

考研概率论

枫聆

2021 年 6 月 1 日

目录

1	随机事件和概率	2
1.1	基本定义	2
1.2	基本性质和运算法则	4
1.3	更深的思考和技巧	6

随机事件和概率

基本定义

Definition 1.1. 对随机现象进行观察或者实验被称为**随机试验**当且仅当满足以下条件

1. 可以在相同的条件下**重复实验**;
2. 所得的可能结果不止一个, 且所有可能结果都能**事前已知**;
3. 每次具体实验之前**无法预知**出现的结果.

Definition 1.2. **随机试验**的每一可能的结果为被称为**样本点**, 所有**样本点**构成的集合被称为**样本空间**.

Definition 1.3. **样本空间**的任一子集被称为**随机事件**. 其中每个单点集被称为**基本事件**. 事件 Ω 被称为**必然事件**当且仅当每次试验必有 Ω 中某一样本点发生. 特别地, 把空集 \emptyset 称为**不可能事件**.

Definition 1.4. 若事件 A 的发生**必然导致**事件 B 发生, 则称事件 B 包含事件 A , 记为 $B \supset A$. 若 $A \supset B$ 和 $A \subset B$ 同时成立, 则称事件 A 和事件 B 相等, 记为 $A = B$.

Definition 1.5. 给定事件 A 和 B , 它们的交记为 $A \cap B$ 或者 AB , 表示其所有的公共样本点构成的事件. 这样事件的发生, 将导致**事件 A 和 B 同时发生**. 它们的并记为 $A \cup B$, 表示它们所有样本点放在一起构成的事件, 这样的事件发生将导致**至少事件 A 和 B 其中一个发生**.

Definition 1.6. 给定事件 A 和 B , 若它们的交 $AB = \emptyset$, 则称事件 A 和 B **互斥**或者**互不相容**. 若它们的并 $A \cup B = \Omega$, 且 $AB = \emptyset$, 则称事件 A 和 B 为**对立事件**或者**互逆事件**, 记为 $\bar{A} = B$ 或者 $\bar{B} = A$.

Definition 1.7. 给定事件 A 和 B , 它们的差记为 $A - B$, 表示事件 A 有而 B 没有的样本点, 通俗地来讲表示事件 A 发生而 B 不发生的样本点组成的新事件.

Definition 1.8. 设试验 E 的样本空间为 Ω , real-valued 函数 $P: \mathcal{A} \rightarrow \mathbb{R}$ 被为一个概率函数, 其中 \mathcal{A} 被称为**输入空间**或者**事件空间**, 即样本空间的**幂集**. 当其满足如下条件 (Kolmogorov axioms) 时

1. 对于任意的 $A \in \mathcal{A}$, 有 $P(A) \geq 0$;
2. $P(\Omega) = 1$;
3. 对于一个两两不相交的事件可数序列 A_1, A_2, \dots , 有 $P(\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i) = \bigcup_{i=1}^{\infty} P(A_i)$ 成立.

则成 P 是试验 E 的一个**概率分布**. 这个 real-value P 其实看做一个代数形式, 其需要满足 3 个公理.

Definition 1.9. 给定事件 A 和 B , 且 $P(A) > 0$, 称

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

为在事件 A 发生的条件下事件 B 发生的条件概率.

Definition 1.10. 若事件 A, B 满足等式

$$P(AB) = P(A)P(B),$$

则称 A 与 B 相互独立. 从条件概率看两个事件的独立性, 也就是其中一个发生的概率是不会影响另一个发生的概率. 推广至 n 个事件 A_1, \dots, A_n 相互独立, 需要 $\binom{n}{2} + \binom{n}{3} + \dots + \binom{n}{n} = 2^n - n - 1$ 等式成立, 即设任意的 $1 < k \leq n$, 对任意 $1 \leq i_1 \leq \dots \leq i_k \leq n$ 满足等式

$$P(A_{i_1} \dots A_{i_k}) = P(A_{i_1}) \dots P(A_{i_k}).$$

基本性质和运算法则

Proposition 1.11. 事件相关的运算法则

1. 交换律 $A \cup B = B \cup A$; $A \cap B = B \cap A$.
2. 结合律 $(A \cup B) \cup C = A \cup (B \cup C)$; $(A \cap B) \cap C = A \cap (B \cap C)$.
3. 分配律 $A \cap (B \cup C) = (A \cap B) \cup (A \cap C)$; $A \cup (B \cap C) = (A \cup B) \cap (A \cup C)$.
4. 对偶律 $\overline{A \cup B} = \bar{A} \cap \bar{B}$; $\overline{A \cap B} = \bar{A} \cup \bar{B}$; $\overline{\bigcup_{i=1}^n A_i} = \bigcap_{i=1}^n \bar{A}_i$; $\overline{\bigcap_{i=1}^n A_i} = \bigcup_{i=1}^n \bar{A}_i$

Proposition 1.12. 概率分布相关性质

1. $P(\emptyset) = 0$;
2. $P(\bar{A}) = 1 - P(A)$;
3. $A \subset B$, 则 $P(A) \leq P(B)$;
4. $0 \leq P(A) \leq 1$;

证明. (2) 因为 $P(\Omega) = P(A \bar{A}) = P(A) + P(\bar{A})$.

(1) 可以马上通过 (2) 直接得到.

(3) P 满足单调性, 可以根据 Kolmogorov axioms(3) 很自然地可以得到.

(4) $P(\emptyset) \leq P(A) \leq P(\Omega)$.

