

Содержание

I	События и их вероятности	3
1	Элементы комбинаторики. Схемы шансов	4
1.1	Эксперименты выбора шариков	4
1.2	Схема шансов без возвращения и с учетом порядка	6
1.3	Схема шансов без возвращения и без учёта порядка	6
1.4	Схема шансов с возвращением и с учётом порядка	6
1.5	Схема шансов с возвращением и без учёта порядка	7
2	События, операции над ними и σ -алгебры событий	8
3	Вероятность и её свойства	15
4	Способы задания и подсчёта вероятности	18
5	Независимые события	18
6	Условная вероятность	18
7	Формула полной вероятности и формулы Байеса	18
8	Биномиальное распределение	18
9	k -номинальное распределение	21
10	Гипергеометрическое распределение	21
II	Теория случайных величин	21
11	Случайные величины	21
12	Абсолютно непрерывные случайные величины	21
13	Функции Хевисайда и Дирака	21
14	Функции одной случайной величины	21
15	Случайные векторы и их распределения	21

16	Функции от двух случайных величин	21
17	Математическое ожидание	21
18	Дисперсия	21
19	Числовые характеристики зависимости случайных величин	21
III Законы больших чисел		21
20	Неравенство Бьенеме–Чебышёва и неравенство Маркова . .	21
21	Последовательности случайных величин	21
22	Законы больших чисел	21
23	Предельные теоремы для биномиального распределения . .	21
24	Характеристические функции	21
25	Вычисление характеристических функций	21
26	Центральная предельная теорема	21
27	Сферическое, ξ^2 -распределение и распределение Стьюдента	21
28	Цепи Маркова	21

Исторические сведения

Возникновение теории вероятностей как науки относят к средним векам, когда появилась возможность и возникла необходимость изучения математическими методами азартных игр (таких как орлянка, кости, рулетка).

Самые ранние работы учёных в области теории вероятностей относятся к XVII веку. Первоначально её основные понятия не имели строго математического описания. Задачи, из которых позже выросла теория вероятностей представляли набор некоторых эмпирических фактов о свойствах реальных событий, которые формулировались с помощью наглядных описаний.

Исследуя прогнозирование выигрыша при бросании костей в письмах друг другу, Блез Паскаль и Пьер Ферма открыли первые вероятностные закономерности. Решением тех же задач занимался и Христиан Гюйгенс. При этом с перепиской Паскаля и Ферма он знаком не был и методику решения изобрёл самостоятельно.

Его статья, в которой он ввёл основные понятия теории вероятностей (понятие вероятности как величину шанса; математическое ожидание для дискретных случаев в виде цены шанса). В своей статье он использует (не сформулированные ещё в явном виде) теоремы сложения и умножения вероятностей. Статья была опубликована в печатном виде на двадцать лет раньше (1657 г.) издания писем Паскаля и Ферма (1679 г.).

Важный вклад в теорию вероятностей внёс Якоб Бернулли, он дал доказательство закона больших чисел в простейшем случае независимых испытаний. В первой половине XIX века теория вероятностей начинает применяться к анализу ошибок наблюдений; Лаплас и Пуассон доказали первые предельные теоремы.

Во второй половине XIX века основной вклад внесли русские учёные П. Л. Чебышёв, А. А. Марков и А. М. Ляпунов. В это время были доказаны закон больших чисел, центральная предельная теорема, а также разработана теория цепей Маркова.

Современный вид теория вероятностей получила благодаря аксиоматике, предложенной Андреем Николаевичем Колмогоровым. В результате теория вероятностей приобрела строгий математический вид и окончательно стала восприниматься как один из разделов математики. Википедия, Статья "Теория вероятностей".

Часть I

События и их вероятности

1. Элементы комбинаторики. Схемы шансов

В этом параграфе мы подсчитываем число элементарных событий или, проще говоря, исходов, шансов, которые могут возникать в результате эксперимента.

Например, при подбрасывании монеты могут произойти 2 исхода, при подбрасывании игрального кубика могут произойти 6 исходов, при извлечении карты из колоды в 54 листа могут произойти 53 исхода. Такие подсчёты изучают в разделе математики, называемом комбинаторикой.

Пусть A и B — два непересекающихся конечных множества с числом элементов m и n соответственно. Очевидны следующие две леммы.

Лемма 1.1. (о сумме). Число шансов выбрать один элемент либо из A либо из B , т.е. из объединения $A \cup B$, равно $m + n$.

Лемма 1.2. (о произведении). Число шансов выбрать пару элементов, один из A , а другой из B , равно mn , т.е. числу элементов в декартовом произведении $A \times B$.

Непосредственным обобщением предыдущей леммы является следующая теорема.

Теорема 1.3. Пусть A_1, A_2, \dots, A_k — конечные непересекающиеся множества, имеющие n_1, n_2, \dots, n_k элементов соответственно. Выберем из каждого множества по одному элементу. Тогда общее число способов, которыми можно осуществить такой выбор, равно $n_1 n_2 \dots n_k$.

