第一章 随机事件及其概率

0.	绪论
1.	随机事件的运算与关系
2.	古典概率的计算（排列组合知识）
3.	概率的性质（对应公理化定义）
4.	条件概率与乘法公式
5.	全概率公式与贝叶斯公式
6.	事件的独立性

第1章3节　条件概率

引例： 假设生男生女概率相等。

已知某家庭第一胎是女孩，则第二胎是男孩的概率有多大?

若已知该家庭中有两个小孩，其中一个是女孩，则另一个是男孩的概率有多大?

这两个问题是一回事，生男孩的概率都是1/2？还是这两个问题的概率有所不同，区别在哪里?

第1章3节 条件概率

在计算事件的概率时，一个事件常与另一个事件有一定的联系。

这种已知事件B发生的条件下，事件A发生的可能性大小称为条件概率，记为P(A|B)。

定义

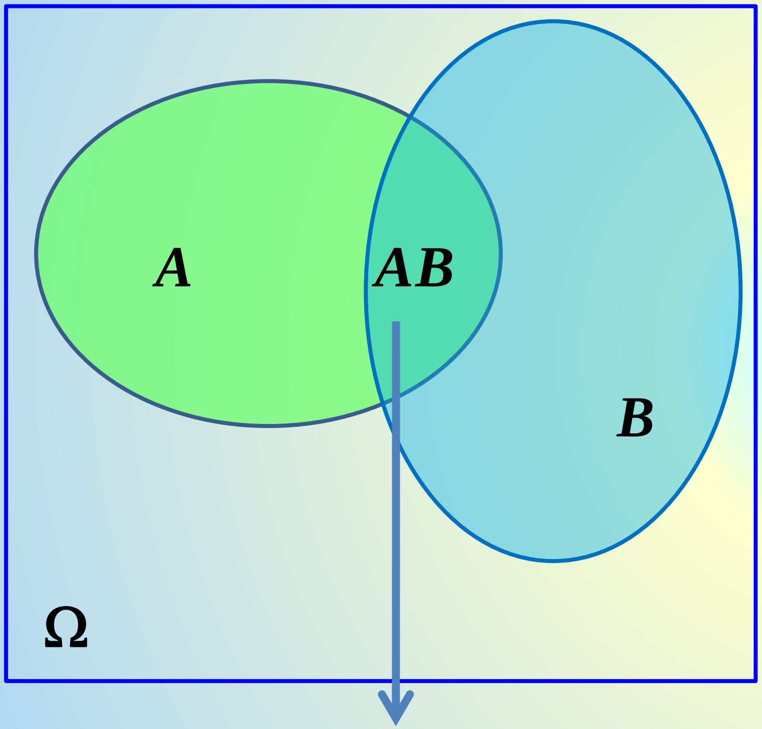
设A、B是随机试验E的两个随机事件，且$P(B)>0$，称

$$P(A|B)=\frac{P(AB)}{P(B)}$$

为在**事件B发生的条件下，事件A发生的条件概率**。

第1章3节　条件概率

- 直观图示理解



$$P(A|B)=\frac{P(AB)}{P(B)}$$

- 理解

设满足古典概型

设Ω所含基本事件数为n

设A所含基本事件数为m_A

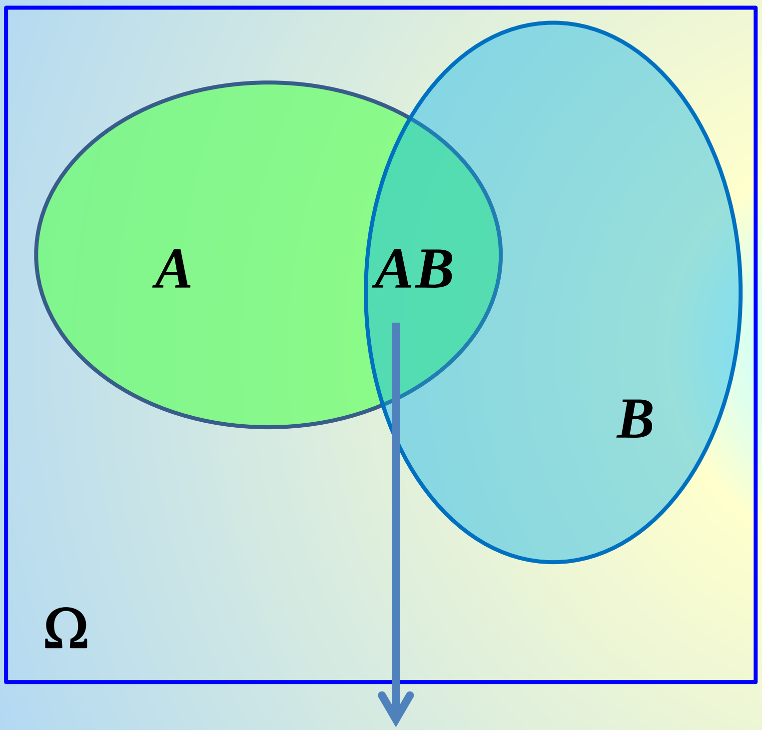
设B所含基本事件数为m_B

设AB所含基本事件数为m_{AB}

$$P(A|B)=\frac{m_{AB}}{m_B}=\frac{m_{AB}/n}{m_B/n}=\frac{P(AB)}{P(B)}$$

第1章3节　条件概率

- 直观图示理解



$$P(A|B)=\frac{P(AB)}{P(B)}$$

- 理解：以扑克牌为例

