

قسم مجال العلوم الاقتصادية والتسيير
والعلوم التجارية LMD-SEGC
السنة الأولى



جامعة محمد خيضر بسكرة
كلية العلوم الاقتصادية والتجارية
وعلوم التسيير

محاضرات في مقياس الإحصاء الرياضي.

المحور الخامس: التوزيعات الاحتمالية الخاصة

إعداد الدكتور هاشمي عبايسة.

h.ababsa@univ-biskra.dz

المحور الخامس: التوزيعات الاحتمالية الخاصة.

تهدف نظرية الاحتمالات إلى دراسة التجارب العشوائية من خلال تحديد نموذج احتمالي يمكننا من وصف هذه التجربة وتحليلها بصورة مقبولة.

من الناحية النظرية يمكننا تصور عددٍ لانهائي من التجارب العشوائية، وبالتالي تكوين عدد لا نهائي أيضا من النماذج الاحتمالية المختلفة، إلا أنه في الواقع هناك عددٌ محدودٌ من التجارب العشوائية التي نصادفها في معظم الأوقات، بحيث تكون لها خصائص مشتركة.

ولهذا سنتطرق في هذه المحاضرة إلى دراسة تلك التجارب العشوائية ونماذجها الاحتمالية المقابلة التي نصادفها بصورة شائعة ومتكررة في التسيير والاقتصاد والتسويق والعلوم الاجتماعية... الخ.

تنقسم قوانين الاحتمالات لهذه التوزيعات الخاصة إلى مجموعتين:

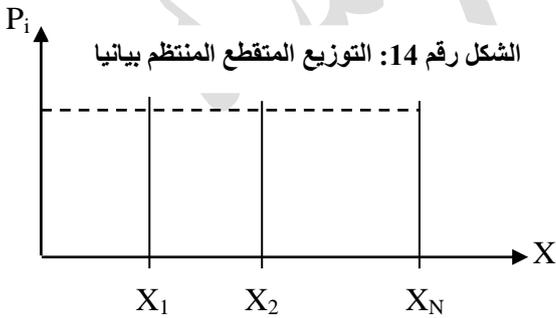
• قوانين التوزيعات الاحتمالية المتقطعة.

• قوانين التوزيعات الاحتمالية المستمرة.

أ- التوزيعات الاحتمالية الخاصة للمتغير المتقطع:
1. التوزيع المنتظم:

➤ تعريفه: نقول إن المتحول العشوائي المتقطع X خاضع للتوزيع المنتظم إذا كان يأخذ القيم الممكنة x_i من فضاء الإمكانيات باحتمالات متساوية، أي:

$$P(X = x_1) = P(X = x_2) = \dots = P(X = x_N)$$



المصدر: افتراضى

➤ تمثيله البياني: (أنظر الشكل رقم 14)

➤ خواصه: ككل توزيع احتمالي:

$$* \sum P(x_i) = 1 \quad * P(x_i) \leq 0$$

➤ قيمه العددية المميزة:

$$E(x) = \sum x = \frac{N+1}{2} \quad \checkmark \text{ التوقع الرياضي:}$$

$$V(x) = E(x^2) - [E(x)]^2 = \frac{N^2-1}{12} \quad \checkmark \text{ التباين:}$$

ملاحظة: العزوم المُركزة ذات المراتب الفردية لهذا التوزيع كلها معدومة أي:

$$\mu_1 = 0, \mu_3 = 0, \mu_5 = 0 \dots \text{ وهكذا.}$$

مثال 01: رمينا قطعة نرد متوازنة، لنفرض أن X متحول عشوائي يمثل عدد النقاط التي تظهر.

- ما هو التوزيع الاحتمالي للمتغير X ؟ ولماذا؟

- أحسب توقعه الرياضي وتباينه.

- حدد تابع توزيعه.

الجواب:

- التوزيع الاحتمالي للمتغير X هو التوزيع المنتظم، لأن جميع إمكانيات X متساوية الاحتمال.

- حساب التوقع الرياضي:

الجدول رقم 08: حساب التوقع الرياضي.

$P_i \cdot X_i$	P_i	X_i
1/6	1/6	1
2/6	1/6	2
3/6	1/6	3
4/6	1/6	4
5/6	1/6	5
6/6	1/6	6
21/6		

$$E(x) = \sum_{i=1}^N x_i P_i = \frac{21}{6} = \frac{N+1}{2} = \frac{7}{2} = 3.5$$

- حساب التباين:

$$V(x) = \frac{N^2 - 1}{12} = \frac{6^2 - 1}{12} = \frac{35}{12} = 2.92$$

المصدر: معطيات المثال 01.

- تحديد تابع التوزيع:

$$F(x_k) = \begin{cases} 0 & \text{(حدث مستحيل)} & x_k < 1 \\ 1/6 & & 1 \leq x_k < 2 \\ 2/6 & & 2 \leq x_k < 3 \\ 3/6 & & 3 \leq x_k < 4 \\ 4/6 & & 4 \leq x_k < 5 \\ 5/6 & & 5 \leq x_k < 6 \\ 6/6 = 1 & \text{(حدث أكيد)} & 6 \leq x_k < +\infty \end{cases}$$

2. التوزيع الثنائي (الحدائي أو ذي الحدين). *Distribution Binomiale*.

➤ تعريفه: يستند هذا التوزيع الى نموذج "برنولي" (نسبة الى "جيمس برنولي" في نهاية القرن 17 م) إذ

يستخدم في التجارب ثنائية النتيجة؛ أي التي تؤدي تجربة واحدة منها إلى نتيجتين اثنتين لا غير، مثلا:

نجاح ≠ فشل، حياة ≠ موت، إصابة ≠ خطأ، ذكر ≠ أنثى...، ولهذا سُمي هذا التوزيع "توزيع برنولي".

➤ قانون احتماله: نضع "p" يمثل احتمال تحقق إحدى النتيجتين في تجربة واحدة (ونسميه نجاحا)، ونضع

"q" يمثل احتمال عدم تحققها (ونسميه فشلا)، حيث $p + q = 1$.

لنكرر هذه التجربة "N" مرة، إن حصولنا على "k" نجاحا يعني بالضرورة حصولنا على "N - k" فشلا، وبما أن هذه التجربة مستقلة، فإن حادث حصولنا على "k" نجاح يتحقق بعدة طرق عددها C_N^k طريقة. وبذلك يكون احتمال حصولنا على k نجاحا من N تجربة كما يلي:

$$P(X = k) = C_N^k p^k q^{N-k}$$

ويكون المتغير X خاضعا للتوزيع الثنائي ذي المعلمتين N و p، حيث نكتب: $X \sim B(N, p)$

➤ مميزات العددية :

$$E(x) = N \cdot p \quad \checkmark \text{ التوقع الرياضي:}$$

$$V(x) = N \cdot p \cdot q \quad \checkmark \text{ التباين:}$$

➤ تابع التوزيع الثنائي: إذا كان X متحولا عشوائيا خاضعا للتوزيع الثنائي، فإن تابع توزيعه يعطى بالعلاقة

$$F(x_k) = P(x \leq x_k) = \sum_{i=1}^k C_N^{x_i} p^{x_i} q^{N-x_i} \quad \text{الآتية:}$$

كما أن احتمال أي يقع X بين قيمتين L, M مثلا يعطى كما يلي :

$$P(L < X < M) = F(M) - F(L)$$

$$P(X > k) = 1 - P(X \leq k) = 1 - F(k) \quad \text{وبالكيفية نفسها:}$$

مثال 02: رمينا قطعة نقود 6 مرات، نفرض أن ظهور الصورة يمثل النجاح.

1. ما هو احتمال ظهور صورتين؟
2. ما هو احتمال ظهور 4 صور على الأقل؟
3. ما هو احتمال عدم ظهور الصورة؟
4. أحسب μ و $V(x)$ لهذا التوزيع؟
5. ما هو احتمال ظهور الصورة أقل من 4 مرات؟

الجواب: $X \sim B(6, 1/2)$

$$1. P(X = 2) = C_6^2 p^2 q^4 = \frac{6!}{2!(6-2)!} \left(\frac{1}{2}\right)^2 \left(\frac{1}{2}\right)^4 = \frac{15}{64}$$

$$2. P(X \geq 4) = P(X = 4) + P(X = 5) + P(X = 6)$$

$$= C_6^4 p^4 q^2 + C_6^5 p^5 q^1 + C_6^6 p^6 q^0$$

$$= \frac{6!}{4!(6-4)!} \left(\frac{1}{2}\right)^4 \left(\frac{1}{2}\right)^2 + \frac{6!}{5!(6-5)!} \left(\frac{1}{2}\right)^5 \left(\frac{1}{2}\right)^1 + \frac{6!}{6!(6-6)!} \left(\frac{1}{2}\right)^6 \left(\frac{1}{2}\right)^0$$

$$= \frac{15}{64} + \frac{6}{64} + \frac{1}{64} = \frac{22}{64}$$

$$3. P(X = 0) = C_6^0 p^0 q^6 = \frac{6!}{0!(6-0)!} \left(\frac{1}{2}\right)^0 \left(\frac{1}{2}\right)^6 = \frac{1}{64}$$

$$4. E(x) = N.p = 6. \left(\frac{1}{2}\right) = 3$$

$$V(x) = N.p.q = 6 \left(\frac{1}{2}\right) \left(\frac{1}{2}\right) = \left(\frac{6}{4}\right) = \frac{3}{2} = 1.5$$

$$5. P(X < 4) = 1 - P(X \geq 4) = 1 - \frac{22}{64} = \frac{42}{64}$$

مثال 03: رمينا زهرة نرد 7 مرات، نفرض أن ظهور 5 أو 6 في أية رمية يمثل النجاح.

