

第七讲大数定律

龚鹤扬

中国科学技术大学统计学博士
上海芯梯科技有限公司

2025 年 5 月 7 日

目录

- 1 引言
- 2 切比雪夫不等式
- 3 弱大数定律 (WLLN)
- 4 强大数定律 (SLLN)
- 5 大数定律的应用
- 6 总结与展望

引言：大数定律的重要性与局限

并非对所有随机变量都成立的普适规律

- 本讲主题：大数定律 (LLN) - 重要的极限定理。
- 核心思想：大量重复试验中，频率 \rightarrow 概率；样本均值 \rightarrow 总体期望。
- LLN：理论概率 \leftrightarrow 统计推断的桥梁；多种统计方法的基础。
- 重要：LLN 结论依赖特定条件 (如期望存在、方差有限)。
- 条件不满足？LLN 可能失效。反例：柯西分布，探讨条件必要性。

7.1 切比雪夫不等式 (Chebyshev's Inequality)

一个重要的概率上界

- 作用：给出随机变量偏离期望概率的**上界**。
- 特点：不依赖具体分布，仅需**期望**、**方差**存在且有限。

7.1 切比雪夫不等式 (Chebyshev's Inequality)

一个重要的概率上界

- 作用：给出随机变量偏离期望概率的**上界**。
- 特点：不依赖具体分布，仅需**期望**、**方差**存在且有限。

定理 7.1 (切比雪夫不等式)

设随机变量 X 具有期望 $E(X) = \mu$ 和方差 $\text{Var}(X) = \sigma^2$ (其中 $0 < \sigma^2 < +\infty$)。则对于任意正数 $\epsilon > 0$ ，有：

$$P(|X - \mu| \geq \epsilon) \leq \frac{\sigma^2}{\epsilon^2}$$

或者等价地：

$$P(|X - \mu| < \epsilon) \geq 1 - \frac{\sigma^2}{\epsilon^2}$$

7.1 切比雪夫不等式 (Chebyshev's Inequality)

一个重要的概率上界

- 作用：给出随机变量偏离期望概率的**上界**。
- 特点：不依赖具体分布，仅需**期望**、**方差**存在且有限。

定理 7.1 (切比雪夫不等式)

设随机变量 X 具有期望 $E(X) = \mu$ 和方差 $\text{Var}(X) = \sigma^2$ (其中 $0 < \sigma^2 < +\infty$)。则对于任意正数 $\epsilon > 0$ ，有：

$$P(|X - \mu| \geq \epsilon) \leq \frac{\sigma^2}{\epsilon^2}$$

或者等价地：

$$P(|X - \mu| < \epsilon) \geq 1 - \frac{\sigma^2}{\epsilon^2}$$

意义与特点：

- **普适性**：条件满足时，对任何分布成立。
- **实用性**：分布未知时的粗略估计。
- **局限性**：界限通常较宽松。

7.2 弱大数定律 (Weak Law of Large Numbers, WLLN)

样本均值的依概率收敛

WLLN 核心：特定条件下，样本均值 **依概率收敛** 于总体期望。

定理 7.2 (切比雪夫弱大数定律)

设 $X_1, X_2, \dots, X_n, \dots$ 是一列**相互独立**、具有相同期望 $E(X_i) = \mu$ 和相同**有限方差** $\text{Var}(X_i) = \sigma^2 < +\infty$ 的随机变量序列。令样本均值为 $\bar{X}_n = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i$ 。则对于任意 $\epsilon > 0$ ，有：

$$\lim_{n \rightarrow \infty} P(|\bar{X}_n - \mu| \geq \epsilon) = 0$$

或者等价地：

$$\lim_{n \rightarrow \infty} P(|\bar{X}_n - \mu| < \epsilon) = 1$$

这表示样本均值 \bar{X}_n **依概率收敛** 于 μ ，记作 $\bar{X}_n \xrightarrow{P} \mu$ 。

注：依赖方差有限；由切比雪夫不等式证明。

伯努利弱大数定律

频率的稳定性

定理 7.3 (伯努利弱大数定律)

设 n_A 是 n 次独立重复伯努利试验中事件 A 发生的次数, p 是事件 A 在每次试验中发生的概率。令 $f_n = \frac{n_A}{n}$ 为事件 A 发生的频率。则对于任意 $\epsilon > 0$, 有:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} P(|f_n - p| \geq \epsilon) = 0$$

揭示了“频率稳定性”本质: n 很大时, f_n 高概率接近 p 。

注: 切比雪夫 *WLLN* 特例; 频率估计概率的理论依据。

期望存在的重要性：引入柯西分布

一个大数定律不成立的著名反例

柯西分布 (Cauchy Distribution)

