Московский Государственный Университет

Байесовские рассуждения

Выполнил: Курцев Д.В.

Группа: 417

Факультет Вычислительной математики и кибернетики Кафедра Математических методов прогнозирования Сентябрь 2022

$1 \quad p(a), p(b)$

 $a \sim \text{Unif } [a_{min}, a_{max}], b \sim \text{Unif } [b_{min}, b_{max}]$

Найдём математическое ожидание и дисперсию для случайной величины a (для b всё аналогично):

$$\mathbb{P}(a=k) = \begin{cases} \frac{1}{n}, & n = a_{max} - a_{min} + 1, k \in [a_{min}, a_{max}] \\ 0, & \text{иначе} \end{cases}$$

Тогда:

$$\mathbb{E} \ a = \sum_{k=a_{min}}^{a_{max}} \frac{1}{n} k = \frac{1}{n} \sum_{k=a_{min}}^{a_{max}} k = \frac{1}{n} \frac{(a_{min} + a_{max}) \ n}{2} = \frac{(a_{min} + a_{max})}{2}$$

Дисперсию вычислим, воспользовавшись свойством, по формуле:

$$\mathbb{D}a = \mathbb{E}a^{2} - \mathbb{E}^{2}a$$

$$\mathbb{E}a^{2} = \frac{1}{n} \sum_{k=a_{min}}^{a_{max}} k^{2} = \frac{1}{n} (\sum_{k=1}^{a_{max}} k^{2} - \sum_{k=1}^{a_{min}-1} k^{2}) = \{\sum_{k=1}^{N} k^{2} = \frac{N(N+1)(2N+1)}{6}\} =$$

$$= \frac{1}{6n} (a_{max}(a_{max}+1)(2a_{max}+1) - a_{min}(a_{min}-1)(2a_{min}-1)) = \frac{1}{6n} (3a_{max}^{2} + 2a_{max}^{3} + a_{max} - 2a_{min}^{3} + 3a_{min}^{2} - a_{min}) \quad (=)$$

$$a_{max}^{3} - a_{min}^{3} = (a_{max} - a_{min} + 1)(a_{max}^{2} + a_{max}a_{min} + a_{min}^{2}) - (a_{max}^{2} + a_{max}a_{min} + a_{min}^{2})$$

$$(=) \frac{1}{6n} (2n(a_{max}^{2} + a_{max}a_{min} + a_{min}^{2}) - 2a_{max}^{2} - 2a_{max}a_{min} - 2a_{min}^{2} + 3a_{max}^{2} + 3a_{min}^{2} + a_{max} - a_{min}) =$$

$$= \frac{1}{6n} (2n(a_{max}^{2} + a_{max}a_{min} + a_{min}^{2}) + a_{max}^{2} + a_{min}^{2} - 2a_{max}a_{min} + a_{max} - a_{min}) =$$

$$= \frac{1}{6n} (2n(a_{max}^{2} + a_{max}a_{min} + a_{min}^{2}) + a_{max}(a_{max} - a_{min} + 1) - a_{min}(a_{max} - a_{min} + 1)) =$$

$$= \frac{1}{6} (2a_{max}^{2} + 2a_{max}a_{min} + 2a_{min}^{2} + a_{max} - a_{min})$$

Таким образом, получим, что дисперсия равна:

$$\mathbb{D}a = \mathbb{E}a^2 - \mathbb{E}^2a = \frac{1}{6}(2a_{max}^2 + 2a_{max}a_{min} + 2a_{min}^2 + a_{max} - a_{min}) - \frac{1}{4}(a_{max}^2 - 2a_{max}a_{min} + a_{min}^2) = \frac{1}{12}(a_{max}^2 + a_{min}^2 - 2a_{max}a_{min} + 2a_{max} - 2a_{min}) = \frac{n^2 - 1}{12}$$

Тогда получим, что

$$\mathbb{E}a = \frac{a_{min} + a_{max}}{2}, \quad \mathbb{E}b = \frac{b_{min} + b_{max}}{2}$$

$$\mathbb{D}a = \frac{(a_{max} - a_{min} + 1)^2 - 1}{12}, \quad \mathbb{D}b = \frac{(b_{max} - b_{min} + 1)^2 - 1}{12}$$

