

入学年度	学部	学科	組	番号	検	フリガナ
						氏名

1

$$f(x) = \begin{cases} x & (0 \leq x \leq 1) \\ (2-x) & (1 \leq x \leq 2) \\ 0 & (x < 0, x > 2) \end{cases}$$

で定義される $f(x)$ を確率密度関数とする確率変数 X について $P\left(X < \frac{1}{2}\right)$, 平均 $\mu = E(X)$, 標準偏差 $\sigma = \sigma(X) = \sqrt{V(X)}$ をそれぞれ求めよ

$$P\left(X < \frac{1}{2}\right) = \int_{-\infty}^{\frac{1}{2}} f(x) dx = \int_0^{\frac{1}{2}} x dx = \left[\frac{1}{2}x^2\right]_0^{\frac{1}{2}} = \frac{1}{8}$$

$$E(X) = \int_{-\infty}^{\infty} xf(x) dx = \int_0^1 x \cdot x dx + \int_1^2 x(2-x) dx = \left[\frac{1}{3}x^3\right]_0^1 + \left[x^2 - \frac{1}{3}x^3\right]_1^2 = \frac{1}{3} + \left(\frac{4}{3} - \frac{2}{3}\right) = 1$$

$$\begin{aligned} V(X) &= \int_{-\infty}^{\infty} (x-0)^2 f(x) dx = \int_0^1 (x-1)^2 x dx + \int_1^2 (2-x)(x-1)^2 (2-x) dx \\ &= \left[\frac{1}{4}x^4 - \frac{2}{3}x^3 + \frac{1}{2}x^2\right]_0^1 + \left[-\frac{1}{4}x^4 + \frac{4}{3}x^3 - \frac{5}{2}x^2 + 2x\right]_1^2 = \frac{1}{12} + \left(\frac{2}{3} - \frac{7}{12}\right) = \frac{1}{6} \end{aligned}$$

$$\sigma(X) = \sqrt{V(X)} = \frac{1}{\sqrt{6}}$$

2

$$f(x) = \begin{cases} \frac{3}{4}(1-x^2) & (-1 \leq x \leq 1) \\ 0 & (\text{その他}) \end{cases}$$

で定義される $f(x)$ を確率密度関数とする確率変数 X について $P\left(X < \frac{1}{2}\right)$, 平均 $\mu = E(X)$, 標準偏差 $\sigma = \sigma(X) = \sqrt{V(X)}$ をそれぞれ求めよ.

$$P\left(X < \frac{1}{2}\right) = \int_{-\infty}^{\frac{1}{2}} f(x) dx = \int_{-1}^{\frac{1}{2}} \frac{3}{4}(1-x^2) dx = \left[\frac{3}{4}x - \frac{1}{4}x^3\right]_{-1}^{\frac{1}{2}} = \frac{11}{32} - \left(-\frac{1}{2}\right) = \frac{27}{32}$$

$$E(X) = \int_{-\infty}^{\infty} xf(x) dx = \int_{-1}^1 x \cdot \frac{3}{4}(1-x^2) dx = \left[\frac{3}{8}x^2 - \frac{3}{16}x^4\right]_{-1}^1 = \frac{3}{16} - \frac{3}{16} = 0$$

$$V(X) = \int_{-\infty}^{\infty} (x-0)^2 f(x) dx = \int_{-1}^1 x^2 \cdot \frac{3}{4}(1-x^2) dx = \left[\frac{1}{4}x^3 - \frac{3}{20}x^5\right]_{-1}^1 = \frac{1}{10} - \left(-\frac{1}{10}\right) = \frac{1}{5}$$

$$\sigma(X) = \sqrt{V(X)} = \frac{1}{\sqrt{5}}$$

3] あるハンバーガー店のドライブスルーでのお客さんの到着間隔 Y (分) は次の確率密度関数で表される指数分布に従っているとす。

$$f(x) = \begin{cases} \frac{1}{3}e^{-\frac{x}{3}} & x \geq 0 \\ 0 & x < 0 \end{cases}$$

- a) 平均到着間隔はいくらか。
 b) 5分間車が来ない確率を求めよ。ただし $e^{-5/3} \approx 0.189$ である。

$$f(x) = \begin{cases} \lambda e^{-\lambda x} & x \geq 0 \\ 0 & x < 0 \end{cases} \quad \text{とおくと,}$$

$$\int_{-\infty}^{\infty} f(x) dx = \int_0^{+\infty} \lambda e^{-\lambda x} dx = \left[\lambda \cdot \frac{1}{-\lambda} e^{-\lambda x} \right]_0^{+\infty} = \lim_{x \rightarrow +\infty} e^{-\lambda x} - (-1) = 0 + 1 = 1$$

