

Introduction to Probability (Joe Blitzstein)

Fernando Náufel

(versão de 24/02/2022)

Sumário

Apresentação	2
01: Probabilidade e contagem	3
Vídeo	3
Pascal e Fermat	3
R	3
Exercícios	5
02: Histórias e axiomas	8
Vídeo	8
Exercícios	8
03: Problema do aniversário, propriedades	14
Vídeo	14
Exercícios	14
04: Probabilidade condicional	22
Vídeo	22
Exercícios	22
Referências	36

Apresentação

- Página do livro: <https://projects.iq.harvard.edu/stat110/home>
- Strategic practice and homework: <https://projects.iq.harvard.edu/stat110/strategic-practice-problems>
- Handouts: <https://projects.iq.harvard.edu/stat110/handouts> — includes solutions to exercises marked with (s) in the book.
- Playlist: <https://www.youtube.com/playlist?list=PL2SOU6wwxB0uwwH80KTQ6ht66KWxbzTIo>

01: Probabilidade e contagem

Vídeo

<https://youtu.be/KbB0FjPg0mw>

Pascal e Fermat

- Ver artigo DEVLIN (2010).
 - Ver [originais em francês de toda a correspondência de Pascal](#).
-

R

Fatoriais e combinações

- Qual o maior valor de n para o qual o R calcula `factorial(n)`?

No meu computador, $n = 170$:

```
factorial(170:171)
## [1] 7,257416e+306      Inf
```

- Para valores maiores, podemos usar `lfactorial(n)` para calcular $\ln n!$:

```
lfactorial(170:171)
## [1] 706,5731 711,7147
```

- Da mesma forma, `lchoose(n, k)` calcula $\ln \binom{n}{k}$.

Tabulando dados: `tabulate` × `table`

```
b <- sample(1:365,23,replace=TRUE)
tabulate(b)
## [1] 0 1 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
## [34] 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
## [67] 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 1 0 0 0 0 1 0 0 0 0 0 0 1 0 0 0
## [100] 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 1 0 0 0 0 0 0 1 0 0 0 0 0 0 0 0 0
## [133] 1 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 1 1 0 0 0 0 0 0
## [166] 0 0 0 0 1 0 0 0 0 1 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 2 0 0 0 0 0
## [199] 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 1 0 0 0 0 1 0 0 0 0 0 0 0 0
## [232] 0 0 0 1 0 1 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
## [265] 0 1 0 0 0 2 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
## [298] 0 1 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 1 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
## [331] 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
```

```
table(b)
## b
## 2 83 88 95 113 120 133 156 157 170 175 190 216 221 235 237 266
## 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 2 1 1 1 1 1
## 270 299 315 348
## 2 1 1 1
```

Funções para o problema do aniversário

```
pbirthday(23)
## [1] 0,5072972
```

```
qbirthday(.5)
## [1] 23
```

```
qbirthday(1)
## [1] 366
```

Para no mínimo 3 no mesmo dia:

```
qbirthday(.5, coincident = 3)
## [1] 88
```

Exercícios

[Enunciados \(pdf\).](#)

Practice

4. Norepeat words

A *norepeatword* is a sequence of at least one (and possibly all) of the usual 26 letters a, b, c, ..., z, with repetitions not allowed.

For example, “course” is a *norepeatword*, but “statistics” is not.

Order matters, e.g., “course” is not the same as “source”.

A *norepeatword* is chosen randomly, with all *norepeatwords* equally likely. Show that the probability that it uses all 26 letters is very close to $1/e$.

- O denominador vai ser o total de todas as *norepeatwords* (NRW), que é a soma de
 - NRW de 1 letra: 26
 - NRW de 2 letras: $26 \cdot 25$
 - NRW de 3 letras: $26 \cdot 25 \cdot 24$
 - ...
 - NRW de 24 letras: $26 \cdot 25 \cdot 24 \cdot \dots \cdot 3$
 - NRW de 25 letras: $26 \cdot 25 \cdot 24 \cdot \dots \cdot 2$
 - NRW de 26 letras: $26 \cdot 25 \cdot 24 \cdot \dots \cdot 1$
- Ou seja,

$$\sum_{k=0}^{25} \frac{26!}{k!}$$

- Que é igual a

$$26! \left(1 + \frac{1}{1!} + \frac{1}{2!} + \frac{1}{3!} + \dots + \frac{1}{25!} \right)$$

- O total de NRW que usam as 26 letras é $26!$.

- A probabilidade procurada é

$$\begin{aligned}
 P &= \frac{26!}{26! \left(1 + \frac{1}{1!} + \frac{1}{2!} + \frac{1}{3!} + \dots + \frac{1}{25!}\right)} \\
 &= \frac{1}{1 + \frac{1}{1!} + \frac{1}{2!} + \frac{1}{3!} + \dots + \frac{1}{25!}} \\
 &= \frac{1}{e}
 \end{aligned}$$

- A última igualdade se justifica porque a série de Taylor para e^x é

$$e^x = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{x^k}{k!}$$

- Numericamente:

```
1 / exp(1)
## [1] 0,3678794
```

```
1 / sum(1 / factorial(0:25))
## [1] 0,3678794
```

Exercícios do livro (cap. 1)

13

A certain casino uses 10 standard decks of cards mixed together into one big deck, which we will call a superdeck. Thus, the superdeck has $52 \cdot 10 = 520$ cards, with 10 copies of each card.

How many different 10-card hands can be dealt from the superdeck? The order of the cards does not matter, nor does it matter which of the original 10 decks the cards came from. Express your answer as a binomial coefficient.

- Usando a notação de OLIVEIRA MORGADO et al. (2004), onde CR_k^n é o número de combinações completas de n elementos de k tipos diferentes, a resposta é

$$CR_{52}^{10} = \binom{52 + 10 - 1}{10} = \binom{61}{10} = 90.177.170.226$$

- Só foi possível usar combinações completas porque a mão tem 10 cartas, o que faz com que haja, essencialmente, um número infinito de cópias de cada um dos 52

tipos de carta. Se a mão tivesse 11 ou mais cartas, seria impossível que todas as cartas fossem iguais, e este raciocínio não poderia ser usado.

02: Histórias e axiomas

Vídeo

https://youtu.be/FJd_1H3rZGg

Exercícios

[Enunciados \(pdf\)](#).