2 p(c)

$$p(a,b,c) = p(c|a,b)p(a)p(b)$$
$$p(c) = \sum_{a} \sum_{b} p(a,b,c) = \sum_{a} \sum_{b} p(c|a,b)p(a)p(b)$$

То есть

$$\mathbb{P}(c=k) = \sum_{a} \sum_{b} \mathbb{P}(c=k|a,b) \mathbb{P}(a) \mathbb{P}(b)$$

Найдём мат ожидание p(c):

$$\mathbb{E} c = \sum_{k} \mathbb{P}(c=k) \ k = \sum_{k} \sum_{a} \sum_{b} \mathbb{P}(c=k|a,b) \mathbb{P}(a) \mathbb{P}(b) k =$$

$$= \sum_{a} \mathbb{P}(a) \sum_{b} \mathbb{P}(b) \sum_{k} \mathbb{P}(c=k|a,b) k = \sum_{a} \sum_{b} \mathbb{P}(a) \mathbb{P}(b) \mathbb{E}(c|a,b) \quad (=)$$

 $\mathbb{E}(c|a,b)$ для обеих моделей равно ap_1+bp_2 . Тогда получим:

$$(=) \sum_{a} \sum_{b} \mathbb{P}(a) \mathbb{P}(b) (ap_1 + bp_2) = \sum_{b} \mathbb{P}(b) \sum_{a} \mathbb{P}(a) ap_1 + \sum_{a} \mathbb{P}(a) \sum_{b} \mathbb{P}(b) bp_2 =$$

$$= p_1 \sum_{b} \mathbb{P}(b) \mathbb{E}a + p_2 \sum_{a} \mathbb{P}(a) \mathbb{E}b = p_1 \mathbb{E}a + p_2 \mathbb{E}b$$

Чтобы найти дисперсию, найдём мат ожидание квадрата c

$$\mathbb{E}c^2 = \sum_k \mathbb{P}(c=k) \ k^2 = \sum_k \sum_a \sum_b \mathbb{P}(c=k|a,b)\mathbb{P}(a)\mathbb{P}(b)k^2 = \sum_a \sum_b \mathbb{P}(a)\mathbb{P}(b)\mathbb{E}(c^2|a,b) = \sum_a \sum_b \mathbb{P}(a)\mathbb{P}(b)(\mathbb{D}(c|a,b) + \mathbb{E}^2(c|a,b))$$

Для 1 модели:

$$\sum_{a} \sum_{b} \mathbb{P}(a) \mathbb{P}(b) \mathbb{D}(c|a,b) = \sum_{a} \sum_{b} \mathbb{P}(a) \mathbb{P}(b) (ap_1(1-p_1) + bp_2(1-p_2)) =$$

$$p_1(1 - p_1) \sum_b \mathbb{P}(b) \sum_a \mathbb{P}(a)a + p_2(1 - p_2) \sum_a \mathbb{P}(a) \sum_b \mathbb{P}(b)b =$$

$$= p_1(1 - p_1)\mathbb{E}a \sum_b \mathbb{P}(b) + p_2(1 - p_2)\mathbb{E}b \sum_a \mathbb{P}(a) = p_1(1 - p_1)\mathbb{E}a + p_2(1 - p_2)\mathbb{E}b$$

Для 2 модели:

$$\sum_{a} \sum_{b} \mathbb{P}(a)\mathbb{P}(b)\mathbb{D}(c|a,b) = \sum_{a} \sum_{b} \mathbb{P}(a)\mathbb{P}(b)(ap_1 + bp_2) = p_1\mathbb{E}a + p_2\mathbb{E}b$$

$$\sum_{a} \sum_{b} \mathbb{P}(a) \mathbb{P}(b) \mathbb{E}^{2}(c|a,b) = \sum_{a} \sum_{b} \mathbb{P}(a) \mathbb{P}(b) (ap_{1} + bp_{2})^{2} =$$

$$= \sum_{a} \sum_{b} \mathbb{P}(a) \mathbb{P}(b) (a^{2}p_{1}^{2} + 2abp_{1}p_{2} + b^{2}p_{2}^{2}) = p_{1}^{2} \sum_{b} \mathbb{P}(b) \sum_{a} \mathbb{P}(a) a^{2} +$$

$$+ p_{2}^{2} \sum_{a} \mathbb{P}(a) \sum_{b} \mathbb{P}(b) b^{2} + 2p_{1}p_{2} \sum_{a} \mathbb{P}(a) a \sum_{b} \mathbb{P}(b) b = p_{1}^{2} \mathbb{E}a^{2} + p_{2}^{2} \mathbb{E}b^{2} + 2p_{1}p_{2} \mathbb{E}a\mathbb{E}b$$

$$\mathbb{E}^{2}c = (p_{1}\mathbb{E}a + p_{2}\mathbb{E}b)^{2} = p_{1}^{2}\mathbb{E}^{2}a + p_{2}^{2}\mathbb{E}^{2}b + 2p_{1}p_{2}\mathbb{E}a\mathbb{E}b$$

