

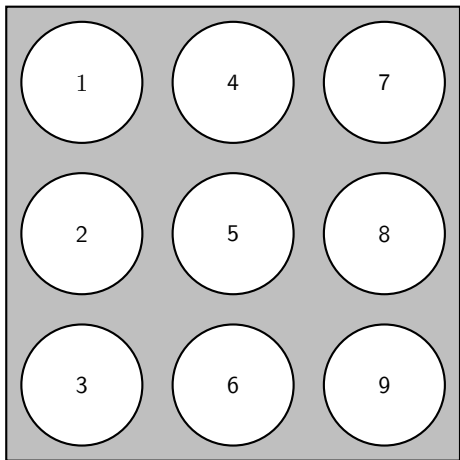
# Теория вероятностей и математическая статистика

Условная вероятность. Полная вероятность. Формула Байеса.

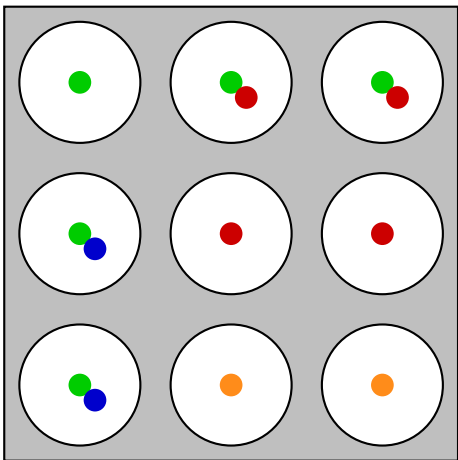
Глеб Карпов

ВШБ Бизнес-информатика

## Мыслительный эксперимент



## Мыслительный эксперимент



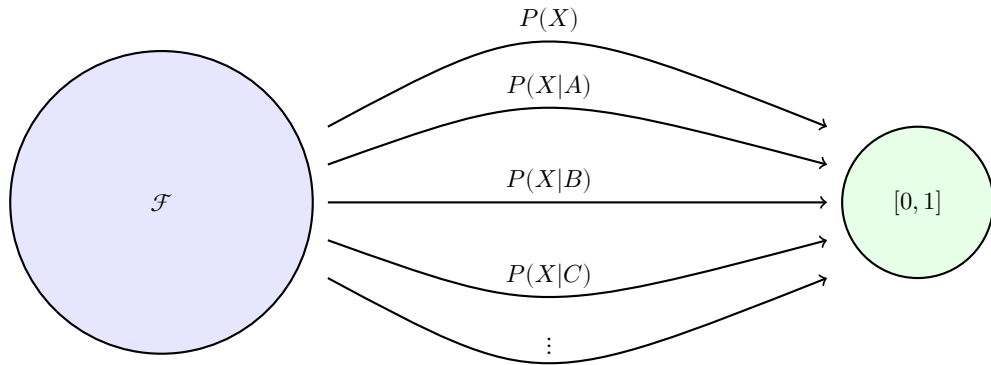
● Зеленая группа: 1,2,3,4,7

● Красная группа: 4,5,7,8

● Синяя группа: 2,3

● Оранжевая группа: 6,9

## Условная вероятность



## Условная вероятность

### Definition

Условная вероятность пересчитывается через обычную вероятность в виде:

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

## Условная вероятность

### Definition

Условная вероятность пересчитывается через обычную вероятность в виде:

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

### Формула Байеса

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

## Условная вероятность

При каждом зафиксированном значении параметра (условия)  $P(X|K)$  - отдельная самостоятельная вероятностная функция. Для каждой справедливы указанные ранее свойства:

- $\forall X, K \in \mathcal{F} : 0 \leq P(X|K) \leq 1$

## Условная вероятность

При каждом зафиксированном значении параметра (условия)  $P(X|K)$  - отдельная самостоятельная вероятностная функция. Для каждой справедливы указанные ранее свойства:

- $\forall X, K \in \mathcal{F} : 0 \leq P(X|K) \leq 1$
- $\forall K \in \mathcal{F} : P(\Omega|K) = 1$ . Easy to show:  $P(\Omega|K) = \frac{P(\Omega \cap K)}{P(K)} = (K \subseteq \Omega) = \frac{P(K)}{P(K)} = 1$



## Условная вероятность

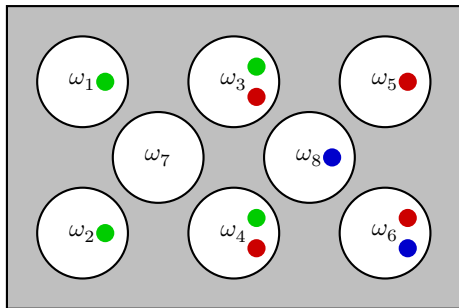
При каждом зафиксированном значении параметра (условия)  $P(X|K)$  - отдельная самостоятельная вероятностная функция. Для каждой справедливы указанные ранее свойства:

- $\forall X, K \in \mathcal{F} : 0 \leq P(X|K) \leq 1$
- $\forall K \in \mathcal{F} : P(\Omega|K) = 1$ . Easy to show:  $P(\Omega|K) = \frac{P(\Omega \cap K)}{P(K)} = (K \subseteq \Omega) = \frac{P(K)}{P(K)} = 1$
- Аддитивность вероятности:

$$\forall X, Y, K \in \mathcal{F} : X \cap Y = \emptyset, P((X \cup Y)|K) = P(X|K) + P(Y|K)$$