Доказательство. Ясно, что число способов такого выбора равно числу точек (элементов) в декартовом произведении $A_1 \times A_2 \times \dots \times A_k$, т.е. равно $n_1 \cdot n_2 \dots n_k$. \square

1.1. Эксперименты выбора шариков

Рассмотрим ящик, содержащий n одинаковых шариков, на которых написаны числа $1, 2, \dots, n$. Эксперимент состоит в том, что из ящика, не глядя, по одному вынимают k шариков, где $k \leq n$. Обозначим через

$$(n_1, n_2, \dots, n_k)$$

упорядоченный набор чисел, где n_1 — номер 1-го вынутого шарика, n_2 — номер 2-го шарика, ..., n_k — номер k -го шарика.

Например, из 5 пронумерованных шариков выбрали 3 шарика и получился набор (4, 2, 1).

Сколько имеется различных способов вынуть из ящика k шариков? На этот вопрос нельзя дать однозначный ответ, потому что такой эксперимент определён неоднозначно.

Во-первых, не определено, возвращают ли извлеченный шарик обратно в ящик. Во-вторых, не определено, какие наборы номеров считать различными и какие наборы считать одинаковыми.

Рассмотрим следующие возможные условия проведения эксперимента.

1. *Эксперимент с возвращением.* Каждый извлечённый шарик возвращается в ящик. В этом случае в наборе могут появляться одинаковые номера. Например, при выборе трёх шариков из ящика, содержащего пять шариков с номерами 1, 2, 3, 4 и 5, могут появиться наборы (3, 3, 5), (1, 2, 4) и (4, 2, 1).
2. *Эксперимент без возвращений.* Извлечённые шарики в ящик не возвращаются. В этом случае в наборе не могут встречаться одинаковые номера. В рассмотренном выше примере набор (3,3,5) не может появиться, а наборы (1,2,4) и (4,2,1) могут.

Опишем теперь, какие наборы номеров мы будем считать различными. Существуют ровно две возможности.

1. *Эксперимент с учётом порядка.* Два набора номеров считаются различными, если они отличаются либо составом, либо порядком. В рассмотренном выше примере все наборы (3,3,5), (1,2,4) и (4,2,1) считаются различными.
2. *Эксперимент без учёта порядка.* Два набора номеров считаются различными, если они отличаются только составом.

В рассмотренном выше примере наборы (1,2,4) и (4,2,1) доставляют одно и то же элементарное событие, а набор (3,3,5) — другое.

Подсчитаем теперь, сколько получится различных исходов для каждого из четырёх экспериментов. Заметим, что в литературе такие эксперименты часто называют схемами выбора или схемами шансов. Схема шансов — это условия (с возвратом или без, какие наборы различны и т.д.), при которых проводится эксперимент.

1.2. Схема шансов без возвращения и с учетом порядка

Теорема 1.4. В эксперименте без возвращения и с учётом порядка число способов выбрать k элементов из n -элементного множества равно

$$A_n^k = n(n-1) \dots (n-k+1) = \frac{n!}{(n-k)!}$$

Число A_n^k называется числом размещений элементов k на n местах. Читается: « A из n по k ».

Доказательство. При выборе первого шарика имеется n возможностей. При выборе второго шарика остаётся $n-1$ возможностей, и т.д. При выборе последнего k -го шарика остаётся $n-k+1$ возможностей. По теор. 1.3 общее число наборов равно $n(n-1) \dots (n-k+1)$, что и требовалось доказать. \square

Следствие 1.5. Число перестановок из n элементов равно $n!$.

Доказательство. Очевидно, что перестановка есть результат выбора по схеме без возвращения и с учётом порядка всех n элементов из n , т.е. общее число перестановок равно $A_n^2 = n!$. \square

1.3. Схема шансов без возвращения и без учёта порядка

Теорема 1.6. В эксперименте без возвращения и без учёта порядка число способов извлечь k из n -элементного множества равно

$$C_n^k = \frac{A_n^k}{k!} = \frac{n!}{k!(n-k)!}$$

Число C_n^k называется числом сочетаний k элементов из n элементов. Читается: « C из n по k »

Доказательство. По следствию 1.5 из k элементов можно образовать $k!$ упорядоченных наборов. Поэтому количество сочетаний (неупорядоченных наборов) в $k!$ раз меньше, чем число размещений. Поделив A_n^k на $k!$, получим требуемый результат. \square

1.4. Схема шансов с возвращением и с учётом порядка

Теорема 1.7. В эксперименте с возвращением и с учётом порядка число способов извлечь k элементов из n -элементного множества равно n^k .

Доказательство. При выборе каждого из k шариков имеется n возможностей. По теореме 1.3 общее число наборов равно $n \cdot n \cdot n \dots n = n^k$. \square

1.5. Схема шансов с возвращением и без учёта порядка

Замечание 1.8. Рассмотрим для примера ящик с двумя шариками 1 и 2, из которого мы вынимаем последовательно два шарика. Без учёта порядка имеется 3 исхода:

$$\{1, 1\}, \{1, 2\} = \{2, 1\}, \{2, 2\}.$$

Теорема 1.9. В эксперименте с возвращением и без учёта порядка число способов извлечь k элементов из n -элементного множества равно C_{n+k-1}^k .

