

Ch01: 概率与随机事件

古典概型与几何概型

September 11, 2023

回忆: 例 0.5

例 0.10 (Poker Hands)

- Decks of 52 cards:
 - 13 ranks: 2, 3, 4, $\dots$, J, Q, K, A
 - 4 suits: S, H, C, D
- Gaming:
 - a one-pair hand consists of 5 cards
- **Questions:** the probability of a one-pair hand is
 - count less than point 12
 - all cards are “S”

回忆: 例 0.5

回到 Poker Hands 的例子:

- **Gaming:** a one-pair hand that draws 5 cards from 52 cards
- 这个游戏的特点:
 1. a one-pair hand consists of 5 cards, such as $\omega_i = \{2S, 3H, 4D, 6C, 10C\}$
 - 试验结果只有有限种可能, 即 $\binom{52}{5} = 2,598,960$
 2. computing the probability of any one-pair hand ω_i
 - 每种结果发生的可能性相同, 即 $P(\omega_i) = \frac{1}{2,598,960}$
- 这样的试验称为**等可能概型**, 即**古典概型 (classical)**.
 - ω_i 也被称为基本事件
 - 若事件 A 包含 k 个基本事件, 则 $P(A) = \frac{k}{2,598,960}$

古典概型：例 0.11

例 0.11 (comparison: 15-7) 将 n 个不同的球随机放入 N ($N \geq n$) 个不同的盒子中, 每个盒子足够大, 可以容纳多个球。请问:

- 事件 A 表示恰有 n 个盒子且每盒一球
- 事件 B 表示指定的 n 个盒子中各有一球
- 事件 C 表示 n 个球都在同一个盒子里的概率
- 事件 D 表示 n 个球都在不同盒子里的概率
- 事件 E 表示指定一个盒子恰有 m 个球

求事件 A, B, C, D, E 发生的概率.

解答: 例 0.11

问题: 将 n 个不同的球随机放入 N ($N \geq n$) 个不同的盒子。

- 基本事件的个数 N^n
- 事件 A 表示恰有 n 个盒子且每盒一球:
球不动, 排盒子 $|A|_{\#} = (N)_n$ 或者 $|A|_{\#} = \binom{N}{n}(N - n)!$
- 事件 B 表示指定的 n 个盒子中各有一球:
仅需排列指定的 n 个球和盒子的关系即可, $|B|_{\#} = n!$
- 事件 C 表示 n 个球都在同一个盒子里的概率:
选出这个盒子即可 $\binom{N}{1}$
- 事件 D 表示 n 个球都在不同盒子里的概率: D 同于 A
- 事件 E 表示指定一个盒子恰有 m 个球:
先给这个盒子挑出球来 $\binom{N}{m}$, 再将剩下的 $n - m$ 个球分配到其他 $N - 1$ 个盒子里 (the latter is a sub-problem). 因此, 有 $\binom{N}{m}(N - 1)^{n-m}$

古典概型：例 0.12

例 0.12 (生日问题) 有 K 个人 ($K < 365$), 每个人的生日等可能地出现于 365 天中的任意一天。

请问：

- 至少两人生日相同的概率
- 恰好有两人生日相同的概率 (思考 ing)

解答: 例 0.12

问题: 有 K 个人 ($K < 365$), 每个人的生日等可能地出现于 365 天中的任意一天。

- 基本事件的个数 365^K
- “至少两人生日相同的概率” 的反问题 (逆问题): “ K 个人在 365 天中完全不相同”. 后者是一个排列问题: $(365)_K$. 所以, 原问题的势为 $365^K - (365)_K$
- “恰好有两人生日相同的概率”: 首先选出这两个人 $\binom{K}{2}$, 选择这两人生在哪一天 $\binom{365}{1}$, 剩下的 $K - 2$ 个人的生日在其他的 364 天里完全不相同 (the latter is a sub-problem of the first problem). 因此, 原问题的势为 $\binom{K}{2} \binom{365}{1} (364)_{K-2}$

超几何概率：例 0.13

例 0.13 设一批 N 件产品中有 M 件次品.