- ما هو احتمال تحقق النجاح 3 مرات؟

الجواب: $X \sim B(7, 2/6)$

$$P(X = 3) = C_7^3 p^3 q^4 = \frac{7!}{3!(7-3)!} \left(\frac{2}{6}\right)^3 \left(\frac{4}{6}\right)^4 = 35 \times \frac{1}{9} \times \frac{16}{81} = \frac{560}{729}$$

$$= 0.7681$$

3. توزيع "بواسون": *Distribution de Poisson*

➤ تعريفه: سُمي هذا التوزيع كذلك نسبة إلى عالم الرياضيات والفيزياء الفرنسي "Siméon Denis Poisson" الذي اكتشفه عام 1838 م. وعلى غرار التوزيع الثنائي، فهذا التوزيع يستخدم في التجارب ثنائية النتيجة، إلا أنه يختص بالأحداث "النادرة الوقوع" في وحدة قياسية معينة، على سبيل المثال:

✓ عدد الأخطاء المطبعية في صفحة من صفحات كتاب.

✓ عدد حوادث السيارات خلال أسبوع معين.

✓ عدد الحشائش الضارة في المتر المربع من حقل قمح مثلاً.

✓ عدد الانتحارات خلال سنة في قُطر من الأقطار.

وفي هذه الحالات جميعاً، عادة ما نجد أن N كبيرة جداً، بينما " p " (احتمال النجاح) صغيراً جداً.

➤ قانون احتماله: نفرض أن X متحول عشوائي متقطع، نقول أن X خاضع لتوزيع بواسون ذي المعلمة λ إذا كان قانون احتماله كما يلي:

$$P(X = x_i) = \frac{\lambda^{x_i} e^{-\lambda}}{x_i!}$$

حيث: λ عدد ثابت يمثل متوسط ظهور النجاحات. (التوقع الرياضي)

ونكتب: $X \sim \mathcal{P}(\lambda)$

➤ مميزات العدديّة:

✓ التوقع الرياضي: $E(x) = \lambda = NP$

✓ التباين: $V(X) = \lambda$

➤ العلاقة بين التوزيعين الثنائي والبواسوني:

إذا كان N كبيراً في التوزيع الثنائي، بينما الاحتمال " p " لظهور حدث ما قريباً من الصفر (أي أن $q = 1 - p$

قريب من 1) فإننا نعتبر هذا الحدث "نادراً"، وعملياً سوف نعتبر الحدث نادراً إذا كان عدد الاختبارات على الأقل

50 ($N \geq 50$) بينما $NP < 5$ ، في مثل هذه الظروف يكون التوزيع الثنائي قريبا جداً من التوزيع البواسوني الذي يمكن استخدامه كتقريب ممتاز للتوزيع الثنائي.

مثال 04: إذا كان 3٪ من مصابيح الكهرباء في أحد المصانع معيبة، نفرض أننا سحبنا عينة من 100 مصباح، أوجد احتمال أن يكون فيها:

- 1- مصباح واحد معيب.
- 2- مصباحان معيبان.
- 3- أربعة مصابيح معيبة.
- 4- أعد حساب هذه الاحتمالات بتطبيق التوزيع الثنائي.
- 5- ماذا تلاحظ.

الجواب: من المعطيات نلاحظ أن:

- الظاهرة ثنائية (المصباح إما معيب وإما غير معيب، والنجاح هو الحصول على مصباح معيب).
- التوقع الرياضي أقل من 5 ($\lambda = np = (0.03)100 = 3 < 5$).
- حجم العينة أكبر من 50 ($N = 100$).

كل ذلك يدعونا لتطبيق التوزيع البواسوني بدلاً عن التوزيع الثنائي، حيث $\lambda = 3$ ، ونكتب $X \sim P(3)$

- 1- $P(X = 1) = \frac{3^1 e^{-3}}{1!} = \mathbf{0.1494}$
- 2- $P(X = 2) = \frac{3^2 e^{-3}}{2!} = \mathbf{0.2240}$
- 3- $P(X = 4) = \frac{3^4 e^{-3}}{4!} = \mathbf{0.1680}$

4- إعادة حساب هذه الاحتمالات بتطبيق التوزيع الثنائي:

- $P(X = 1) = C_{100}^1 p^1 q^{99} = \frac{100!}{1!(100-1)!} (0.03)^1 (0.97)^{99} = \mathbf{0.1471}$
- $P(X = 2) = C_{100}^2 p^2 q^{98} = \frac{100!}{2!(100-2)!} (0.03)^2 (0.97)^{98} = \mathbf{0.2251}$
- $P(X = 4) = C_{100}^4 p^4 q^{96} = \frac{100!}{4!(100-4)!} (0.03)^4 (0.97)^{96} = \mathbf{0.1706}$

5- واضح جلياً تقارب نتائج التوزيعين، وواضح أيضاً أن استخدام التوزيع الثنائي مع الأحداث النادرة أصعب واعقد من استخدام التوزيع البواسوني، ولهذا يُفضل استخدام هذا الأخير في مثل هذه الحالات.

مثال 05: تتلقى تحويلة الهاتف في الجامعة المكالمات الخارجية بين الساعة 10h والساعة 12h ، بمعدل ثلاث مكالمات في الدقيقة.

المطلوب: احسب احتمال أن يكون بين الساعة 10.55h و 10.56h :

- 1- ولا مكالمات.
- 2- مكالمات واحدة.
- 3- على الأقل مكالمتين.
- 4- على الأكثر مكالمتين.

الجواب: من المعطيات نلاحظ:

- أننا أمام ظاهرة ثنائية، النجاح فيها هو وصول المكالمات.
- التوقع الرياضي أقل من 5 ($\lambda = 3 < 5$).
- N أكبر من 50، فهو غير محدد.

كل ذلك يدعونا لتطبيق التوزيع البواسوني بدلا عن التوزيع الثنائي، حيث $\lambda = 3$ ، ونكتب $X \sim \mathcal{P}(3)$

$$1. P(X = 0) = \frac{3^0 e^{-3}}{0!} = \mathbf{0.0498} \text{ (ولا مكاملة)}$$

$$2. P(X = 1) = \frac{3^1 e^{-3}}{1!} = \mathbf{0.1494} \text{ (مكاملة واحدة)}$$

$$3. P(X \geq 2) = 1 - P(X < 2) = 1 - [P(X = 0) + P(X = 1)] \text{ (على الأقل مكاملتين)}$$

$$= 1 - \left(\frac{3^0 e^{-3}}{0!} + \frac{3^1 e^{-3}}{1!} \right) = 1 - (0.0498 + 0.1494) = \mathbf{0.8008}$$

$$4. P(X \leq 2) = P(X = 0) + P(X = 1) + P(X = 2)$$

$$= \frac{3^0 e^{-3}}{0!} + \frac{3^1 e^{-3}}{1!} + \frac{3^2 e^{-3}}{2!} = (0.0498 + 0.1494 + 0.2240) = \mathbf{0.4232}$$

$$F(x_k) = P(X \leq x_k) = \sum_{i=0}^{x_k} \frac{\lambda^i e^{-\lambda}}{i!} \quad \blacktriangleright \text{ تابع توزيع بواسون:}$$

ملاحظة:

- 1 معرفة قيمة λ مسألة ضرورية لحساب الاحتمال وفق قانون بواسون.
- 2 يمكن استخراج قيمة الاحتمال أو تابع التوزيع البواسوني من خلال جداول إحصائية أُعدت لذلك.

4. التوزيع فوق الهندسي: (التوزيع الهندسي الزائدي) *Distribution hypergéométrique*

➤ تعريفه: عند دراستنا للتوزيع الثنائي يتضح لنا أن عمليات السحب لتكوين العينة كانت تتم مع إعادة

العُنصر المسحوب الى المجتمع، وهذا يترتب عنه أمران، يعتبران بمثابة شرطي تطبيق التوزيع الثنائي، هما:

- أن جميع السَّحبات (أو التجارب) مستقلة عن بعضها البعض.
- أن احتمال النجاح في تجربة واحدة p ثابت.

لكن هناك بعض الحالات لا يمكن أن يتم فيها السحب مع الإعادة (كإجراء فحص حول الإصابة بمرض معين) وهنا يختل شرطا تطبيق التوزيع الثنائي (استغلال التجارب، وثبات p) فنلجأ الى تطبيق قانون آخر يسمى قانون فوق الهندسي.

➤ قانون احتماله : إذا كان X متغيرا عشوائيا خاضعا للتوزيع فوق الهندسي، ذي المعالم N ، M ، n فإننا

نكتب $X \sim H(N, M, n)$ ، ويعطى قانون احتماله كما يأتي:

$$P(X = k) = \frac{C_M^k C_{N-M}^{n-k}}{C_N^n}$$

حيث:

K : عدد النجاحات.

M : عدد العناصر التي يَنْصَبُ عليها الاهتمام في المجتمع.

N : حجم المجتمع Ω .

n : حجم العينة المسحوبة.

➤ مميزات العدديّة:

$$E(x) = n \cdot P = n \left(\frac{M}{N} \right) \quad \checkmark \text{ التوقع الرياضي:}$$

$$V(x) = \frac{N-n}{N-1} \cdot n \cdot P \cdot q \quad \checkmark \text{ التباين:}$$

وهذا التباين أصغر من تباين التوزيع الثنائي. يسمى المقدار $\frac{N-n}{N-1}$ "مؤثر عدم الإعادة".

مثال 06: تتكون هيئة التدريس في أحد فروع الجامعة من أربعة كيميائيين وسبعة فيزيائيين، سحبنا -بصورة عشوائية- لجنة مؤلفة من أربعة أساتذة. لنفرض أن X متحول عشوائي يمثل عدد الكيميائيين في هذه اللجنة.

المطلوب: حدد التوزيع الاحتمالي للمتغير X .

الجواب: نلاحظ أن تجربة سحب هذه اللجنة هي تجربة فوق هندسية، لأن:

- التجربة ثنائية النتيجة، فكل أستاذ مسحوب إما أن يكون كيميائياً وإما أن يكون فيزيائياً.
- السحب يتم دون إعادة، إذ لا يعقل سحب أستاذ ثم اعادته لأن هذا من شأنه جعل تكرار سحب الأستاذ نفسه حدثاً ممكناً، وعلى ذلك فالسحب دون إعادة سيترتب عليه اختلال الشرطين السابقين لتطبيق التوزيع الثنائي.