Тогда в итоге получим:

$$\mathbb{D}_{1}c = p_{1}(1-p_{1})\mathbb{E}a + p_{2}(1-p_{2})\mathbb{E}b + p_{1}^{2}\mathbb{E}a^{2} + p_{2}^{2}\mathbb{E}b^{2} + 2p_{1}p_{2}\mathbb{E}a\mathbb{E}b - p_{1}^{2}\mathbb{E}^{2}a - p_{2}^{2}\mathbb{E}^{2}b - 2p_{1}p_{2}\mathbb{E}a\mathbb{E}b =
= p_{1}(1-p_{1})\mathbb{E}a + p_{2}(1-p_{2})\mathbb{E}b + p_{1}^{2}\mathbb{D}a + p_{2}^{2}\mathbb{D}b
\mathbb{D}_{2}c = p_{1}\mathbb{E}a + p_{2}\mathbb{E}b + p_{1}^{2}\mathbb{D}a + p_{2}^{2}\mathbb{D}b$$

В итоге имеем:

$$\mathbb{E} c = p_1 \mathbb{E} a + p_2 \mathbb{E} b$$

$$\mathbb{D}_1 c = p_1 (1 - p_1) \mathbb{E} a + p_2 (1 - p_2) \mathbb{E} b + p_1^2 \mathbb{D} a + p_2^2 \mathbb{D} b$$

$$\mathbb{D}_2 c = p_1 \mathbb{E} a + p_2 \mathbb{E} b + p_1^2 \mathbb{D} a + p_2^2 \mathbb{D} b$$

3 p(c|a)

$$p(c|a) = \frac{p(a,c)}{p(a)} = \frac{\sum_{b} p(a,b,c)}{p(a)} = \frac{\sum_{b} p(c|a,b)p(a)p(b)}{p(a)} = \sum_{b} p(c|a,b)p(b)$$

$$\Rightarrow \quad \mathbb{P}(c=k|a) = \sum_{b} \mathbb{P}(c=k|a,b)\mathbb{P}(b)$$

Аналогично p(c) найдём мат ожидание и дисперсию для p(c|a):

$$\mathbb{E}(c|a) = \sum_{k} \sum_{b} \mathbb{P}(c=k|a,b) \mathbb{P}(b) \ k = \sum_{b} \mathbb{P}(b) \mathbb{E}(c|a,b) = \sum_{b} \mathbb{P}(b) (ap_1 + bp_2) =$$
$$= p_1 a + p_2 \mathbb{E}b$$

$$\mathbb{E}(c^2|a) = \sum_k \sum_b \mathbb{P}(c=k|a,b) \mathbb{P}(b) k^2 = \sum_b \mathbb{P}(b) \mathbb{E}(c^2|a,b) = \sum_b \mathbb{P}(b) (\mathbb{D}(c^2|a,b) + \mathbb{E}^2(c|a,b))$$

Для 1 модели:

$$\sum_{b} \mathbb{P}(b)\mathbb{D}(c^{2}|a,b) = \sum_{b} \mathbb{P}(b)(p_{1}(1-p_{1})a + p_{2}(1-p_{2})b) = p_{1}(1-p_{1})a + p_{2}(1-p_{2})\mathbb{E}b$$