Homework

4. Teorema das colunas

(a) Mostre que

$$\binom{k}{k} + \binom{k+1}{k} + \binom{k+2}{k} + \cdots + \binom{n}{k} = \binom{n+1}{k+1}$$

- O lado direito significa escolher $k + 1$ pessoas dentre $n + 1$ pessoas.
- O truque é **ordenar as pessoas** de algum modo.
- Um exemplo concreto, com $n = 4$ e $k = 2$, mostrando que

$$\binom{5}{3} = \binom{4}{2} + \binom{3}{2} + \binom{2}{2}$$

1. Vamos chamar as $n + 1$ pessoas de 1, 2, 3, 4, 5.

2. Grupos de $k + 1$ pessoas onde o menor número é 1:

- 1, 2, 3
- 1, 2, 4
- 1, 2, 5
- 1, 3, 4
- 1, 3, 5
- 1, 4, 5

3. Grupos de $k + 1$ pessoas onde o menor número é 2:

- 2, 3, 4
- 2, 3, 5
- 2, 4, 5

4. Grupos de $k + 1$ pessoas onde o menor número é 3:

- 3, 4, 5

- No caso geral, vamos ordenar as $n + 1$ pessoas, rotulando-as como

$$a_0, a_1, a_2, \dots, a_n$$

- Como a ordem **dentro de cada grupo** não importa, vamos escolher primeiro um elemento para ser o de **menor índice do grupo** e escolher os restantes k elementos dentre os elementos de índice maior do que o primeiro.
- Se escolhermos a_0 como o de menor índice, temos $\binom{n}{k}$ modos de escolher os restantes.
- Se escolhermos a_1 como o de menor índice, temos $\binom{n-1}{k}$ modos de escolher os restantes.
- ...
- Se escolhermos $a_{n-(k+1)}$ como o de menor índice, temos $\binom{k+1}{k}$ modos de escolher os restantes.
- Se escolhermos a_{n-k} como o de menor índice, temos $\binom{k}{k}$ modos de escolher os restantes.

(b) Suppose that a large pack of Haribo gummi bears can have anywhere between 30 and 50 gummi bears. There are 5 delicious flavors. How many possibilities are there for the composition of such a pack of gummi bears?

- Usando a notação de OLIVEIRA MORGADO et al. (2004), onde CR_k^n é o número de combinações completas de n elementos de k tipos diferentes, a resposta é

$$\begin{aligned}
CR_5^{30} + CR_5^{31} + \dots + CR_5^{50} &= \binom{34}{4} + \binom{35}{4} + \dots + \binom{54}{4} \\
&= \binom{55}{5} - \left[\binom{33}{4} + \binom{32}{4} + \dots + \binom{4}{4} \right] \\
&= \binom{55}{5} - \binom{34}{5}
\end{aligned}$$

Exercícios do livro (cap. 1)

17

$$\sum_{k=0}^n \binom{n}{k}^2 = \binom{2n}{n}$$

- Quero escolher n pessoas dentre $2n$ pessoas (lado direito).
- Divido as $2n$ pessoas em dois grupos de n cada.
- Para $k \in \{0, 1, \dots, n\}$:
 - Escolho k pessoas do primeiro grupo — $\binom{n}{k}$ — para entrar.
 - Escolho k pessoas do segundo grupo — $\binom{n}{k}$ — para **não** entrar.
 - Para este valor de k , tenho $\binom{n}{k}^2$ maneiras de selecionar n pessoas, com k pessoas do primeiro grupo e $n - k$ pessoas do segundo.

18

$$\sum_{k=1}^n k \binom{n}{k}^2 = n \binom{2n-1}{n-1}$$

Usamos o mesmo raciocínio do exercício anterior, com a seguinte modificação:

- Temos $2n$ pessoas, divididas em dois grupos de n , como antes.
- Como antes, quero escolher n pessoas dentre as $2n$.
- Mas agora, para cada escolha, quero designar uma das n pessoas do primeiro grupo como chefe (i.e., sempre haverá pelo menos uma pessoa do primeiro grupo). Isto corresponde ao fator n no lado direito.

- Escolhido o chefe, preciso escolher $n-1$ pessoas dentre as $2n-1$ restantes ($n-1$ do primeiro grupo, n do segundo). Isto corresponde ao segundo fator do lado direito.
- Do lado esquerdo, para $k \in \{1, 2, \dots, n\}$:
 - Vou escolher k pessoas do primeiro grupo — $\binom{n}{k}$ — para entrar.
 - Dentre elas, vou escolher um chefe — k .
 - Vou escolher k pessoas do segundo grupo — $\binom{n}{k}$ — para **não** entrar.

19

$$\sum_{k=2}^n \binom{k}{2} \binom{n-k+2}{2} = \binom{n+3}{5}, \quad \forall n \geq 2$$

- Um exemplo concreto: $n = 3$
- Queremos escolher 5 elementos dentre 6.
- Para $k \in \{2, 3\}$:
 1. Escolhemos sempre o elemento $k+1$:

$$\begin{array}{cccccc} 1 & 2 & \underbrace{3}_{k=2} & 4 & 5 & 6 \\ 1 & 2 & 3 & \underbrace{4}_{k=3} & 5 & 6 \end{array}$$

Este é o elemento que vai estar **no meio** do grupo dos escolhidos.

2. Escolhemos 2 dentre os k primeiros elementos:

$$\begin{array}{cccccc} \underbrace{1 \ 2}_{k=2} & 3 & 4 & 5 & 6 \\ \underbrace{1 \ 2 \ 3}_{k=3} & 4 & 5 & 6 \end{array}$$

3. Escolhemos 2 dentre os $n-k+2$ últimos elementos:

$$\begin{array}{cccccc} 1 & 2 & 3 & \underbrace{4 \ 5 \ 6}_{k=2} \\ 1 & 2 & 3 & 4 & \underbrace{5 \ 6}_{k=3} \end{array}$$