Ω所含基本事件数为54

设A={取出牌为红心}

　B={取出牌为K}

则AB={取出牌为红心K}

$$P(A)=\frac{13}{54},\quad P(B)=\frac{4}{54},\quad P(AB)=\frac{1}{54}$$

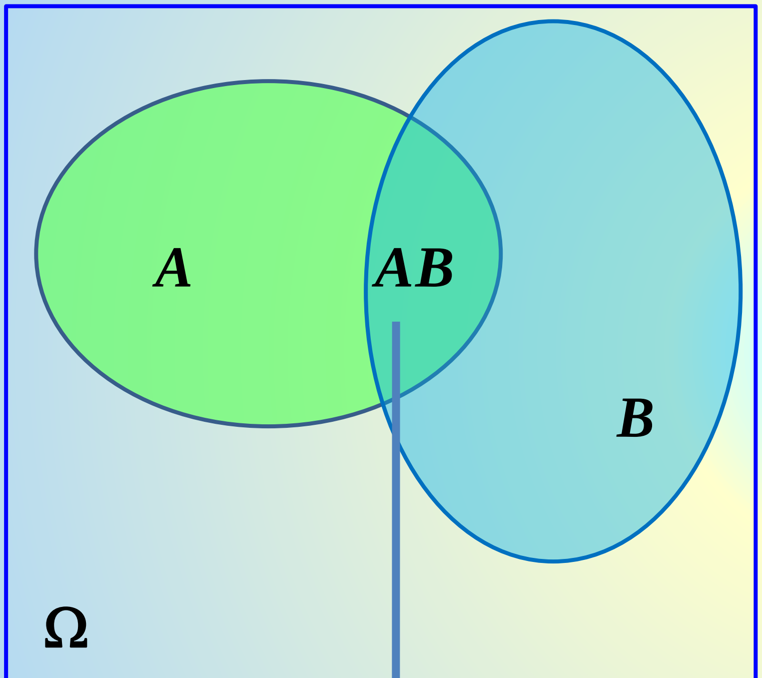
$$P(A|B)=\frac{1}{4}=\frac{P(AB)}{P(B)}$$

$$P(B|A)=\frac{1}{13}=\frac{P(AB)}{P(A)}$$

注意：$\boxed{P(A|B)\neq P(B|A)}$

第1章3节　条件概率

- **直观图示理解**



$$P(A|B)=\frac{P(AB)}{P(B)}$$

思考三个概率的区别：

P(AB)、P(A|B)、P(B|A)

- P(AB)是AB同时发生的概率
- P(A|B)是B发生条件下A发生（或者AB同时发生）的概率
- P(B|A)是A发生条件下B发生（或者AB同时发生）的概率

- 三者各不相同——即便有时概率值相同，表达的含义也不一样

电子科技大学数学科学学院 杜鸿飞　hongfeidu@qq.com

第1章3节　条件概率

引例： 假设生男生女概率相等。已知某家庭第一胎是女孩，则第二胎是男孩的概率有多大?

若已知该家庭中有两个小孩，其中一个是女孩，则另一个是男孩的概率有多大?

思路： 这两个问题不是一回事，概率有所不同

1. 家庭中有两个小孩，样本空间是{男男、男女、女男、女女}
2. 家庭第一胎是女孩，样本空间是{女男，女女}

根据条件概率的定义，利用古典概率可以计算：

- 第一胎是女孩，则第二胎是男孩的概率为1/2
- 一个是女孩，则另一个是男孩的概率为2/3

样本空间是什么?