Для 2 модели:

$$\sum_{b} \mathbb{P}(b)\mathbb{D}(c^{2}|a,b) = \sum_{b} \mathbb{P}(b)(p_{1}a + p_{2}b) = p_{1}a + p_{2}\mathbb{E}b$$

$$\sum_{b} \mathbb{P}(b)\mathbb{E}^{2}(c|a,b) = \sum_{b} \mathbb{P}(b)(ap_{1} + bp_{2})^{2} = p_{1}^{2}a^{2} + p_{2}^{2}\mathbb{E}b^{2} + 2p_{1}p_{2}a\mathbb{E}b$$

$$\Rightarrow D_{1}(c|a) = p_{1}(1-p_{1})a + p_{2}(1-p_{2})\mathbb{E}b + p_{1}^{2}a^{2} + p_{2}^{2}\mathbb{E}b^{2} + 2p_{1}p_{2}a\mathbb{E}b - p_{1}^{2}a^{2} - p_{2}^{2}\mathbb{E}^{2}b - 2p_{1}p_{2}a\mathbb{E}b =$$

$$= p_{1}(1-p_{1})a + p_{2}(1-p_{2})\mathbb{E}b + p_{2}^{2}\mathbb{D}b$$

В итоге имеем:

$$\mathbb{E}(c|a) = p_1 a + p_2 \mathbb{E}b$$

$$\mathbb{D}_1(c|a) = p_1 (1 - p_1) a + p_2 (1 - p_2) \mathbb{E}b + p_2^2 \mathbb{D}b$$

$$\mathbb{D}_2(c|a) = p_1 a + p_2 \mathbb{E}b + p_2^2 \mathbb{D}b$$

 $D_2(c|a) = p_1 a + p_2 \mathbb{E}b + p_2^2 \mathbb{D}b$

$4 \quad p(c|b)$

Абсолютно аналогично p(c|a) получим, что

$$p(c|b) = \sum_{a} p(c|a,b)p(a) \qquad \mathbb{P}(c=k|b) = \sum_{a} \mathbb{P}(c=k|a,b)\mathbb{P}(a)$$
$$\mathbb{E}(c|b) = p_1\mathbb{E}a + p_2b$$
$$\mathbb{D}_1(c|b) = p_1(1-p_1)\mathbb{E}a + p_2(1-p_2)b + p_1^2\mathbb{D}a$$
$$\mathbb{D}_2(c|b) = p_1\mathbb{E}a + p_2b + p_1^2\mathbb{D}a$$

5 p(d)

$$p(d,c) = p(d|c)p(c) \implies p(d) = \sum_{c} p(d,c) = \sum_{c} p(d|c)p(c) \implies$$

$$\Rightarrow \mathbb{P}(d=k) = \sum_{c} \mathbb{P}(d=k|c)\mathbb{P}(c)$$

Найдём мат ожидание p(d):

$$\mathbb{E} d = \sum_{k} \mathbb{P}(d=k) \ k = \sum_{k} \sum_{c} \mathbb{P}(d=k|c) \mathbb{P}(c) k = \sum_{c} \mathbb{P}(c) \sum_{k} \mathbb{P}(d=k|c) k =$$

$$= \sum_{c} \mathbb{P}(c) \mathbb{E}(d|c) = \sum_{c} \mathbb{P}(c) (\mathbb{E}c + \mathbb{E} \operatorname{Bin}(c, p_{3})) = \sum_{c} \mathbb{P}(c) c + \sum_{c} \mathbb{P}(c) c p_{3} =$$

$$\mathbb{E}c + p_{3} \sum_{c} \mathbb{P}(c) c = (1 + p_{3}) \mathbb{E}c$$

Найдём мат ожидание d^2 :

$$\mathbb{E} d^2 = \sum_k \mathbb{P}(d=k) \ k^2 = \sum_k \sum_c \mathbb{P}(d=k|c)\mathbb{P}(c)k^2 = \sum_c \mathbb{P}(c)\mathbb{E}(d^2|c) =$$
$$= \sum_k \mathbb{P}(c)(\mathbb{D}(d|c) + \mathbb{E}^2(d|c))$$

Так как в $\mathbb{D}(d|c)$ и $\mathbb{E}^2(d|c)$ c является константой, то:

$$\mathbb{E}^{2}(d|c) = (\mathbb{E}c + \mathbb{E}Bin(c, p_{3}))^{2} = (c + cp_{3})^{2} = c^{2}(1 + p_{3})^{2}$$
$$\mathbb{D}(d|c) = \mathbb{D}(c + Bin(c, p_{3})) = \mathbb{D}Bin(c, p_{3}) = cp_{3}(1 - p_{3})$$

$$\Rightarrow \mathbb{E} d^2 = \sum_{c} \mathbb{P}(c)(c^2(1+p_3)^2 + cp_3(1-p_3)) = p_3(1-p_3)\mathbb{E} c + (1+p_3)^2\mathbb{E} c^2 =$$