Доказательство. Т.к. порядок появления шариков не учитывается, то мы учитываем лишь только то, сколько раз в наборе появится i -й шарик для каждого $i = 1, 2, \dots, n$. Обозначим через k_i число появлений i -го шарика в наборе. Во-первых, $0 \leq k_i \leq k$, а во-вторых,

$$k_1 + k_2 + \dots + k_n = k.$$

Поставим каждому исходу в соответствие набор чисел (k_1, k_2, \dots, k_n) . Легко видеть, что это соответствие является взаимно однозначным. Такое соответствие можно рассматривать как способ нумерации наборов. (Например, исходам из замеч. 1.8 ставятся в соответствие следующие номера: $\{1, 1\} \leftrightarrow (2, 0)$, $\{1, 2\} \leftrightarrow (1, 1)$ и $\{2, 2\} \leftrightarrow (0, 2)$. Рассмотрим теперь другой эксперимент. Пусть теперь имеется n урн с номерами $i = 1, 2, \dots, n$, в которых размещаются k неразличимых шариков. Сколько существует способов разложить шарики по урнам? Нас интересует только количество шариков в i -й урне для каждого i . Обозначим через k_i число шариков в i -й урне. Ясно, что $0 \leq k_i \leq k$, и что числа k_i в этом эксперименте тоже удовлетворяют уравнению

$$k_1 + k_2 + \dots + k_n = k.$$

Исходы этого эксперимента тоже взаимно однозначно описываются наборами чисел

(k_1, k_2, \dots, k_n) . Т.о., исходы в эксперименте с урнами и исходы предыдущего эксперимента с ящиком занумерованы одним и тем же набором чисел, поэтому число исходов в обоих экспериментах одно и то же и равно числу решений этого уравнения. Вычислим это число для эксперимента с урнами. Изобразим расположение шариков в урнах с помощью схематичного рисунка. Вертикальными линиями обозначим перегородки между урнами, а кружками — шарики, находящиеся в них. Например,

$$|\bullet\bullet| \bullet\bullet\bullet || \bullet || \bullet\bullet | \bullet |.$$

На рисунке показаны 9 шариков, рассыпанные по 7 урнам: 1-я и 6-я урны содержат по 2 шарика, 2-я урна содержит 3 шарика, 3-я и 5-я урны — пустые и, наконец, 4-я и 7-я урны содержат по одному шарiku.

Меняя местами шарики и стенки, можно получить все возможные расположения шариков в урнах. Другими словами, все расположения можно получить, расставляя k шариков и $n - 1$ стенок на $n - 1 + k$ местах. Число $n - 1 + k$ получается следующим образом. Число стенок у n урн равно $n + 1$, и т.к. две крайние стенки двигать нельзя, то число стенок, которые можно двигать равно $n - 1$. Поэтому шарики могут занимать k мест, а стенки урн — оставшиеся $n - 1$ место. По теор. 1.6 число способов расставить k шариков на $n - 1 + k$ местах и затем расставить стенки на оставшихся $n - 1$ местах равно C_{n+k-1}^k . Что и требовалось доказать. \square

2. События, операции над ними и σ -алгебры событий

Теория вероятностей, как и любая современная математическая теория, начинается с аксиоматических (неопределяемых) понятий. Такими являются следующие понятия.

1. Понятие: *эксперимент* = *опыт* = *испытание*. Считается, что все три слова означают одно и то же, т.е. являются синонимами.
2. Понятие: *произойти* = *возникнуть* = *появиться*.
3. Понятие: *элементарное событие* = *элементарный исход* = *результат* = *шанс*.

При этом считается, что в результате опыта происходит одно и только одно элементарное событие.

Определение 2.1. Множество всех элементарных событий данного эксперимента называется *пространством элементарных событий*, или часто короче *пространством*.

Будем обозначать его через Ω . Ясно, что пространство элементарных событий не пусто, $\Omega \neq \emptyset$.

Как множество пространство Ω может быть либо конечным¹, либо счётным², либо несчётным множеством³.

Определение 2.2. Конечные и счётные пространства элементарных событий называются *дискретными*.

Примеры.

1. Эксперимент: подбрасывание монеты. Элементарные события: o – выпадение орла, p – выпадение решётки. Пространство $\Omega = \{o, p\}$ является конечным множеством.
2. Эксперимент: одновременное подбрасывание двух монет одного достоинства. Пространство элементарных событий $\Omega = \{(o, o), (o, p), (p, p)\}$ является конечным множеством.
3. Эксперимент: подбрасывание одной монеты до выпадения первого орла. Пространство элементарных событий

$$\Omega = \{o, ro, rro, rrrro, rrrrro, rrrrrro, \dots\}$$

– счётное множество.

4. Эксперимент: на стол $\Omega = I^2 = I \times I$ садится мыльный пузырь и лопается, оставляя под собой точку (x, y) . Элементарное событие: появление на плоскости точки (x, y) . Пространство элементарных событий Ω – несчётное множество.

Определение 2.3. Если пространство Ω содержит только одно элементарное событие, то эксперимент называется с детерминированным (определённым) исходом; в противном случае эксперимент называется со случайным исходом.

Определение 2.4. Любое подмножество $A \subset \Omega$ пространства элементарных событий называется случайным событием или просто событием. Считается, что событие A произошло, если произошло любое элементарное событие Ω , содержащееся в A , см. рис. 1.

¹Конечное множество – множество, количество элементов которого конечно, то есть, существует неотрицательное целое число n , равное количеству элементов этого множества. В противном случае множество называется бесконечным.

²Счётное множество есть бесконечное множество, элементы которого можно пронумеровать натуральными числами. Более формально: множество Ω является счётным, если существует биекция $\Omega \leftrightarrow N$, где N обозначает множество всех натуральных чисел.

