

Высшая школа экономики

Факультет прикладной политологии

Математика для политологов

И.А.Хованская, Н.А. Сопрунова, И.В.Щуров, А.В.Михайлович, К.И.Сонин
(РЭШ), Я.Н. Шитов

2 октября 2012 г.

Лекция 5. Элементы теории вероятностей, часть 3

Формула полной вероятности

Рассмотрим следующую ситуацию. Допустим, в некотором вузе есть три факультета: математический, физический и химический. Факультеты отличаются по числу студентов — например, на математическом факультете учится $1/10$ студентов всего вуза, на физическом — $3/10$, а на химическом — оставшиеся $6/10$ (то есть $3/5$) всех студентов вуза (см. табл. 1).¹ Мы также знаем, какова доля отличников на каждом факультете. Например, на математическом факультете каждый четвертый является отличником, на физическом — каждый второй студент отличник, а на химическом $3/4$ студентов являются отличниками. Спрашивается, какова доля отличников в целом по вузу?

факультет	матфак	физфак	химфак
какая часть студентов учится на факультете	$1/10$	$3/10$	$6/10$
доля отличников на факультете	$1/4$	$1/2$	$3/4$

Таблица 1: Распределение студентов по факультетам

Допустим для простоты, что всего в вузе учится 1000 студентов. Тогда на математическом факультете будет $1000 \times \frac{1}{10} = 100$ студентов. Среди них четвертая часть (то есть $1000 \times \frac{1}{10} \times \frac{1}{4} = 100 \times \frac{1}{4} = 25$ человек) являются отличниками, и это составляет $25/1000 = 0.025$ от студентов всего вуза. Нетрудно видеть, что это число не зависит от того, сколько студентов всего учится в вузе — если их N человек, то среди них $N \times \frac{1}{10}$ учится на математическом факультете, отличников с математического факультета $N \times \frac{1}{10} \times \frac{1}{4}$ человек, и их доля среди всех N студентов вуза равна $N \times \frac{1}{10} \times \frac{1}{4} \times \frac{1}{N} = \frac{1}{10} \times \frac{1}{4} = 0.025$. (Вспомните задачи про фонды и компании, которые владели какими-то частями друг другаЖ)

Иными словами, можно записать:

$$\begin{aligned} \text{Доля отличников с мат. факультета среди студентов всего вуза} &= \\ &= \text{доля студентов этого факультета среди студентов всего вуза} \times \\ &\quad \times \text{доля отличников на математическом факультете} \quad (1) \end{aligned}$$

На физическом факультете учится $1000 \times \frac{3}{10} = 300$ студентов. Отличников среди них половина, то есть $300 \times \frac{1}{2} = 150$ человек. Это составляет $150/1000 = 0.15$ от всех студентов вуза. Наконец, на третьем — химическом — факультете учится $1000 \times \frac{6}{10} = 600$ студентов. Из них три четверти отличники, то есть $600 \times \frac{3}{4} = 450$ студентов, что составляет $450/1000 = 0.45$ от всех студентов вуза.

Поскольку каждый отличник учится ровно на одном факультете, чтобы найти число всех отличников, достаточно сложить полученные числа: всего отличников $25 + 150 + 450 = 625$ человек. Доля отличников по всему вузу составляет $625/1000 = 0.625$. Заметим, что к тому же результату мы бы пришли, если бы складывали доли отличников от всего вуза по каждому факультету: $0.025 + 0.15 + 0.45 = 0.625$. Ответ не изменился бы, если бы в вузе училось не 1000 студентов, а любое другое число (проверьте!).

Переведем теперь рассмотренную задачу на язык теории вероятностей. Допустим, мы выбираем случайного студента вуза. Пространство элементарных исходов здесь совпадает со множеством всех студентов

¹Конечно, мы считаем, что каждый студент учится только на одном факультете, и каждый учится на каком-нибудь факультете из этих трех.