第1章3节　条件概率

◆条件概率性质

1. $0 \le P(A|B) \le 1$

2. $P(\Omega|B) = 1$

3. 若事件$A_1, A_2, \dots$互不相容，则

$$P\left(\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i \,\middle|\, B\right) = \sum_{i=1}^{\infty} P(A_i|B)$$

性质3证明：

条件概率定义

$$P\left(\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i \,\middle|\, B\right) = \frac{P\left[\left(\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i\right) \cap B\right]}{P(B)}$$

分配律

$$= \frac{P\left[\bigcup_{i=1}^{\infty} (A_i B)\right]}{P(B)} = \frac{\sum_{i=1}^{\infty} P(A_i B)}{P(B)}$$

可列可加性

$$= \sum_{i=1}^{\infty} \frac{P(A_i B)}{P(B)} = \sum_{i=1}^{\infty} P(A_i|B)$$

条件概率定义

第1章3节　乘法公式

定理

设$P(B)>0$，则有

$$P(AB)=P(B)P(A|B)$$

若$P(A)>0$，则有

$$P(AB)=P(A)P(B|A)$$

更一般地有：

若$P(A_1A_2\cdots A_{n-1})>0$，则

$$P(A_1A_2\ldots A_{n-1}A_n)=P(A_1)P(A_2|A_1)\ldots P(A_n|A_1A_2\ldots A_{n-1})$$

由条件概率？

分母不能为0？

$$P(A_1)P(A_2|A_1)\ldots P(A_n|A_1A_2\ldots A_{n-1})$$

$$\cancel{P(A_1)}\times\frac{\cancel{P(A_1A_2)}}{\cancel{P(A_1)}}\times\frac{P(A_1A_2A_3)}{\cancel{P(A_1A_2)}}\times\cdots\frac{P(A_1A_2\cdots A_n)}{P(A_1A_2\cdots A_{n-1})}$$

第1章3节 乘法公式

更一般地有：

若 $P(A_1A_2\ldots A_{n-1})>0$，则

$$P(A_1A_2\ldots A_{n-1}A_n)=P(A_1)P(A_2|A_1)\ldots P(A_n|A_1A_2\ldots A_{n-1})$$

由概率单调性

条件概率，分母不能为0!

$$A_1\supset A_1A_2\supset A_1A_2A_3\supset\cdots A_1A_2\cdots A_{n-1}$$

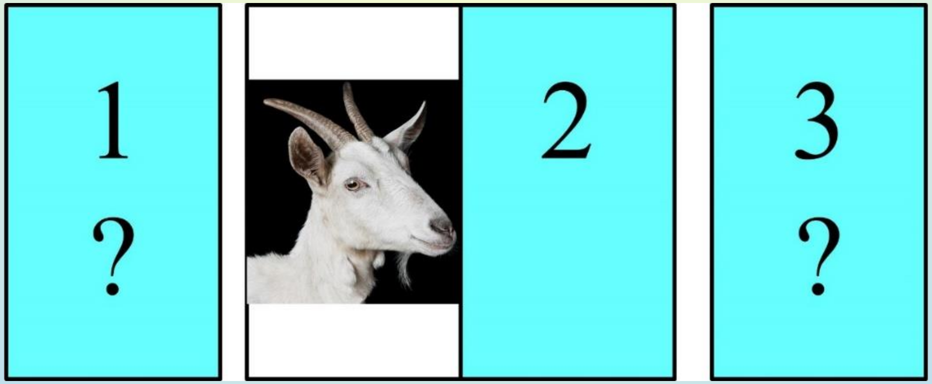
$$P(A_1)\geq P(A_1A_2)\geq P(A_1A_2A_3)\geq\cdots\geq P(A_1A_2\cdots A_{n-1})$$

例： 空战试验

第1章3节　全概率公式

　　蒙提霍尔问题，也称**三门问题**，出自美国的电视游戏节目Let's Make a Deal，节目主持人为蒙提·霍尔(Monty Hall)。参赛者面对三扇关闭着的门，其中一扇后面是汽车，选中该门就可以赢得汽车，另外两扇门后面各有一只山羊；当参赛者选择一门但未开启的时候，然后知道门后面有什么的主持人，会开启剩下两门中的一扇露出其中的山羊，然后主持人问参赛者是否更换选择去选另一扇关着的门。