PDF:

$$f(x; x_0, \gamma) = \frac{1}{\pi\gamma \left[1 + \left(\frac{x-x_0}{\gamma} \right)^2 \right]}$$

x_0 : 位置参数 (峰值、中位数、众数); $\gamma > 0$: 尺度参数 (宽度、半峰全宽)。

标准柯西 ($x_0 = 0, \gamma = 1$): $f(x) = \frac{1}{\pi(1+x^2)}$ 。

特点:

- 钟形对称, 但**重尾** (比正态分布尾部厚)。
- **期望 $E(X)$ 不存在** (积分发散)。
- **方差 $\text{Var}(X)$ 亦不存在**。

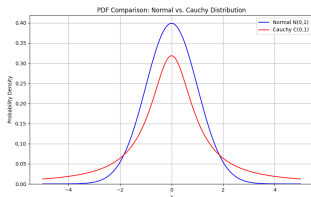


图: *

PDFs: $N(0,1)$ vs $C(0,1)$

对 **LLN** 的影响:

- 不满足 LLN 的”期望存在/方差有限”条件。
- i.i.d. 柯西序列的样本均值**不收敛**。

可视化：正态 vs. 柯西样本均值路径

样本均值随样本量 n 变化的轨迹

正态分布 $N(0, 1)$
($E(X) = 0$, $\text{Var}(X) = 1$)

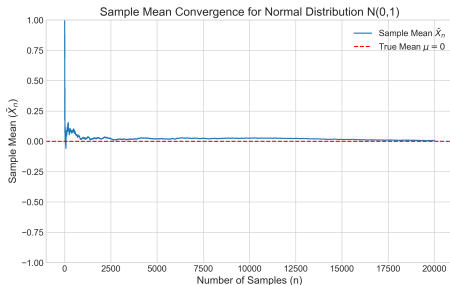


图: \bar{X}_n 快速稳定收敛到 $\mu = 0$

柯西分布 $C(0, 1)$
($E(X)$ 不存在)

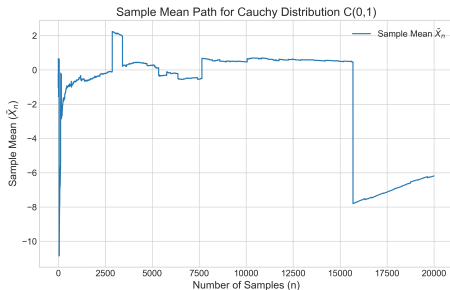


图: \bar{X}_n 持续剧烈波动, 不收敛

柯西样本均值：持续波动，不收敛 (极端值影响)

辛钦弱大数定律 (Khinchin's WLLN)

期望存在即可保证依概率收敛 (i.i.d. 情况)

辛钦 WLLN: i.i.d. 序列, 仅要求**期望存在** (无需方差有限)。

定理 7.4 (辛钦弱大数定律)

设 $X_1, X_2, \dots, X_n, \dots$ 是一列**独立同分布 (i.i.d.)** 的随机变量序列, 且其共同的期望 $E(X_i) = \mu$ **存在** (即 $|\mu| < \infty$)。令样本均值为 $\bar{X}_n = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i$ 。则对于任意 $\epsilon > 0$, 有:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} P(|\bar{X}_n - \mu| \geq \epsilon) = 0$$

即 $\bar{X}_n \xrightarrow{P} \mu$ 。

柯西分布与辛钦 WLLN:

- i.i.d. 柯西序列: 期望**不存在** \implies **不满足**辛钦 WLLN 条件。
- 结论: 其样本均值 \bar{X}_n **不**依概率收敛。

7.3 强大数定律 (Strong Law of Large Numbers, SLLN)

样本均值的几乎必然收敛 (更强的收敛)

SLLN: 更强收敛性, 样本均值**几乎必然收敛** ($\xrightarrow{a.s.}$) 于总体期望 (同样要求期望存在)。

定理 7.5 (柯尔莫哥洛夫强大数定律)

设 $X_1, X_2, \dots, X_n, \dots$ 是一列**独立同分布 (i.i.d.)** 的随机变量序列, 且其共同的期望 $E(X_i) = \mu$ **存在** (即 $|\mu| < \infty$)。令样本均值为 $\bar{X}_n = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i$ 。则:

$$P\left(\lim_{n \rightarrow \infty} \bar{X}_n = \mu\right) = 1$$

这表示样本均值 \bar{X}_n **几乎处处收敛** (Almost Surely Converge) 于 μ , 记作 $\bar{X}_n \xrightarrow{a.s.} \mu$ 。

柯西分布与 SLLN:

- i.i.d. 柯西序列: 期望**不存在** \implies **不满足**SLLN 条件。
- 结论: 其样本均值 \bar{X}_n **不几乎必然收敛**。