³Множество, не являющееся конечным или счетным, называется несчетным.

Определение 2.5. 1) Событие Ω называется *достоверным*.

2) Событие $\emptyset \subset \Omega$ называется *невозможным*.

Каждое элементарное событие $\omega \in \Omega$ можно рассматривать как одноэлементное подмножество достоверного события Ω , т.е. $\{\omega\} \subset \Omega$. Для изображения событий можно использовать диаграммы Венна⁴.

Пусть A и B – события, они показаны на рис. 1.

Рис. 1: События в достоверном событии Ω .

Определение 2.6. 1) Событие $A \cup B$ называется *объединением* событий и состоит в том, что произошло хотя бы одно из событий A или B .

2) Событие $A \cap B$ называется *пересечением* событий A и B и состоит в том, что произошли оба события A и B .

3) Событие $A \setminus B$ называется *разностью* событий A и B и состоит в том, что событие A произошло, а B – нет.

4) Событие $\bar{A} = \Omega \setminus A$ называется *противоположным событием* A и состоит в том, что событие A не произошло. Ясно, что $A = \bar{\bar{A}}$ (событие, противоположное к противоположному, является исходным событием). Т.к. $\bar{\emptyset} = \Omega \setminus \emptyset$ и $\bar{\Omega} = \Omega \setminus \Omega = \emptyset$, то невозможное событие \emptyset и достоверное событие Ω являются взаимно противоположными (друг другу).

5) Говорят, что событие A *влечёт* событие B , и пишут $A \subset B$, если при наступлении события A происходит и событие B .

Определение 2.7. 1) События A и B называются *несовместными*, если $A \cup B$ является невозможным событием, т.е. $A \cup B = \emptyset$.

2) События A_1, \dots, A_n называются *попарно несовместными*, если для любых $1 \leq i < j \leq n$ события A_i и A_j несовместны.

Определение 2.8. Рассмотрим множество \mathfrak{A} , элементами которого являются события пространства Ω (не обязательно все!). Множество \mathfrak{A} называется алгеброй событий, если достоверное событие Ω и любые события $A, B \in \mathfrak{A}$ удовлетворяют аксиомам:

Акс. $\mathcal{A}1$. $\Omega \in \mathfrak{A}$.

Акс. $\mathcal{A}2$. $A \cup B \in \mathfrak{A}$.

Акс. $\mathcal{A}3$. $A \cap B \in \mathfrak{A}$.

Акс. $\mathcal{A}4$. $A \setminus B \in \mathfrak{A}$.

Из аксиомы $\mathcal{A}1$ следует, что алгебра событий не может быть пустой; она всегда содержит достоверное событие Ω . А т.к. $\Omega \setminus \Omega = \emptyset$, то из аксиомы $\mathcal{A}4$ следует, что $\emptyset \in \mathfrak{A}$, т.е. любая алгебра событий \mathfrak{A} содержит вместе с достоверным и невозможное событие.

⁴Джон Венн (John Venn, 1834 – 1923), английский логик.

Примеры

1) Для любого пространства элементарных событий Ω набор из двух множеств $\mathfrak{A}_0 = \{\emptyset, \Omega\}$ удовлетворяет аксиомам $\mathcal{A}1$ – $\mathcal{A}4$, поэтому $\mathfrak{A}_0 = \{\emptyset, \Omega\}$ является алгеброй событий. Алгебра событий \mathfrak{A}_0 называется тривиальной. Это самая маленькая алгебра событий.

2) В этом примере эксперимент – подбрасывание игральной кости. Пространство элементарных событий есть $\Omega = \{1, 2, 3, 4, 5, 6\}$. Пусть событие $A = \{1, 3, 5\}$ – выпадение нечётного числа очков, а событие $B = \{2, 4, 6\}$ – выпадение чётного числа очков. Множество событий $\mathfrak{A}_1 = \{\emptyset, \Omega, A, B\}$ удовлетворяет аксиомам $\mathcal{A}1$ – $\mathcal{A}4$, поэтому является алгеброй событий.

3) Для любого пространства элементарных событий Ω множество $\mathfrak{B}(\Omega)$ = множество всех подмножеств Ω удовлетворяет аксиомам $\mathcal{A}1$ – $\mathcal{A}4$, поэтому является алгеброй событий. Эта алгебра событий является самой большой на Ω . Для $\Omega = \{1, 2, 3, 4, 5, 6\}$ эта алгебра событий содержит 64 события.

4) Задайте ещё какую-нибудь алгебру событий на $\Omega = \{1, 2, 3, 4, 5, 6\}$. Сколько различных алгебр событий можно задать на этом пространстве элементарных событий?

Замечание 2.9. Из аксиом $\mathcal{A}1$ – $\mathcal{A}4$ следует, что если к конечному набору событий из любой алгебры событий применить операции объединения, пересечения и вычитания конечное число раз, то полученное событие тоже содержится в этой алгебре.

Замечание 2.10. Если пространство элементарных событий конечно, $\Omega = \{\omega_1, \omega_2, \dots, \omega_n\}$, то любая его алгебра событий тоже конечна. Это следует из того, что множество $\mathfrak{B}(\Omega)$ всех возможных событий, содержащихся в Ω , тоже конечно и содержит 2^n событий.

