

---

# NMFM301 – Statistika pro finanční matematiky

## 1. Pravděpodobnostní rozdělení a pořádkové statistiky

---

Nechť je  $X_1, \dots, X_n$  náhodný výběr z nějakého rozdělení. Označme

$$X_{(1)} = \min\{X_1, \dots, X_n\} \quad \text{a} \quad X_{(n)} = \max\{X_1, \dots, X_n\}$$

(nejmenší a největší pozorování ve výběru). Označme

$$W_n = X_{(n)} - X_{(1)}$$

rozmezí dat (*range*). Označme

$$M_n = \frac{X_{(1)} + X_{(n)}}{2}$$

prostředek dat (*midpoint*).

### A Příklady na cvičení

**A1.** [Opakovací] Nechť  $X_i$  má distribuční funkci  $F$  pro všechna  $i = 1, \dots, n$ .

- Určete distribuční funkce  $X_{(1)}$  a  $X_{(n)}$ .
- Nechť  $X_i$  má hustotu  $f$  vzhledem k Lebesguově míře. Najděte hustoty  $X_{(1)}$  a  $X_{(n)}$ .

**A2.** [Instruktážní] Nechť  $X_i$  má distribuční funkci  $F$  pro všechna  $i = 1, \dots, n$ .

- Určete sdruženou distribuční funkci  $X_{(1)}$  a  $X_{(n)}$ .
- Nechť  $X_i$  má hustotu  $f$  vzhledem k Lebesguově míře. Najděte sdruženou hustotu  $X_{(1)}$  a  $X_{(n)}$ .

**A3.** [Procvičovací] Nechť  $X_i$  má spojitě rozdělení s distribuční funkcí  $F$  a hustotou  $f$ .

- Určete sdruženou hustotu rozmezí  $W_n$  a minima  $X_{(1)}$ .
- Nechť  $X_i$  má exponenciální rozdělení. Ukažte, že  $W_n$  a  $X_{(1)}$  jsou nezávislé. Určete rozdělení náhodné veličiny  $\exp\{-\lambda W_n\}$ .

**A4.** [Procvičovací] Nechť  $X_1, \dots, X_n$  je náhodný výběr z rozdělení  $R(0, 1)$ . Spočítejte hustotu  $W_n$ ,  $E W_n$  a  $\text{var } W_n$ .

### B Doplnující příklady (nahrazování, procvičování)

**B1.** Pro nezávislé veličiny  $X \sim \text{Exp}(\lambda)$  a  $Y \sim \text{Exp}(\nu)$

- určete rozdělení  $Z = \min\{X, Y\}$ ,
- spočítejte  $E Z$ ,
- spočítejte  $P[X < Y]$ .

**B2.** Nechť  $F_{X,Y}$  je sdružená distribuční funkce náhodného vektoru  $(X, Y)^T$ . Určete distribuční funkci  $Z = \max(X, Y)$ .

**B3.** Nechť  $X_1, \dots, X_n$  je náhodný výběr z  $R(0, \theta)$ , kde  $\theta > 0$ . Ukažte, že  $W_n/\theta$  má beta rozdělení a určete jeho parametry.

**B4.** Pro nezávislé stejně rozdělené veličiny  $X, Y \sim \text{Exp}(\lambda)$  určete hustotu

$$U = \frac{\min\{X, Y\}}{\max\{X, Y\}}.$$

**B5.** Necht'  $X_1, \dots, X_n$  je náhodný výběr z libovolného spojitého rozdělení s distribuční funkcí  $F$  a hustotou  $f$ . Dokažte, že prostředek dat  $M_n$  má distribuční funkci

$$H(x) = n \int_{-\infty}^x [F(2x - y) - F(y)]^{n-1} f(y) dy.$$

**B6.** Necht'  $X_i \sim N(0, 1)$ ,  $i = 1, \dots, n$ , jsou nezávislé. Ukažte, že pro  $n = 2$  jest  $\mathbb{E} W_n = \pi^{-1/2}$  a pro  $n = 3$  jest  $\mathbb{E} W_n = \frac{3}{2}\pi^{-1/2}$ .

**B7.** Necht'  $X_1, \dots, X_n$  je náhodný výběr nezáporných spojitých náhodných veličin s distribuční funkcí  $F$ . Dokažte, že

$$\mathbb{E} W_n = \int_0^\infty \{1 - F^n(x) - [1 - F(x)]^n\} dx.$$

[Návod: Použijte vztah  $\mathbb{E} X = \int_0^\infty [1 - F(x)] dx$ , který platí pro libovolnou spojitou náhodnou veličinu takovou, že  $\mathbb{P}[X \geq 0] = 1$ .]

**B8.** [Obtížnější] Necht'  $X_1, \dots, X_n$  je náhodný výběr z libovolného spojitého rozdělení s distribuční funkcí  $F$ . Zobecněte postup z předchozího příkladu a dokažte, že

$$\mathbb{E} W_n = \int_{-\infty}^\infty \{1 - F^n(x) - [1 - F(x)]^n\} dx.$$

**B9.** [Obtížnější] Necht'  $X_1, \dots, X_n$  je náhodný výběr z  $R(0, \theta)$ , kde  $\theta > 0$ . Ukažte, že

$$n \left[ 1 - \frac{W_n}{\theta} \right] \xrightarrow{D} Y, \quad n \rightarrow \infty,$$

kde  $Y$  má gama rozdělení.