　　问题是：**更换选择是否会增加参赛者赢得汽车的机率？**

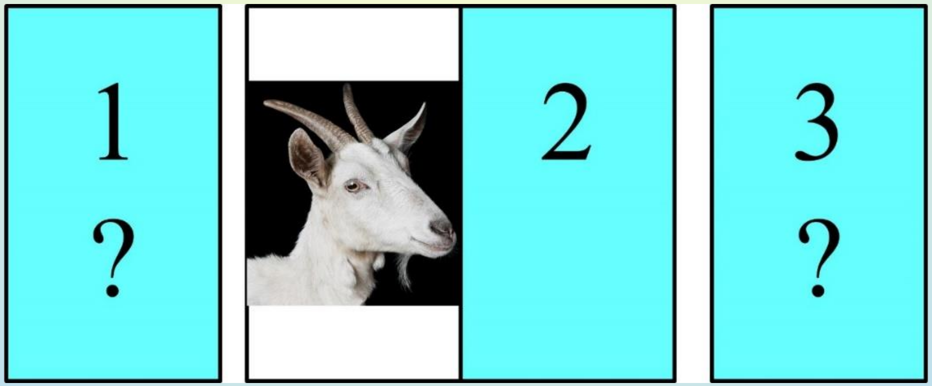


第1章3节　全概率公式

蒙提霍尔问题，也称三门问题，出自美国的电视游戏节目Let's Make a Deal，节目主持人为蒙提·霍尔(Monty Hall)。

很多人认为：参赛者选择门的时候并不知道门后面的东西，所以有1/3概率选到车；经主持人淘汰一个后面是山羊的门，剩下两个门一个是山羊，一个是汽车，因此有1/2的概率选到汽车；参赛者无论换或者不换，赢得汽车的机率是50%。

但主持人给出的答案是：应该换！



如何分析不同的选择对结果的影响?

