# 不确定性知识的表示与推理

第十三章 不确定性的量化

## 提纲

- > 不确定性推理的例子
- ▶处理不确定性的方法
- > 基本概率符号
- ▶使用完全联合分布进行推理
- ▶贝叶斯规则及其应用

一个不确定性的例子: 自动驾驶出租车智能体

目标: 将乘客按时送到机场

规划:  $A_t =$  在飞机起飞t分钟前出发,并以合理的速度驶向机场。

问题: A, 规划能使乘客准时到达机场吗?

环境:

- 1. 部分可观测的 (路况, 其它驾驶员规划, etc.)
- 2. 不确定性(车辆爆胎,引擎失灵, etc.)

- 一个逻辑智能体可能给出的结论:
  - 1. 有风险的断言: "规划A<sub>90</sub> 将使我们及时到达机场"

2. 得出如下的弱一些的结论:

"规划 $A_{90}$  将使我们及时到达机场,只要车不抛锚,汽油不耗尽,不遇到任何交通事故,桥上也没有交通事故,飞机不会提前起飞,而且没有陨星砸到我的车,……"

一个不确定性推理的例子: 诊断牙病患者的牙痛

我们试着用命题逻辑写出牙病诊断的规则,考虑下面的简单规则:

 $Toothache \Rightarrow Cavity \times$ 

更新规则:

Toothache ⇒ Cavity ∨ GumProblem ∨ Abscess ......

不幸的是:为了使规则正确,我们不得不增加一个无限长的可能原因的列表

- 试图使用逻辑会失败,有以下三个原因:
  - 惰性: 无法列举出前提和结论的完整集合.
  - 无知: 缺乏相关事实、初始条件, etc.
    - 理论的无知: 对于该领域, 缺少完整的理论.
    - 实践的无知: 即使我们知道所有的规则, 对于一个特定的病人我们也无法确定。

### 提纲

- > 不确定性推理的例子
- > 处理不确定性的方法
- > 基本概率符号
- ▶使用完全联合分布进行推理
- ▶贝叶斯规则及其应用

不确定环境下,智能体的知识提供相关语句的信念度(degree of belief),
 处理信念度的主要工具是概率理论(probability theory)

- 概率提供了一种方法以概括由我们的惰性和无知产生的不确定性
  - 规划A<sub>25</sub>将使我们及时到达机场的概率(可能性)是0.04
  - 牙痛病人有牙洞的概率(可能性)是0.8

- 概率理论:
  - 没有关于世界的断言
  - 概率将命题与智能体自身的知识状态联系起来:
    - e.g.,  $P(A_{25} \mid \text{no reported accidents}) = 0.06$
  - 命题的概率随新证据而变化:
    - e.g.,  $P(A_{25} \mid \text{no reported accidents, 5 a.m.}) = 0.15$

• 再次考虑去机场的规划 A<sub>t</sub>

```
P(A_{25} \text{ gets me there on time } | ...) = 0.04

P(A_{90} \text{ gets me there on time } | ...) = 0.70

P(A_{120} \text{ gets me there on time } | ...) = 0.95

P(A_{1440} \text{ gets me there on time } | ...) = 0.9999
```

我们该如何做选择?

- 效用理论(Utility theory) 对偏好进行表示和推理,每个状态具有"效用"度 量值
  - 偏好:及时到达机场、避免在机场长时间等待、避免路上超速罚单等

• 概率论: 用于处理信念度的理论

• 效用理论: 对偏好进行表示和推理, 是有效性的度量

• 决策理论 = 概率理论 + 效用理论

- 基本思想: 一个智能体是理性的, 当且仅当它选择能产生最高期望效用

(Maximum Expected Utility, MEU)的行动

• 期望效用是行动的所有可能结果的平均

**function** DT-AGENT(percept) **returns** an action **persistent**: belief\_state, probabilistic beliefs about the current state of the world action, the agent's action

update belief\_state based on action and percept calculate outcome probabilities for actions, given action descriptions and current belief\_state select action with highest expected utility given probabilities of outcomes and utility information return action