Para provar

$$1^3 + 2^3 + \dots + n^3 = (1 + 2 + \dots + n)^2$$

a. Vamos provar

$$1 + 2 + \dots + n = \binom{n+1}{2}$$

b. E vamos provar

$$1^3 + 2^3 + \dots + n^3 = 6\binom{n+1}{4} + 6\binom{n+1}{3} + \binom{n+1}{2}$$

a. Considere $n + 1$ times, numerados de 0 a n , num campeonato onde cada time joga com todos os outros exatamente uma vez. O total de jogos será

$$\binom{n+1}{2}$$

- O time 0 joga com n times com número maior que ele.
 - O time 1 joga com $n - 1$ times com número maior que ele.
 - O time 2 joga com $n - 2$ times com número maior que ele.
 - ...
 - O time $n - 2$ joga com 2 times com número maior que ele.
 - O time $n - 1$ joga com 1 time com número maior que ele.
 - O time n joga com 0 times com número maior que ele.
- b. Hint: Imagine choosing a number between 1 and n and then choosing 3 numbers between 0 and n smaller than the original number, with replacement. Then consider cases based on how many distinct numbers were chosen.
- Vamos chamar o número escolhido de k .
 - Para $k = 1$, só temos o 0 para escolher. É 1 possibilidade.
 - Para $k = 2$, temos 2 números. São 2^3 possibilidades.
 - Para $k = 3$, temos 3 números. São 3^3 possibilidades.
 - No geral, para $k = n$, são n^3 possibilidades.
 - A soma de todos os casos é a soma dos cubos.

- Vamos examinar o caso em que k foi o número escolhido. De quantas maneiras podemos escolher 3 números entre 0 e $k - 1$, com reposição?
 - Com 1 número, basta escolher o número: $\binom{k}{1}$ possibilidades.
 - Com 2 números distintos:
 - * Escolhemos os 2 números: $\binom{k}{2}$ possibilidades;
 - * Escolhemos qual dos 2 aparecerá 2 vezes: 2 possibilidades;
 - * Escolhemos a posição do número que aparece uma vez: 3 possibilidades.
 - * São $6\binom{k}{2}$ possibilidades.
 - Com 3 números distintos:
 - * Escolhemos os 3 números: $\binom{k}{3}$ possibilidades;
 - * Escolhemos a ordem dos 3 números: 6 possibilidades;
 - * São $6\binom{k}{3}$ possibilidades.
- Para todos os valores de k , o total de possibilidades é

$$\sum_{k=1}^n \left[\binom{k}{1} + 6\binom{k}{2} + 6\binom{k}{3} \right]$$

- Usando o teorema das colunas, chegamos ao resultado

$$\binom{n+1}{2} + 6\binom{n+1}{3} + 6\binom{n+1}{4}$$

03: Problema do aniversário, propriedades

Vídeo

https://youtu.be/LZ5Wergp_PA

Exercícios

Exercícios do livro (cap. 1)

26

Amostra **com reposição** de tamanho 1000 a partir de uma população de tamanho 1 milhão. Cada pessoa tem a mesma probabilidade de ser escolhida.

Qual a probabilidade de pelo menos uma pessoa ser escolhida mais de uma vez?

Usando $N = 1.000.000$ e $n = 1.000$:

$$\begin{aligned} P &= 1 - P(\text{ninguém escolhido mais de uma vez}) \\ &= 1 - \frac{\binom{N}{n} \cdot n!}{N^n} \\ &= 1 - \frac{N}{N} \cdot \frac{N-1}{N} \cdot \frac{N-2}{N} \cdot \dots \cdot \frac{N-n+1}{N} \end{aligned}$$

N	n	P
1.000.000	1.000.000	1,00000000
1.000.000	100.000	1,00000000
1.000.000	10.000	1,00000000
1.000.000	1.000	0,3932670
1.000.000	100	0,0049379
1.000.000	10	0,0000450
1.000.000	1	0,00000000

Na verdade, esta é a mesma distribuição do problema dos aniversários, com N dias e n pessoas.

Para N grande e n pequeno, a probabilidade P de pelo menos uma pessoa ser escolhida mais de uma vez se aproxima de 0:

27

- Função de *hash* $h(x)$.
- k telefones armazenados em n posições, todas com a mesma probabilidade.
- Qual a probabilidade de colisão?

De novo, $\text{pbirthday}(k, n)$.

57

- Existem 10^{44} moléculas na atmosfera.
- No seu último suspiro, César respirou 10^{22} delas (**sem** reposição).
- Você respira 10^{22} moléculas agora (**com** reposição).
- Qual a probabilidade de que pelo menos uma molécula sua tenha sido de César também?

A resposta é $1 - P(\text{nenhuma molécula sua foi de César})$.

Para calcular $P(\text{nenhuma molécula sua foi de César})$:

- Todas as respiradas possíveis (com reposição, com ordem): $(10^{44})^{(10^{22})}$.
- Todas as respiradas sem moléculas de César (com reposição, com ordem): $(10^{44} - 10^{22})^{(10^{22})}$.
- Daí,

$$\begin{aligned}
 P(\text{nenhuma molécula sua foi de César}) &= \frac{(10^{44} - 10^{22})^{(10^{22})}}{(10^{44})^{(10^{22})}} \\
 &= \left(\frac{10^{44} - 10^{22}}{10^{44}} \right)^{(10^{22})} \\
 &= \left(1 - \frac{1}{10^{22}} \right)^{(10^{22})} \\
 &\approx e^{-1}
 \end{aligned}$$

- Logo, a probabilidade procurada é aproximadamente

$$1 - e^{-1} \approx 0,63$$

- Formulação original em PAULOS (1988):

Now for better news of a kind of immortal persistence. First, take a deep breath. Assume Shakespeare's account is accurate and Julius Caesar gasped "You too, Brutus" before breathing his last. What are the chances you just inhaled a molecule which Caesar exhaled in his dying breath? The surprising answer is that, with probability better than 99 percent, you did just inhale such a molecule.

For those who don't believe me: I'm assuming that after more than two thousand years the exhaled molecules are uniformly spread about the world and the vast majority are still free in the atmosphere. Given these reasonably valid assumptions, the problem of determining the relevant probability is straightforward. If there are N molecules of air in the world and Caesar exhaled A of them, then the probability that any given molecule you inhale is from Caesar is A/N . The probability that any given molecule you inhale is not from Caesar is thus $1 - A/N$. By the multiplication principle, if you inhale three molecules, the probability that none of these three is from Caesar is $[1 - A/N]^3$. Similarly, if you inhale B molecules, the probability that none of them is from Caesar is approximately $[1 - A/N]^B$. Hence, the probability of the complementary event, of your inhaling at least one of his exhaled molecules, is $1 - [1 - A/N]^B$. A , B (each about 1/30th of a liter, or 2.2×10^{22}), and N (about 10^{44} molecules) are such that this probability is more than .99. It's intriguing that we're all, at least in this minimal sense, eventually part of one another.