## Независимость событий

•  $G = \{1, 2, 3, 4\}$     •  $R = \{3, 4, 5, 6\}$     •  $B = \{6, 8\}$



•  $P(G) = 0.5, P(R) = 0.5, P(B) = 0.25$

**i** Question

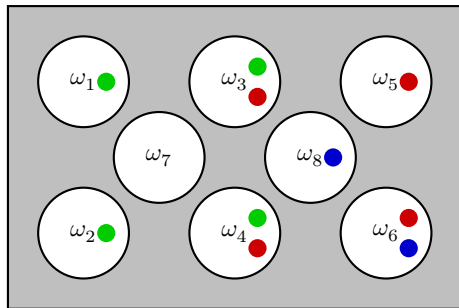
$P(G|R), P(R|G) = ?$

**i** Question

$P(R|B), P(B|R) = ?$

## Независимость событий

•  $G = \{1, 2, 3, 4\}$     •  $R = \{3, 4, 5, 6\}$     •  $B = \{6, 8\}$



•  $P(G) = 0.5, P(R) = 0.5, P(B) = 0.25$

**i** Question

$P(G|R), P(R|G) = ?$

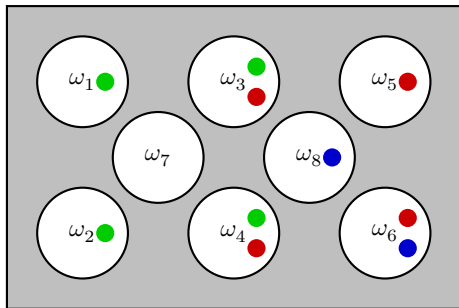
•  $P(G|R) = 0.5, P(R|G) = 0.5$

**i** Question

$P(R|B), P(B|R) = ?$

## Независимость событий

- $G = \{1, 2, 3, 4\}$
- $R = \{3, 4, 5, 6\}$
- $B = \{6, 8\}$



- $P(G) = 0.5, P(R) = 0.5, P(B) = 0.25$

**i** Question

$$P(G|R), P(R|G) = ?$$

- $P(G|R) = 0.5, P(R|G) = 0.5$

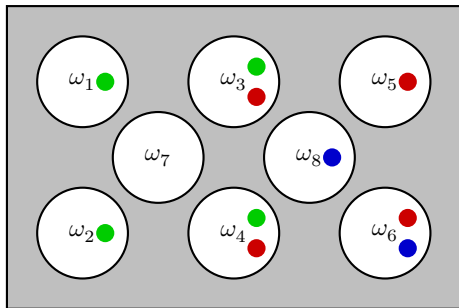
**i** Question

$$P(R|B), P(B|R) = ?$$

- $P(R|B) = 0.5, P(B|R) = 0.25$

## Независимость событий

- $G = \{1, 2, 3, 4\}$
- $R = \{3, 4, 5, 6\}$
- $B = \{6, 8\}$



- $P(G) = 0.5, P(R) = 0.5, P(B) = 0.25$

i Question

$$P(G|R), P(R|G) = ?$$

- $P(G|R) = 0.5, P(R|G) = 0.5$

i Question

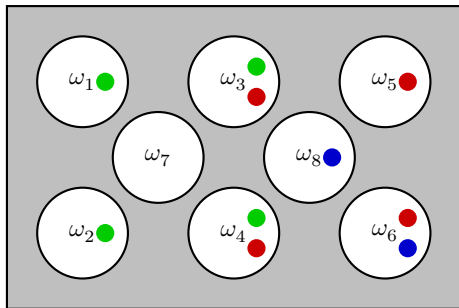
$$P(R|B), P(B|R) = ?$$

- $P(R|B) = 0.5, P(B|R) = 0.25$

- Наблюдаем:  $P(B) = P(B|R), P(R) = P(R|B)$ . Коэффициент ожидания этих событий а.к.а. вероятность не зависит от того, происходит ли одновременно другое событие или нет. Мы называем такие события **независимыми**.

## Независимость событий

- $G = \{1, 2, 3, 4\}$
- $R = \{3, 4, 5, 6\}$
- $B = \{6, 8\}$



- $P(G) = 0.5, P(R) = 0.5, P(B) = 0.25$

i Question

$$P(G|R), P(R|G) = ?$$

- $P(G|R) = 0.5, P(R|G) = 0.5$

i Question

$$P(R|B), P(B|R) = ?$$

- $P(R|B) = 0.5, P(B|R) = 0.25$

- Наблюдаем:  $P(B) = P(B|R), P(R) = P(R|B)$ . Коэффициент ожидания этих событий а.к.а. вероятность не зависит от того, происходит ли одновременно другое событие или нет. Мы называем такие события **независимыми**.
- Более формально, чтобы называть  $A$  и  $B$  независимыми, должно выполняться:

$$P(A|B) = P(A) \text{ и } P(B|A) = P(B), \text{ при } P(A), P(B) > 0.$$

## Независимость событий

- Если немного поработаем с идеей о независимости, получим более удобное определение:

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

### **i** Definition

События  $A$  и  $B$  из одного вероятностного пространства  $(\Omega, \mathcal{F}, P)$  называются независимыми, если:

$$P(A \cap B) = P(A) \cdot P(B),$$

и зависимыми в обратном случае.