$$= p_3(1-p_3)\mathbb{E} c + (1+p_3)^2(\mathbb{D} c + \mathbb{E}^2 c)$$

Тогда получим, что:

$$\mathbb{D} d = \mathbb{E} d^2 - \mathbb{E}^2 d = p_3 (1 - p_3) \mathbb{E} c + (1 + p_3)^2 (\mathbb{D} c + \mathbb{E}^2 c) - (1 + p_3)^2 \mathbb{E}^2 c =$$

$$= p_3 (1 - p_3) \mathbb{E} c + (1 + p_3)^2 \mathbb{D} c$$

В итоге имеем:

$$\mathbb{E} d = (1 + p_3)\mathbb{E} c \quad \mathbb{D} d = p_3(1 - p_3)\mathbb{E} c + (1 + p_3)^2\mathbb{D} c$$

6 p(c|d)

Для вывода формулы распределения воспользуемся теоремой Байеса:

$$p(c|d) = \frac{p(d|c)p(c)}{\sum_{c} p(d|c)p(c)} = \frac{p(d|c)p(c)}{\sum_{c} p(c,d)} = \frac{p(d|c)p(c)}{p(d)}$$

$$\Rightarrow \quad \mathbb{P}(c=k|d) = \frac{\mathbb{P}(d|c=k)\mathbb{P}(c=k)}{\mathbb{P}(d)}$$

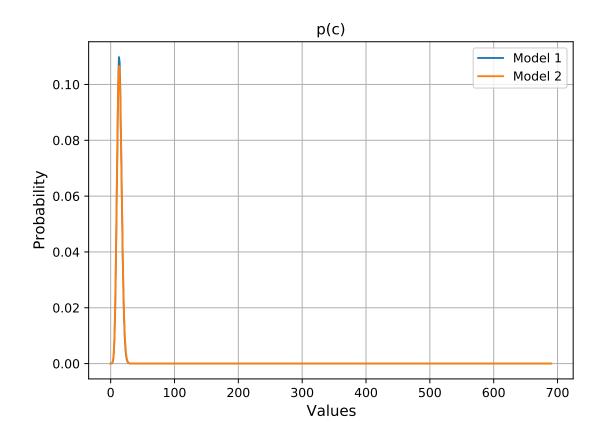
7 p(c|a, b, d)

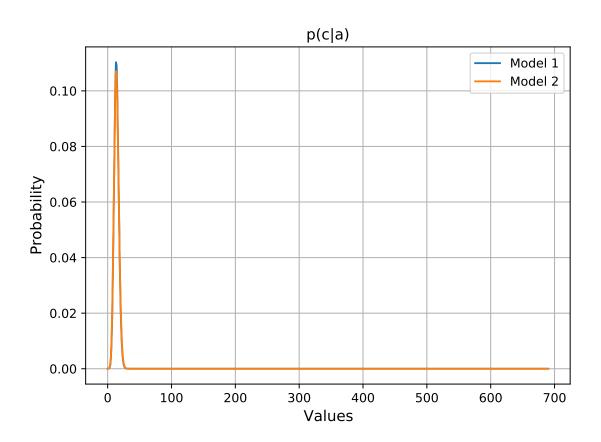
$$p(a,b,c,d) = p(c|a,b,d)p(a,b,d) \quad \Rightarrow \quad p(c|a,b,d) = \frac{p(a,b,c,d)}{p(a,b,d)} = \frac{p(a,b,c,d)}{\sum_{c} p(a,b,c,d)}$$

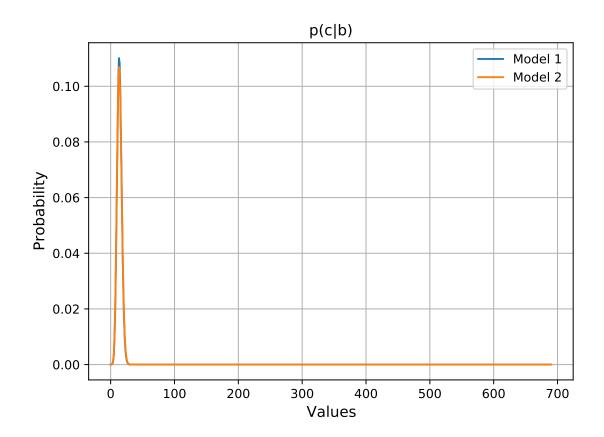
$$\Rightarrow \quad \mathbb{P}(c=k|a,b,d) = \frac{\mathbb{P}(a)\mathbb{P}(b)\mathbb{P}(c=k|a,b)\mathbb{P}(d|c=k)}{\sum_{c} \mathbb{P}(a)\mathbb{P}(b)\mathbb{P}(c=k|a,b)\mathbb{P}(d|c=k)}$$