(по-прежнему будем считать, что их 1000 человек). Можно рассмотреть различные события — например, событие H_1 — ”студент учится на математическом факультете”, событие H_2 — ”студент учится на физическом факультете”, событие H_3 — ”студент учится на химическом факультете”, а также событие A — ”студент является отличником”. Каковы вероятности таких событий?

Событию H_1 (”студент учится на математическом факультете”) благоприятствует столько исходов, сколько студентов учится на матфаке. Вероятность события H_1 в таком случае равна отношению числа студентов математического факультета к числу студентов всего вуза, то есть будет в точности совпадать с долей студентов мат. факультета во всём вузе — по условию, она равна $1/10$. Аналогично обстоит ситуация с событиями H_2 и H_3 .

Событию A (”студент оказался отличником”) благоприятствует столько исходов, сколько отличников учится в вузе (в примере — 625 человек). Таким образом, вероятность случайно выбрать отличника из всего вуза — это в точности доля студентов-отличников во всем вузе (то есть 0.625).

Допустим теперь, что мы выбрали случайного студента среди студентов математического факультета. Какова в таком случае вероятность, что он окажется отличником? С точки зрения теории вероятностей, это будет *условная вероятность события A при условии H_1* (то есть $p(A|H_1)$). Нетрудно видеть, что эта вероятность в точности равна доле отличников среди студентов математического факультета (то есть $1/4$).

Предположим, что мы знаем только те данные, которые приведены в условии задачи. Иными словами, нам даны вероятности событий H_1, H_2, H_3 , а также условные вероятности события A при условиях H_1, H_2, H_3 (то есть $p(A|H_1), p(A|H_2), p(A|H_3)$). Мы также знаем, что события H_1, H_2, H_3 попарно несовместны (то есть один студент может учиться только на одном факультете) и вместе образуют всё пространство элементарных исходов (любой студент учится хотя бы на одном факультете). Иными словами, эти события разбивают всё пространство элементарных исходов на несколько непересекающихся частей — в этом случае такие события часто называют *гипотезами*, и говорят, что они образуют ”полную систему событий”. Тот факт, что гипотезы попарно несовместны, и что в объединении они дают всё пространство элементарных событий очень важен — он означает, что всегда реализуется в точности одна гипотеза.

Нетрудно видеть, что по указанным данным можно найти вероятность события A (то есть долю отличников среди студентов всего вуза) — точно таким образом, как мы это сделали выше. Запишем приведенное решение в терминах теории вероятностей:

Напомним, что $p(A|H_1)$ — это доля отличников на математическом факультете, $p(H_1)$ — доля студентов математического факультета на всем вузе, и значит $p(A|H_1) \times p(H_1)$ — доля отличников с математического факультета среди всех студентов вуза (см. формулу (1)). Иными словами, это то же самое, что $p(AH_1)$ — вероятность одновременного выполнения A и H_1 (в примере — вероятность выбрать одного из 25 отличников с математического факультета — она составляет 0.025). Аналогично $p(A|H_2) \times p(H_2)$ — доля отличников со физического факультета среди всех студентов вуза, $p(A|H_3) \times p(H_3)$ — доля отличников с химического факультета среди всех студентов вуза. Складывая эти доли, получаем долю всех отличников вуза, то есть $p(A)$.

$$p(A) = p(A|H_1) \times p(H_1) + p(A|H_2) \times p(H_2) + p(A|H_3) \times p(H_3), \quad (2)$$

Говоря человеческим языком, это означает, что доля всех отличников в вузе это сумма долей отличников каждого факультета от всех студентов вуза.

