحات كتاب، عدد المكالمات الهاتفية التي تصل مكتب، عدد السيارات التي تدخل المراقب... إلخ.

نقول أن X تبع توزيع بواسون $(P(\lambda))$ ، ذي المعلمة " λ " الموجبة (متوسط عدد مرات ظهور الحوادث النادرة) إذا كان توزيعها الاحتمالي:

$$P(X=x_i) = \frac{e^{-\lambda} \cdot \lambda^{x_i}}{x_i!} ; X = 0, 1, 2, \dots, n \quad \text{و لـ كل عدد طبيعي } X \text{ و } e=2.7$$

1.2.4. مواصفات التوزيع

* يستخدم في حالة الأحداث المستقلة النادرة، * متوسط عدد النجاحات معروف بـ λ ، * متوسط عدد النجاحات يتتناسب مع طول الوقت.

• سُـرـخـدـمـ لـتـحـدـيـدـ اـحـتـالـ عـرـقـونـ عـدـدـ مـنـيـنـ مـنـاـبـاـتـ حـيـ وـحـدـةـ الرـصـنـ

2.2.4. خصائص التوزيع

$$\delta = \sqrt{\lambda} \quad * \text{ الإنحراف المعياري:} \quad \delta^2 = \lambda \quad * \text{ التباين:} \quad \mu = \lambda \quad * \text{ المتوسط:}$$

$$V(x) \quad E(x) \quad \text{التوزيع الباقي}$$

مثال: إذا كان متوسط عدد الأخطاء المطبعية على صفحات إحدى الكتب هو 3 أخطاء، أوجد التوزيع الاحتمالي ثم أحسب:

1/ عدم ظهور أي خطأ. 2/ ظهور خطأين. 3/ خطأين على الأقل. 4/ خطأين على الأكثر.

الحل: نلاحظ أن $\lambda=3$ ، و X (الحدث): عدد الأخطاء المطبعية

X : متغير عشوائي منفصل يأخذ القيم: 0; 1; 2; ...، و ينبع التوزيع بواسوني $\lambda=3$ ، دالة احتماله هي:

1/ عدم ظهور أي خطأ: $P(x=0) = \frac{e^{-3} \cdot 3^0}{0!} = e^{-3} = 0.05$ ، 2/ ظهور خطأين: $P(x=2) = \frac{e^{-3} \cdot 3^2}{2!} = 0.225$

3/ خطأين على الأكثر: $P(x \leq 2) = P(x=0) + P(x=1) + P(x=2) = 0.05 + 0.15 + 0.225 = 0.425$

4/ خطأين على الأقل: $P(x \geq 2) = 1 - P(x \leq 1) = 1 - 0.2 = 0.8$

$$P(x=0) + P(x=1)$$

التوزيعات الاحتمالية

$$X \sim H(m, b_1, n_1)$$

3.4 التوزيع الهندسي الزائد (فوق الهندسي): Hypergéométric

نعتبر صندوق يحتوي على n_1 كريمة بيضاء و n_2 كريمة حمراء، نسحب منه m كريمة بالصدفة. نعرف المتغير العشوائي X الذي يمثل عدد الكرات البيضاء التي تحصلنا عليها خلال السحب. في هذه الحالة نقول أن X يخضع للتوزيع الهندسي زائد: $X \sim H(m, n_1, n_2)$

دالة احتمالية معطاة على النحو التالي:

$$P(X=x_i) = \frac{C_{n_1}^x \cdot C_{n_2}^{m-x}}{C_{n_1+n_2}^m \cdot C_N^m}$$

$$N = n_1 + n_2$$

1.3.4 مواصفات التوزيع: هو توزيع متقطع يستخدم في حساب الاحتمالات،

2.3.4 خصائص التوزيع:

$$\delta = \sqrt{V(x)} \quad * \text{المترسق المعياري: } V(x) = E(x^2) - E^2(x) \quad * \text{البيان: } E(x) = \sum_{i=1}^3 X_i \cdot P(X = x_i)$$

مثال 1: يحتوي صندوق على 4 كريات بيضاء، و 2 حمراء. نسحب منه بالصدفة 3 كريات. نعرف المتغير العشوائي X الذي يمثل عدد الكرات البيضاء المحصل عليها.

x_i	1	2	3
$P(X=x_i)$	$\frac{1}{5}$	$\frac{3}{5}$	$\frac{1}{5}$

1. أكتب التوزيع الاحتمالي لـ X .

2. ما هو احتمال الحصول على الأقل على كريمة واحدة بيضاء.

3. أحسب متوسط الكرات البيضاء الممكن الحصول عليها

$$P(X=x_i) = \frac{C_4^x \cdot C_2^{3-x}}{C_6^3} \quad \text{دالة احتماليتها هي: } X \sim H(3, 4, 2) \quad \text{معناه } X \text{ يخضع إلى التوزيع الهندسي الزائد:}$$

$$P(X=1) = \frac{C_4^1 \cdot C_2^2}{C_6^3} = \frac{(4)(1)}{(20)} = \frac{1}{5} \quad P(X=2) = \frac{C_4^2 \cdot C_2^1}{C_6^3} = \frac{(6)(2)}{(20)} = \frac{3}{5} \quad P(X=3) = \frac{C_4^3 \cdot C_2^0}{C_6^3} = \frac{(4)(1)}{(20)} = \frac{1}{5}$$

2. احتمال الحصول على الأقل على كرتين بيضاوين: $P(X \geq 2) = P(X=2) + P(X=3) = \frac{3}{5} + \frac{1}{5} = \frac{4}{5}$

$$E(x) = \sum_{i=1}^3 X_i \cdot P(X = x_i) = 1 \left(\frac{1}{5}\right) + 2 \left(\frac{3}{5}\right) + 3 \left(\frac{1}{5}\right) = 2 \quad 3. \text{ متوسط الكرات البيضاء:}$$

x_i	1	2	3	4
$P(X=x_i)$	0,03	0,333	0,5	0,166

$$\frac{C_4^1 \cdot C_2^3}{C_6^4} = 0,03$$

مثال 2: من بين 10 أشخاص الذين قدموا ملف لطلب التوظيف. تؤسسة

03 (جامعة)

معية 7 منهم يحملون درجة جامعية، اختير منهم 4، $E(x)=2.77$, $E(x^2)=6.35$

مثلاً (جامعة)، عدد طلبات 15، منها 7، حرف 56 بربطة، و 54 اركان رسمية