

丁巳 1190/18

高等学校教材

# 概率论及数理统计

上册

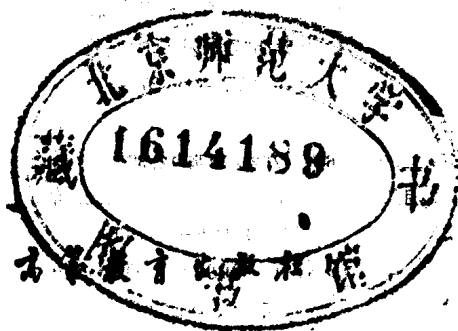
(第二版)

中山大学数学系

梁之舜 邓集贤

杨维权 司徒菊 邓永录

编著



本书是中山大学数学力学系编《概率论及数理统计》(1980年)的修订第二版,现改为编者个人署名。第二版与第一版相比有不少小的修改。总的结构与第一版相同,仍分上、下册出版。

本书可作为综合大学、师范院校数学专业、应用数学专业和计算数学专业的教材,也可作其它有关专业的参考书。

学习本书只要求具有初等微积分基础知识,因此本书具有适应面广、便于自学的特点。

高等学校教材

## 概率论及数理统计

上册

第二版

中山大学数学系

梁之舜 邓集贤

编著

杨维权 司徒荣 邓永录

高等教育出版社出版

新华书店北京发行所发行

文字六〇三厂印装

开本 850×1160 1/32 印张 12.375 字数 290 000

1980年3月第一版 1988年5月第2版 1990年2月第3次印刷

印数 9 121—211450

ISBN7-04-000885-4/O·549

定价 2.85元

# 说 明

本教材是根据1977年10月高等学校理科数学教材编写大纲讨论会上所制定的“概率论及数理统计”教材编写大纲编写的。在编写过程中，按照讨论会上提出的基本原则：(1)这门课程是大学所设置的课程中唯一的一门研究随机现象统计规律性的基础课；(2)宜于没有学习过实变函数论课、具有初等微积分基础的读者自学；(3)学时安排72~108学时。我们作了如下尝试：1)保证理论的完整性与严谨性，对概率论及数理统计学中最基本的概念、定理和公式，作较为全面的且比较严格的叙述；2)由于是一门介绍随机现象的统计规律性的学科，因此，较为注意建立随机现象及其统计规律性的基本概念和方法，尽量阐述清楚基本概念、定理和公式的客观实际意义；3)由于学时所限，在处理教材时，对某些纯分析的有关内容，不得不采用指出参考书、用小字编写或打\*号的办法，从而保证重点；4)在选择例子方面，采用了两种类型的例子，一种例子是比较简单且易于为人们所理解的，这种例子主要是用来便于引入或解释概念、定义及定理。另一种例子是应用于各方面的随机现象的实例，特别是有典型意义的例子，以体现这门课程的应用广泛性这一特点；5)论证当中，尽可能用微积分的知识，避免应用较为高深的数学知识(如勒贝格积分等)。于是，必然会碰到有难于证明的命题，如关于随机变数的函数是否是随机变数？独立随机变数的函数是否仍独立？这些问题只给出条件与结论，不加证明(一般都指出了参考书)。

全书分为三部分：第一部分是概率论基础，包括第一、二、三、

四、五共五章；第二部分是数理统计初步，包括第六、七、八、九共四章；第三部分是随机过程引论及概率论与数理统计在计算方法中的应用，包括第十、十一两章。

本教材适用于综合性大学及师范院校理科和工科院校的教学、计算数学及其他有关专业的“概率论及数理统计”课，各专业可根据需要及讲授学时数，适当选择本教材中的有关内容。

本教材由梁之舜、邓集贤两同志主编，杨维权、司徒荣、邓永录三同志参加编写。杨维权、许刘俊两同志编写全部习题和部份解答。

1979年1月在广州举行了有14个兄弟院校28名代表参加的审稿会议，与会代表认真审阅了全书，并就书的结构、选材和细节提出了十分中肯的意见，在此基础上我们又对全书作了最后修改。谨此向主审单位南开大学以及其他参加审稿会的兄弟院校有关同志表示衷心感谢。由于编者水平有限，时间匆促，本教材难免存在不少缺点和不当之处，恳请读者提出指正。