**Figure 13.1** A decision-theoretic agent that selects rational actions.

## 提纲

- > 不确定性推理的例子
- > 处理不确定性的方法
- > 基本概率知识
- ▶使用完全联合分布进行推理
- ▶贝叶斯规则及其应用

- 概率理论
  - 随机变量、事件
  - 概率公理
  - 无条件概率 (先验概率)、条件概率 (后验概率)
  - 完全联合概率分布
  - 乘法法则、链式法则

- 随机变量 表示可能世界中的不确定性
  - R (Is it raining?)
- 与命题逻辑相似:
  - 可能世界是由对随机变量的赋值进行定义的, 随机变量以大写字母开头
- 布尔随机变量
  - e.g., Cavity (do I have a cavity?) 定义域: < true, false>
- 离散随机变量
  - e.g., Weather is one of < sunny, rainy, cloudy, snow>

变量的值总是用小写

- 基本要素: 随机变量
- 基本命题通过单个随机变量的赋值进行构造:
  - e.g., Cavity = false (abbreviated as  $\neg cavity$ )
  - Weather = sunny (abbreviated as sunny)
- 复合命题由基本命题的逻辑连接构造
  - e.g., Weather = sunny ∨ Cavity = false

## 基本概率符号

考虑随机变量 Weather, 其定义域为 < sunny, rainy, cloudy, snow>,每个可能取值的概率,可以写成:

P(Weather = sunny) = 0.6

P(Weather = rain) = 0.1

P(Weather = cloudy) = 0.29

P(Weather = snow) = 0.01

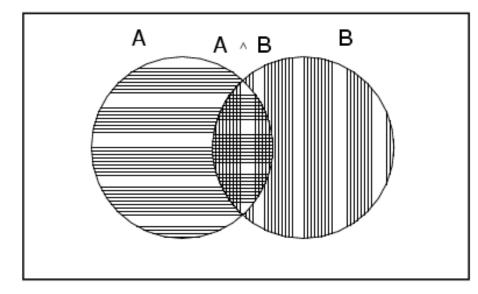
也可以简写为:

**P**(*Weather*) = <0.6, 0.1, 0.29, 0.01> (normalized, i.e., sums to 1)

P定义了随机变量 Weather的一个概率分布

- 对给定的两个随机变量A, B
  - $-0 \le P(a) \le 1$
  - -P(true) = 1 and P(false) = 0
  - $-P(\neg a) = 1-P(a)$
  - $P(A \vee B) = P(A) + P(B) P(A \wedge B)$

True



• 先验概率 或 无条件概率 e.g., P(*Cavity* = true) = 0.1 P(*Weather* = sunny) = 0.72

• 联合概率分布:多个变量取值的所有组合的概率 **P**(Weather,Cavity)是一个4\*2的概率表:

Weather =	sunny	rainy	cloudy	snow
Cavity = true	0.144	0.02	0.016	0.02
Cavity = false	0.576	0.08	0.064	0.08

- e.g., P(sunny,Cavity)
- 完全联合概率分布:
  - e.g., P(Toothache, Weather, Cavity)
  - 一个完全联合分布基本满足计算任何命题的概率的需求

- 条件概率 或 后验概率
  - e.g., P(cavity | toothache) = 0.8
- 额外条件很重要
  - 如果获得进一步信息,cavity为真,条件概率将更新为:

P(cavity | toothache,cavity) = 1

- 无关的证据,可以简化
  - e.g.,P(cavity | toothache, sunny) = P(cavity | toothache) = 0.8
- 条件概率是由无条件概率定义的:

$$P(a|b) = \frac{P(a,b)}{P(b)}$$

要求: *P(b*)>0

#### • 乘法法则:

$$P(a \land b) = P(a \mid b) P(b) = P(b \mid a) P(a)$$

- e.g., P(Weather, Cavity) = P(Weather | Cavity) P(Cavity)
- · 考虑有n个变量的联合分布:

$$\mathbf{P}(X_{1},...,X_{n}) = \mathbf{P}(X_{1},...,X_{n-1}) \mathbf{P}(X_{n} \mid X_{1},...,X_{n-1})$$
 (乘法法则)  
=  $\mathbf{P}(X_{1},...,X_{n-2}) \mathbf{P}(X_{n-1} \mid X_{1},...,X_{n-2}) \mathbf{P}(X_{n} \mid X_{1},...,X_{n-1})$  (乘法法则)  
= ...  
=  $\prod_{i=1 \sim n} \mathbf{P}(X_{i} \mid X_{1},...,X_{i-1})$  (乘法法则)

