



СИНГУЛЯРНОЕ РАСПРЕДЕЛЕНИЕ

СИНГУЛЯРНОЕ РАСПРЕДЕЛЕНИЕ, распределение вероятностей, для которого функция распределения $F(x)$ непрерывна на всей действительной оси и мера Лебега множества её точек роста равна нулю. При этом точка x называется точкой роста функции $F(x)$, если $F(x+\varepsilon)-F(x-\varepsilon) > 0$ для любого $\varepsilon > 0$. Точками роста $F(x)$ для [дискретного распределения](#) являются её точки разрыва и предельные для них, а для абсолютно непрерывного распределения, т. е. для распределения, имеющего [плотность вероятности](#), точками роста заведомо являются точки x , в которых плотность положительна и непрерывна. Самый известный пример С. р. даёт распределение Кантора, для функции распределения которого множество точек роста совпадает с [Кантора множеством](#). В прикладных задачах С. р. практически не встречаются. Любая функция распределения $G(x)$ допускает представление $G(x)=p_{ac}G_{ac}(x)+p_sG_s(x)+p_dG_d(x)$, где сумма неотрицательных чисел p_{ac} , p_s , p_d равна единице, а $G_{ac}(x)$, $G_s(x)$, $G_d(x)$ – абсолютно непрерывная, сингулярная и дискретная функции распределения. Правая часть последнего равенства называется разложением Лебега функции $G(x)$.

Литература

Лит.: Лукач Е. Характеристические функции. М., 1979.

Loading [MathJax]/jax/element/mml/optable/GreekAndCoptic.js