Определение 2.11. Алгебра событий \mathfrak{A} называется σ -алгеброй, если для любого счётного набора событий $A_1, A_2, \dots \in \mathfrak{A}$ выполнена пятая аксиома:

$$\text{Акс. } \mathcal{A}5. \quad \bigcup_{n=1}^{\infty} A_n \in \mathfrak{A}.$$

Замечание 2.12. Из аксиом $\mathcal{A}1$ – $\mathcal{A}4$ не следует, что объединение несчётного количества событий является событием из σ -алгебры. Рассмотрение несчётных объединений событий приводит к построению т.н. неизмеримых событий, вероятность наступления которых не существует. Первый пример такого неизмеримого события построил Витали⁵. При построении неизмеримого множества Витали используется аксиома теории множеств – аксиома выбора.

⁵ Джузеппе Витали (Giuseppe Vitali, 26.08.1875 – 29.02.1932, Italy) – итальянский математик.

Аксиома выбора. Для любого произвольного набора непустых непересекающихся множеств можно составить множество, выбрав в него по одному элементу из каждого множества этого набора.

Теорема 2.13 (Теорема Витали – построение неизмеримого множества). Существуют множества, длина которых не может быть выражена никаким числом.

Доказательство. Для доказательства нам понадобятся лишь следующие очевидные свойства длины:

- длина дуги остается неизменной при повороте окружности вокруг центра;
- длина дуги, которая представляет собой объединение счетного количества попарно непересекающихся дуг, равна сумме длин этих дуг.

Рассмотрим стандартную (единичного радиуса) окружность S^1 . Она эквивалентна отрезку $[0, 2\pi)$, т.е. её длина равна 2π . На этой окружности центральный угол в радианах равен длине дуги на которую он опирается.

Для любого рационального числа $\frac{p}{q}$, где $q \neq 0$, рассмотрим дугу длины $\frac{2\pi p}{q}$.

Если отложить её на окружности S^1 последовательно q раз, то полученная дуга замкнётся, т.е. начало 1-ой дуги совпадёт с концом q -ой.

Для любого иррационального числа α рассмотрим дугу длины $2\pi\alpha$. Ясно, что если отложить эту дугу n раз на окружности S^1 , то начало и конец дуги $2\pi\alpha n$ не совпадут ни при каком целом n . Это означает, что множество

$$A_0 = \{\dots, -2\pi\alpha n, \dots, -4\pi\alpha, -2\pi\alpha, 0, 2\pi\alpha, 4\pi\alpha, \dots, 2\pi\alpha n, \dots\}$$

является счётным. Заметим, что для любого целого n поворот на угол $2\pi\alpha n$ переводит множество A_0 в себя. Если взять произвольную точку (угол) $\varphi \in [0, 2\pi)$ на окружности, такую чтобы $\varphi \notin A_0$, то множество

$$A_\varphi = \{\dots, \varphi - 2\pi\alpha n, \dots, \varphi - 4\pi\alpha, \varphi - 2\pi\alpha, \varphi, \varphi + 2\pi\alpha, \varphi + 4\pi\alpha, \dots, \varphi + 2\pi\alpha n, \dots\}$$

тоже является счётным, и для любого целого n поворот множества A_φ на угол $2\pi\alpha n$ тоже переводит его в себя.

Заметим, что т.к. $\varphi \notin A_0$, то множества A_0 и A_φ не пересекаются: если бы они имели общую точку, то при $n = \pm 1, \pm 2, \dots$ все остальные их точки получились бы прибавлением дуг $2\pi\alpha n$, и тогда бы множества A_0 и A_φ совпадали.

Заметим, что для любого целого n поворот на угол $2\pi\alpha n$ переводит множество A_φ в себя.

Если теперь выбрать угол $\psi \in [0, 2\pi)$, такой чтобы $\psi \notin A_0$ и $\psi \notin A_\varphi$, то множество

$$A_\psi = \{\dots, \psi - 2\pi\alpha n, \dots, \psi - 4\pi\alpha, \psi - 2\pi\alpha, \psi, \psi + 2\pi\alpha, \psi + 4\pi\alpha, \dots, \psi + 2\pi\alpha n, \dots\}$$

тоже является счётным, и для любого целого n поворот множества A_ψ на угол $2\pi\alpha n$ тоже переводит его в себя. Заметим, что т.к. $\psi \notin A_0$ и $\psi \notin A_\varphi$, то множество A_ψ не пересекается ни с A_0 и ни с A_φ .

Заметим, что для любого целого n поворот на угол $2\pi\alpha n$ переводит множество A_ψ в себя.

Процесс построения таких непересекающихся множеств можно продолжить неограниченно⁶, пока не будут исчерпаны (выбраны) все точки окружности S^1 . В каждом таком множестве содержится счетное число точек, и все точки в одном множестве получаются друг из друга поворотами на угол $2\pi\alpha$.

Разные множества не пересекаются. Таким образом, окружность S^1 является объединением непересекающихся множеств $A_0, A_\varphi, A_\psi, \dots$ т.е.

$$S^1 = \bigcup_{\lambda \in \{0, \varphi, \psi, \dots\}} A_\lambda$$

Объединение счётного набора счётных множеств есть счётное множество. А т.к. окружность S^1 состоит из несчетного множества точек, то набор построенных множеств $A_0, A_\varphi, A_\psi, \dots$ является несчётным. Другими словами множество индексов $\{0, \varphi, \psi, \dots\}$ – несчётное.