• 链式法则:  $P(X_1, ..., X_n) = \prod_{i=1}^n P(X_i \mid X_1, ..., X_{i-1})$  $P(X_1, X_2, ..., X_n) = P(X_1)P(X_2|X_1)P(X_3|X_1, X_2)...$ 

### 提纲

- > 不确定性推理的例子
- > 处理不确定性的方法
- > 基本概率知识
- ▶使用完全联合分布进行推理
- ▶贝叶斯规则及其应用

- 使用完全联合概率分布作为"知识库",从中可以导出所有问题的答案。
- 概率推理: 根据已观察到的证据, 计算查询命题的后验概率。
- 例如, 计算条件概率
  - $-P(A_{100} \text{ on time } | \text{ no reported accidents}) = 0.90$
  - 表示给定证据下的信念度
- 随着新的证据的出现,概率会发生变化
  - $-P(A_{100} \text{ on time} \mid \text{no accidents}, 5 \text{ a.m.}) = 0.95$
  - $-P(A_{100} \text{ on time } | \text{ no accidents, 5 a.m., raining}) = 0.80$
  - 观察新的证据,更新信念度

- 一个简单的例子: 诊断牙病患者的牙痛
  - 问题域:由三个布尔变量 Toothache, Cavity和 Catch组成
  - Catch表示由于牙医的钢探针不洁而导致的牙龈感染

- 给定完全联合分布,一个2\*2\*2的表格

	toothache		$\neg toothache$	
	catch	$\neg catch$	catch	$\neg catch$
cavity	0.108	0.012	0.072	0.008
$\neg cavity$	0.016	0.064	0.144	0.576

Figure 13.3 A full joint distribution for the *Toothache*, *Cavity*, *Catch* world.

• 给定完全联合分布:

	toothache		$\neg toothache$	
	catch	$\neg catch$	catch	$\neg catch$
cavity	0.108	0.012	0.072	0.008
$\neg cavity$	0.016	0.064	0.144	0.576
Figure 13.3	Figure 13.3 A full joint distribution for the <i>Toothache</i> , <i>Cavity</i> , <i>Catch</i> world.			

- 对于任意命题 $\phi$ , 其概率是使得该命题成立的可能世界的概率之和:  $P(\phi) = \Sigma_{\omega:\omega \models \phi} P(\omega)$
- 一种计算任何命题概率的方法:
  - 识别命题为真的可能世界,然后把它们的概率加起来
  - 例如: P(cavity ∨ toothache) = 0.108 + 0.012 + 0.072 + 0.008 + 0.016 + 0.064 = 0.28

• 给定完全联合分布:

	toothache		$\neg toothache$	
	catch	$\neg catch$	catch	$\neg catch$
cavity	0.108	0.012	0.072	0.008
$\neg cavity$	0.016	0.064	0.144	0.576
Figure 13.3	A full joint distribution for the Toothache, Cavity, Catch world.			

- 一个特别常见的任务: 提取某个变量的概率分布 (无条件概率/边缘概率)
- 边缘化规则,或者称为求和消元:
  - P(toothache) = 0.108 + 0.012 + 0.016 + 0.064 = 0.2

• 给定完全联合分布:

	toothache		$\neg toothache$	
	catch	$\neg catch$	catch	$\neg catch$
cavity	0.108	0.012	0.072	0.008
$\neg cavity$	0.016	0.064	0.144	0.576
Figure 13.3	A full joint distribution for the Toothache, Cavity, Catch world.			

```
P(\neg cavity \mid toothache) = P(\neg cavity \land toothache)
P(toothache)
= 0.016+0.064
0.108 + 0.012 + 0.016 + 0.064
= 0.4
```

这两个计算出来的值相加等于1。

分母是不变的,是常数。

$$P(cavity \mid toothache) = P(cavity \land toothache)$$

$$= 0.108 + 0.012$$

$$= 0.108 + 0.012 + 0.016 + 0.064$$

$$= 0.6$$

- 例如: **P**(Cavity | toothache)
  - $= \alpha P(Cavity, toothache)$
  - =  $\alpha$  [P(Cavity, toothache, catch) + P(Cavity, toothache,  $\neg$  catch)]
  - $= \alpha [<0.108,0.016> + <0.012,0.064>]$
  - $= \alpha < 0.12, 0.08 >$
  - = <0.6,0.4>