□

Proposition 1.13. 五大概率公式

1. 加法公式

$$P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(AB);$$
$$P(A \cup B \cup C) = P(A) + P(B) + P(C) - P(AB) - P(AC) - P(BC) + P(ABC).$$

2. 减法公式

$$P(A - B) = P(A) - P(AB).$$

3. 乘法公式 当 $P(A) > 0$ 时,

$$P(AB) = P(A)P(B|A);$$

当 $P(A_1 A_2 \cdots A_{n-1}) > 0$ 时,

$$P(A_1 A_2 \cdots A_n) = P(A_1)P(A_2|A_1) \cdots P(A_n|A_1 A_2 \cdots A_{n-1}).$$

4. **全概率公式** 设 B_1, B_2, \dots, B_n 满足 $\bigcup_{i=1}^n B_i = \Omega$, $B_i B_j = \emptyset$ 且 $P(B_k) > 0$, $k = 1, 2, \dots, n$, 则对任意事件有

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

其中称满足 $\bigcup_{i=1}^n B_i = \Omega$, $B_i B_j = \emptyset$ 的 B_1, B_2, \dots, B_n 为一个**完备事件组**. 通常把 $P(B_1), P(B_2), \dots, P(B_n)$ 叫做**先验概率**. 全概率公式的意义在于可以将复杂的事件 A 划分为简单互斥事件 AB_1, AB_2, \dots, AB_n , 再结乘法公式计算出 A 的概率.

5. **贝叶斯公式** 设 B_1, B_2, \dots, B_n 满足 $\bigcup_{i=1}^n B_i = \Omega$, $B_i B_j = \emptyset$ 且 $P(A) > 0, P(B_k) > 0$, $k = 1, 2, \dots, n$, 则

$$P(B_j|A) = \frac{P(B_j)P(A|B_j)}{\sum_{i=1}^n P(B_i)P(A|B_i)}, j = 1, 2, \dots, n.$$

贝叶斯公式的意义在于在事件 A 已经发生的条件下, 贝叶斯公式可以用来寻找导致 A 发生各种“原因” B_i 的概率. 其中 $P(B_j|A)$ 被称为**后验概率**.

证明. (2) $P(A) = P(AB \cup A\bar{B}) = P(AB) + P(A - B)$.

(1) $P(A \cup B) = P((A - AB) \cup (B - AB) \cup AB)$, 再根据 (2) 有

$$\begin{aligned} P((A - AB) \cup (B - AB) \cup AB) &= P(A) - P(AB) + P(B) - P(AB) + P(AB) \\ &= P(A) + P(B) - P(AB). \end{aligned}$$

实际上这里还是要分类讨论一下当 $A = B$ 的时候.

(3) 条件概率的另一种写法.

(4) $P(A) = P(\bigcup_{i=1}^n AB_i) = \sum_{i=1}^n P(AB_i)$, 再用 (3) 替换一下即可.

(5) $P(B_j|A) = \frac{P(B_j A)}{P(A)}$, 用 (3) 和 (4) 分别替换分子和分母即可.

□

更深的思考和技巧

Annotation 1.14. 零概率事件 $P(A) = 0$ 与不可能事件 $A = \emptyset$ 不是一个概念.

Annotation 1.15. 如何理解事件之间独立性 事件 A 和 B 独立, 则下面等式成立

$$P(AB) = P(A)P(B).$$

你可能总想深究其更本质的含义, 可能你会联想到当事件 A 和 B 独立时, 那么 A 和 B 之间有什么关系呢? 实际上并不能确定 A 和 B 有什么特别地确切的关系, 所以你把上述等价理解为在描述一个代数结构就好了, 从这个代数结构可以引发一些有趣的性质 i.e. 例如化简某些运算条件概率, 所以就特别地把这个代数结构提出来了. 但是当 $P(A) > 0, P(B) > 0$ 时, 有这样一种关系: 互斥不独立, 独立不互斥, 证明也是很显然的.

Annotation 1.16. 当 $P(A) = 0$ 时, 如何计算 $P(AB)$? 条件概率的定义中特别指明了 $P(A) > 0$, 那么 $P(A)$ 等于 0 时候, 条件概率 $P(B|A)$ 是未定义的. 那么此时如果我们要计算 $P(AB)$ 应该怎么办呢? 肯定不能使用乘法公式了. 我们可以利用 P 的单调性, 因为 $AB \subseteq A$, 所以 $P(AB) \leq P(A)$, 所以 $P(AB) = 0$.

Annotation 1.17. 取部分对立事件不影响独立性 若 $P(AB) = P(A)P(B)$, 有下面等式成立

$$P(\bar{A}\bar{B}) = P(\bar{A})P(\bar{B})$$

$$P(\bar{A}B) = P(\bar{A})P(B)$$

$$P(A\bar{B}) = P(A)P(\bar{B})$$

我们来证明第一个等式

$$\begin{aligned} P(AB) &= P(A)P(B) \\ &= (1 - P(\bar{A}))(1 - P(\bar{B})) \\ &= 1 - P(\bar{A}) - P(\bar{B}) + P(\bar{A})P(\bar{B}) \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} P(\bar{A}) + P(\bar{B}) - P(\bar{A} \cup \bar{B}) &= P(\bar{A})P(\bar{B}) \\ P(\bar{A}\bar{B}) &= P(\bar{A})P(\bar{B}) \end{aligned}$$

其余的等式应用类似的手法来证明. 由此在 A 和 B 相互独立的情况下, 延伸出来一些有用的等式

$$\begin{aligned} P(A \cup B) &= 1 - P(\bar{A}\bar{B}) = 1 - P(\bar{A})P(\bar{B}) \\ P(A - B) &= P(A\bar{B}) = P(A)P(\bar{B}) \end{aligned}$$

这些等式也可以推广为 n 个事件相互独立.