编 者

1979年3月

## 第二版说明

本教材自1980年3月出第一版至今,已连续七次印刷,共出版十五万余套。这表明本教材选择的内容和深度基本符合有关大专院校的教学要求。所以在这次修订时基本内容没有作大的改动。

几年来,使用本教材的院校有综合性大学(数学系和其它学科系)、师范院校和工科院校等,在使用过程中,大家给我们提出了不少很好的改进意见,我们在此表示衷心感谢。我校谢平民等同志在教学过程中对本教材进行细致的推敲,提出了许多宝贵意见,我们特表谢意。

本教材第二版依据教学过程发现的问题和所提意见,分别由原执笔者作适当修改,其中第一、四、五、十章和附录I, II由邓集贤负责;第二、三章和附录III由司徒荣负责;第六、七、八、九章以及这几章的习题和答案由杨维权负责;第十一章由邓永录负责;第一至第五章的习题和答案由许刘俊负责,全书由梁之舜、邓集贤主持编写和修改。

从本教材第一版问世到现在,经历了七年多时间。此期间内国内外先后出版了若干种概率统计教材,它们各自有其特点。最近,有一种动向似乎逐渐引起人们的关注。一些学者如意大利 de Finetti 学派及美国斯坦福和哈佛大学教授 Persi Diaconis, 他们对概率概念的客观性,对“随机”的实际意义,对“相同条件下重复试验”以至独立性和条件独立性,以及“相互独立同分布”等概念进行了深入的思考与分析,提出了和传统观点不全一致的看法(参看 Exchangeability in Probability and statistics, edited by

G. Koch and F. Spizzichino(1982). Gina kolata: “随机意味着什么”*Science*, 1986, 译载世界科学 1987 第一期). 本教材是一本入门的书, 我们不打算展开这方面的讨论. 但我们同意这样的看法, 即: 基本概念的不确切, 将会带来概率论模型的误用. 因此这次修订时, 在少数地方对有些提法进行了相应的修改, 对有些名词的出现不加定义而打上引号. 但估计这并不会引起读者的困难, 正如点、线、面作为不加定义的数学概念引用并不影响几何学的学习一样.

最后, 让我们借此机会再次对关心、支持本教材改进的所有同志表示衷心感谢. 限于编者水平, 本教材还会存在缺点和错误, 敬希读者批评指正.

编 者

1987 年“五·一”劳动节

# 序 言

当人们开始接触数学或把数学作为研究自然现象的工具时，人们很快就感觉到数学有一个显著的特点，就是确切性：二加一等于多少？一个等腰直角三角形的每个锐角是多少度？直角三角形勾股弦之间的关系如何？人们可以得到肯定而确切的唯一结论。当然也有不完全确定的情形，例如圆周率 $\pi$ 的近似值是3.1416还是3.14159？但这仅是用十进位表示中近似程度的不同而已， $\pi$ 的值还应该是确定的。当时人们认为数学之所以成为研究自然现象的重要而有力的工具，是因为自然现象都应该是能肯定其结果的，因为只有这样才能应用数学作为研究的工具，并根据所作的科学结论对未来进行预测与推断。

人类的社会实践使人们逐步认识到自然现象和科学实验的结果等，并非都是确定的，经常碰到在相同条件下可能得到多种不同结果的情形。然而在进行了大量观察或多次重复试验后，人们逐步发现这些在一次观察或试验不能肯定结果的现象具有近乎必然的客观规律。而且发现应用数学的方法可以研究各种结果出现的可能性大小，从而发展了研究偶然现象规律性的学科——概率论和数理统计。

概率论和数理统计的概念和一些简单的方法，特别是连系于赌博和人口统计的概型和方法，可能出现比较早。但它们之所以得到发展且逐步形成一门严谨的学科，还是和社会生产力的发展有密切关系。换句话说，主要是产生于社会客观实际的需要。