- 现从 N 件产品中**有放回**地任选 n 件, 记事件 A 为“取出的产品种恰有 m 件次品”, 求事件 A 的概率.
- 现从 N 件产品中**无放回**地任选 n 件, 记事件 B 为“取出的产品种恰有 m 件次品”, 求事件 B 的概率.

后者被称为 **超几何概率 (hypergeometric)**.

解答：例 0.13

- “有放回 “：基本事件的个数 N^n , 取到 m 件次品 $\binom{M}{m}M^m$, 剩下的都是良品 $(N - M)^{n-m}$. 因此, $\binom{M}{m}M^m(N - M)^{n-m}$.
- “无放回 “：基本事件的个数 $\binom{N}{n}$, 取到 m 件次品 $\binom{M}{m}$, 剩下的都是良品 $\binom{N-M}{n-m}$. 因此, $\binom{M}{m}\binom{N-M}{n-m}$.

思考: 例 0.14

例 0.14 (抽签问题) 袋中有 a 个不同的白球, b 个不同的红球, 假设有 k 个人依次随机

- 有放回地
- 无放回地

从袋中取一个球, 问第 i 个人 ($i \leq k$) 取出红球的概率?

提醒: 该问题是否是等可能概型?

解：例 0.14

问题：袋中有 a 个不同的白球, b 个不同的红球, 假设有 k 个人依次随机无放回地从袋中取一个球, 问第 i 个人 ($i \leq k$) 取出红球的概率?

提问:

- 基本事件是什么?
- 如何计数该事件中所包含的基本事件个数?
- a, b, i, k 的大小关系会影响结果吗?
- 抽签的公平性

解答：例 0.14

问题：袋中有 a 个不同的白球, b 个不同的红球, 假设有 k 个人依次随机有放回地从袋中取一个球, 问第 i 个人 ($i \leq k$) 取出红球的概率?

- 有放回的问题里, 第几个人取都是相互不影响的, 所以 $\frac{b}{a+b}$.

问题：袋中有 a 个不同的白球, b 个不同的红球, 假设有 k 个人依次随机无放回地从袋中取一个球, 问第 i 个人 ($i \leq k$) 取出红球的概率?

- 基本事件: $(a+b)_i$
- 第 i 个人一定会取到红球 b
- 我们现在需要讨论前 $i-1$ 个人怎么取? 该问题可以表述为“前 $i-1$ 个人无放回地取 $a+b-1$ 个球, 这是原问题的子问题. $(a+b-1)_{i-1}$.
- 因此, $b(a+b-1)_{i-1}$. 因而, 可以得到概率 $\frac{b}{a+b}$.

拓展：当 $a \leq i$ 或者 $b \leq i$ 时, 可能会出现“第 i 个人必然取得或者一定不会取得红球”的情况. 当前的技术进行计算有点麻烦, 可以通过计算机模拟来实现.

超几何概率：例 0.15

例 0.15 (匹配问题) 将 n 对夫妻任意分成 n 组, 每组一男一女, 问至少有一对夫妻被分到同一组的概率是多少?

思考: 这个题和生日题的联系和区别在哪里?

解答: 例 0.15

问题: 将 n 对夫妻任意分成 n 组, 每组一男一女, 问至少有一对夫妻被分到同一组的概率是多少?

- 基本事件是什么? $(n!)^2$ or $n!$
- 如何计数该事件中所包含的基本事件个数?

$$\text{总数} = S(n) + \binom{1}{n} S(n-1) + \cdots + \binom{n-1}{n} S(1) + 1$$

- $S(1, 1) = 0, S(2) = 1, S(3) = 2, \dots$
- $P = 1 - \frac{S(n)}{\text{总数}}$
- Other way?

解答: 例 0.15

问题: 将 n 对夫妻任意分成 n 组, 每组一男一女, 问至少有一对夫妻被分到同一组的概率是多少?