注: 柯尔莫哥洛夫强大数定律的条件与辛钦弱大数定律相同 (i.i.d. 且期望存在), 但结论更强。

WLLN 与 SLLN 的区别与联系 (1): 核心概念与正态分布

依概率收敛 vs. 几乎必然收敛

核心区别:

- **WLLN** - 依概率收敛 (\xrightarrow{P}): $\lim_{n \rightarrow \infty} P(|\bar{X}_n - \mu| \geq \epsilon) = 0$. 关注概率的极限。
- **SLLN** - 几乎必然收敛 ($\xrightarrow{a.s.}$): $P(\lim_{n \rightarrow \infty} \bar{X}_n = \mu) = 1$. 关注样本路径的极限。

WLLN 与 SLLN 的区别与联系 (1): 核心概念与正态分布

依概率收敛 vs. 几乎必然收敛

核心区别:

- **WLLN** - 依概率收敛 (\xrightarrow{P}): $\lim_{n \rightarrow \infty} P(|\bar{X}_n - \mu| \geq \epsilon) = 0$. 关注**概率**的极限。
- **SLLN** - 几乎必然收敛 ($\xrightarrow{a.s.}$): $P(\lim_{n \rightarrow \infty} \bar{X}_n = \mu) = 1$. 关注**样本路径**的极限。

条件与对比:

- SLLN 比 WLLN **更强** ($\xrightarrow{a.s.} \implies \xrightarrow{P}$)。
- 两者最广泛应用的 i.i.d. 版本都要求 **期望存在** ($|\mu| < \infty$)。
- 对于正态分布 (例如 $N(\mu, \sigma^2)$):
 - 期望 μ 存在、方差 σ^2 有限 \implies 满足 LLN 条件。
 - i.i.d. 正态样本均值 \bar{X}_n : $\xrightarrow{P} \mu$ 且 $\xrightarrow{a.s.} \mu$ 。

WLLN 与 SLLN 的区别与联系 (2): 柯西分布反例

期望不存在导致大数定律失效

回顾柯西分布的关键特性:

- 期望不存在 \implies 不满足 LLN 的期望存在条件。

WLLN 与 SLLN 的区别与联系 (2): 柯西分布反例

期望不存在导致大数定律失效

回顾柯西分布的关键特性:

- 期望**不存在** \implies 不满足 LLN 的期望存在条件。

对于 i.i.d. 柯西序列的样本均值 \bar{X}_n :

- $\bar{X}_n \not\xrightarrow{P} \text{const}$
- $\bar{X}_n \not\xrightarrow{a.s.} \text{const}$
- **惊人事实**: 若 $X_i \sim C(0, 1)$ i.i.d., 则 $\bar{X}_n = \frac{1}{n} \sum X_i \sim C(0, 1)$ (**仍为标准柯西分布**, 与 n 无关!)

与正态分布对比, 凸显期望存在性的重要。

7.4 大数定律的应用 (Applications of LLN)

应用广泛，但基础是满足 LLN 条件 (尤其期望存在)

- 前提：应用均假设满足 LLN 条件 (尤其期望存在)。
- 理论与解释：
 - 频率稳定性 (伯努利 LLN)。
 - 解释平均结果的稳定趋向。
- 统计推断：
 - 参数估计 (样本均值 \rightarrow 总体期望, 前提: 期望存在!)。
 - 蒙特卡洛方法 (随机抽样估计)。
- 风险管理与保险：预测平均赔付。
- 质量控制：样本推断总体。
- 物理与工程：多次测量取平均减小误差。
 - 警示：若误差为柯西分布，平均无效!

核心警示：LLN 条件 (尤其期望存在) 是应用有效的关键。柯西分布等失效。

总结与展望

本讲小结

- 切比雪夫不等式: 概率上界 (需方差)。
- 弱大数定律 (WLLN): $\bar{X}_n \xrightarrow{P} \mu$ (如辛钦: i.i.d., $E X_i$ 存在)。
- 强大数定律 (SLLN): $\bar{X}_n \xrightarrow{a.s.} \mu$ (如柯尔莫哥洛夫: i.i.d., $E X_i$ 存在); $SLLN \implies WLLN$.
- LLN 条件核心: 期望存在性。
- 反例 - 柯西分布: $E X$ 不存在 \implies LLN 不适用; \bar{X}_n 仍为柯西。
- LLN 地位: 连接概率论与统计实践的**核心桥梁**。

展望

- 大数定律描述了平均行为的极限。
- 核心极限定理 中心极限定理 (CLT): 描述样本均值的分布 \rightarrow 正态分布 (通常需 $E X, \text{Var } X$ 存在)。
- 大数定律和中心极限定理共同构成了现代统计推断的理论基石。

谢谢聆听！

问题与讨论