وعلى ذلك فإن X (عدد الكيميائيين في اللجنة) خاضع للتوزيع فوق الهندسي $H(11,4,4)$ ، X ، قيمة الممكنة هي:

$$\Omega = \{0, 1, 2, 3, 4\}$$

$$P(X = 0) = \frac{C_4^0 C_{11-4}^{4-0}}{C_{11}^4} = 0.106$$

$$P(X = 1) = \frac{C_4^1 C_7^3}{C_{11}^4} = 0.424$$

$$P(X = 2) = \frac{C_4^2 C_7^2}{C_{11}^4} = 0.380$$

$$P(X = 3) = \frac{C_4^3 C_7^1}{C_{11}^4} = 0.085$$

$$P(X = 4) = \frac{C_4^4 C_7^0}{C_{11}^4} = 0.003$$

ومن هنا يمكننا وضع التوزيع الاحتمالي للمتغير X كما يأتي:

الجدول رقم 09: التوزيع الاحتمالي للمتغير فوق الهندسي X

المجموع ¹	4	3	2	1	0	x_i
1.000	0.003	0.085	0.380	0.424	0.106	$p(x_i)$

المصدر: حلول المثال 06.

ب- التوزيعات الاحتمالية الخاصة للمتغير المستمر:

1. التوزيع المنتظم:

➤ تعريفه: لنفرض أن لدينا متحولاً عشوائياً مستمراً X معرفاً على المجال $[a, b]$ ، فإذا كانت كثافة توزعته تحافظ على قيمة ثابتة في هذا المجال وتساوي الصفر خارجه، نقول أن X خاضع لتوزيع منتظم.

➤ قانون احتماله: انطلاقاً من التعريف السابق، نعرف قانون التوزيع المستمر المنتظم كما يلي:

$$f(x) = \begin{cases} \frac{1}{b-a} & \dots \dots X \in [a, b] \\ 0 & \dots \dots X \notin [a, b] \end{cases}$$

➤ تمثيله البياني: أنظر الشكل رقم 15.

➤ خواصه: ككل توزيع احتمالي، لا بد من توافر ما يلي:

$$* f(x) \geq 0 \Leftrightarrow \frac{1}{b-a} \geq 0$$

وهذا محقق دائماً طالما أن $a < b$

$$* \int_a^b f(x) dx = 1$$

➤ تابع التوزيع المنتظم:

$$F(x_k) = P(X \leq x_k) = \int_a^{x_k} f(x) dx = \int_a^{x_k} \frac{1}{b-a} dx = \frac{1}{b-a} x \Big|_a^{x_k} = \frac{x_k - a}{b-a}$$

ومنه فإن تابع التوزيع يأخذ الصورة التالية: أي أن: $F(b) = P(X \leq b) = \frac{b-a}{b-a} = 1$

$$F(x_k) = \begin{cases} 0 & \dots \dots x_k < a \\ \frac{x_k - a}{b-a} & \dots \dots a \leq x_k < b \\ 1 & \dots \dots x_k \geq b \end{cases}$$

أما الاحتمالات الأخرى فتحسب بتوظيف تابع التوزيع كما يلي:

$$* P(X > x_k) = 1 - P(X \leq x_k) = 1 - F(x_k) = 1 - \frac{x_k - a}{b-a}$$

$$* P(x_1 \leq X \leq x_2) = F(x_2) - F(x_1) = \frac{x_2 - a}{b-a} - \frac{x_1 - a}{b-a} = \frac{x_2 - x_1}{b-a}$$

¹ قد يلاحظ الطالب أن هذا المجموع لا يساوي واحد بالضبط بل يساوي 0.998 وهذا ببساطة راجع لمشاكل التقريب فقط.

أي الاحتمال يساوي طول المجال الجزئي على طول المجال الكلي.

➤ المميزات العددية للمتغير المستمر الخاضع للتوزيع المنتظم:

✓ التوقع الرياضي: $E(x) = \frac{b+a}{2}$ حيث ينطبق $E(x)$ على منتصف المجال $[a, b]$ في محور

السينات.

ملاحظات:

- إذا كان X معرفاً في المجال $[-a, +a]$ فإن $E(x) = 0$.

- إذا كان $X \in [a, b]$ فإن $E(x) \in [a, b]$.

- بسبب التناظر في هذا التوزيع فإن التوقع الرياضي والوسيط متساويان بينما ليس لهذا التوزيع

منوالاً.

✓ التباين: $V(x) = \frac{(b-a)^2}{12}$

2. التوزيع الطبيعي: *Distribution Normale*

➤ تعريفه: يُعتبر التوزيع الطبيعي من أهم التوزيعات الاحتمالية المستمرة وأكثرها استخداماً في نظرية

الاحتمالات والإحصاء الرياضي، وذلك لعدة اعتبارات أهمها:

✓ في الكثير من الحالات التطبيقية - اجتماعية كانت أم اقتصادية - يكون توزيع المتحول العشوائي طبيعياً، كطول الإنسان، وزنه، عمره، معدل ذكائه، ...

✓ معظم قوانين التوزيعات الاحتمالية - المتقطعة منها والمستمرة - تؤول إلى هذا التوزيع عند توافر شروط

معينة.

✓ تعتمد اختبارات الفروض الإحصائية ومجالات الثقة على التوزيع الطبيعي¹.

➤ قانون احتماله: نقول أن المتحول العشوائي X خاضع للتوزيع الطبيعي، ذي المعلمتين μ و σ (ونكتب:

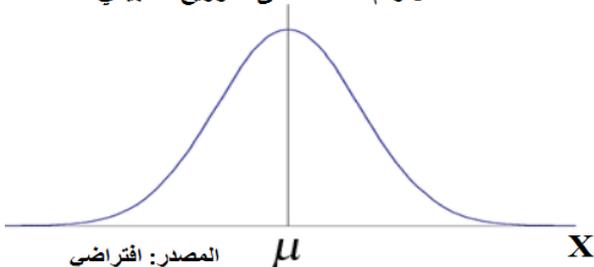
$X \sim \mathcal{N}(\mu, \sigma)$) إذا كانت دالة كثافته المعرفة في المجال $]-\infty, +\infty[$ كما يلي:

$$f(x) = \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}$$

حيث: $e = 2.71828$

$\pi = 3.14$

الشكل رقم 16: منحنى التوزيع الطبيعي



المصدر: افتراضي

σ : الانحراف المعياري. μ : التوقع الرياضي.

➤ تمثيله البياني:

انظر الشكل رقم 16.

¹ هذا الموضوع سيتطرق له الطلبة بالتفصيل في السنة الثانية.

➤ خواصه:

✓ منحنى التوزيع الطبيعي ناقوسي الشكل.

✓ مهما كانت قيمة X فإن $f(x) \geq 0$ وهذا لأن المنحنى دوماً فوق محور السينات (المحور الأفقي).

✓ $\int_{-\infty}^{+\infty} f(x) dx = 1$ (أي أن مجموع المساحة الكلية تحت المنحنى دوماً يساوي 1).

✓ منحناه متناظر حول المحور العمودي الذي يشمل μ على المحور الأفقي أي أن هذا العمود يقسم المساحة

$$P(X \leq \mu) = P(X \geq \mu) = \frac{1}{2}$$

✓ الكمية إلى قسمين متساويين بحيث:

✓ يصل إلى قمته (أعلى احتمال) عندما $X = E(x)$ ، وبما أن المنحنى متناظر فإنه عند هذه النقطة نجد أن:

$$X = E(x) = M_e = M_o$$

✓ يتصف منحناه بأنه معتدل؛ أي أنه لا مدب ولا مفلطح وغير ملتو، ولهذا يسمى أحياناً التوزيع المعتدل.

✓ في التوزيع الطبيعي دوماً نجد النسب التالية:

- المساحة المحصورة في المجال $E(x) \pm \sigma = 68.27\%$ من المساحة الكلية.
- المساحة المحصورة في المجال $E(x) \pm 2\sigma = 95.45\%$ من المساحة الكلية.
- المساحة المحصورة في المجال $E(x) \pm 3\sigma = 99.73\%$ من المساحة الكلية.
- المساحة المحصورة في المجال $E(x) \pm \frac{2}{3}\sigma = 50.00\%$ من المساحة الكلية.

➤ القيم العددية المميزة للمتغير العشوائي الطبيعي:

$$E(x) = \mu \quad \checkmark \text{ التوقع الرياضي:}$$

$$V(x) = \sigma^2 \quad \checkmark \text{ التباين:}$$

➤ تابع التوزيع الطبيعي:

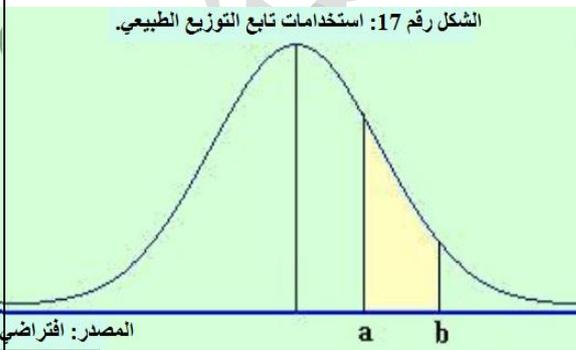
$$F(x_k) = P(X \leq x_k) = \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^{x_k} e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}} dx$$

ومنه يمكننا حساب احتمال أن يقع X بين قيمتين a ، b كما يلي:

$$P(a \leq X \leq b) = \int_a^b f(x) dx = \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} \int_a^b e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}} dx$$

➤ قانون التوزيع الطبيعي المعياري:

الشكل رقم 17: استخدامات تابع التوزيع الطبيعي.