#### 归一化方法

基本思想: 计算查询变量的概率分布,可以固定证据变量 (evidence variables),然后在隐变量 (hidden variables)上求和并归一化

#### 归一化方法:

假设查询变量为X,证据变量集合为E,e表示其观察值;假设其余的未观测变量为Y。

计算查询变量:

$$P(X | e) = \alpha P(X, e) = \alpha \Sigma_y P(X, e, y)$$

- 问题: 规模扩展性不好
  - 对于一个由n个布尔变量所描述的问题域,最坏情况下的时间复杂性 $O(2^n)$ ,空间复杂性  $O(2^n)$

### 提纲

- > 不确定性推理的例子
- > 处理不确定性的方法
- > 基本概率知识
- ▶使用完全联合分布进行推理
- ▶贝叶斯规则及其应用

- 先验概率: 根据历史资料或主观判断所确定的各种事件发生的概率。
- 先验概率可分为两类:
  - 客观先验概率: 是指利用过去的历史资料计算得到的概率(如: 在自然语言处理中, 从语料库中统计词语的出现频率——客观 先验概率);
  - 主观先验概率: 是指在无历史资料或历史资料不全的时候, 只能凭借人们的主观经验来判断取得的概率。

- 后验概率:是指利用贝叶斯公式,结合调查等方式获取了新的附加信息,对先验概率修正后得到的更符合实际的概率。
- 条件概率: 是指当条件事件发生后, 该事件发生的概率。

$$P(A \mid B) = P(B \mid A)P(A)/P(B)$$

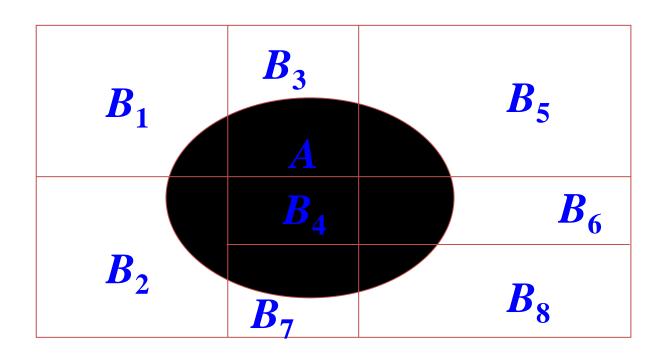
条件概率的计算可以通过两个事件各自发生的概率,以及相反方向的条件概率得到。

- 全概率公式
- 设 $B_1, B_2, ..., B_n$ 是两两互斥的事件,且 $P(B_i) > 0$ ,i = 1, 2, ..., n,  $B_1 + B_2 + ..., + B_n = \Omega$  。
- 另有一事件 $A = AB_1 + AB_2 + ... + AB_n$

$$P(A) = \sum_{i=1}^{n} P(B_i)P(A \mid B_i)$$

- 全概率公式可看成是"由原因推结果",即:每个原因对结果的发生有一定"作用",结果发生的可能性与各种原因的"作用"大小有关。
- ■全概率公式表达了它们之间的 关系。

### $B_i$ 是原因 A是结果



- 贝叶斯公式(后验概率公式)
- 设先验概率为 $P(B_i)$ ,调查所获的新附加信息为 $P(A|B_i)$  (i=1,2,...,n),则 贝叶斯公式计算的后验概率为:

$$P(B_i \mid A) = P(B_i)P(A \mid B_i) / \sum_{i=1}^n P(B_i)P(A \mid B_i)$$

- 该公式于1763年由贝叶斯(Bayes)导出。
- 该公式是在观察到事件A已发生的条件下,寻找导致A发生的每个原因的概率。
- 是大多数进行概率推理的人工智能系统的基础
- 贝叶斯规则在实践中很有用:
  - 很多情况下,前三项有很好的估计,而需要计算第4项

