

Základy matematiky a statistiky pro humanitní obory II

Pavel Rychlý Vojtěch Kovář

Fakulta informatiky, Masarykova univerzita
Botanická 68a, 60200 Brno, Czech Republic
{pary, xkovar3}@fi.muni.cz

30. 3. 2011

Obsah přednášky

Podmíněná pravděpodobnost

Nezávislé jevy

Bayesův vzorec

„Paradoxy“: Aplikace Bayesova vzorce

Podmíněná pravděpodobnost

- ▶ Pravděpodobnost jevu A , za předpokladu, že nastal jev B
 - ▶ značíme $P(A|B)$
 - ▶ např. pravděpodobnost deště zítra v poledne za předpokladu deště dnes v poledne
 - ▶ např. pravděpodobnost, že součet dvou hodů kostkou bude 8, pokud první výsledek byl 3
 - ▶ např. pravděpodobnost deště zítra v poledne za předpokladu, že dnes skončíme o 10 minut dřív
 - ▶ např. pravděpodobnost, že člověk je bezdomovec, pokud má vousy delší než 5 cm
 - ▶ → jevy A a B mohou, ale nemusí mít kauzální souvislost

Podmíněná pravděpodobnost

- ▶ Výpočet podmíněné pravděpodobnosti
 - ▶ $P(A|B) = P(A, B)/P(B)$
 - ▶ kde $P(A, B)$ je pravděpodobnost, že jevy A a B nastanou současně

Nezávislé jevy

- ▶ Jevy A a B jsou nezávislé, pokud
 - ▶ to, jestli nastal jev B, neovlivní pravděpodobnost jevu A
 - ▶ $P(A|B) = P(A)$
- ▶ Pro nezávislé jevy platí
 - ▶ $P(A, B) = P(A) * P(B)$
 - ▶ pozor: platí **pouze** pro nezávislé jevy
- ▶ Reálné jevy nebývají téměř nikdy dokonale nezávislé

Bayesův vzorec

- ▶ Převod mezi podmíněnými pravděpodobnostmi
 - ▶ $P(A|B) = \frac{P(B|A)*P(A)}{P(B)}$
- ▶ Důkaz
 - ▶ $P(A|B) = P(A, B)/P(B)$
 - ▶ $P(B|A) = P(B, A)/P(A)$
 - ▶ $P(A|B) * P(B) = P(A, B) = P(B|A) * P(A)$

„Paradoxy“: Aplikace Bayesova vzorce – I

- ▶ Mějme následující soutěž
 - ▶ troje dveře, za jedněmi z nich je výhra
 - ▶ moderátor, který ví, kde je výhra
 - ▶ vybereme si dveře 1
 - ▶ moderátor soutěže otevře dveře 3
 - ▶ za nimi výhra není
 - ▶ nyní máme možnost svou volbu změnit
- ▶ Vyplatí se změnit volbu a vybrat dveře 2?

„Paradoxy“: Aplikace Bayesova vzorce – I (2)

- ▶ Označme si události následovně
 - ▶ V_1, V_2, V_3 : výhra je za dveřmi 1, 2 nebo 3
 - ▶ X : moderátor otevřel dveře 3
 - ▶ (předpokládáme, že v případě, že výhra je za dveřmi, které jsme si vybrali, se moderátor rozhoduje náhodně)
- ▶ Vyjádřeme pravděpodobnosti
 - ▶ $P(V_1) = P(V_2) = P(V_3) = 1/3$
 - ▶ $P(X|V_1) = 1/2$
 - ▶ (vybrali jsme správně, moderátor rozhoduje náhodně)
 - ▶ $P(X|V_2) = 1$
 - ▶ (vybrali jsme špatně, moderátor má jedinou možnost)
 - ▶ $P(X|V_3) = 0$
 - ▶ (moderátor nevybere dveře s cenou)

„Paradoxy“: Aplikace Bayesova vzorce – I (3)

▶ Spočteme podmíněné pravděpodobnosti pro událost X

$$\text{▶ } P(V_1|X) = \frac{P(X|V_1)*P(V_1)}{P(X)} = \frac{\frac{1}{2}*\frac{1}{3}}{\frac{1}{2}} = 1/3$$

$$\text{▶ } P(V_2|X) = \frac{P(X|V_2)*P(V_2)}{P(X)} = \frac{1*\frac{1}{3}}{\frac{1}{2}} = 2/3$$

$$\text{▶ } P(V_3|X) = \frac{P(X|V_3)*P(V_3)}{P(X)} = \frac{0*\frac{1}{3}}{\frac{1}{2}} = 0$$

▶ Jak to?