التوزيع الطبيعي المعياري هو حالة خاصة من التوزيع الطبيعي، نحصل عليه باستبدال المتغير العشوائي

$$Z = \frac{X - \mu_x}{\sigma_x}$$

الطبيعي X بمتغير عشوائي طبيعي معياري Z بحيث:

$$Z \sim \mathcal{N}(0, 1) \text{ و } \sigma_z = 1$$

$$f(Z) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{z^2}{2}} \quad / Z \in]-\infty, +\infty[$$

وعليه تكون دالة كثافة Z كما يلي:

➤ أهمية التوزيع الطبيعي المعياري:

لحساب الاحتمالات دون استخدام التكاملات نلجأ عادة إلى إنشاء جداول احصائية لهذا الغرض، لكن في حالة التوزيع الطبيعي نلاحظ أنه كلما تغير μ أو σ تغير التوزيع وهذا يتطلب جدولاً جديداً، لذلك ظهرت الحاجة إلى توزيع معياري واحد، وبالتالي جدول معياري واحد لكل الحالات المختلفة، وهنا تكمن أهمية التوزيع الطبيعي المعياري.

➤ تابع التوزيع للمتغير المعياري Z :

$$F(z_k) = P(Z \leq z_k) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^{z_k} e^{-\frac{z^2}{2}} dz$$

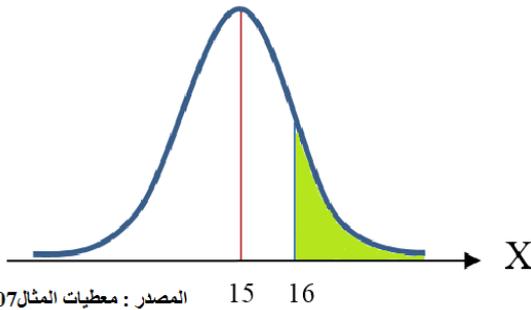
$$F(z_k) = F(x_k) \quad \text{فإن } Z = \frac{X - \mu_x}{\sigma_x}$$

أي أن المساحة تحت المنحنى الطبيعي المحصورة بين $-\infty$ و x_k هي نفسها المحصورة بين $-\infty$ و z_k ولقد

وضع الإحصائيون جداول لحساب تابع التوزيع المعياري أيضاً، ولإبراز

أهمية هذه الجداول نورد المثال الآتي:

الشكل رقم 18: توزيع نقاط الطلبة.



مثال 07: إذا كانت نقاط الطلبة تخضع للتوزيع الطبيعي بتوقع رياضي يساوي

15 وانحراف معياري يساوي 1، أوجد نسبة الطلبة الذين تفوق نقاطهم 16

في مادة الإحصاء.

الجواب: نلاحظ أن $X \sim \mathcal{N}(15, 1)$ وأن المطلوب هو البحث عن

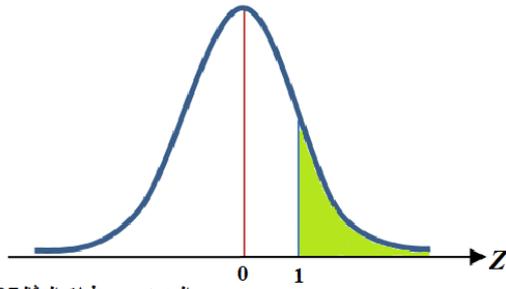
المساحة تحت المنحنى من 16 إلى $+\infty$ المبينة باللون الأخضر في الشكل رقم

18.

وللقيام بذلك علينا أن نتقل من هذا التوزيع إلى التوزيع الطبيعي المعياري الذي يقابله، حيث:

$$z_1 = \frac{16 - \mu}{\sigma} = \frac{16 - 15}{1} = 1 \quad (\text{انظر الشكل رقم 19}).$$

الشكل رقم 19: التوزيع الطبيعي المعياري لنقاط الطلبة.



المصدر : معطيات المثال 07

إن نسبة الطلبة المحصورة نقاطهم في هذا المجال (أكبر من 16) هي نفسها احتمال وجود طالب نقطته أكبر من 16. وعلى ذلك، وبلاستعانة بجدول التوزيع الطبيعي المعياري الموجود في الملحق رقم 02:

$$P(X \geq 16) = P(Z \geq 1) = P(0 \leq Z \leq +\infty) - P(0 \leq Z \leq 1) \\ = 0.5 - 0.3413 = 0.1587 = 15.87\%$$

لنشرح مصادر هذه النسب أو الاحتمالات، وكيفية استخدام الجدول:

- $P(0 \leq Z \leq +\infty) = 0.5$ لأن المساحة الإجمالية - كما نعلم - تساوي 1، إذن فالمساحة من 0 إلى $+\infty$ تساوي النصف.
- $P(0 \leq Z \leq 1) = 0.3413$ استخرجناها من جدول التوزيع الطبيعي المعياري الموجود في الملحق رقم 02، والجدول رقم 10 أسفله يُبين مقطعاً من هذا الملحق. (انظر بالضبط الخانة الناتجة عن تقاطع العمود 2 مع السطر 12).

الجدول رقم 10: مقطع من جدول التوزيع الطبيعي المعياري.

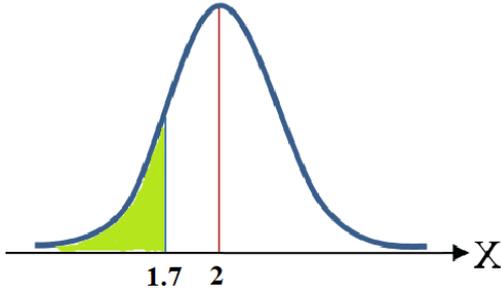
Areas Under the One-Tailed Standard Normal Curve										
This table provides the area between the mean and some Z score. For example, when Z score = 1.45 the area = 0.4265.										
Z	0.00	0.01	0.02	0.03	0.04	0.05	0.06	0.07	0.08	0.09
0.0	0.0000	0.0040	0.0080	0.0120	0.0160	0.0199	0.0239	0.0279	0.0319	0.0359
0.1	0.0398	0.0438	0.0478	0.0517	0.0557	0.0596	0.0636	0.0675	0.0714	0.0753
0.2	0.0793	0.0832	0.0871	0.0910	0.0948	0.0987	0.1026	0.1064	0.1103	0.1141
0.3	0.1179	0.1217	0.1255	0.1293	0.1331	0.1368	0.1406	0.1443	0.1480	0.1517
0.4	0.1554	0.1591	0.1628	0.1664	0.1700	0.1736	0.1772	0.1808	0.1844	0.1879
0.5	0.1915	0.1950	0.1985	0.2019	0.2054	0.2088	0.2123	0.2157	0.2190	0.2224
0.6	0.2257	0.2291	0.2324	0.2357	0.2389	0.2422	0.2454	0.2486	0.2517	0.2549
0.7	0.2580	0.2611	0.2642	0.2673	0.2704	0.2734	0.2764	0.2794	0.2823	0.2852
0.8	0.2881	0.2910	0.2939	0.2967	0.2995	0.3023	0.3051	0.3078	0.3106	0.3133
0.9	0.3159	0.3186	0.3212	0.3238	0.3264	0.3289	0.3315	0.3340	0.3365	0.3389
1.0	0.3413	0.3438	0.3461	0.3485	0.3508	0.3531	0.3554	0.3577	0.3599	0.3621
1.1	0.3643	0.3665	0.3686	0.3708	0.3729	0.3749	0.3770	0.3790	0.3810	0.3830

المصدر: الملحق رقم 02.

- يتكون جدول التوزيع الطبيعي المعياري (أو جدول Z) مما يأتي:¹
 - ✓ **العمود الأول:** يضم الجزء الأول من قيمة Z والمتكونة من الجزء الصحيح والرقم الأول بعد الفاصلة.
 - ✓ **السطر الأول:** يضم الجزء الثاني من قيمة Z والمتكونة من الرقم الثاني بعد الفاصلة.
 - ✓ **بقية الخانات:** تضم المساحات أو الاحتمالات الموافقة للمساحة المضللة من الشكل المبين أعلى الجدول، والمحصورة عادة بين 0 وقيمة Z.² تنتج هذه الخلايا أو الخانات عن تقاطع الأعمدة والأسطر حسب قيمة Z؛ مثلاً عندما $Z=1.15$ فإننا نذهب للخانة الناتجة عن تقاطع السطر رقم 13 (أين الجزء الأول من Z يساوي 1.1) والعمود رقم 07 (أين الجزء الثاني من Z يساوي 0.05) فنجد المساحة (الاحتمال) بين 0 و 1.15 تساوي 0.3749

¹ لقد تختلفت هذه المكونات من جدول لآخر، إلا أن النتيجة المتوصل إليها باستخدامها جميعاً ستكون واحدة.
² وقد نجد اختلافاً في جداول Z أخرى، كأن تكون المساحة المضللة من $-\infty$ إلى قيمة موجبة من قيم Z.

الشكل رقم 20: توزيع أعمار البطاريات.



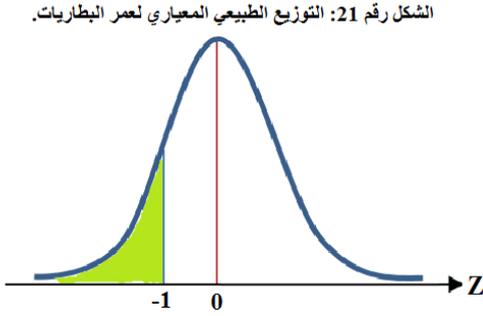
المصدر: معطيات المثال رقم 08.

مثال 08: ركبت في إحدى السيارات بطارية من صنع وطني، فإذا علمت أن عمر هذا النوع من البطاريات يتوزع طبيعياً بمتوسط عمر إنتاجي يساوي سنتين وانحراف معياري يساوي 0.3 سنة، ما هو احتمال هذه البطارية صالحة لمدة لا تزيد عن 1.7 سنة.