在十七世纪资本主义上升的初期，关闭的封建社会经济逐渐

为航海商业经济所取代。航海商业是冒风险的事业，大量投资是否有利可图？怎样估计出现各种不幸事故与自然灾害的可能性？“概率统计”从某种意义上来说，正是从研究这一类问题开始的。

航海商业的发展，开始了为掠夺殖民地的战争而大量征兵征税，发展了人口统计学；制造枪炮，开始了弹道学的研究；天文学的观测和力学的分析，开始了对观测误差的规律的研究，所有这些都为“概率统计”的发展开辟了道路。

当代科学发展的一个特点是概率统计的方法日益渗透到各个领域。很多力学现象都不能排除随机因素的影响；波涛翻滚的海浪只能用随机过程来描述；各种仪器设备、自动化装置、计算机等的效能估计都和可靠性理论有关；从蒲丰的针（见第一章的例1.2.9）开始发展起来的概率计算方法（蒙特卡罗方法）是解决一些计算问题（特别是多维）和求复杂边界条件的微分方程解的有效工具；最优控制中对随机状态的估计更必须应用概率统计学。生产质量控制中的抽样检查和进行科学实验都需要根据“部分”推断“总体”，这种好像“坐井观天”的方法的理论根据是什么？这些都必须从概率统计的基本理论中找出答案。

这本教材只是一本概率统计学的入门书，我们希望读者通过学习本教材获得一些基础知识，为进一步学习概率统计学创造必要的条件。



# 目 录

说明	1
序言	1
<b>第一章 随机事件和概率</b>	<b>1</b>
§ 1.1 随机事件的直观意义及其运算	1
一、必然现象与随机现象	1
二、随机试验与事件	4
三、事件的关系与运算	5
四、用集合与几何图形表示事件, 样本空间	7
§ 1.2 概率的直观意义及其计算	10
一、古典概率	11
二、统计概率	17
三、几何概率	19
§ 1.3 概率模型与公理化结构	24
§ 1.4 条件概率	38
一、条件概率的定义、例及性质	38
二、乘法公式	43
三、全概率公式	47
四、贝叶斯公式	50
§ 1.5 相互独立随机事件, 独立试验概型	54
一、相互独立随机事件	54
二、串联, 并联系统的可靠度计算	60
三、独立试验概型	63
习题	68
<b>第二章 随机变数及其分布函数</b>	<b>73</b>
§ 2.1 随机变数的直观意义与定义	73
一、离散型随机变数与分布列	76
二、连续型随机变数及其密度函数	99

三、分布函数及其基本性质	116
§ 2.2 多维随机变数及其分布函数	121
一、二维分布函数及其基本性质	121
二、边沿分布	127
§ 2.3 相互独立随机变数, 条件分布	131
一、相互独立随机变数	131
二、条件分布	136
§ 2.4 随机变数的函数及其分布函数	142
一、和的分布	144
二、商的分布	148
三、随机变数的线性变换与平方变换	151
四、 $\chi^2$ -分布, $t$ -分布, $F$ -分布	154
习题	163
<b>第三章 随机变数的数学特征</b>	174
§ 3.1 数学期望与方差	174
一、离散型和连续型随机变数的数学期望和方差	177
二、一般的随机变数的数学期望与方差的定义和性质	191
§ 3.2 矩	198
§ 3.3 多维随机变数的数字特征	201
§ 3.4 多维随机变数的函数的数字特征	212
§ 3.5 条件数学期望	227
习题	231
<b>第四章 特征函数</b>	237
§ 4.1 特征函数的定义及其性质	237
一、特征函数定义及例	237
二、特征函数性质	244
三、特征函数与矩的关系	246
§ 4.2 反演公式及唯一性定理	248
§ 4.3 相互独立随机变数特征函数的特征函数	257
§ 4.4 多维随机变数的特征函数	260
一、定义及例	260
二、二维随机变数特征函数的性质	262