61

- n passageiros para n assentos.
- Passageiro k inicialmente alocado no assento k .
- MAS Passageiro 1 decide escolher assento ao acaso (cada assento com a mesma probabilidade).
- Então, cada passageiro seguinte se senta no assento inicialmente alocado para ele, se disponível; caso contrário, escolhe um assento ao acaso.
- Qual a probabilidade de que o último passageiro se sente no assento alocado para ele?

Possibilidades O último passageiro só pode se sentar no lugar 1 ou no lugar n .

Aliás, isto é um caso específico de um fenômeno mais geral, Qualquer que seja o valor de n :

- O passageiro 3 nunca fica no assento 2: ou o passageiro 1 pegou, ou ficou livre para o passageiro 2 (que é obrigado a pegá-lo).
- O passageiro 4 nunca fica nos assentos 2 nem 3: ou o passageiro 1 pegou o assento 3, ou aconteceu um dos casos acima e o assento 3 ficou livre para o passageiro 3 (que é obrigado a pegá-lo).
- O passageiro 5 nunca fica nos assentos 2 nem 3 nem 4: ou o passageiro 1 pegou o assento 4, ou aconteceu um dos casos acima e o assento 4 ficou livre para o passageiro 4 (que é obrigado a pegá-lo).
- etc.
- Seguindo o raciocínio, chegamos à conclusão de que o passageiro n só pode ocupar o assento 1 ou o assento n .

Probabilidades

- Examinando exemplos com $n \in \{3, 4, 5\}$, a probabilidade parece ser $1/2$.
- Por quê?
- O assento do passageiro n depende da pergunta (no momento em que o passageiro n vai se sentar)

“O assento 1 já foi tomado?”

cujas respostas são opostas à da pergunta

“O assento n já foi tomado?”

- Com que probabilidade a resposta a esta última pergunta é sim?
- Em todos os passos anteriores, como explicado acima em “possibilidades”, os assentos 1 e n sempre estão disponíveis para qualquer passageiro que vá escolher um assento ao acaso.
- Como todos os assentos têm a mesma probabilidade de ser escolhidos, a probabilidade de o assento 1 estar tomado é igual à probabilidade de o assento n estar tomado.
- Logo, a probabilidade de o passageiro n acabar no assento n é $1/2$.

Problema do aniversário com probabilidades diferentes:

- Seja $\vec{p} = (p_1, p_2, \dots, p_{365})$ o vetor das probabilidades de alguém nascer em algum dos dias do ano.
- Seja

$$e_k(x_1, \dots, x_n) = \sum_{1 \leq j_1 < j_2 < \dots < j_k \leq n} x_{j_1} \dots x_{j_k}$$

o k -ésimo **polinômio simétrico elementar** sobre as variáveis x_1, \dots, x_n .

Por exemplo,

$$e_1(x_1, x_2, x_3) = x_1 + x_2 + x_3$$

$$e_2(x_1, x_2, x_3) = x_1x_2 + x_1x_3 + x_2x_3$$

$$e_3(x_1, x_2, x_3) = x_1x_2x_3$$

- a. Seja $k \geq 2$. Qual a probabilidade de pelo menos uma coincidência de aniversários em termos de \vec{p} e de um polinômio simétrico elementar?

A probabilidade de **não haver coincidência** é a soma das probabilidades de todos os eventos da forma

As pessoas 1, 2, ... k nasceram em dias diferentes j_1, j_2, \dots, j_k .

Por exemplo, para $k = 3$, a soma será

$$3! \cdot (p_1p_2p_3 + p_1p_2p_4 + \dots + p_{363}p_{364}p_{365})$$

Isto é igual a

$$k! \cdot e_k(\vec{p})$$

A probabilidade de pelo menos uma coincidência é

$$1 - k! \cdot e_k(\vec{p})$$

- b. Quando $p_j = 1/365$ para todo j , esta probabilidade é mínima.

No caso em que $p_j = p = 1/365$ para todo j , temos

$$\begin{aligned}
1 - k! \cdot e_k(\vec{p}) &= 1 - k! \cdot \binom{365}{k} \cdot p^k \\
&= 1 - \frac{365 \cdot 364 \cdot \dots \cdot (365 - k + 1)}{365^k}
\end{aligned}$$

Neste caso, o valor de $e_k(\vec{p})$ é máximo.

c. Considere a desigualdade

$$\frac{x+y}{2} \geq \sqrt{xy}$$

que vem do raciocínio

$$\begin{aligned}
(x+y)^2 - 4xy &= (x-y)^2 \geq 0 \implies (x+y)^2 - 4xy \geq 0 \\
&\implies (x+y)^2 \geq 4xy \\
&\implies \frac{(x+y)^2}{4} \geq xy \\
&\implies \frac{x+y}{2} \geq \sqrt{xy}
\end{aligned}$$

Defina $\vec{r} = (r_1, \dots, r_{365})$ tal que

- $r_1 = r_2 = (p_1 + p_2)/2$,
- $r_j = p_j$ para $3 \leq j \leq 365$.

Verifique que

$$\begin{aligned}
e_k(x_1, \dots, x_n) &= x_1 x_2 e_{k-2}(x_3, \dots, x_n) + \\
&\quad (x_1 + x_2) e_{k-1}(x_3, \dots, x_n) + \\
&\quad e_k(x_3, \dots, x_n)
\end{aligned}$$

e use a desigualdade para mostrar que, quando $\vec{p} \neq \vec{r}$,

$$P(\text{coincidência} \mid \vec{p}) > P(\text{coincidência} \mid \vec{r})$$

- Observe que

$$\frac{x+y}{2} = \sqrt{xy} \implies x = y$$

Ou seja, quando $x \neq y$, a desigualdade é estrita.