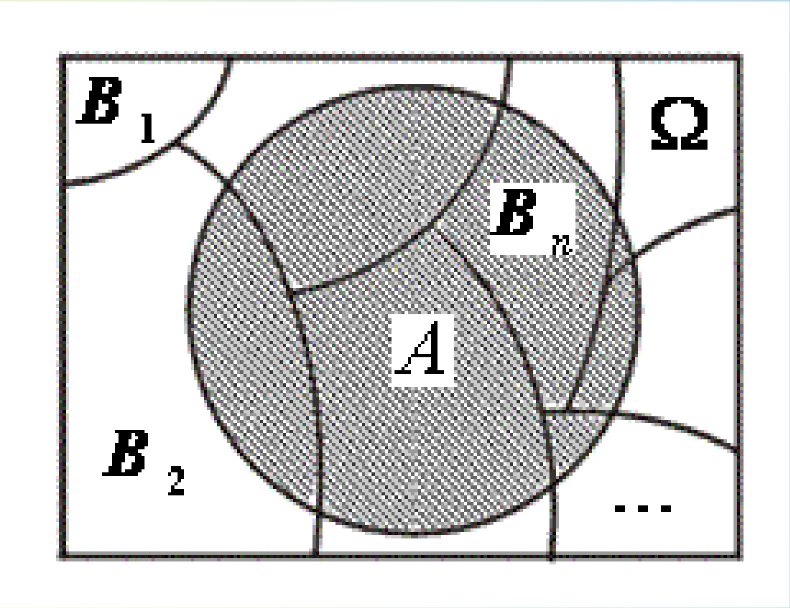
第1章3节　全概率公式

- 计算事件的概率有时可能很复杂，为简化问题可以对基本事件进行分类计算。
- 如右图

$A = A \cap \Omega$

$= A \cap (B_1 \cup B_2 \cup \ldots \cup B_n)$

$= AB_1 \cup AB_2 \cup \ldots \cup AB_n$



要计算A的概率，将

$AB_1, AB_2, \ldots, AB_n$的概率加起来即可

$B_1, B_2, \ldots, B_n$的含义？如何

电子科技大学数学科学学院 杜鸿飞　hongfeidu@qq.com

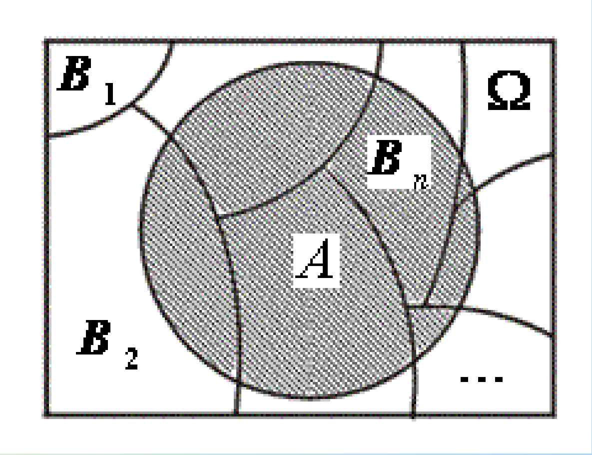
第1章3节　全概率公式

引例：→ **摸球试验**

定义　设Ω为随机试验E的样本空间，$B_1, B_2, \cdots, B_n$为E的一组事件，若

(1) $B_i \cap B_j = \Phi$, $i \neq j$

(2) $B_1 \cup B_2 \cup \cdots \cup Bn = \Omega$



称$B_1, B_2, \cdots, B_n$为Ω的一个有限划分.

第1章3节　全概率公式

定理(全概率公式)

设随机试验E的样本空间为Ω，$A \subset \Omega$，$B_1, B_2, \cdots, B_n$为Ω的一个有限划分，且$P(B_i) > 0, i = 1, 2, \cdots, n$，则有

$$P(A) = \sum_{i=1}^{n} P(B_i) P(A \mid B_i)$$

$\Omega = B_1 \cup B_2 \cup \cdots \cup B_n$

证明： $B_1, B_2, \cdots, B_n$为Ω的一个有限划分

$$A = A \cap \Omega = A \cap (B_1 \cup B_2 \cup \cdots \cup B_n) = \bigcup_{i=1}^{n} (AB_i)$$

分配律

第1章3节　全概率公式

$B_1, B_2, \cdots, B_n$ 互不相容

故， $AB_1, AB_2, \cdots, AB_n$ 互不相容

有限可加性

$$P(A) = P\left(\bigcup_{i=1}^{n}(AB_i)\right) = \sum_{i=1}^{n} P(AB_i)$$

乘法公式

$$= \sum_{i=1}^{n} P(B_i)P(A|B_i)$$

【证毕】

该公式常用在预测推断中，又称为**事前概率**。

第1章3节　全概率公式

蒙提霍尔问题理论推导:

仔细分析可知在游戏中，主持人知道门后面的东西，因此主持人肯定会开启背后是山羊的门，这是一个十分重要的隐藏条件！下面用全概率公式给出理论推导思路。

设A={参赛者最初选中汽车}，B={更换选择后选中汽车}

可知 $P(A)=1/3$，$P(B|A)=0$，$P(B|\overline{A})=1$

$$P(B)=P(A)P(B|A)+P(\overline{A})P(B|\overline{A})$$
$$=\frac{1}{3}\times 0+\left(1-\frac{1}{3}\right)\times 1=\frac{2}{3}$$

说明更换选择后，赢得汽车的概率由1/3上升为2/3，因此参赛者应该更换选择。

第1章3节　全概率公式

定理(全概率公式)

设随机试验E的样本空间为Ω，$A \subset \Omega$，$\mathrm{B}_1, \mathrm{B}_2, \cdots, B_n$为$\Omega$的一个有限划分，且$P(B_i) > 0, i = 1, 2, \cdots, n$，则有

$$P(A) = \sum_{i=1}^{n} P(AB_i) = \sum_{i=1}^{n} P(B_i)P(A|B_i)$$

该公式常用在预测推断中，又称为**事前概率**。

例：

抽检试验

抽签的公平性

第1章3节 贝叶斯公式

在应用中常遇到：

已知结果发生，去找出最有可能导致它发生的原因。

定理（贝叶斯公式）： 设随机试验E的样本空间为Ω，$A\subset\Omega$，$B_1, B_2, \cdots, B_n$为Ω的一个有限划分，且$P(B_i)>0, i=1,2,\cdots,n$，则有

$$P(B_j\mid A)=\frac{P(B_j)P(A\mid B_j)}{\sum_{i=1}^{n}P(B_i)P(A\mid B_i)}$$

第1章3节 贝叶斯公式

证明:

乘法公式

$$P(B_j|A)=\frac{P(AB_j)}{P(A)}=\frac{P(AB_j)}{\sum_{i=1}^{n}P(AB_i)}=\frac{P(B_j)P(A|B_j)}{\sum_{i=1}^{n}P(B_i)P(A|B_i)}$$

全概率公式

【证毕】

该公式常用于根据结果推测原因，称为<u>事后概率</u>。

在实际应用中，常把事件A看成“结果”，把事件B_1，B_2，…，B_n看成导致该结果的可能的“原因”。

实例如：设备维修，计算机诊病等。

例： 病情诊断试验　慎用测谎仪

条件概率一般用法