§ 4.5 母函数	266
习题	270
<b>第五章 相互独立随机序列的极限定理</b>	<b>274</b>
§ 5.1 大数定律	275
* § 5.2 强大数定律	282
* § 5.3 依概率收敛与以概率为 1 收敛的关系	297
§ 5.4 中心极限定理	299
一、依分布收敛	301
二、依分布收敛的充分必要条件	302
三、中心极限定理	310
* § 5.5 三种收敛的关系	325
习题	327
<b>附录I 排列组合补充</b>	<b>333</b>
<b>附录II 集合论简介</b>	<b>337</b>
<b>附录III R-S积分</b>	<b>342</b>
表 1 二项分布	356
表 2 泊松分布	358
表 3 正态分布	362
译名对照表	364
参考书目	365
上册习题答案	367

# 第一章 随机事件和概率

## § 1.1 随机事件的直观意义及其运算

### 一、必然现象与随机现象

在自然界里,在生产实践和科学实验中,人们观察到的现象大体可归结为两种类型.一类是可事前预言的,即在准确地重复某些条件下,它的结果总是肯定的,或是根据它过去的状态,在相同条件下完全可以预言将来的发展.我们把这一类型现象称之为确定性现象或必然现象.例如重物在高处总是垂直落到地面;在一个大气压下,水在  $100^{\circ}\text{C}$  时会沸腾;水稻的生长从播种到收割,总是经过发芽、育秧、长叶、吐穗、扬花、结实这几个阶段;在射击时(假设空气阻力等可以忽略)弹道完全由射击的初始条件(如炮弹的初速、发射角和弹道参数等)决定.早期的科学就是研究这一类现象的规律性,所应用的数学工具如数学分析、几何、代数、微分方程等是大家所熟悉的.但人们逐渐还发现另一类型的现象,它是事前不可预言的,即在相同条件下重复进行试验,每次结果未必相同;或是知道它过去的状况,在相同条件下,未来的发展事前却不能完全肯定.这一类型的现象我们称之为偶然性现象或随机现象.如抛掷一个质地均匀的对称的硬币,结果可能是正面向上,或背面向上;新生的婴儿可能是男或是女;在相同海况与气象条件下,某定点海面的浪高时起时伏;当空气阻力等不能忽略时,弹道不能根据初始条件完全确定,可能向不同方向作程度不同的偏移,事前不能肯定.类似的例子还可以举出许多来.

初时人们把这种现象称为“偶然现象”是指它是“不正常的”、“出乎意料的”或者是“原因不明的”，甚至对于迅雷、疾风、陨石、地震等认为是天降的灾难。

是不是这些偶然现象都没有什么规律性可寻呢？事实上并非如此。人们通过长期的反复观察和实践，逐渐发现所谓不可预言，只是对一次或少数几次观察或实践而言，当在相同条件下进行大量观察时，偶然现象都呈现某种规律，因而也是可以预言的。例如根据各个国家各个时期的人口统计资料，新生婴儿中男婴和女婴的比例大约总是 1:1。据传，在我国古代很早的时候就已经知道了这样一个结果。又如人的高度虽然各不相同，但通过大量的统计，如果在一定范围内把人的高度按所占的比例画出“直方图”，就可以连成一条和铜钟的纵剖面一样的曲线；定点海面在一段时间内的浪高，也可以画出类似的曲线，如图 1.1.1。还有更简单的例子（大家可以立即检验的），均匀的硬币抛掷多次，正面和背面出现的次数比例总是近似 1:1，而且大体上抛掷次数愈多，愈接近这个比值。历史上，蒲丰掷过 4040 次，得到 2048 次正面；皮尔逊掷过 24000 次，得到 12012 次正面。

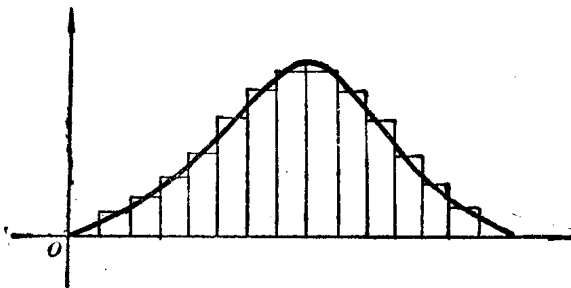


图 1.1.1

从上面的叙述中我们看到，自然界中存在着具有如下特性的现象：在一定的条件组实现时，有多种可能的结果发生，事前人们

不能预言将出现那种结果,但大量重复观察时,所得的结果却呈现某种规律,称为随机现象的统计规律性。

正如革命导师恩格斯所说:“在表面上是偶然性在起作用的地方,这种偶然性始终是受内部的隐蔽着的规律支配的,而问题只是在于发现这些规律。”(《马克思恩格斯选集》中译本第四卷 243页)。