- 基本事件的个数 $n!$
- 考虑 “1 对夫妻匹配成功” 的情况: 任取 1 对 $\binom{n}{1}$, 其余的任意排列 (子问题: $n - 1$ 对夫妻任意分成 $n - 1$ 组) $(n - 1)!$
- 考虑 “2 对夫妻匹配成功” 的情况: 任取 2 对 $\binom{n}{2}$, 其余的任意排列 (子问题: $n - 2$ 对夫妻任意分成 $n - 2$ 组) $(n - 2)!$
- ...
- 易发现, 上述事件满足容斥原理. 即

$$\sum_i |A_i|_{\#} - \sum_{i < j} |A_i A_j|_{\#} + \dots \Rightarrow \binom{n}{1}(n - 1)! - \binom{n}{2}(n - 2)! + \dots$$

思考题：例 0.16

例 0.16 (匹配问题) 将 n 对夫妻任意分成 n 组, 每组 2 人, 不限男女, 问至少有一对夫妻被分到同一组的概率是多少?

几何概型

古典概型考虑有限的样本空间, 即有限个等可能的基本事件, 在很多实际应用中受到限制.

接下来, 我们讨论另一种特殊的随机现象, 具有如下特征:

- **样本空间无限可测.** 样本空间包含无限不可列个样本点, 可以用几何图形 (如一维线段、二维平面区域、或三维空间区域等) 来表示, 其相应的几何测度 (如长度、面积、体积等) 是一个非零有限的实数
- **基本事件等可能性.** 每个基本事件发生的可能性大小相等, 从而使得每个事件发生的概率与该事件的几何测度相关, 与具体位置无关

称为几何概型.

几何概型与测度

定义 0.4 在一个测度有限的区域 Ω 内等可能性投点, 落入 Ω 内的任意子区域 A 的可能性与 A 区域的测度成正比, 与 A 的位置与形状无关, 这样的概率模型称之为几何概型.

事件 A 发生的概率为

$$P(A) = \frac{A \text{ 的测度}}{\Omega \text{ 的测度}} = \frac{\mu(A)}{\mu(\Omega)}$$

这里 $\mu(\cdot)$ 表示区域的测度.

几何概型：例 0.17

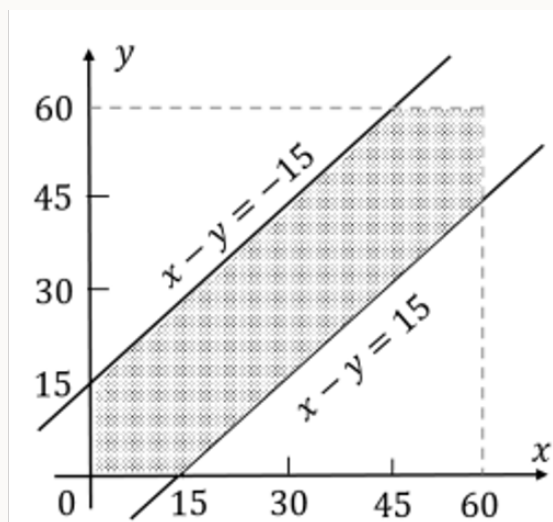
例 0.17 (时间约定问题) 两银行经理约定中午 12:00 - 13:00 到某地会面, 两人到达时间随机, 先到者等另一人 15 分钟后离开. 求两人见面的概率.

几何概型: Monte-Carlo 模拟法

通过计算机模拟近似计算几何概型的概率. 具体地,

- 构造概率模型
- 进行计算机模拟试验
- 用统计的方法计算其估计值近似概率

```
 $n_A \leftarrow 0$   
For  $i = 1 : N$   
   $x \leftarrow \text{Random}(0, 60)$   
   $y \leftarrow \text{Random}(0, 60)$   
  If  $|x - y| \leq 15$  then  
     $n_A \leftarrow n_A + 1$   
  Endif  
Endfor  
Return  $n_A/N$ 
```