Выберем из каждого множества $A_0, A_\varphi, A_\psi, \dots$ ровно по одной точке и по аксиоме выбора составим из этих точек множество B_0 .

⁶В математике различают два типа бесконечности: потенциальная и актуальная бесконечности.

Потенциальная бесконечность означает, что процесс построения какого-либо объекта может быть продолжен неограниченно. В нашем случае процесс построения множеств $A_\varphi, A_\xi, A_\psi, \dots$ может быть продолжен неограниченно (если не принимать во внимание, какое время может быть потрачено на это построение). Другой пример потенциальной бесконечности возникает при построении натурального ряда. Если мы выпишем все натуральные числа от 1 до n , то ничто не мешает нам написать число $n + 1$, и т.д. Потенциальная бесконечность есть бесконечный процесс построения объектов, у которого нет последнего шага. Например, в доказательстве по методу математической индукции.

Под актуальной бесконечностью понимается бесконечная совокупность, построение которой завершено, и все ее элементы наличествуют одновременно. Например, мы будем иметь дело с актуальной бесконечностью, если перечислим весь натуральный ряд полностью и имеем его в законченном виде $N = \{1, 2, \dots, n, \dots\}$. Актуальная бесконечность представляет собой весьма сильную идеализацию. В самом деле, она допускает не только возможность построения последующего объекта, если построен предыдущий, но и постулирует, что все возможные объекты уже построены и существуют одновременно. В нашем случае актуальная бесконечность означает, что процесс построения множеств $A_0, A_\varphi, A_\psi, \dots$ закончен, и мы имеем это множество множеств $\{A_0, A_\varphi, A_\psi, \dots\}$ налицо.

Построенное множество B_0 называется *множеством Витали*. Для каждого $n = \pm 1, \pm 2, \dots$ обозначим через B_n множество, которое получается в результате поворота множества B_0 на угол $2\pi n\alpha$.

Ясно, что все множества B_n , $n \in \mathbb{Z}$, имеют одну и ту же длину. Т.к. все точки множества A_λ , где $\lambda \in \{0, \varphi, \psi, \dots\}$, можно получить, поворачивая одну из них на углы $2\pi n\alpha$, и т.к. в множестве B_0 собраны по одной точке из каждого множества A_λ , то объединение всех B_n составляет окружность S^1 , т.е.

$$S^1 = \bigcup_{n=-\infty}^{\infty} B_n$$

Оставшуюся часть доказательства проведём методом от противного. Предположим, что длина множества Витали B_0 существует, и обозначим её через $\mu(B_0)$. Тогда все множества B_n имеют одну и ту же длину, т.к. получены из B_0 поворотом на угол кратный $2\pi\alpha$. Т.к. множества B_n не пересекаются, то сумма их длин равна длине окружности S^1 . Поэтому

$$\begin{aligned} 2\pi = \mu(S^1) &= \mu\left(\bigcup_{n=-\infty}^{\infty} B_n\right) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} \mu(B_n) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} \mu(B_0) = \\ &= \begin{cases} \infty, & \text{если } \mu(B_0) > 0 \\ 0, & \text{если } \mu(B_0) = 0 \end{cases} \end{aligned}$$

Полученное противоречие означает, что длины у множества Витали B_0 нет вообще никакой (ни нулевой, ни конечной, ни бесконечной). Такие множества и соответствующие им события называются *неизмеримыми*. \square

Замечание 2.14. 1) В предыдущем примере было доказано существование неизмеримого множества (множества Витали) и предъявлена конструкция его построения. Меняя иррациональное число α , можно получить несчётное количество неизмеримых множеств на окружности $S^1 = [0, 2\pi)$.

Если аксиому выбора не признавать, то неизвестно можно ли вообще построить неизмеримые множества. Можно доказать, что аксиома $\mathcal{A}5$ не допускает появление неизмеримых событий.

2) Если Ω – несчётное множество (отрезок, площадка, объёмное тело), то множество $P(\Omega)$ всех подмножеств множества Ω не является σ -алгеброй, потому что оно содержит неизмеримые события.

Замечание 2.15. Все конечные и счётные алгебры событий являются σ -алгебрами.

Лемма 2.16. Если A_1, A_2, \dots есть счётный набор событий из σ -алгебры \mathfrak{A} , то $\bigcap_{n=1}^{\infty} A_n \in \mathfrak{A}$

Доказательство. Пусть $A_1, A_2, \dots \in \mathfrak{A}$, Тогда из аксиомы $\mathcal{A}4$ следует, что

$$\overline{A_1}, \overline{A_2}, \dots \in \mathfrak{A},$$

а из аксиомы $\mathcal{A}5$ следует, что

$$\bigcup_{n=1}^{\infty} \overline{A_n} \in \mathfrak{A}.$$

Тогда по аксиоме 4 дополнение к этому множеству тоже принадлежит \mathfrak{A} , т.е.

$$\overline{\bigcup_{n=1}^{\infty} \overline{A_n}} \in \mathfrak{A}$$

по формулам двойственности де Моргана

$$\overline{\bigcup_{n=1}^{\infty} \overline{A_n}} = \bigcap_{n=1}^{\infty} A_n,$$

поэтому

$$\bigcap_{n=1}^{\infty} A_n \in \mathfrak{A}$$

□

Следствие 2.17. Лемма 2.16 и аксиома $\mathcal{A}5$ эквивалентны.