الجواب: نلاحظ أن $X \sim N(2, 0.3)$ وأن المطلوب هو البحث عن المساحة تحت المنحنى من $(-\infty)$ إلى 1.7 المبينة باللون الأخضر في الشكل رقم 20.

وللقيام بذلك علينا أن نتقل من هذا التوزيع إلى التوزيع الطبيعي المعياري الذي يقابله، حيث: $Z_1 = \frac{x_1 - \mu}{\sigma} = \frac{1.7 - 2}{0.3} = (-1)$ (انظر الشكل رقم 21).

وعلى ذلك، وبلاستعانة بمجدول التوزيع الطبيعي المعياري الموجود في الملحق رقم 02 فإن:



المصدر: معطيات المثال رقم 08.

$$\begin{aligned} P(X \leq 1.7) &= P(Z \leq -1) = P(Z \geq 1) \quad (\text{بسبب التناظر}) \\ &= P(0 \leq Z \leq +\infty) - P(0 \leq Z \leq 1) \\ &= 0.5 - 0.3413 = \mathbf{0.1587} \end{aligned}$$

ملاحظة: على غرار التوزيع الطبيعي، فإنه في التوزيع المعياري سنجد أن:

$$\begin{aligned} * P(-1 \leq Z \leq +1) &= 68.27\% & * P(-3 \leq Z \leq +3) &= 99.73\% \\ * P(-2 \leq Z \leq +2) &= 95.45\% & * P\left(\frac{-2}{3} \leq Z \leq \frac{+2}{3}\right) &= 50.00\% \end{aligned}$$

➤ **العلاقة بين التوزيع الطبيعي والتوزيع الثنائي:**

في التوزيع الثنائي عندما يكون عدد التجارب N كبيراً جداً فإن هذا سيشرح صعوبة حساب الاحتمال، وفي هذا الإطار لاحظ العالم الرياضي الإنجليزي *De.Moivre* أن التوزيع الطبيعي هو النهاية الحدية لتوزيع الثنائي، وهذا ما أكده العالم الفرنسي *Laplass*.

أي أنه كلما كانت N كبيرة، بينما لم يكن p ولا q قريبين جداً من الصفر، فإن التوزيع الثنائي يقترب كثيراً من التوزيع الطبيعي، حيث يمكن استخدام هذا الأخير بديلاً عن الأول، أين يكون المتغير العشوائي المعياري كما يلي: $Z = \frac{x - NP}{\sqrt{NPq}}$ ، ونعتبر أن هذا يتحقق إذا كان: $N \geq 50$ و $NP > 5$ و $Nq > 5$ بعبارة أخرى: عدد التجارب يفوق 50 تجربة وكل من NP و Nq كلاهما أكبر من 5.

➤ العلاقة بين التوزيع الطبيعي وتوزيع بواسون:

طالما أن هناك علاقة بين التوزيعين الثنائي والبواسوني من جهة، وعلاقة بين التوزيعين الثنائي والطبيعي من جهة أخرى، فإن هذا الأخير تربطه علاقة أكيدة بالتوزيع البواسوني. فإذا كان لدينا متحول عشوائي خاضع للتوزيع البواسوني بحيث كلما كانت قيمة λ كبيرة جداً ($\lambda \rightarrow +\infty$)، فإن التوزيع البواسوني يؤول إلى التوزيع الطبيعي ذي

$$Z = \frac{x-\lambda}{\sqrt{\lambda}} \text{ المتحول العشوائي المعياري } Z \text{ المعرف كما يلي:}$$

3. التوزيع الأسي: *Distribution Exponentielle*

➤ تعريفه: عادة ما يستخدم التوزيع الأسي في المسائل المتعلقة بقياس الزمن، أين المتغير العشوائي قيمته عبارة عن لحظة معينة (مفاجئة) على محور الزمن، مثل لحظة النداء للزيون التالي إلى شباك معين (البريد مثلاً)، لحظة انطفاء مصباح كهربائي أثناء الخدمة، لحظة الانتهاء من تصليح آلة... الخ.

وكقاعدة عامة، يُستخدم التوزيع الأسي لتمثيل مدة حياة ظاهرة ما إذا كان لها متوسط يساوي $\frac{1}{\alpha}$ وكانت هذه الظاهرة لا تخضع للتقدم، كما يحدث مثلاً مع عمر الإنسان.¹

نشير أيضاً إلى أن لهذا التوزيع علاقة بتوزيع "بواسون"، فإذا كان وقوع أحداث معينة يتبع توزيع بواسون، فإن المدة الفاصلة بين وقوع حدثين من هذه الأحداث تتبع التوزيع الأسي، فمثلاً إذا كان وصول الزبائن إلى أحد شبابيك خدمة ما يتبع توزيع بواسون، فإن المدة الفاصلة بين وصول كل زبونين إلى الشباك تخضع للتوزيع الأسي.

➤ قانون احتماله: نقول إن المتحول العشوائي المستمر الموجب X يخضع للتوزيع الأسي ذي المعلمة α ، ونكتب $X \sim e(\alpha)$ ، إذا كان قانون احتماله معرف كما يلي:

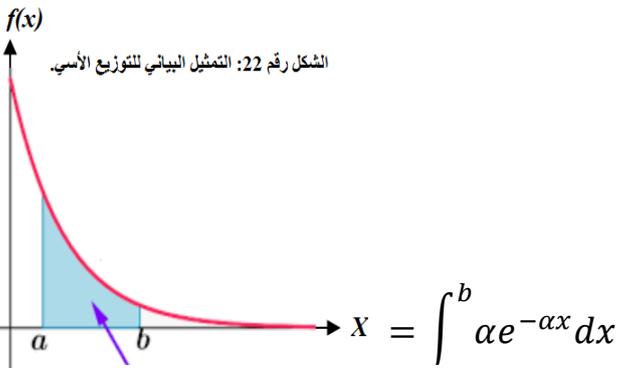
$$f(x) = \begin{cases} \alpha e^{-\alpha x} & \dots \dots X \geq 0 \\ 0 & \dots \dots X < 0 \end{cases} \quad / \alpha > 0$$

➤ خواصه: مهما كان X موجباً فإن:

$$* f(x) \geq 0 \quad * \int_0^{+\infty} f(x) dx = 1$$

➤ تمثيله البياني: أنظر الشكل رقم 22. حيث

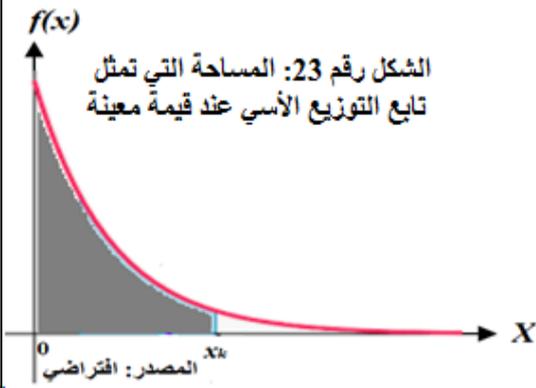
يمكن حساب احتمال وقوع X بين a و b :



المصدر: <http://www.jaicompris.com/lycee/math/probabilite/loi->

¹ فعمر الإنسان يمر بثلاث مراحل أساسية: تبدأ بمرحلة الصبا ثم مرحلة قوة الشباب ثم تنتهي بمرحلة الشيخوخة، وهذا مطرد في كل البشر تقريباً.

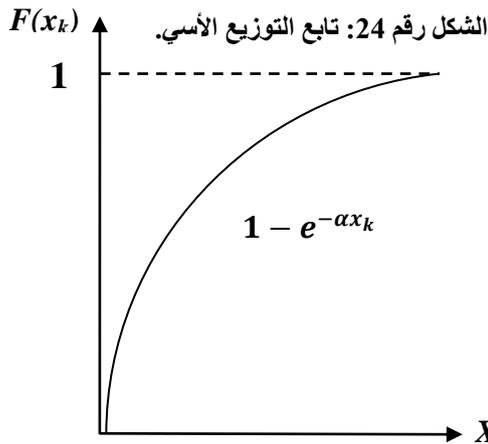
➤ تابع التوزيع الأسي:



الشكل رقم 23: المساحة التي تمثل
تابع التوزيع الأسي عند قيمة معينة

$$f(x)dx = \int_0^{x_k} \alpha e^{-\alpha x} dx$$

وبتبسيط هذا التكامل إلى صورته النهائية نجد أن:



الشكل رقم 24: تابع التوزيع الأسي.

$$1 - e^{-\alpha x_k}$$

$$F(x_k) = \begin{cases} 0 & x < 0 \\ 1 - e^{-\alpha x} & x \geq 0 \end{cases}$$

يمكن تمثيل تابع التوزيع $F(x_k)$ بيانياً وفقاً لما يظهر في الشكل رقم 24.

➤ المميزات العددية للمتغير الأسي:

• التوقع الرياضي: $E(x) = \frac{1}{\alpha}$

• التباين: $V(x) = \frac{1}{\alpha^2}$

مثال 09: تتلقى ورشة لتصليح الآلات الكاتبة في المتوسط 5 مكالمات في الساعة، فإذا حدّدنا انطلاق الزمن في لحظة معينة x_1 ، ما هو احتمال تلقي مكالمات خلال نصف الساعة القادم؟

الجواب: لنفرض أننا الآن عند اللحظة x_1 ، وأطلقنا العداد الزمني "كرونومتر". إن لحظة وصول أول مكالمات خلال نصف الساعة القادم هي متغير عشوائي خاضع للتوزيع الأسي ذي المعلمة $\alpha = \frac{1}{5}$ (لأن $E(x) = \frac{1}{\alpha} = 5$ ونكتب $X \sim e(\frac{1}{5})$).