- ▶ otevření dveří moderátorem ve 2/3 případů určí správné dveře
- ▶ (ve 2/3 případů si vybereme na začátku špatně)
- ▶ představme si variantu hry, kdy máme 1000 dveří a moderátor otevírá 998

Zajímavosti

▶ Pouze 13 % lidí změní svou původní volbu

- ▶ a při opakování pokusu se chovají stále stejně

▶ Obdobný pokus s holuby

- ▶ holubi se během 30 dní naučili téměř vždy změnit původní volbu

▶ (zdroj a více informací viz Wikipedia: Monty Hall problem)

„Paradoxy“: Aplikace Bayesova vzorce – II

▶ Testování drog mezi zaměstnanci

▶ Mějme k dispozici test, který odhalí požití drogy na 99 %

- ▶ je pozitivní v 99 % případů, kdy zkoumaný požil drogu
- ▶ je negativní v 99 % případů, kdy zkoumaný nepožil drogu

▶ Dále dejme tomu, že 0,5 % zaměstnanců skutečně požilo drogu

▶ Záměr vedení firmy

- ▶ otestovat všechny zaměstnance
- ▶ propustit ty, kteří budou mít pozitivní test

▶ Je tento záměr správný?

▶ Kolik procent propuštěných bude propuštěno neoprávněně?

„Paradoxy“: Aplikace Bayesova vzorce – II (2)

▶ Označme události

- ▶ D: testovaný zaměstnanec požil drogu
- ▶ N: testovaný zaměstnanec nepožil drogu
- ▶ pos: test zaměstnance je pozitivní
- ▶ neg: test zaměstnance je negativní

▶ Vyjádřeme známé pravděpodobnosti

- ▶ $P(D) = 0,005$
- ▶ $P(N) = 0,995$
- ▶ $P(pos|D) = 0,99$ („true positive“)
- ▶ $P(pos|N) = 0,01$ („false positive“)
- ▶ $P(pos) = P(truepositive) + P(falsepositive) = 0,99 * 0,005 + 0,01 * 0,995 = 0,0149$

„Paradoxy“: Aplikace Bayesova vzorce – II (3)

- ▶ Chceme zjistit $P(D|pos)$
 - ▶ pravděpodobnost, že zaměstnanec požil drogu za předpokladu, že má pozitivní test
 - ▶
$$P(D|pos) = \frac{P(pos|D)*P(D)}{P(pos)}$$
 - ▶
$$= \frac{0,99*0,005}{0,0149}$$
- ▶ $P(D|pos) = 0,3322$
- ▶ Kde je problém?
 - ▶ testy s úspěšností 99 % jsou relativně časté

„Paradoxy“: Aplikace Bayesova vzorce – III

- ▶ Morfologické značkování nejednoznačných slov
 - ▶ např. „jak“
 - ▶ 80 % výskytů v textu je spojka
 - ▶ 20 % výskytů v textu je podstatné jméno
- ▶ Cíl
 - ▶ chceme maximalizovat podíl správně označovaných výskytů
 - ▶ bez dalších informací (např. o kontextu)
- ▶ Otázky
 - ▶ jaký je optimální postup?
 - ▶ jaké úspěšnosti značkování lze takto dosáhnout?

Závěry

- ▶ Přemýšlejme nad čísly a nad tím, co znamenají
 - ▶ i 99 % může být hodně málo
- ▶ V jednoduchosti je síla
 - ▶ i zdánlivě hloupý postup může být optimální
 - ▶ je třeba domýšlet věci do důsledků