- Para o vetor \vec{p} :

$$\begin{aligned}
P(\text{coincidência} \mid \vec{p}) &= 1 - k! \cdot e_k(\vec{p}) \\
&= 1 - k! \cdot [p_1 p_2 \cdot e_{k-2}(p_3, \dots, p_n) + (p_1 + p_2) \cdot e_{k-1}(p_3, \dots, p_n) + e_k(p_3, \dots, p_n)]
\end{aligned}$$

- Para o vetor \vec{r} :

$$\begin{aligned}
P(\text{coincidência} \mid \vec{r}) &= 1 - k! \cdot e_k(\vec{r}) \\
&= 1 - k! \cdot \left[\frac{(p_1 + p_2)^2}{4} \cdot e_{k-2}(p_3, \dots, p_n) + (p_1 + p_2) \cdot e_{k-1}(p_3, \dots, p_n) + e_k(p_3, \dots, p_n) \right]
\end{aligned}$$

- A única diferença está no primeiro fator dentro dos colchetes.
- Pela desigualdade:

$$\frac{p_1 + p_2}{2} \geq \sqrt{p_1 p_2} \implies \frac{(p_1 + p_2)^2}{4} \geq p_1 p_2$$

- Conclusão: para todo vetor \vec{p} de probabilidades, é possível preservar ou diminuir a probabilidade de uma coincidência substituindo quaisquer 2 de suas componentes pelo valor da média aritmética delas. Assim, o vetor que minimiza a probabilidade precisa ter todas as suas componentes iguais.

04: Probabilidade condicional

Vídeo

<https://youtu.be/P7NE4WF8j-Q>

Exercícios

[Enunciados \(pdf\)](#).

Homework

3.1 Lewis Carroll

Este problema foi proposto pela primeira vez por Lewis Carroll em 1893.

- Uma bolsa contém uma bola, que é ou azul, ou verde, com probabilidades iguais.
- Uma bola verde é colocada na bolsa; agora, há 2 bolas na bolsa.
- Uma bola é retirada da bolsa ao acaso.
- A bola retirada é verde.
- Qual é a probabilidade de que a bola que sobrou na bolsa seja verde?

- Antes de mais nada, vamos definir os eventos:

O = bola original é verde
 R = bola retirada é verde
 S = bola que sobrou é verde

- O importante é perceber que o enunciado diz que o evento R aconteceu, mas as probabilidades devem ser calculadas pensando em todos os resultados possíveis, **antes de o experimento acontecer.**
- Ou seja, em vez de tomar $P(R) = 1$ — **o que seria errado** — vamos calcular $P(S | R)$: a probabilidade de que a bola que sobrou seja verde, **sabendo que a bola retirada foi verde.**
- Começamos com a lei da probabilidade total, condicionando aos dois casos possíveis:

$$P(S | R) = \underbrace{P(S | R, O) \cdot P(O | R)}_{\text{caso 1: bola original verde}} + \underbrace{P(S | R, \neg O) \cdot P(\neg O | R)}_{\text{caso 2: bola original azul}}$$

- No caso 1:

$$\begin{aligned}
 P(S | R, O) \cdot P(O | R) &= 1 \cdot P(O | R) \\
 &= P(O | R)
 \end{aligned}$$

- No caso 2:

$$\begin{aligned}
 P(S | R, \neg O) \cdot P(\neg O | R) &= 0 \cdot P(\neg O | R) \\
 &= 0
 \end{aligned}$$

Isto faz sentido: **se a bola original era azul, não há como a bola que sobrou ser verde.**

- Só precisamos calcular a probabilidade do caso 1, que é $P(O | R)$. Vamos usar Bayes:

$$\begin{aligned}
 P(O | R) &= \frac{P(R | O) \cdot P(O)}{P(R)} \\
 &= \frac{1 \cdot 1/2}{P(R)}
 \end{aligned}$$

- Para calcular $P(R)$, lei da probabilidade total de novo, condicionando sobre a bola original:

$$\begin{aligned}
 P(R) &= P(R | O) \cdot P(O) + P(R | \neg O) \cdot P(\neg O) \\
 &= 1 \cdot 1/2 + 1/2 \cdot 1/2 \\
 &= 3/4
 \end{aligned}$$

- Chegamos a

$$\begin{aligned}
 P(O \mid R) &= \frac{P(R \mid O) \cdot P(O)}{P(R)} \\
 &= \frac{1 \cdot 1/2}{P(R)} \\
 &= \frac{1/2}{3/4} \\
 &= \frac{2}{3}
 \end{aligned}$$

- Outra maneira de calcular $P(S \mid R)$ seria aplicar Bayes primeiro:

$$P(S \mid R) = \frac{P(R \mid S) \cdot P(S)}{P(R)}$$

mas as probabilidades do numerador são mais difíceis de calcular! Teríamos que usar a lei da probabilidade total duas vezes para o numerador (além de uma vez para o denominador).

3.5 Xadrez

- Você vai jogar 2 partidas de xadrez contra um adversário desconhecido.
- O nível do seu adversário pode ser novato, intermediário, ou avançado, com probabilidades iguais.
- As probabilidades de você vencer uma partida são, dependendo do nível do adversário, respectivamente, 90%, 50%, e 30%.

- Qual a probabilidade de você vencer a primeira partida?
- Parabéns, você venceu a primeira partida. Dada esta informação, qual a probabilidade de que você também vença a segunda partida (suponha que, **dado o nível do seu adversário**, os resultados das partidas são independentes)?
- Explique a diferença entre
 - supor que os resultados das partidas são independentes, e
 - supor que os resultados das partidas são independentes, dado o nível do seu adversário.

Qual destas suposições parece mais razoável? Por quê?

- Antes de mais nada, vamos definir os eventos:

N = o adversário é novato

I = o adversário é intermediário

A = o adversário é avançado

V_1 = você vence a primeira partida

V_2 = você vence a segunda partida

- O enunciado dá as probabilidades

$$P(N) = 1/3$$

$$P(I) = 1/3$$

$$P(A) = 1/3$$

$$P(V_1 | N) = 9/10$$

$$P(V_1 | I) = 5/10$$

$$P(V_1 | A) = 3/10$$

- Para resolver (a), basta usar probabilidade total, condicionando sobre o nível do adversário:

$$\begin{aligned} P(V_1) &= P(V_1 | N) \cdot P(N) + P(V_1 | I) \cdot P(I) + P(V_1 | A) \cdot P(A) \\ &= \frac{9}{10} \cdot \frac{1}{3} + \frac{5}{10} \cdot \frac{1}{3} + \frac{3}{10} \cdot \frac{1}{3} \\ &= \frac{1}{3} \cdot \left(\frac{9}{10} + \frac{5}{10} + \frac{3}{10} \right) \\ &= \frac{17}{30} \end{aligned}$$

Faz sentido. Como as probabilidades dos níveis possíveis do adversário são iguais, a probabilidade de vencer é **a média aritmética** das probabilidades de vencer contra cada nível.

Se as probabilidades dos níveis do adversário fossem diferentes, seria a **média ponderada**.