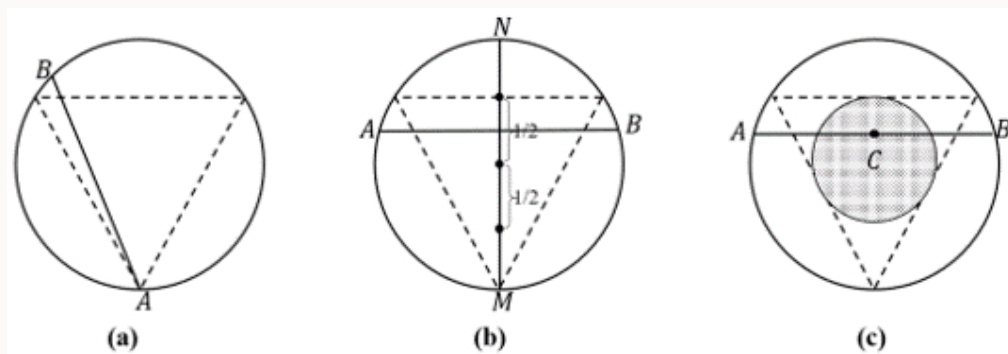
几何概型：例 0.18

例 0.18 (公交车发车班次) 假设一乘客到达汽车站的时间是任意的, 客车间隔一段时间发班, 请规划最长的间隔发车时间, 才能确保乘客候车等待时间不超过 20 分钟的概率大于 80%.

几何概型：例 0.19

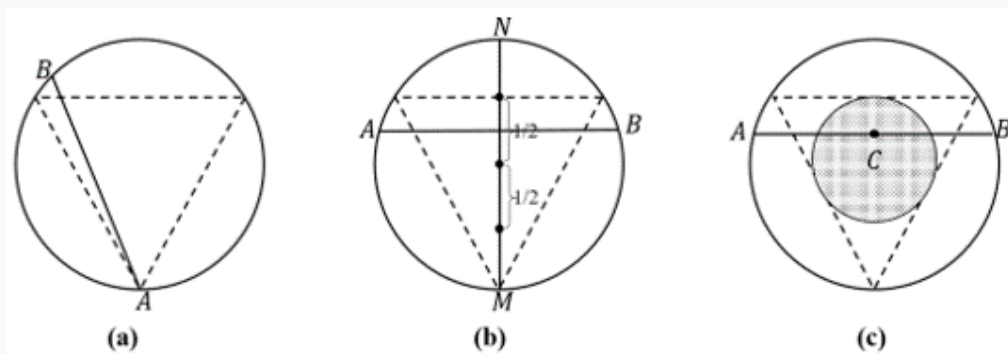
例 0.19 (贝特朗 (Bertrand) 奇论) 在半径为 1 的圆内随机地取一条弦, 求其弦长超过该圆内接等边三角形边长 $\sqrt{3}$ 的概率.

解法：贝特朗 (Bertrand) 奇论



- **解法一：**通过三角形任意一个顶点 A 做圆的切线, 由该顶点做一条弦, 弦的另一端在圆上任意一点 B . 此时概率为 $P = 1/3$.
- **解法二：**在垂直于三角形任意一边的直径 MN 上随机取一个点, 并通过该点做一条垂直于该直径的弦 AB . 此时概率为 $P = 1/2$.
- **解法三：**当弦的中点在阴影标记的圆内时, 弦 AB 的长度大于三角形的边长. 此时概率为 $P = 1/4$.

解法：贝特朗 (Bertrand) 奇论



提示：同一问题有三种不同答案, 究其原因在于圆内“取弦”时规定尚不够具体, 不同的“等可能性假定”导致了不同的样本空间.

- 解法一：概率为 $P = 1/3$ ——假设弦的端点在圆周上均匀分布.
- 解法二：概率为 $P = 1/2$ ——假设弦的中心在直径上均匀分布.
- 解法三：概率为 $P = 1/4$ ——假设弦的中心在圆内均匀分布.

Appendix: 古典概型和几何概型的关系

本节课的几个概念:

- 古典概型
- 超几何概型——有放回 vs 无放回
- 几何概型——样本空间与几何测度