概率论与数理统计就是研究随机现象统计规律性的一门数学学科。

根据马克思、恩格斯的论述,必然性与偶然性是对立统一的概念,偶然性不能理解为“碰巧的”,(为了避免作这种误解,人们往往把它称为“随机性”)它蕴含内在必然性的规律;反过来,被断定为必然的东西,是由纯粹的偶然性构成的。

**例 1.1.1** 研究气体的性质知道,由于气体是由数目众多的分子构成,这些分子以很快的速度进行剧烈的运动,在运动的过程中相互碰撞而改变其动量和方向,因而每个分子的运动是随机现象,而大量的分子运动呈现出的总体现象——温度、压强却满足波义耳定律。

曾经有人认为,所以会出现事前不可预言的偶然现象,是因为我们对一个现象出现的原因还缺乏全面足够的知识,认为随着科学的发展和人类认识的深化,总有一天将不再存在不可预言的随机现象。

诚然,增加条件组的条件来减少随机性是可能的。例如,人的高度按不同的年龄、地区、性别是有差异的,若限定在同一地区,在一定年龄范围内选取同性别的人来测量高度,可能会得到比一般任意选取时有较均匀的结果,但随机因素的影响总是不可避免的。很多现象初始条件的稍微改变,其产生的后果却差别很大。在实际中即使人们有可能把条件组的条件绝对控制到每次都一样,但影响的因素还是大量的,且相互作用错综复杂。例如在例 1.1.1 关

于气体分子运动的例子中,即使我们把一立方厘米气体的  $2.683 \times 10^{18}$  个分子的运动方程和初始条件都列出来,且不说我们要求出这组联立方程的解也是很困难的,更应注意这里在建立方程和确定初始条件时已是忽略了许多次要的,但往往是随机的因素。

因此,偶然性现象是客观存在的,那种否认偶然现象的想法,是“力图用根本否认偶然性的办法来对付偶然性”(恩格斯《自然辩证法》中译本 196 页)。

## 二、随机试验与事件

为了叙述方便,我们把对某种自然现象作一次观察或进行一次科学试验,统称为一个试验。如果这个试验“在相同条件下可以重复进行”,而且每次试验的结果事前不可预言,我们就称它为一个随机试验。

下面,我们所说的试验都是指随机试验。

进行一个试验总有一个观察的目的,试验中会观察到有多种不同的可能结果。例如抛掷一个质地均匀的硬币,我们的目的是要观察它那一面朝上,这里只有两种不同的结果:“正面”或“背面”,至于硬币落在桌面上那一个位置,朝那个方向滚动等不在目的之列,我们不算作结果。

试验的每一个可能结果一般称为随机事件,简称为事件,我们用字母  $A, B, C, \dots$  表示。

**例 1.1.2** 在  $0, 1, 2, \dots, 9$  十个数字中任意选取一个,可有十种不同的结果:“取得一个数是 0”, $\dots$ ,“取得一个数是 9”。但还有其它可能结果:“取得一个数是奇数”,“取得一个是大于 4 的数”,“取得一个数是 3 的倍数”等等。

我们把不可能再分的事件称为基本事件。例如在例 1.1.2 中,“取得一个数是 0”,“取得一个数是 1”, $\dots$ ,“取得一个数是 9”都是基本事件。由若干基本事件组合而成的事件称为复合事件。例如

“取得一个数为3的倍数”是一个复合事件，它由“取得一个数是3”，“取得一个数是6”，“取得一个数是9”三个基本事件组合而成。

一个事件是否称为基本事件是相对于试验的目的来说的。例如量度人的身高，一般说，区间 $(0, 4)$ 中的任一实数，都可以是一个基本事件，这时，基本事件有无穷个；但如果量度高度是为了了解乘车是否需要买全票、半票或免票，这时就只有三个基本事件了。