إن تلقي مكالمات في غضون نصف ساعة معناه أن التوقيت الذي سيسجل على "الكرونومتر" لحظة وصول المكالمات سيكون أقل من أو يساوي نصف ساعة، ومنه احتمال وصول هذه المكالمات يحسب كما يلي:

$$p(X \leq 0.5) = F(0.5) = 1 - e^{-(\frac{1}{5})0.5} = 1 - 0.4094 = \mathbf{0.5906}$$

4. توزيع غاماً: *Distribution Gamma*

➤ تعريفه: لقد اشتق توزيع غاماً اسمه من دالة رياضية معروفة تدعى "الدالة غاماً" والتي لها دور مهم في تعريف العديد من التوزيعات الاحتمالية مثل: توزيع غاماً، توزيع "بيتاً"، توزيع

كاي مربع، فيشر، ستورنت... الخ. ولهذا سنتطرق باختصار إلى هذه الدالة الموجبة قبل دراسة توزيع قاماً.

➤ دالة قاماً: يرمز للدالة قاماً ذات المعلمة الموجبة تماماً "n" بالرمز Γ وتعرف كما يلي:

$$\Gamma(n) = \int_0^{+\infty} x^{n-1} e^{-x} dx$$

➤ خصائص دالة قاماً:

- 1) $\Gamma(n) = (n-1)\Gamma(n-1)$
- 2) $\Gamma(n) = (n-1)!$
- 3) $\Gamma(1) = 1$
- 4) $\Gamma\left(\frac{1}{2}\right) = \sqrt{\pi}$

مثال 10: أحسب ما يلي:

1. $\Gamma(4.5)$
2. $\int_0^{+\infty} x^5 e^{-x} dx$
3. $\int_0^{+\infty} \frac{e^{-x}}{x^{1/2}} dx$

الجواب: لنوظف خصائص الدالة Γ :

1. $\Gamma(4.5) = 3.5\Gamma(3.5)$
 $\Gamma(3.5) = 2.5\Gamma(2.5)$
 $\Gamma(2.5) = 1.5\Gamma(1.5)$
 $\Gamma(1.5) = 0.5\Gamma(0.5)$
 $\Gamma(0.5) = \sqrt{\pi}$

وعلى ذلك:

$$\Gamma(4.5) = (3.5)(2.5)(1.5)(0.5)(\sqrt{\pi}) = 11.63$$

2. $\int_0^{+\infty} x^5 e^{-x} dx = \int_0^{+\infty} x^{4-1} e^{-x} dx = \Gamma(4) = 3! = 6$
3. $\int_0^{+\infty} \frac{e^{-x}}{x^{1/2}} dx = \int_0^{+\infty} x^{(-1/2)} e^{-x} dx = \int_0^{+\infty} x^{(\frac{1}{2}-1)} e^{-x} dx = \Gamma(1/2) = \sqrt{\pi} = 1.77$

➤ قانون احتمال توزيع قاماً: نقول عن متحول عشوائي X أنه خاضع لتوزيع قاماً ذي

المعلمين الموجبين تماماً n, α ، ونكتب $X \sim \Gamma(\alpha, n)$ ، إذا كان قانون احتمال معرفاً كما يلي:

$$f(x) = \begin{cases} \frac{1}{\Gamma(n)} \alpha^n \cdot x^{n-1} \cdot e^{-\alpha x} & \dots \dots X \geq 0 \\ 0 & \dots \dots X < 0 \end{cases} \quad /n > 0, \alpha > 0$$

➤ القيم العددية المميزة لمتغير توزيع قاماً:

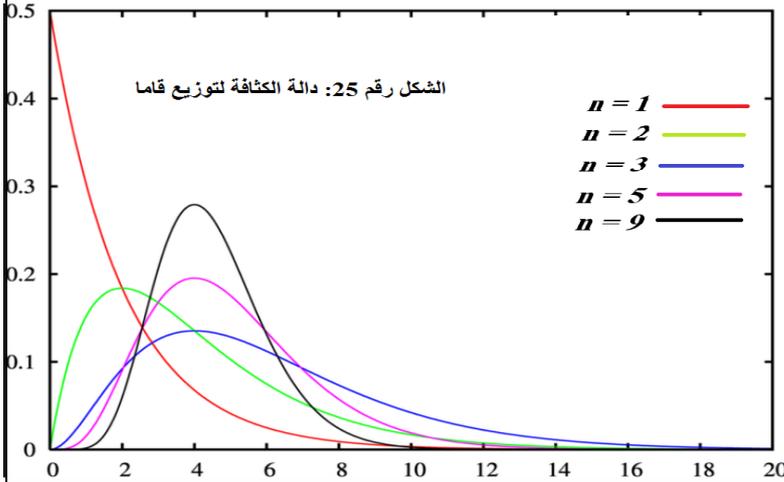
- التوقع الرياضي: $E(x) = \frac{n}{\alpha}$
- التباين: $V(x) = \frac{n}{\alpha^2}$

➤ حالة خاصة: إذا كان $n=1$ فإن

توزيع قاما يصبح
التوزيع الأسي.

➤ الشكل البياني لتوزيع قاما: يأخذ توزيع

قاما أشكالاً مختلفة حسب قيمة المعلمة n ، حيث
كلما كبرت قيمة n كلما آل المنحنى إلى التوزيع
الطبيعي. (أنظر الشكل رقم 25).



المصدر: https://fr.wikipedia.org/wiki/Loi_Gamma

➤ خواصه:

$$* f(x) \geq 0$$

$$* \int_0^{+\infty} f(x) dx = 1$$

➤ تابع توزيع قاما:

$$F(x_k) = p(X \leq x_k) = \frac{1}{\Gamma(n)} \int_0^{x_k} x^{n-1} e^{-x} dx$$

نظرية: إذا كان لدينا متحولين عشوائيين X_1, X_2 خاضعين لتوزيع قاما بمعلمتين n_1, n_2 على الترتيب فإن

المتحول العشوائي X الذي يساوي $(X_1 + X_2)$ خاضع هو الآخر لتوزيع قاما ذي المعلمة n حيث: $n = n_1 + n_2$.

5. توزيع بيتا: *Distribution Bêta*

➤ تعريفه: على غرار توزيع قاما فقد أشتق اسم هذا التوزيع من دالة رياضية معروفة هي "دالة بيتا" وهذه الدالة علاقة وطيدة بدالة قاما.

➤ دالة بيتا: تُعرف الدالة بيتا ذات المعلمتين الموجبتين تماماً m, n كما يلي:

$$\beta(m, n) = \int_0^1 x^{m-1} (1-x)^{n-1} dx$$

➤ العلاقة بين الدالتين "قاما" و"بيتا":

$$\beta(m, n) = \frac{\Gamma(m) \cdot \Gamma(n)}{\Gamma(m+n)}$$

➤ خواص الدالة "بيتا"

$$* \beta(m, n) = \beta(n, m)$$

$$* \beta(1, 1) = 1$$

$$* \beta\left(\frac{1}{2}, \frac{1}{2}\right) = \pi$$

➤ قانون احتمال توزيع بيتا: نقول أن المتحول العشوائي X خاضع لتوزيع بيتا ذي المعلمتين الموجبتين تماما m, n ، ونكتب: $X \sim \beta(m, n)$ ، إذا كانت دالة كثافته معرفة كما يلي:

$$f(x) = \begin{cases} \frac{1}{\beta(m, n)} \cdot x^{m-1} \cdot (1-x)^{n-1} & \dots \dots 0 < X < 1 \\ 0 & \dots \dots \text{فيما عدا ذلك} \dots \dots \end{cases}$$

➤ خواص توزيع بيتا: $f(x) \geq 0$ * $\int_0^1 f(x) dx = 1$ *

➤ المميزات العددية لمتغير توزيع بيتا:

• التوقع الرياضي: $E(x) = \frac{m}{m+n}$

• التباين: $V(x) = \frac{m \cdot n}{(m+n)^2 \cdot (m+n+1)}$

ملاحظة: انطلاقا من العلاقة بين الدالتين Γ و β يمكن كتابة دالة كثافة β بدلالة Γ كما يلي:

$$f(x) = \begin{cases} \frac{\Gamma(m+n)}{\Gamma(m) \cdot \Gamma(n)} \cdot x^{m-1} \cdot (1-x)^{n-1} & \dots \dots 0 < X < 1 \\ 0 & \dots \dots \text{فيما عدا ذلك} \dots \dots \end{cases}$$

➤ تابع توزيع بيتا:

$$F(x_k) = \frac{1}{\beta(m, n)} \int_0^{x_k} x^{m-1} (1-x)^{n-1} dx$$

6. توزيع كاي - مربع χ^2 : (*Distribution Khi Deux*)

➤ تعريفه: اكتشف العالم *Helmert* عام 1876م ثم تطرق له فيما بعد العالم كارل بيرسون عام 1900م وأدخل الرمز اليوناني χ لأول مرة عام 1905م.

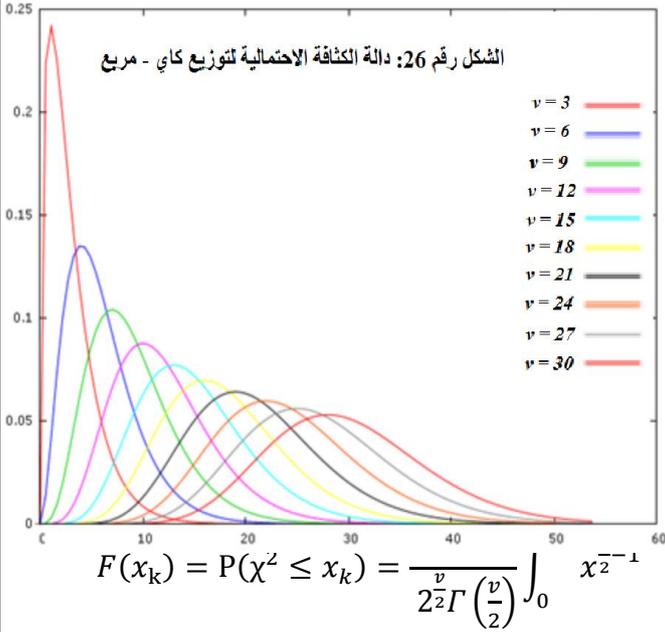
ويعتبر هذا التوزيع من أهم التوزيعات الاحتمالية المستمرة، المستخدمة بكثرة في مجال التقدير واختبارات الفروض من خلال مقارنة مجموعة من المشاهدات مع ما يقابلها نظريا، كما يستعمل في اختبار جودة التوفيق (*L'ajustement*) وكذا استقلال جداول التوافق.