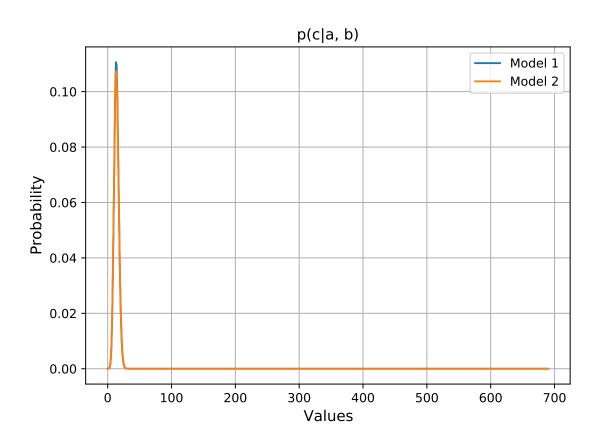
8 Графики распределений

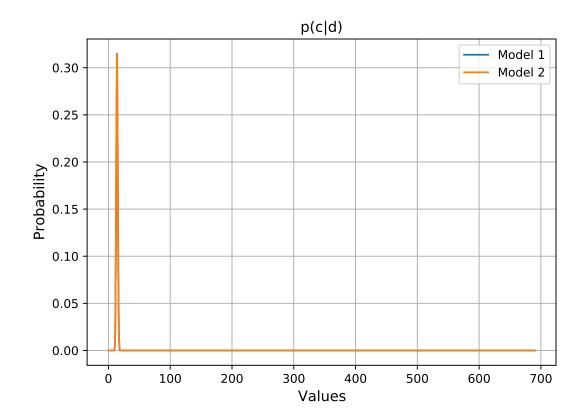
Мат ожидания для обеих моделей совпадают. Обозначим за \mathbb{D}_1 дисперсию для первой модели, а за \mathbb{D}_2 для второй. За t_i будем принимать время работы i-ой модели

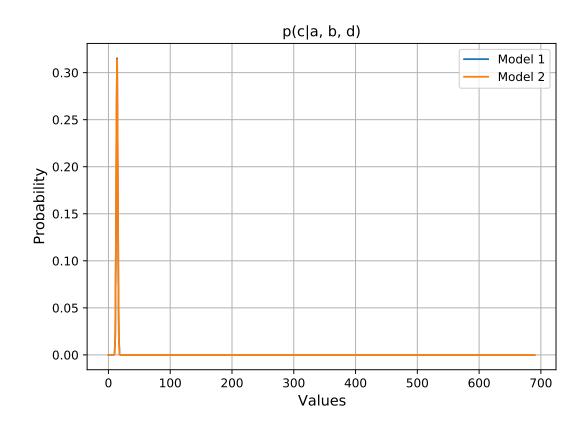












 $\mathbb{E}\ c = 13.75$ $\mathbb{D}_1\ c = 13.1675$ $\mathbb{D}_2\ c = 14.0475$ $t_1 = 208\ ms$ $t_2 = 8.82\ \mu s$ $\mathbb{E}\ (c|a=83)=13.8$ $\mathbb{D}_1\ (c|a=83)=13.0$ $\mathbb{D}_2\ (c|a=83)=13.885$ $t_1=117\ ms$ $t_2=9.3\ \mu s$

$$\mathbb{E}(c|b=550)=13.75$$
 $\mathbb{D}_1(c|b=550)=13.0825$ $\mathbb{D}_2(c|b=550)=13.9625$ $t_1=11.9~ms$ $t_2=4~ms$