- Para (b), queremos calcular $P(V_2 | V_1)$.

Dizer que V_1 e V_2 são independentes **dado o nível do adversário** é dizer

$$P(V_2 | V_1, N) = P(V_1 | V_2, N) = P(V_2 | N) = P(V_1 | N)$$

e analogamente para probabilidades condicionadas a I e a A .

Ou seja, dado um nível específico do adversário, saber que V_1 ocorreu não altera a probabilidade de V_2 ocorrer, e vice-versa.

Vamos calcular $P(V_2 | V_1)$ usando probabilidade total, condicionando ao nível:

$$\underbrace{P(V_2 | V_1, N) \cdot P(N | V_1)}_{\text{novato}} + \underbrace{P(V_2 | V_1, I) \cdot P(I | V_1)}_{\text{intermediário}} + \underbrace{P(V_2 | V_1, A) \cdot P(A | V_1)}_{\text{avançado}}$$

Para o lado esquerdo de cada produto, a independência condicional diz que

$$P(V_2 | V_1, N) = P(V_1 | N) = 9/10$$

$$P(V_2 | V_1, I) = P(V_1 | I) = 5/10$$

$$P(V_2 | V_1, A) = P(V_1 | A) = 3/10$$

Para o lado direito de cada produto, usamos Bayes. Todas as probabilidades envolvidas já foram calculadas.

Novato:

$$\begin{aligned} P(N | V_1) &= \frac{P(V_1 | N) \cdot P(N)}{P(V_1)} \\ &= \frac{9/10 \cdot 1/3}{17/30} \\ &= \frac{9}{17} \end{aligned}$$

Intermediário:

$$\begin{aligned} P(I | V_1) &= \frac{P(V_1 | I) \cdot P(I)}{P(V_1)} \\ &= \frac{5/10 \cdot 1/3}{17/30} \\ &= \frac{5}{17} \end{aligned}$$

Avançado:

$$\begin{aligned} P(A | V_1) &= \frac{P(V_1 | A) \cdot P(A)}{P(V_1)} \\ &= \frac{3/10 \cdot 1/3}{17/30} \\ &= \frac{3}{17} \end{aligned}$$

A resposta final é

$$\frac{9}{10} \cdot \frac{9}{17} + \frac{5}{10} \cdot \frac{5}{17} + \frac{3}{10} \cdot \frac{3}{17} = \frac{23}{34}$$

- Para responder (c):

Dizer que V_1 e V_2 são **incondicionalmente** independentes seria dizer que

$$P(V_2 | V_1) = P(V_2)$$

Ainda mais, como o nível do adversário não muda de uma partida para outra, teríamos também

$$P(V_2) = P(V_1)$$

Ou seja, cada partida seria uma prova de Bernoulli com a mesma probabilidade de sucesso.

Considerando independência **condicional**, saber que vencemos a primeira partida nos dá informação sobre o nível do adversário, e esta informação é considerada para calcular a probabilidade de vencer a segunda partida.

De fato, usando independência condicional, temos

$$P(V_1) \approx 0,57$$

e

$$P(V_2 | V_1) \approx 0,68$$

Exercícios do livro (cap. 2)

2

- Uma mulher está grávida de meninos gêmeos.
- Gêmeos podem ser idênticos ou fraternos.
- $1/3$ dos gêmeos são idênticos.
- Gêmeos idênticos têm 50% de chance de serem ambos meninos, e 50% de chance de serem ambos meninas.
- Para gêmeos fraternos, cada gêmeo tem, independentemente, 50% de chance de ser menino, e 50% de chance de ser menina.
- Qual a probabilidade de a mulher estar grávida de gêmeos idênticos?

- Eventos:

I = os gêmeos são idênticos
 M = os gêmeos são dois meninos

- Probabilidades dadas:

$$\begin{aligned}P(I) &= 1/3 \\P(M | I) &= 1/2 \\P(M | \neg I) &= 1/4\end{aligned}$$

- Queremos calcular $P(I | M)$. Usamos Bayes:

$$P(I | M) = \frac{P(M | I) \cdot P(I)}{P(M)}$$

- Só falta o valor de $P(M)$, que calculamos usando probabilidade total:

$$\begin{aligned}P(M) &= P(M | I)P(I) + P(M | \neg I)P(\neg I) \\&= 1/2 \cdot 1/3 + 1/4 \cdot 2/3 \\&= 1/3\end{aligned}$$

- Concluimos

$$\begin{aligned}P(I | M) &= \frac{P(M | I) \cdot P(I)}{P(M)} \\&= \frac{1/2 \cdot 1/3}{1/3} \\&= 1/2\end{aligned}$$

- Um aluno está resolvendo uma questão de múltipla escolha com n opções.
- K é o evento que corresponde a ele saber a resposta correta.
- R é o evento que corresponde a ele acertar (sabendo ou chutando).
- Se ele sabe a resposta, ele acerta.
- Se ele não sabe, ele chuta uma opção ao acaso.
- Considere $P(K) = p$.

(a) Ache $P(K | R)$.

(b) Mostre que $P(K | R) \geq p$. Por que isto faz sentido? Quando a igualdade é exata?

a. Vamos usar Bayes, supondo $p = P(K) > 0$:

$$\begin{aligned}
 P(K | R) &= \frac{P(R | K) \cdot P(K)}{P(R)} \\
 &= \frac{1 \cdot p}{P(R | K) \cdot P(K) + P(R | \neg K) \cdot P(\neg K)} \\
 &= \frac{p}{1 \cdot p + \frac{1}{n} \cdot (1 - p)} \\
 &= \frac{np}{np + (1 - p)}
 \end{aligned}$$

b. Isto equivale a mostrar

$$\frac{np}{np + (1 - p)} \geq p$$

Como todos os valores são positivos, isto equivale a

$$np \geq np^2 + (1 - p)p$$

Dividindo ambos os lados por $p > 0$:

$$n \geq np + 1 - p$$

Dai,

$$\begin{aligned}
 n \geq np + 1 - p &\iff n - np \geq 1 - p \\
 &\iff n(1 - p) \geq 1 - p \\
 &\iff n \geq 1 \quad (\text{supondo } p < 1)
 \end{aligned}$$

O que é verdade, pois existe pelo menos uma opção (a correta).

Se $p = 1$, a igualdade vale, e $P(K | R) = 1$, pois o aluno sempre sabe a resposta e sempre acerta.