3. Вероятность и её свойства

Определение 3.1. Пусть Ω — пространство элементарных событий, и \mathfrak{A} — его σ -алгебра событий. Вероятностью называется функция множества $P : \mathfrak{A} \rightarrow \mathbb{R}$, удовлетворяющая следующим аксиомам:

Акс. $\mathcal{P}1$ (неотрицательность вероятности). Для любого события $A \in \mathfrak{A}$ выполнено равенство $P(A) \geq 0$.

Акс. $\mathcal{P}2$ (нормированность вероятности). $P(\Omega) = 1$

Акс. $\mathcal{P}3$ (счётная аддитивность вероятности как функции множества).

Для любого счётного набора попарно несовместных событий $A_1, A_2, \dots \in \mathfrak{A}$ имеет место равенство

$$P\left(\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n\right) = \sum_{n=1}^{\infty} P(A_n)$$

В частности, эта аксиома справедлива и для конечного набора попарно несовместных событий. Акс. $\mathcal{P}1$ (непрерывность вероятности). Для любой убывающей последовательности событий $A_1 \supset A_2 \supset \dots \supset A_n \supset \dots$ из σ -алгебры \mathfrak{A} такой, что $\bigcap_{n=1}^{\infty} A_n = \emptyset$, выполняется равенство

$$\lim_{n \rightarrow \infty} P(A_n) = 0$$

Определение 3.2. Тройка $(\Omega, (\mathfrak{A}), P)$ называется *вероятностным пространством*.

Докажем теперь основные свойства вероятности пп. 3.3 – 3.12.

Лемма 3.3. Если событие A влечёт событие B , т.е. $A \subseteq B$, то $P(B \setminus A) = P(B) - P(A)$

Доказательство. Т.к. $B = A \cup (B \setminus A)$, и события A и $B \setminus A$ несовместны, то по аксиоме \mathfrak{P} имеем $P(B) = P(A) + P(B \setminus A)$, что и требовалось доказать. \square

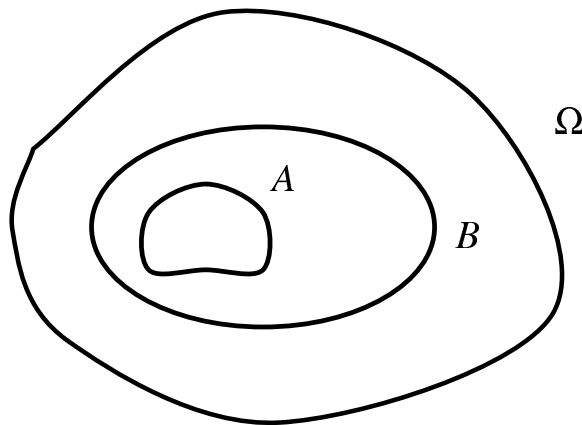


Рис. 1: Если $A \subseteq B$, то $P(B \setminus A) = P(B) - P(A)$.

Следствие 3.4. Если $A \subseteq B$, то $P(A) \geq P(B)$.

Лемма 3.5. $P(\emptyset) = 0$.

Доказательство. $P(\emptyset) = P(\Omega \setminus \Omega) = P(\Omega) = P(\Omega) = 1 - 1 = 0$ \square

Лемма 3.6. Для любого события $A \in \mathfrak{A}$ выполнено неравенство

$$0 \leq P(A) \leq 1$$

Доказательство. Т.к. $\emptyset \subseteq A \subseteq \Omega$, то из след. 3.4 следует утверждение леммы. \square

Лемма 3.7. Для любого события $A \in \mathfrak{A}$ имеем $P(\bar{A}) = 1 - P(A)$

Доказательство. $P(\bar{A}) = P(\Omega \setminus A) = P(\Omega) - P(A) = 1 - P(A)$ \square

Лемма 3.8. Для любых событий $A, B \in \mathfrak{A}$ выполнено равенство

$$P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A \cap B).$$

Доказательство. Т.к. $A \cup B = A \cup (B \setminus (A \cap B))$, и события A и $B \setminus (A \cap B)$ несовместны, то применяя сначала Акс. $\mathcal{P}3$, а затем лемму 3.3 получим $P(A \cup B) = P(A) + P(B \setminus (A \cap B)) = P(A) + P(B) - P(A \cap B)$. \square

Следствие 3.9. Для любых событий $A, B \in \mathfrak{A}$ выполнено равенство

$$P(A \cup B) \geq P(A) + P(B).$$

Следствие 3.10. Если события A и B несовместны, т.е. $A \cap B = \emptyset$, то

$$P(A \cup B) \leq P(A) + P(B).$$

Доказательство. По лемме 3.8 имеем $P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A \cap B) = P(A) + P(B) - P(\emptyset) = P(A) + P(B)$. \square

Следствие 3.11. $P(A_1 \cup \dots \cup A_n) \leq \sum_{i=1}^n P(A_i)$.