- 例:已知任意时刻阴天的概率为0.3,记为P(A)=0.3,下雨的概率为0.2,记为P(B)=0.2。阴天之后下雨的概率为0.6,记为条件概率P(B|A)=0.6。那么在下雨的条件下,是阴天的概率是多少?
- 【解】根据条件概率公式,可得:

$$P(A|B) = P(B|A)*P(A)/P(B)$$
  
= 0.6\*0.3/0.2  
= 0.9

- 例:某电子设备厂所用的元件由三家元件厂提供,根据以往记录,这三个厂家的次品率分别为0.02,0.01和0.03,提供元件的份额分别为0.15,0.8和0.05,设这三家的产品在仓库是均匀混合的,且无区别的标志。
  - 问题1:在仓库中,随机抽取一个元件,求它是次品的概率;
  - 一问题2:在仓库中,随机抽取一个元件,若已知它是次品,则该次品来自 三家供货商的概率分别是多少?

• 【解】设A表示"取到的元件是次品",B<sub>i</sub>表示"取到的元件是由第i个 厂家生产的",则

$$P(B_1)=0.15$$
,  $P(B_2)=0.8$ ,  $P(B_3)=0.05$ 

• 对于问题1, 由全概率公式可得:

$$P(A) = P(B_1)*P(A|B_1) + P(B_2)*P(A|B_2)$$

$$+ P(B_3)*P(A|B_3)$$

$$= 0.15*0.02+0.8*0.01+0.05*0.03$$

$$= 0.0125$$

• 【解】设A表示"取到的元件是次品",B<sub>i</sub>表示"取到的元件是由第i个厂家生产的",则

$$P(B_1)=0.15$$
,  $P(B_2)=0.8$ ,  $P(B_3)=0.05$ 

• 对于问题2,由贝叶斯公式可得:

$$P(B_1|A) = P(B_1)*P(A|B_1)/P(A)$$

$$= 0.15*0.02/0.0125 = 0.24$$

$$P(B_2|A) = P(B_2)*P(A|B_2)/P(A)$$

$$= 0.8*0.01/0.0125 = 0.64$$

$$P(B_3|A) = P(B_3)*P(A|B_3)/P(A)$$
  
= 0.05\*0.03/0.0125 = 0.12

- 简单示例: 医疗诊断
- 结果effect看作是证据,确定造成这一结果的未知因素cause ,贝叶斯规则:

$$P(\text{cause}|\text{effect}) = \frac{P(\text{effect}|\text{cause})P(\text{cause})}{P(\text{effect})}$$

- 条件概率 P(effect cause) 量化了因果方向上的关系
- 条件概率 P(cause effect) 描述诊断方向上的关系
- 实际中, 经常有因果关系的条件概率, 而想得出诊断关系。

- 简单实例: 医疗诊断
  - 医生知道脑膜炎有70%的可能会引起病人脖子僵硬。医生还了解一些无条件的事实:病人患脑膜炎的先验概率为1/50,000,而任何一个病人脖子僵硬的概率为 1%。问:脖子僵硬的病人患脑膜炎的概率?
  - 令m表示"病人患有脑膜炎"的命题, s表示"病人脖子僵硬"的命题
  - 则有: P(m) = 1/50000 P(s|m) = 0.7 P(s) = 0.01
  - $-P(m|s) = \frac{P(s|m) * P(m)}{P(s)} = (0.7* 1/50000) /0.01 = 0.0014$

- 简单实例: 医疗诊断
  - 医生知道脑膜炎有70%的可能会引起病人脖子僵硬。医生还了解一些无条件的事实:病人脖子僵硬的先验概率为1/50,000,而任何一个病人脖子僵硬的概率为 1%。
  - 问题: 计算**P**(*M*|*s*)?
  - 归一化的方法:

$$\mathbf{P}(M|s) = \langle P(m|s), P(\neg m|s) \rangle$$
$$= \alpha \langle P(s|m)P(m), P(s|\neg m)P(\neg m) \rangle$$

- 简单示例 2: 明天要举行户外运动会。近年来,每年仅下雨 5 天 (5/365=0.014)。不幸的是,天气预报员预测明天会下雨。当真的下雨时,天 气预报员准确地预测了90%的降雨。当不下雨时,他错误地预测了10%的降雨。明天下雨和不下雨的可能性分别有多大?
- 令rain表示明天下雨的概率, predict表示预测明天下雨的概率
- 则有:
  - P(rain) = 0.014 ;  $P(\neg rain) = 0.986$  ; P(predict|rain) = 0.9 ;  $P(predict|\neg rain) = 0.1$
- 问题: 计算**P**(Rain predict)?