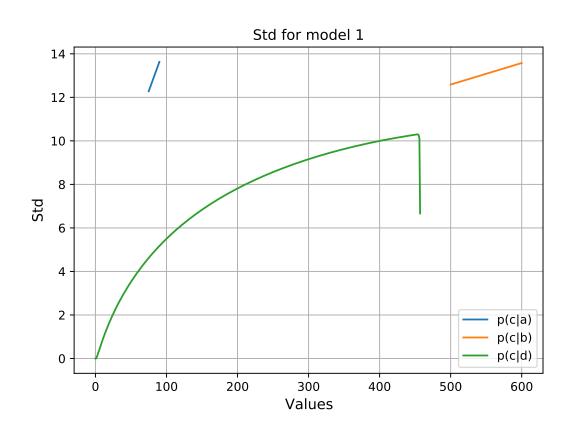
$$\mathbb{E}(c|a=83, b=550) = 13.8$$
 $\mathbb{D}_1(c|a=83, b=550) = 12.915$ $\mathbb{D}_2(c|a=83, b=550) = 13.8$ $t_1 = 15.4 \, ms$ $t_2 = 2.03 \, ms$

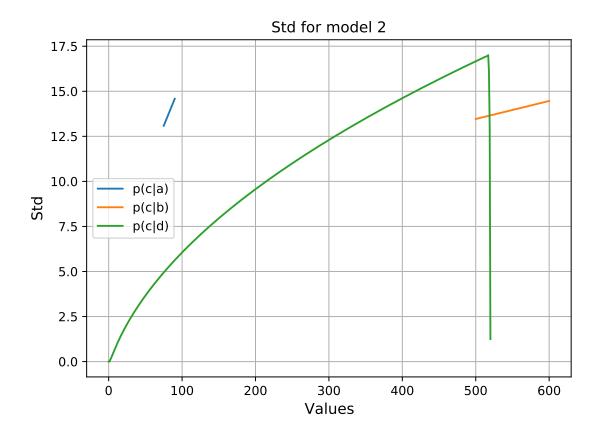
$$\mathbb{E}(c|d=18)=13.9$$
 $\mathbb{D}_1(c|d=18)=1.534$ $\mathbb{D}_2(c|d=18)=1.544$ $t_1=1.23$ s $t_2=685$ ms

$$\mathbb{E}$$
 $(c|a=83,b=550,d=18)=13.9$ \mathbb{D}_1 $(c|a=83,b=550,d=18)=1.530$ \mathbb{D}_2 $(c|a=83,b=550,d=18)=1.540$ $t_1=423$ ms $t_2=253$ ms \mathbb{E} $d=17.875$ \mathbb{D}_1 $d=25.14$ \mathbb{D}_2 $d=26.63$ $t_1=622$ ms $t_2=333$ ms

Как видно из графиков и из значений дисперсий лучше всего на прогноз c влияет d. Что неудивительно, так как количество присутствующих студентов намного сильнее коррелирует с отметившимися, чем с общим количеством записанных на курс. Заметим так же, что a вносит чуть больше ясности, чем b.