Se $n = 1$, a igualdade vale, e $P(K | R) = p$, pois o aluno acertar (ele sempre acerta!) e o aluno saber são independentes.

Imagine $n > 1$.

Lembre-se de que $P(K | R) = \frac{P(K \cap R)}{P(R)}$.

O numerador é a probabilidade do evento “o aluno sabe e o aluno acerta”. Esta probabilidade é exatamente p , pois “o aluno sabe” é sub-evento de “o aluno acerta”.

O numerador $P(R)$ é um número tal que $0 < P(R) < 1$. Vamos chamar este número de $1/x$, para $x > 1$.

Então,

$$P(K | R) = \frac{P(K \cap R)}{P(R)} = \frac{p}{1/x} = xp > p$$

Em R Valores teóricos:

```
n <- 1:9
p <- seq(0, 1, .25)

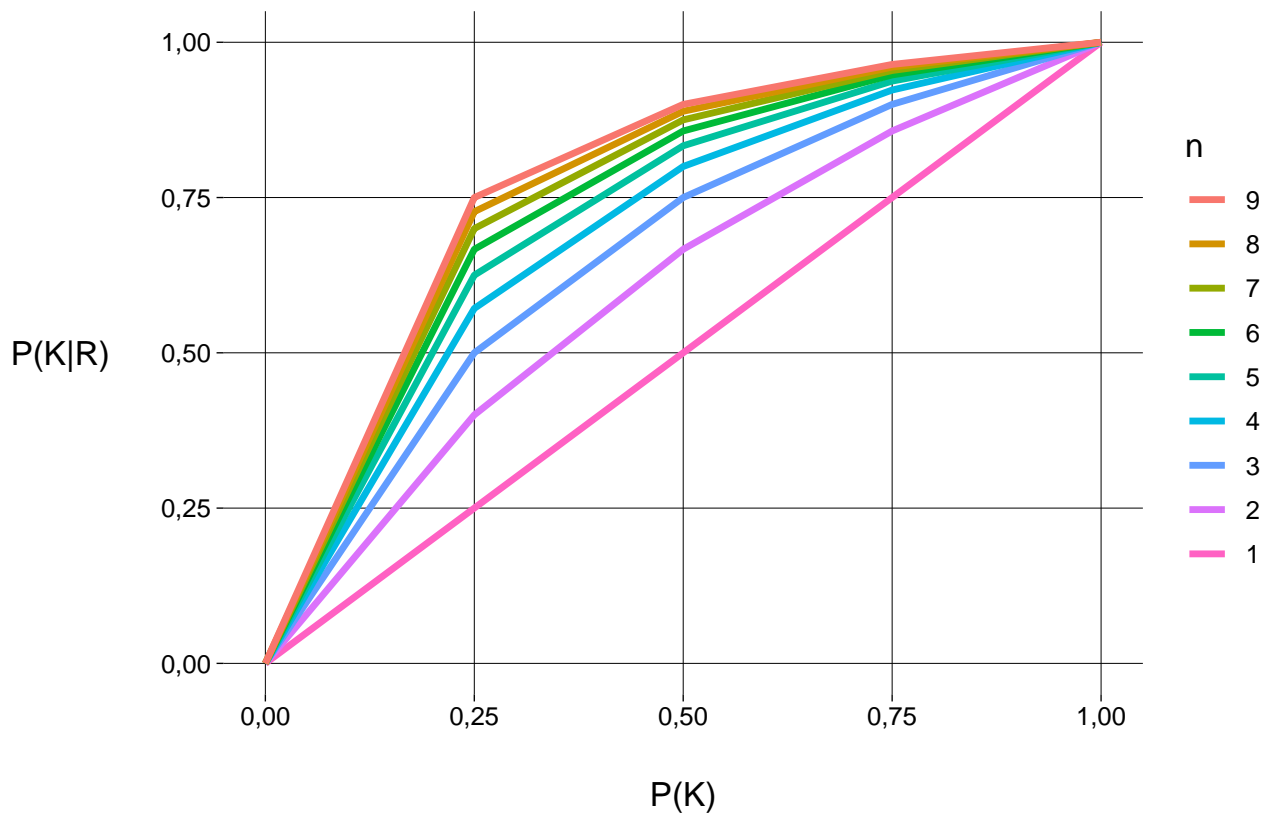
df <- expand.grid(n = n, p = p) %>%
  mutate(
    pkr_teorico = n * p / (p * (n - 1) + 1)
  ) %>%
  arrange(n)

df
## # A tibble: 45 x 3
##       n     p pkr_teorico
##   <int> <dbl>     <dbl>
## 1     1     0         0
## 2     1  0.25     0.25
## 3     1  0.5      0.5
## 4     1  0.75     0.75
## 5     1     1         1
## 6     2     0         0
## # ... with 39 more rows
```

Gráfico:

```
df %>%
```

```
ggplot(aes(p, pkr_teorico)) +
  geom_line(
    aes(group = n, color = fct_rev(as.factor(n))),
    size = 1.25
  ) +
  labs(
    x = 'P(K)',
    y = 'P(K|R)',
    color = 'n'
  )
)
```



Conclusão óbvia: quanto maior o número n de opções, maior a probabilidade $P(K | R)$ de o aluno ter acertado sabendo, em oposição a ter acertado chutando:



$$\begin{aligned} \lim_{n \rightarrow \infty} P(K | R) &= \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{np}{np + 1 - p} \\ &= \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{p}{p} \\ &= 1 \end{aligned}$$

Simulação:


```

sim <- function(n, p, reps = 1e7) {

  sabe <- sample(
    c(TRUE, FALSE),
    reps,
    replace = TRUE,
    c(p, 1 - p)
  )

  acerta <- sabe
  nao_sabe <- sum(!sabe)

  acerta[which(!sabe)] <-
    sample(
      c(TRUE, FALSE),
      nao_sabe,
      replace = TRUE,
      prob = c(1/n, 1 - 1/n)
    )

  sum(sabe) / sum(acerta)
}

sim <- Vectorize(sim)

```

```

df <- df %>%
  mutate(
    pkr_simulado = sim(n, p)
  )

df
## # A tibble: 45 x 4
##       n      p pkr_teorico pkr_simulado
##   <int> <dbl>     <dbl>     <dbl>
## 1     1  0         0         0
## 2     1 0.25       0.25      0.250
## 3     1 0.5        0.5      0.500
## 4     1 0.75       0.75      0.750
## 5     1 1          1         1
## 6     2 0         0         0
## # ... with 39 more rows