となり、 $f(x)$ は確率密度関数となる。この分布 X の期待値 $E(X)$ は、

$$\begin{aligned} E(X) &= \int_{-\infty}^{\infty} x f(x) dx = \int_0^{+\infty} \lambda x e^{-\lambda x} dx = \left[-x e^{-\lambda x} \right]_0^{+\infty} + \int_0^{+\infty} e^{-\lambda x} dx \\ &= \lim_{x \rightarrow +\infty} (-x e^{-\lambda x}) - (-0) + \left[-\frac{1}{\lambda} e^{-\lambda x} \right]_0^{+\infty} = \lim_{x \rightarrow +\infty} \left(-\frac{1}{\lambda} e^{-\lambda x} \right) - \left(-\frac{1}{\lambda} \right) = \frac{1}{\lambda} \end{aligned}$$

また、分散 $V(X)$ を計算公式 $V(X) = E(X^2) - E(X)^2$ 用いて計算すると、

$$\begin{aligned} E(X^2) &= \int_{-\infty}^{\infty} x^2 f(x) dx = \int_0^{+\infty} \lambda x^2 e^{-\lambda x} dx = \left[-x^2 e^{-\lambda x} \right]_0^{+\infty} + \int_0^{+\infty} 2x e^{-\lambda x} dx \\ &= \lim_{x \rightarrow +\infty} (-x^2 e^{-\lambda x}) + 0 + \left[-\frac{2}{\lambda} x e^{-\lambda x} \right]_0^{+\infty} + \int_0^{+\infty} \frac{2}{\lambda} e^{-\lambda x} dx \\ &= 0 + \lim_{x \rightarrow +\infty} \left(-\frac{2}{\lambda} x e^{-\lambda x} \right) + 0 + \left[-\frac{2}{\lambda^2} e^{-\lambda x} \right]_0^{+\infty} = \lim_{x \rightarrow +\infty} \left(-\frac{2}{\lambda^2} e^{-\lambda x} \right) - \left(-\frac{2}{\lambda^2} \right) \\ &= 0 + \frac{2}{\lambda^2} = \frac{2}{\lambda^2} \\ V(X) &= E(X^2) - E(X)^2 = \frac{2}{\lambda^2} - \left(\frac{1}{\lambda} \right)^2 = \frac{1}{\lambda^2} \end{aligned}$$

a) $\lambda = \frac{1}{3}$ の場合なので、平均到着時間 $E(Y)$ は $\frac{1}{\frac{1}{3}} = 3$ (分)

b) $P(Y \geq 5) = \int_5^{\infty} f(x) dx = \int_5^{\infty} \frac{1}{3} e^{-\frac{x}{3}} dx = \left[-e^{-\frac{x}{3}} \right]_5^{\infty} = -\lim_{M \rightarrow \infty} e^{-\frac{M}{3}} + e^{-\frac{5}{3}} = e^{-\frac{5}{3}} \approx 0.189$

[微分積分を履修していない人へ] e とは、 π と同様にある実数の定数であって、その値は $e = 2.718281828459045\dots$ であり、「Napier の数」とか「自然対数の底」と呼ばれる。 e のもつ一番大事な性質は、指数関数 $f(x) = e^x$ を考えると、その導関数が $f'(x)$ が e^x に一致すること、すなわち

$$(e^x)' = e^x$$

であることである。 2^x や 10^x の導関数はこのように簡単には表されず、微積分がかかわる理論においては指数関数は通常 e を底とする指数関数 e^x を用いる。

連鎖律 (合成関数の微分公式) : $(f(g(x)))' = f'(g(x))g'(x)$ を用いれば、 a を定数とすると、

$$(e^{ax})' = a e^{ax}, \quad \int e^{ax} dx = \frac{1}{a} e^{ax} + C$$

が成り立つ。また、 a が正数のとき、 x を大きくするにしたがって e^{-ax} は急激に減少する関数で、 $\lim_{x \rightarrow +\infty} e^{-ax} = 0$ となる。これより、

$$\int_0^{+\infty} e^{-ax} dx = \left[\frac{-1}{a} e^{-ax} \right]_0^{+\infty} = \lim_{x \rightarrow +\infty} \left(\frac{-1}{a} e^{-ax} \right) - \left(\frac{-1}{a} e^0 \right) = \frac{1}{a}$$

が成り立つ。また、部分積分の公式 : $\int_a^b f(x)g'(x) dx = [f(x)g(x)]_a^b - \int_a^b f'(x)g(x) dx$ により、

$$\int_0^{+\infty} x e^{-ax} dx = \left[x \cdot \frac{-1}{a} e^{-ax} \right]_0^{+\infty} - \int_0^{+\infty} \frac{-1}{a} e^{-ax} dx = \frac{1}{a} \int_0^{+\infty} e^{-ax} dx = \frac{1}{a^2}$$

が成り立つ。

a が正数のとき、どんな自然数 n についても $\lim_{x \rightarrow +\infty} x^n e^{-ax} = 0$ が成り立つことにも注意しておく必要があった。