Это рассуждение можно записать более формально. Действительно, напомним, что по определению условной вероятности,

$$p(A|H_1) = \frac{p(AH_1)}{p(H_1)}, \quad (3)$$

где $p(AH_1)$ — вероятность одновременного выполнения A и H_1 . Умножая обе части этого равенства на $p(H_1)$, получим:

$$p(AH_1) = p(A|H_1) \times p(H_1). \quad (4)$$

С другой стороны, поскольку события H_1, H_2, H_3 не пересекаются и вместе образуют всё пространство элементарных исходов, событие A можно представить как объединение кусочков, лежащих в H_1, H_2, H_3 , то есть $A = AH_1 + AH_2 + AH_3$. События AH_1, AH_2, AH_3 тоже не пересекаются, и значит их вероятности можно складывать: $p(A) = p(AH_1 + AH_2 + AH_3) = p(AH_1) + p(AH_2) + p(AH_3)$. Учитывая (4), имеем: $p(A) = p(A|H_1) \times p(H_1) + p(A|H_2) \times p(H_2) + p(A|H_3) \times p(H_3)$.

Доказанная нами формула (2) называется *формулой полной вероятности*. В общем случае гипотез может быть не три, а больше, и формула выглядит так.

Пусть имеется полная система событий H_1, H_2, \dots, H_n : все эти события попарно несовместны и их сумма составляет всё пространство элементарных исходов Ω . Пусть нам известны вероятности $p(H_1), p(H_2), \dots, p(H_n)$ событий (гипотез) H_1, H_2, \dots, H_n . Разумеется, $p(H_1) + p(H_2) + \dots + p(H_n) = 1$. Пусть мы знаем условные вероятности выполнения события A при условии выполнения каждого из событий

H_1, H_2, \dots, H_n , т.е. $p(A|H_1), p(A|H_2), \dots, p(A|H_n)$. Тогда вероятность события A (полная вероятность) составляет

$$p(A) = p(H_1)p(A|H_1) + p(H_2)p(A|H_2) + \dots + p(H_n)p(A|H_n)$$

Примеры:

1. На столе лежат три монетки: две обыкновенные и одна с орлами с двух сторон. Наудачу выбирается одна монетка и подбрасывается. С какой вероятностью выпадет орел?

Мы могли выбрать либо обычную монетку, либо монетку с двумя орлами. В каждом из этих случаев не сложно найти вероятность выпадения орла, поэтому обозначим за H_1 событие (гипотезу) — мы взяли обычную монетку, за H_2 событие (гипотезу) — мы взяли монетку с двумя орлами. Интересующее нас событие A — выпадение орла на выбранной монетке. Итак, имеем:

$$\begin{aligned} p(H_1) &= 2/3, & p(A|H_1) &= 1/2 \\ p(H_2) &= 1/3, & p(A|H_2) &= 1 \end{aligned}$$

Значит,

$$p(A) = p(H_1)p(A|H_1) + p(H_2)p(A|H_2) = \frac{2}{3} \times \frac{1}{2} + \frac{1}{3} \times 1 = \frac{2}{3}.$$

2. Тест на ВИЧ выдает верный результат в 95% случаев. Известно, что ВИЧ заражена 1/1000 часть всего населения. Человек получил положительный результат теста на ВИЧ (то есть по результатам теста он заражен). С какой вероятностью он действительно заражен?

Пусть

H_1 событие (гипотеза) — человек заражен ВИЧ,

H_2 событие (гипотеза) — человек не заражен ВИЧ.

Гипотезы H_1 и H_2 образуют полную систему событий.

Событие A — тест дал положительный результат.

Тогда

$$\begin{aligned} p(H_1) &= 0,001, & p(A|H_1) &= 0,95 \\ p(H_2) &= 0,999, & p(A|H_2) &= 0,05 \end{aligned}$$

Значит,

$$p(H_1|A) = \frac{p(H_1)p(A|H_1)}{p(H_1)p(A|H_1) + p(H_2)p(A|H_2)} = \frac{0,001 \times 0,95}{0,001 \times 0,95 + 0,999 \times 0,05} \approx 0,0189$$

Результат кажется удивительным: ведь ошибка теста всего 5%, как же могло получиться, что вероятность заболевания при положительном результате теста так мала? Дело в том, что среди людей, получивших положительный результат теста, гораздо больше получивших ложный положительный результат (5% от 99,9% населения), чем людей, действительно зараженных ВИЧ (0,1% населения), а тем более, действительно больных, получивших положительный результат теста.