```

```

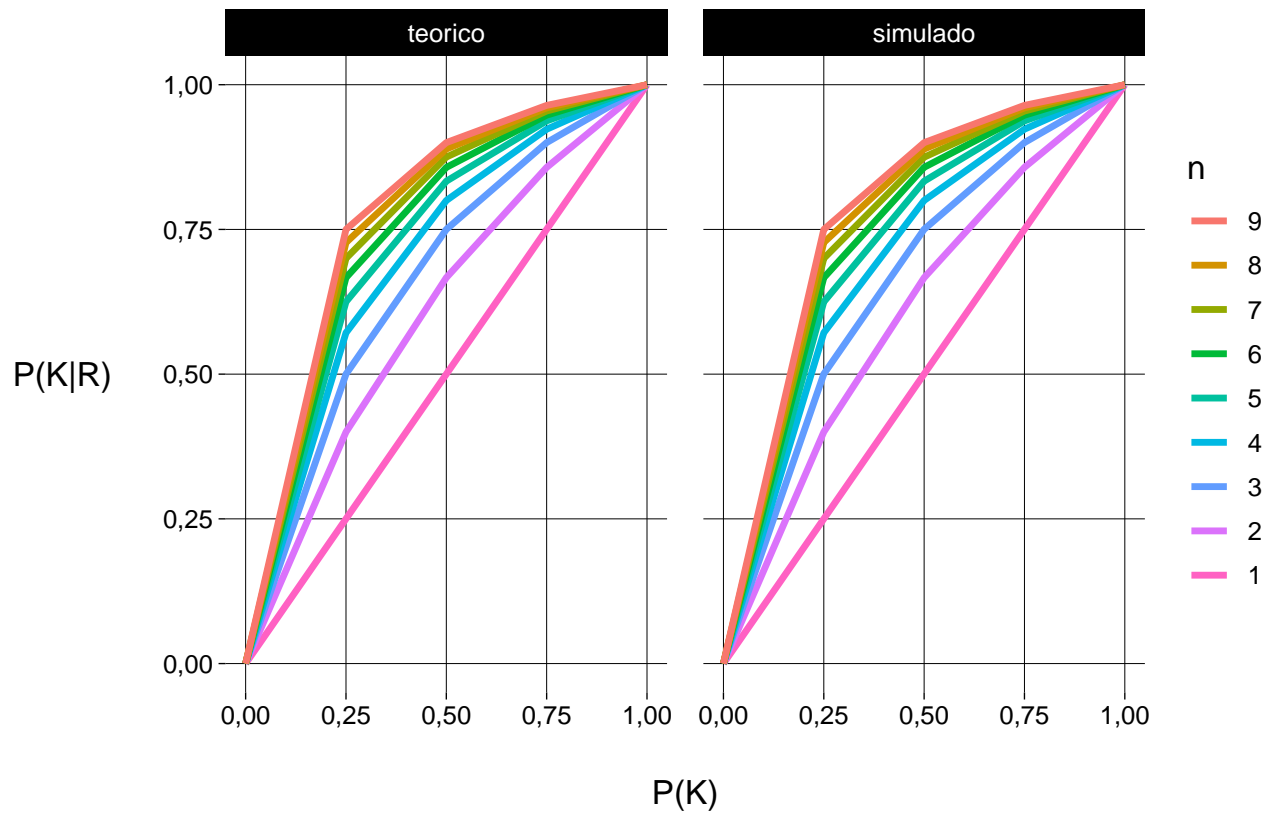
df %>%
  pivot_longer(
    cols = starts_with('pkr'),

```

```

names_to = 'tipo',
names_prefix = 'pkr_',
values_to = 'valor'
) %>%
ggplot(aes(p, valor)) +
  geom_line(
    aes(group = n, color = fct_rev(as.factor(n))),
    size = 1.25
  ) +
  labs(
    x = 'P(K)',
    y = 'P(K|R)',
    color = 'n'
  ) +
  facet_wrap(~fct_rev(tipo)) +
  theme(panel.spacing.x = unit(.5, 'cm'))

```



Alice está tentando enviar uma mensagem codificada em binário para Bob.

- a. Ela envia um **bit**: 0 ou 1 com probabilidades iguais. Se ela envia 0, há probabilidade 5% de erro. Se ela envia 1, há probabilidade 10% de erro.

Dado que Bob recebeu 1, qual a probabilidade de Alice ter enviado 1?

- Eventos:

A = Alice envia 1

B = Bob recebe 1

E = Houve erro

- Queremos achar $P(A | B)$. Usando Bayes:

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

- Para calcular $P(B | A)$: a probabilidade de Bob receber 1 se Alice enviar 1 é a probabilidade de não haver erro quando Alice envia 1:

$$P(B | A) = \frac{90}{100}$$

- $P(A)$ é a probabilidade de Alice enviar 1:

$$P(A) = \frac{1}{2}$$

- Para calcular $P(B)$, usamos probabilidade total, condicionando sobre o erro:

$$P(B) = P(B | E) \cdot P(E) + P(B | \neg E) \cdot P(\neg E)$$

- $P(B | E)$ é a probabilidade de Bob receber 1 se houve erro; i.e., a probabilidade de Alice enviar 0 e haver erro:

$$P(B | E) = \frac{5}{100}$$

- Para calcular $P(E)$, vamos condicionar sobre A :

$$\begin{aligned}
 P(E) &= P(E \mid A) \cdot P(A) + P(E \mid \neg A) \cdot P(\neg A) \\
 &= \frac{10}{100} \cdot \frac{1}{2} + \frac{5}{100} \cdot \frac{1}{2} \\
 &= \frac{3}{40}
 \end{aligned}$$

- Daí, $P(B) = P(B \mid E) \cdot P(E) = \frac{3}{800}$.
- Continuar...

14

15

16

17

29

Referências

DEVLIN, K. [The Pascal-Fermat Correspondence: How Mathematics Is Really Done](#). **The Mathematics Teacher**, v. 103, n. 8, p. 579–582, abr. 2010.

OLIVEIRA MORGADO, A. C. DE et al. **Análise combinatória e probabilidade**. Rio de Janeiro: Impa / Vitae, 2004.

PAULOS, J. A. [Innumeracy: Mathematical Illiteracy and Its Consequences](#). 1. ed. New York: Hill; Wang, 1988.