简单示例2:明天要举行户外运动会。近年来,每年仅下雨5天(5/365=0.014)。不幸的是,天气预报员预测明天会下雨。当真的下雨时,天气预报员准确地预测了90%的降雨。当不下雨时,他错误地预测了10%的降雨。明天下雨和不下雨的可能性分别有多大?

```
\begin{aligned} \mathbf{P}(\textit{Rain}|\textit{predict}) &= <\textit{P}(\textit{rain}|\textit{predict}), \textit{P}(\neg \textit{rain}|\textit{predict}) > \\ &= \alpha <\textit{P}(\textit{predict}|\textit{rain}) *\textit{P}(\textit{rain}), \textit{P}(\textit{predict}|\neg \textit{rain}) *\textit{P}(\neg \textit{rain}) > \\ &= \alpha < 0.9 * 0.014, 0.1 * 0.986 > \\ &= < 0.111, \ 0.889 > \end{aligned}
```

α 为归一化常数, 保证概率和为1

例 设 H<sub>1</sub>, H<sub>2</sub>, H<sub>3</sub> 分别是三个结论, E 是支持这些结论的证据, 且已知:

解 根据上面的公式可得

$$P(H_1/E) = \frac{P(H_1) \times P(E/H_1)}{P(H_1) \times P(E/H_1) + P(H_2) \times P(E/H_2) + P(H_3) \times P(E/H_3)}$$
$$= \frac{0.12}{0.12 + 0.2 + 0.1} = 0.28$$

同理,可得

$$P(H_2/E) = 0.476$$

 $P(H_3/E) = 0.238$ 

由此例可以看出,由于证据 E 的出现,H<sub>3</sub> 成立的可能性略有增加,H<sub>1</sub>,H<sub>2</sub> 成立的可能性有不同程度的下降。

例 设已知:

$$P(H_1) = 0.4$$
,  $P(H_2) = 0.3$ ,  $P(H_3) = 0.3$   
 $P(E_1/H_1) = 0.5$ ,  $P(E_1/H_2) = 0.6$ ,  $P(E_1/H_3) = 0.3$   
 $P(E_2/H_1) = 0.7$ ,  $P(E_2/H_2) = 0.9$ ,  $P(E_2/H_3) = 0.1$   
求: $P(H_1/E_1E_2)$ ,  $P(H_2/E_1E_2)$ 和  $P(H_3/E_1E_2)$ 的值各是多少。  
解 根据上述公式,可得  
 $P(H_1/E_1E_2) =$   
 $P(E_1/H_1) \times P(E_2/H_1) \times P(H_1) / [P(E_1/H_1) \times P(E_2/H_1) \times P(H_1)$   
 $+ P(E_1/H_2) \times P(E_2/H_2) \times P(H_2) + P(E_1/H_3) \times P(E_2/H_3) \times P(H_3)]$   
 $= \frac{0.14}{0.14 + 0.162 + 0.009}$   
 $= 0.45$ 

同理,可得

 $P(H_2/E_1E_2) = 0.52$ 

 $P(H_3/E_1E_2) = 0.03$ 

由此例可以看出,由于证据  $E_1$  和  $E_2$  的出现, $H_1$  和  $H_2$  成立的可能性有不同程度的增加, $H_3$  成立的可能性下降了。

#### 思考题

1% of women at age forty who participate in routine screening have breast cancer. 80% of women with breast cancer will get positive mammographies. 9.6% of women without breast cancer will also get positive mammographies. A woman in this age group had a positive mammography in a routine screening. What is the probability that she actually has breast cancer?

#### 小结

- 由于环境可能是部分可观察的或不确定的,智能体需要处理不确定性。
- 概率是描述不确定知识的一种严格形式。通过条件概率,将命题与智能体自身的知识联系起来
- 给定一个完全联合分布可以计算该问题域中任何命题的概率,但对复杂领域,需要找到一种方法来降低联合概率的数目

# 谢谢!