➤ قانون توزيعه احتمالي: إذا كان X متحولا عشوائيا موجبا خاضعا لتوزيع كاي - مربع، ذي المعلمة الموجبة ν (ونكتب: $X \sim \chi^2(\nu)$) فإن دالة كثافته معرفة كما يلي:

$$f(x) = \begin{cases} \frac{1}{(2)^{\frac{\nu}{2}} \Gamma(\frac{\nu}{2})} \cdot e^{-\frac{x}{2}} \cdot x^{\frac{\nu}{2}-1} & \dots \dots X \geq 0 \\ 0 & \dots \dots \text{ذلك عدا ذلك} \dots \dots \end{cases}$$

حيث: ν : عدد صحيح موجب يعكس عدد درجات الحرية، ويرمز له أحيانا بالرمز dl أو df .

Γ: الدالة غاما.



➤ شكله البياني:

يأخذ توزيع χ^2 أشكالاً مختلفة حسب قيمة ν حيث يقترب من التوزيع الطبيعي كلما كبرت قيمة ν (أنظر الشكل 26).

➤ خواصه:

$$\int_0^{+\infty} f(x) dx = 1 \quad * f(x) \geq 0$$

➤ تابع توزيع χ^2 :

المصدر: <http://www.jvbaudot.fr/Stats/khideux.html>

➤ القيم العددية المميزة لـ χ^2 :

• التوقع الرياضي: $E(x) = \nu$

• التباين: $V(x) = 2\nu$

➤ جدول قانون توزيع χ^2 : يلخص هذا الجدول قيم χ^2 عند درجات حرية مختلفة وباحتمالات (مساحات) مختلفة حسب الشكل المبين في أعلى الجدول المخصص لذلك. أنظر الملحق رقم 03.

مثال 11: أوجد احتمال أن تكون قيمة χ^2 عند $\nu = 10$:

أ- أقل من أو تساوي 2.156

ب- أكبر من أو تساوي 15.987

ج- أقل من أو تساوي 23.21

الجواب: قبل الشروع في الحل، لا بد أولاً من شرح مُبسّطٍ لكيفية استخدام الجدول:

يتكون جدول توزيع كاي - مربع - مما يأتي:¹

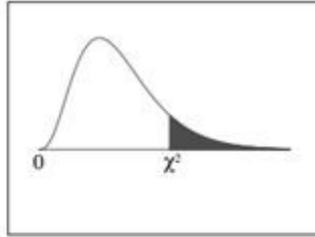
- ✓ العمود الأول: يضم قيم درجات الحرية dl أو df أو ν . (هذه هي الرموز المعتادة للتعبير عن درجة الحرية).
- ✓ السطر الأول: يضم الاحتمال أو مقدار المساحة المضللة بالأسود في الجهة اليمنى² من الشكل الموجود أعلى الجدول.
- ✓ بقية الخانات: تضم قيم المتغير كاي - مربع، والموجودة على محور الفواصل. تنتج هذه الخلايا أو الخانات عن تقاطع الأعمدة والأسطر؛ مثلاً عندما $\nu=5$ (أو dl كما هو في الجدول أدناه) و $p = 0.900$ فإننا نذهب للخانة الناتجة عن تقاطع السطر رقم 06 (أين درجة الحرية تساوي 5) والعمود رقم 06 (أين المساحة أو الاحتمال 0.900) فنجد

¹ قد تختلف هذه المكونات من جدول لآخر، إلا أن النتيجة المتوصل إليها باستخدامها جميعاً ستكون واحدة.
² وقد نجد اختلافاً في جداول كاي-مربع الأخرى، كأن تكون المساحة المضللة في الجهة اليسرى من الشكل.

قيمة كاي-مربع تساوي 1.610 ونكتب $\chi^2_{0.9}(v = 5) = 1.610$ (انظر الخانة الملونة بالبرتقالي في الجدول 11).

الجدول رقم 11: جدول توزيع كاي - مربع.

Chi-Square Distribution Table



The shaded area is equal to α for $\chi^2 = \chi^2_{\alpha}$.

df	$\chi^2_{.995}$	$\chi^2_{.990}$	$\chi^2_{.975}$	$\chi^2_{.950}$	$\chi^2_{.900}$	$\chi^2_{.100}$	$\chi^2_{.050}$	$\chi^2_{.025}$	$\chi^2_{.010}$	$\chi^2_{.005}$
1	0.000	0.000	0.001	0.004	0.016	2.706	3.841	5.024	6.635	7.879
2	0.010	0.020	0.051	0.103	0.211	4.605	5.991	7.378	9.210	10.597
3	0.072	0.115	0.216	0.352	0.584	6.251	7.815	9.348	11.345	12.838
4	0.207	0.297	0.484	0.711	1.064	7.779	9.488	11.143	13.277	14.860
5	0.412	0.554	0.831	1.145	1.610	9.236	11.070	12.833	15.086	16.750
6	0.676	0.872	1.237	1.635	2.204	10.645	12.592	14.449	16.812	18.548
7	0.989	1.239	1.690	2.167	2.833	12.017	14.067	16.013	18.475	20.278
8	1.344	1.646	2.180	2.733	3.490	13.362	15.507	17.535	20.090	21.955
9	1.735	2.088	2.700	3.325	4.168	14.684	16.919	19.023	21.666	23.589
10	2.156	2.558	3.247	3.940	4.865	15.987	18.307	20.483	23.209	25.188
11	2.603	3.053	3.816	4.575	5.578	17.275	19.675	21.920	24.725	26.757
12	3.074	3.571	4.404	5.226	6.304	18.549	21.026	23.337	26.217	28.300
13	3.565	4.107	5.009	5.892	7.042	19.812	22.362	24.736	27.688	29.819
14	4.075	4.660	5.629	6.571	7.790	21.064	23.685	26.119	29.141	31.319
15	4.601	5.229	6.262	7.261	8.547	22.307	24.996	27.488	30.578	32.801
16	5.142	5.812	6.908	7.962	9.312	23.542	26.296	28.845	32.000	34.267

المصدر: <https://www.academia.edu/10107363/Chi-square-table>

ونعود إلى حل المثال رقم 11:

نذهب إلى السطر المقابل لدرجة حرية تساوي 10، ونبحث عن قيم كاي - مربع التي تقابلها داخل الجدول، وفي كل مرة نجد قيمة من قيم كاي - مربع نبحث عما يقابلها من احتمال أو مساحة في السطر الأول.

1. $p(\chi^2 \leq 2,16) = 1 - p(\chi^2 \geq 2,16) = 1 - 0,995 = 0,005$
2. $p(\chi^2 \geq 16) = 0,1$
3. $p(\chi^2 \leq 23,21) = 1 - p(\chi^2 \geq 23,21) = 1 - 0,01 = 0,99$

➤ خصائص توزيع χ^2 :

- إذا كان $v = 2$ فإن توزيع χ^2 يصبح التوزيع الأسّي، أين $\alpha = \frac{1}{2}$.
- إذا وضعنا $x=2y$ و $\frac{x}{2} = n$ ، فإن توزيع χ^2 يصبح توزيع "Γ".
- إذا كان $v > 30$ فإن المتحول العشوائي "u" المعروف كما يلي:

$u = \sqrt{2\chi^2} - \sqrt{2v - 1}$ خاضع تقريباً إلى التوزيع الطبيعي المعياري، حيث يمكن إيجاد قيمة u من

جدول التوزيع الطبيعي المعياري، وتعويضها في القانون التالي لإيجاد قيمة χ^2 عند احتمال معين p:

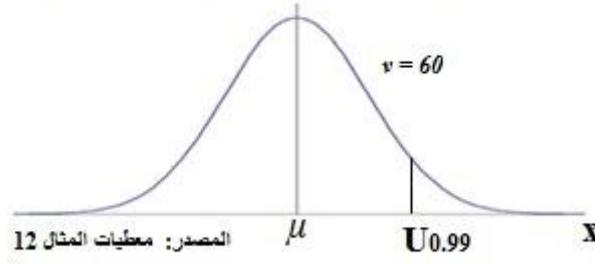
$$\chi^2_p = \frac{1}{2} [u_p + \sqrt{2v - 1}]^2$$

مثال 12: من الجدول رقم 11 أعلاه، "حدد قيمة $\chi^2_{0.99}$ إذا كان $v = 60$.

الجواب: لنستخدم فكرة اقتراب توزيع كاي-مربع من التوزيع الطبيعي لأن $v > 30$

كما رأينا في الشكل رقم 26 أعلاه فإنه عندما $v > 30$ يصبح شكل توزيع كاي-مربع قريبا من شكل التوزيع الطبيعي على النحو الآتي:

الشكل رقم 27: تحول توزيع كاي-مربع إلى التوزيع الطبيعي.



ما علينا الآن سوى الذهاب لجدول التوزيع الطبيعي المعياري، واستخراج قيمة $U_{0.99}$ ، أي القيمة على محور الفواصل التي تحصر خلفها أو على يسارها مساحة قدرها 99%، وبما أن 50% من المساحة محصور بين μ و $-\infty$ فإن ما بقي من المساحة والمحصور بين $U_{0.99}$ و μ يقدر بنسبة 49% .