Теорема 3.12.

$$\begin{aligned} P(A_1 \cup A_2 \cup \dots \cup A_n) &= \sum_{i=1}^n P(A_i) - \sum_{1 \leq i < j \leq n} P(A_i \cap A_j) \\ &+ \sum_{1 \leq i < j < m \leq n} P(A_i \cap A_j \cap A_m) - \dots + (-1)^{n-1} P(A_1 \cap A_2 \cap \dots \cap A_n). \end{aligned}$$

Доказательство. Применяя метод математической индукции и лемму 3.8 получим требуемый результат. \square

4. Способы задания и подсчёта вероятности
5. Независимые события
6. Условная вероятность
7. Формула полной вероятности и формулы Байеса
8. Биномиальное распределение

Рассмотрим эксперимент, состоящим в n -кратном повторении схемы Бернулли (т.е. в подбрасывании ломаного гроша n раз). Вопрос: «Какова вероятность того, что в результате этих n испытаний «успех» (орёл) выпадет ровно k раз, а остальные $n - k$ раз выпадет «неудача» (решка)?»

Обозначим искомую вероятность (выпадения орла) через $P_n(k)$. Ясно, что этот эксперимент имеет конечное пространство элементарных событий $\Omega = \{0, 1, 2, \dots, n\}$ – орёл выпал 0 раз, 1 раз, 2 раза, \dots , n раз.

Теорема 8.1. Для любого $k \in \Omega$ имеет место формула Бернулли

$$P_n(k) = C_n^k p^k (1-p)^{n-k} = C_n^k p^k q^{n-k}.$$

Доказательство. Рассмотрим один из благоприятных элементарных исходов:

$$\underbrace{(y, y, \dots, y)}_{k \text{ раз}}, \underbrace{(H, H, \dots, H)}_{n-k \text{ раз}} \quad (1)$$

Здесь буквами «у» и «н» обозначены соответственно «успех» и «неудача». Поскольку испытания независимы, вероятность элементарного исхода (первые k испытаний завершились успехом, а остальные неудачей) по опред. 5.1 равна $p^k(1-p)^{n-k}$.

Другие элементарные исходы, благоприятные событию A , отличаются от рассмотренного $\underbrace{(y, y, \dots, y)}_{k \text{ раз}}, \underbrace{(H, H, \dots, H)}_{n-k \text{ раз}}$ лишь перераспределением k успехов на n местах. По теор. 1.6 существует ровно C_n^k способов расположить k успехов на n местах. Поэтому событие A состоит из C_n^k элементарных исходов, вероятность каждого из них равна $p^k(1-p)^{n-k}$. \square

Определение 8.2. Эксперимент, имеющий ряд распределения

$$\begin{array}{ll}
k & P_n(k) \\
0 & C_n^0 p^0 q^n = q^n \\
1 & C_n^1 p^1 q^{n-1} = npq^{n-1} \\
2 & C_n^2 p^2 q^{n-2} = \frac{n(n-1)}{2} p^2 q^{n-2} \\
\ldots & \ldots \\
k & C_n^k p^k q^{n-k} = \frac{n!}{k!(n-k)!} p^k q^{n-k} \\
\ldots & \ldots \\
n & C_n^n p^n = p^n
\end{array}$$

называется биномиальным распределением.

Название этого распределения связан с тем, что сумма всех вероятностей из второй строки ряда распределения может быть вычислены по формуле бинома Ньютона, т.е.

$$\sum_{k=0}^n C_n^k p^k q^{n-k} = (p+q)^n = 1 \quad (2)$$

На рис. 8 показан график биномиального распределения $P_{16}(k) = C_{16}^k \cdot 0.65^k \cdot 0.35^{16-k}$. График является симметричным при $p = q = \frac{1}{2}$.

Если $p > q$, то максимум сдвигается вправо, и наоборот. Возникает естественный вопрос. Какое число успехов при n испытаниях наиболее вероятно? Другими словами, при каком k достигается максимум функции $P_n(k) = C_n^k p^k q^{n-k}$? Другими словами, при каком (каких) k вероятность достигает максимума?

Теорема 8.3. Если в схеме Бернулли вероятность появления «успеха» (орла) равна p , то в биномиальном распределении с n испытаниями наиболее вероятным числом «успехов» (орлов) является либо

- единственное число $[np + p]$, если число $np + p$ не целое, либо
- два числа $np + p$ и $np + p + 1$, если число $np + p$ целое.

Доказательство. Сравним отношение чисел $P_n(k)$ и $P_n(k-1)$ с единицей.

$$\frac{P_n(k)}{P_n(k-1)} = \frac{C_n^k p^k q^{n-k}}{C_n^{k-1} p^{k-1} q^{n-k+1}} = \frac{p(n-k+1)}{kq} = 1 + \frac{np + p - k}{kq} \quad (3)$$

Видно, что

1. $P_n(k) > P_n(k-1)$ при $np + p - k > 0$, т.е. при $k < np + p$;

2. $P_n(k) < P_n(k-1)$ при $np + p - k < 0$, т.е. при $k > np + p$;
3. $P_n(k) = P_n(k-1)$ при $np + p - k = 0$, что возможно лишь, если $np + p$ – целое число.

□

9. k -номинальное распределение

10. Гипергеометрическое распределение

Часть II

Теория случайных величин

11. Случайные величины

12. Абсолютно непрерывные случайные величины

13. Функции Хевисайда и Дирака

14. Функции одной случайной величины

15. Случайные векторы и их распределения

16. Функции от двух случайных величин

17. Математическое ожидание

18. Дисперсия

19. Числовые характеристики зависимости случайных величин

Часть III

Законы больших чисел

20. Неравенство Бьенеме–Чебышёва и неравенство Маркова

21. Последовательности случайных величин