9 Уточнение прогноза



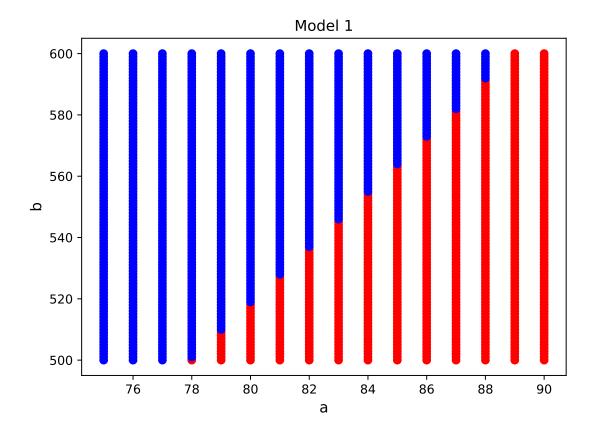


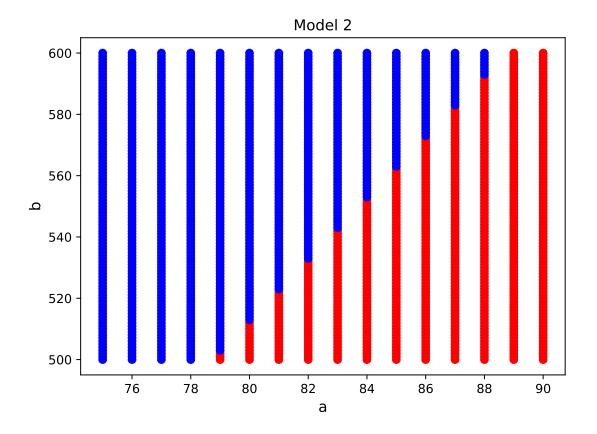
Заметим, что во второй модели при достаточно больших d $\mathbb{D}(c|d) > \mathbb{D}(c|b)$. Следовательно нельзя сказать, что d вносит наибольший вклад в уточнение для прогноза c. Напротив, в первой модели $\mathbb{D}(c|d)$ растёт с ростом d, однако потом начинает уменьшаться. Что вполне предсказуемо, так как становится меньше возможных вариантов для c. Поэтому в первой модели можно утверждать, что d играет большую роль в оценке c. (Для больших значений d не получается вычислить дисперсию из-за точности вычислений на компьютере)

Найдём множества $A = \{(a,b) \mid \mathbb{D}(c|b) < \mathbb{D}(c|a)\}$ и $B = \{(a,b) \mid \mathbb{D}(c|b) \geq \mathbb{D}(c|a)\}$ Обозначим за $p_i' = p_i$ или $p_i' = p_i(1-p_i), i \in \{1,2\}$ в зависимости от модели. Тогда: $\mathbb{D}(c|a) = p_1'a + p_2'\mathbb{E}b + p_2^2\mathbb{D}b, \mathbb{D}(c|b) = p_1'\mathbb{E}a + p_2'b + p_1^2\mathbb{D}a$ $\mathbb{D}(c|a) - \mathbb{D}(c|b) = p_1'(a - \mathbb{E}a) + p_2'(\mathbb{E}b - b) + p_2^2\mathbb{D}b - p_1^2\mathbb{D}a > 0$ $\Rightarrow p_1'a - p_2'b > p_1'\mathbb{E}a - p_2'\mathbb{E}b - p_2^2\mathbb{D}b + p_1^2\mathbb{D}a = const$ $\Rightarrow p_1'a - p_2'b > const$

Получили линейную зависимость от a и b. Следовательно множества A и B линейно разделимы. И множество A состоит из пар удовлетворяющих уравнению $p_1'a-p_2'b>const.$

Изобразим на графике эти множества. Синими точками обозначены элементы B, а красными A. Как видно из рисунка данные множества линейно раздели-



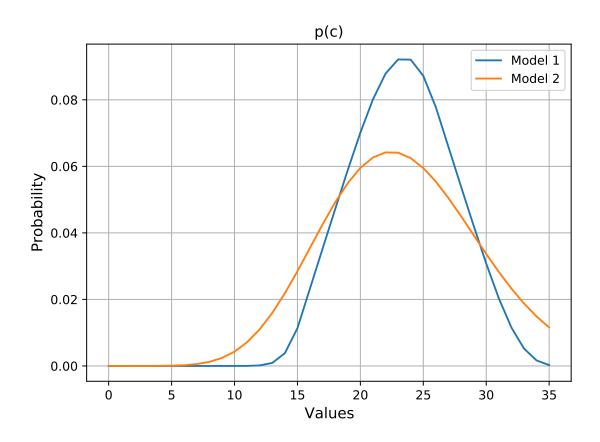


10 Сравнение моделей

Как уже было получено в предыдущем разделе модели отличаются в уточнении прогноза c. Так же заметим, что вторая модель является лишь приближением первой. Известно, что биномиальное распределение Bin(n,p) при большом количестве испытаний и маленькой вероятности успеха может быть c высокой точностью приближено пуассоновским распределением $Poiss(\lambda)$ с $\lambda = np$. Но если у нас мало испытаний и большая вероятность успеха, то тогда данные модели будут показывать совершенно разный результат.

Пусть на излюбленный курс по байесовским методам ходит только кафедра ММП, на которой из года в год 15-25 человек. А так как это не совсем простые студенты, то они посещают абсолютно все пары. Тогда вероятность их присутствия 0.95. Студенты других кафедр менее ответственные, поэтому их ходит до 10 человек с вероятностью 0.8 (среди них тоже есть матёрые).

Построим графики вероятностей распределения p(c).



Как видно из рисунка, вероятности довольно сильно отличаются. Вторая модель менее точная, поэтому имеет более большую дисперсию.

P.s. автор не хотел никого обидеть, просто слегка утрировал реальность.