### 三、事件的关系与运算

进行一个试验，有这样或那样的事件发生，它们各有不同的特性，彼此之间又有一定的联系。下面我们引进事件之间的一些重要关系和运算，这将有利于今后对事件和它的概率的叙述和研究。

1. 在一定条件组下必然发生的事件称为必然事件。在一定条件组下必然不发生的事件称为不可能事件。必然事件用符号 $\Omega$ 表示，不可能事件用符号 $\emptyset$ 表示。把必然事件和不可能事件也算作随机事件，这对我们讨论问题是方便的。

例如，就目前世界上人高来说“人的高度小于4米”是必然事件，而“人的高度大于4米”则是不可能事件。

2. 如果两个事件 $A$ 与 $B$ 不可能同时发生，则称事件 $A$ 与 $B$ 为互不相容。例如必然事件 $\Omega$ 与不可能事件 $\emptyset$ 是互不相容的，又例如在例1.1.2中“取得一个数是0”和“取得一个数是1”是互不相容的。

如果 $A_1, A_2, \dots, A_n$ 中的任意两个事件是互不相容的，则称 $A_1, A_2, \dots, A_n$ 互不相容。

3. 如果事件 $A$ 发生必然导致事件 $B$ 发生，则称事件 $A$ 含于事件 $B$ ，或称事件 $B$ 包含事件 $A$ ，并记为 $A \subset B$ 。如例1.1.2中，令 $A$ 表示“取得一数为4的倍数”， $B$ 表示“取得一数为偶数”，则 $A \subset B$ 。



又如对任一事件  $A$ , 有  $\emptyset \subset A \subset \Omega$ .

$A \subset B$  的一个等价说法是, 如果事件  $B$  不发生则事件  $A$  必然不发生.

如果  $A \subset B$  且  $B \subset A$ , 则称  $A$  与  $B$  相等(或等价), 记为  $A=B$ .

4. 如  $C$  表示“事件  $A$  与  $B$  中至少有一个发生”这一事件, 称它为  $A$  与  $B$  的和(或并), 记为  $C=A \cup B$ . 如在例 1.1.2 中, 令  $A$  表示“取出一数为偶数”<sup>①</sup>,  $B$  表示“取得一数大于 5”, 则  $C=A \cup B$  表示“取得一数或者大于 5, 或者是偶数”, 即等价于“取出一数为 0, 2, 4, 6, 7, 8, 9 中之一数”.

5. 如  $D$  表示“事件  $A$  与  $B$  同时发生”这一事件, 称它为  $A$  与  $B$  的积(或交), 记为  $D=A \cap B$ . 用上例, 则  $D$  表“取得一数为 6 或 8”.

由事件积的定义, 立即得到:

a) 对任一事件  $A$ , 有  $A \cap \Omega = A, A \cap \emptyset = \emptyset$ ;

b) 若  $A_1, A_2$  互不相容, 则  $A_1 \cap A_2 = \emptyset$ .

6. 如  $E$  表示“事件  $A$  发生而事件  $B$  不发生”这一事件, 则称  $E$  为  $A$  与  $B$  之差, 记为  $E=A-B$ . 用前例,  $E=A-B$  表示“取得一个数为 0, 2, 4 中之一数”.

由二事件之差的定义立即得到: 对任意事件  $A$  有

$$A-A=\emptyset; A-\emptyset=A;$$

$$A-\Omega=\emptyset.$$

7.  $\Omega$  与  $A$  之差  $\Omega-A$  这一事件称为  $A$  的逆事件, 记为  $\bar{A}$ , 它表示“ $A$  不发生”这一事件. 用前例,  $\bar{A}$  表示“取出一数为奇数”.

事件的和与事件的积都可以推广到有限(有穷)多个事件, 即

$$A = \bigcup_{i=1}^n A_i \text{ 表示“} A_1, A_2, \dots, A_n \text{ 中至少有一事件发生”这一}$$

事件.

---

<sup>①</sup> 为方便起见, 以后均把数 0 算作偶数.