وعلى ذلك نذهب لجدول التوزيع الطبيعي المعياري ونبحث عن القيمة في محور الفواصل (قيمة Z) المقابلة لاحتمال 0.4900، ونسجدها تقع عند احتمال 0.4901 أي عند $Z_1 = 2.33$ وهي قيمة U التي نبحث عنها، ومنه:

نعوضها في المعادلة السابقة لنجد قيمة كاي مربع كما يلي:

$$\chi^2_{0.99} = \frac{1}{2} [u_{0.99} + \sqrt{2v - 1}]^2 = \frac{1}{2} [2.33 + \sqrt{2(60) - 1}]^2 =$$

وقد يطرح الطالب هنا سؤالاً مهماً: لماذا قمنا بهذه الجولة الطويلة في البحث عن قيمة كاي-مربع في حين كان بإمكاننا استخراجها من جدول كاي، حيث لدينا درجة الحرية 60 والاحتمال 0.99؟

والجواب أننا تعمدنا اختيار درجة الحرية 60 ليتسنى لنا المقارنة بين نتيجة كاي المستخرجة مباشرة من الجدول، ونتيجة كاي المستخرجة بواسطة المعادلة كما في المثال، ونقارن بين النتيجتين لنلاحظ التقارب بينهما.

7. توزيع ستودنت: (*La distribution T de Student*)

- تعريفه: وجد العالم ويليام سيبي قوست *W.S.Gosset* الملقب بـ *Student* أنه لا يمكن إجراء عملية اختبار المعنوية (*test de signification*) على العينات الصغيرة باستخدام التوزيع الطبيعي، رغم خضوع المتحول العشوائي لهذا التوزيع، لذلك وضع توزيعاً آخر للعينات الصغيرة وأطلق عليه اسم "توزيع ستودنت".
- قانون احتماله: إذا كان T متحولاً عشوائياً خاضعاً لتوزيع ستودنت فإن دالة كثافته تعرف كما يلي:

$$f(t) = \begin{cases} \frac{\Gamma\left(\frac{\nu+1}{2}\right)}{\frac{1}{\sqrt{\nu\pi}} \cdot \Gamma\left(\frac{\nu}{2}\right)} \left[1 + \frac{t^2}{\nu}\right]^{-\frac{(\nu+1)}{2}} & \forall t \in]-\infty, +\infty[\end{cases}$$

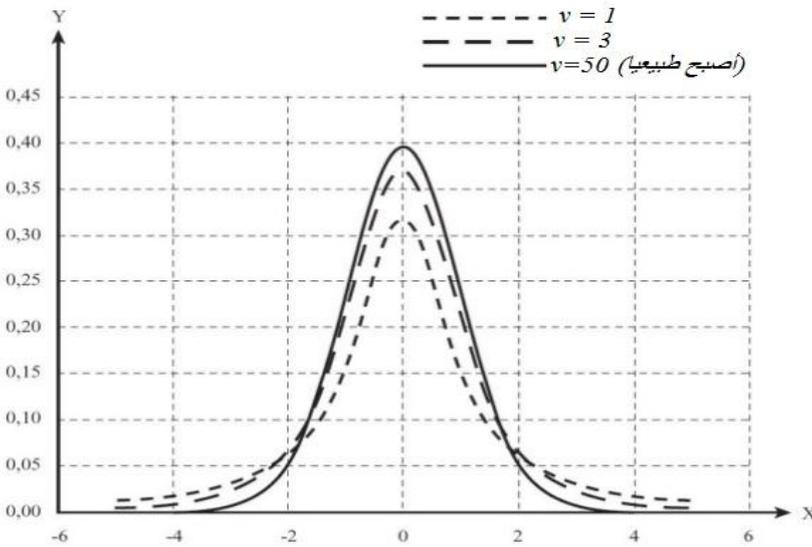
حيث ν درجة الحرية، وتساوي حجم العينة ناقص 1، أي: $\nu = n - 1$

➤ خواصه:

$$* \int_{-\infty}^{+\infty} f(t) dt = 1$$

$$* f(t) \geq 0$$

الشكل رقم 28: توزيع ستودنت حسب درجات الحرية



➤ شكله البياني:

شكله متناظر حول الصفر، و هو أكثر تفلطحاً و إنبساطاً من التوزيع الطبيعي، وكلما زادت قيمة ν كلما إقترب من هذا الأخير، حتى إذا بلغت ν 30 فأكثر يصبح توزيع T قريباً جداً من التوزيع الطبيعي.

المصدر: https://statistics.ead-minerve.fr/Web_FR/co/Distributions%20connues_FR.html

تابع توزيع ستورنت:

$$F(t_k) = P(T \leq t_k) = \frac{\Gamma\left(\frac{\nu+1}{2}\right)}{\frac{1}{\sqrt{\nu\pi}} \cdot \Gamma\left(\frac{\nu}{2}\right)} \int_{-\infty}^{t_k} \left(1 + \frac{t^2}{\nu}\right)^{-\frac{(\nu+1)}{2}} dt$$

➤ القيم العددية المميزة لـ T :

• التوقع الرياضي: $E(t) = 0$

• التباين: $U(t) = \frac{v}{v-2}$ حيث $v > 2$

➤ جدول قانون توزيع T : وضع الإحصائيون جدولاً يساعد على تحديد قيمة T بمعلومية درجة المعنوية α (مستوى الدلالة) ودرجة الحرية v .

مثال 13: أوجد قيمة T إذا كان $v = 7$ و $\alpha = 5\%$.

➤ خصائص توزيع ستورنت:

✓ منحنى T متناظر حول محور الترتيب حيث:

$$P(T \leq t) = 1 - P(T \leq -t) \text{ ومنه } P(T \leq 0) = P(T \geq 0) = 0.5$$

✓ طرفاً منحنى T يمتدان الى مالانهاية في الاتجاهين دون أن يتقاطعا مع المحور الأفقي.

8. توزيع فيشر-سنيديكور " F ": *Distribution de Fisher-Snedecor*

➤ تعريفه: نقول عن متحول عشوائي F أنه يخضع لتوزيع فيشر إذا كانت دالة كثافته معرفة كما يلي:

$$f(t) = \begin{cases} \frac{\Gamma\left(\frac{v_1+v_2}{2}\right)}{\Gamma\left(\frac{v_1}{2}\right) \cdot \Gamma\left(\frac{v_2}{2}\right)} \cdot (v_1)^{\frac{v_1}{2}} \cdot (v_2)^{\frac{v_2}{2}} \cdot (x)^{\frac{v_1}{2}-1} \cdot (v_1 + v_2 x)^{-\left(\frac{v_1+v_2}{2}\right)} & x \geq 0 \\ 0 & \text{فيما عدا ذلك} \end{cases}$$

حيث v_1, v_2 درجتا الحرية لتوزيع F .

➤ خواصه:

$$* \int_0^{+\infty} f(x) dx = 1 \quad * f(t) \geq 0$$

• إذا كان لدينا متغيرين عشوائيين N_1, N_2 خاضعين لتوزيع N^2 بدرجتى حرية v_1, v_2 على الترتيب

فإن المتحول العشوائي F حيث $F = \frac{N_1/v_1}{N_2/v_2}$ خاضع لتوزيع فيشر بدرجتى حرية v_1, v_2

$$F_p(v_1, v_2) = \frac{1}{F_{1-p}(v_2, v_1)}$$

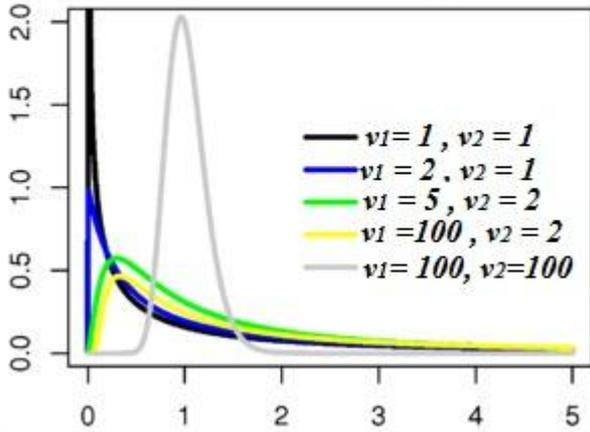
➤ المميزات العددية للمتغير F :

• التوقع الرياضي: $E(x) = \frac{v_2}{v_2-2}$

• التباين : $U(x) = \frac{2v_2^2(v_1+v_2-2)}{v_1(v_2-4)(v_2-2)^2}$ حيث $v_2 > 4$

➤ شكله المياني:

الشكل رقم 29: توزيع فيشر حسب درجات الحرية.



نلاحظ أن شكله يتغير حسب درجتي الحرية v_1 و v_2 بحيث كلما كبرت قيمتهما اقترب من شكل التوزيع الطبيعي، وهذا ما يظهره بوضوح الشكل رقم 29.

المصدر: http://www.statelem.com/loi_de_fisher.php

➤ تابع توزيع فيشر:

$$f(x_k) = P(F \leq x_k) = \frac{\Gamma\left(\frac{v_1+v_2}{2}\right)}{\Gamma\left(\frac{v_1}{2}\right) \Gamma\left(\frac{v_2}{2}\right)} \int_0^{x_k} (v_1)^{\frac{v_1}{2}} \cdot (v_2)^{\frac{v_2}{2}} \cdot (x)^{\frac{v_1}{2}-1} (v_2 + v_1 x)^{-2} dx$$

➤ جدول قانون توزيع فيشر:

يعطي هذا الجدول القيم الممكنة للمتغير العشوائي F عند احتمال معين P وبدرجتي حرية v_1 و v_2 ولهذا

نكتب أحيانا كل هذه المعطيات كما يلي: " $F_p(v_1, v_2)$ " أو " $F_p(v_1, v_2)$ "

يمكن أن نجد جدولين حسب قيمة P: أحدهما عند P=95% (أي مستوى المعنوية $\alpha = 5\%$) والآخر

عند P=95% (أي مستوى المعنوية $\alpha = 1\%$).

مثال 14: أحسب ما يلي:

- $F_{0.95}(1,10)$
- $F_{0.95}(6,1)$
- $F_{0.99}(6,10)$
- $F_{0.95}(\infty, \infty)$