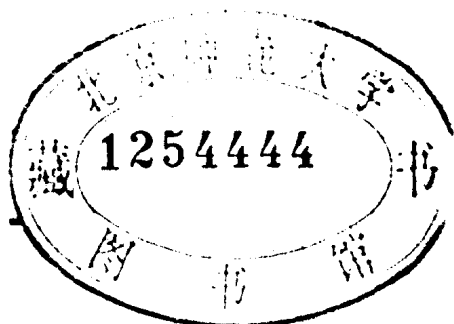


概率论及数理统计

王福保 等编著

501/190/21



教员阅览室(二)

同济大学出版社

1984

责任编辑 黄国新

封面设计 赵文奎

概率论及数理统计

王福保 闵华玲 叶润修 编著

同济大学出版社出版

(上海四平路 1239 号)

新华书店上海发行所发行 上海商务印刷厂印刷

开本 850×1168 1/32 印张 12 字数 342 千字

1984 年 12 月第 1 版 1984 年 12 月第 1 次印刷

印数 1—32,000 科技新书目 82-152

统一书号 13335·002 定价 1.90 元

内 容 提 要

本书内容包括概率论及数理统计两部分,两者并重,篇幅相当。

在概率论部分中,包括预备知识、随机事件及其概率、条件概率、事件的相互独立性及试验的相互独立性、一维与多维随机变数及其分布、随机变数的函数、随机变数的数字特征等内容,阐明了概率论方面的基本知识,突出了随机变数的分布,以便读者正确理解概率论中最主要的概念——随机变数的取值规律。

在数理统计部分中,包括数理统计的基本概念、估计、假设检验、方差分析、一元正态线性回归等内容,对数理统计中最主要的内容作了确切扼要的论述,特别对某些很有用处但一般初等教材中不常列出的内容(如容许域、偏峰态检验、一元正态线性回归中的判别及控制等)也作了介绍。

本书中还列举了不少例题以帮助读者理解并应用概率统计的理论及方法,每章末附有相当数量的习题,书末有全部习题答案。

本书可供高等院校各专业的本科生及研究生作为概率论及数理统计课程的教材或教学参考书,也可供具有高等数学及少量线性代数知识的广大科技工作者参考使用。

前 言

近几十年来,随着生产力的飞跃发展,不论在自然科学领域中还是在社会科学领域中,传统的肯定性数学模型已经不能合乎要求地解决所遇到的各种类型的理论问题及应用问题,因而有必要引进随机性数学模型.在此过程中,随机性数学的各个分支的发展异常迅速,高等院校的学生及广大科技工作者迫切要求掌握这方面的知识.撰写本书的目的就是为解决这一问题创造条件.

本书在高等数学及少量线性代数知识的基础上,为读者提供了一本学习随机数学中最基本的部分(概率论)及应用最为广泛的部分(数理统计)的教材.除选取了一般公认为必不可少的内容外,还列入了一些一般初等教材中不常见的内容,例如,容许域、偏峰态检验、一元正态回归中的判别及控制等.特别根据作者长期从事教学工作的体会,对于一些最基本的概念作了尽可能确切的阐述,希望这样做能使读者不致由于对这方面的理解不深入而影响到在解决实际问题时正确使用随机性数学模型,并能为进一步学习随机数学打下扎实的基础.

为了便于学习,本书列入了较多的例题,并附有相当数量的习题及全部习题答案.

本书的手稿已在教学中使用过多次,并在听取了有关各方面的意见后进行了反复修改,但是,由于作者水平有限,不足之处在所难免,衷心希望读者提出宝贵意见.

本书在出版过程中,承茆诗松、吕乃刚两位老师审阅,并承何迎晖硕士参加整理、校对,谨致谢忱.

王福保 闵华玲 叶润修

1984.5.

目 录

概率论部分

第一章 预备知识	1
第一节 排列与组合	1
一、排列	1
二、组合	4
第二节 集合	5
习题 1	10
第二章 随机事件及其概率	12
第一节 随机试验及基本空间	12
第二节 随机事件	13
第三节 随机事件的概率	19
一、古典概型 概率的古典定义	19
二、几何概率	23
三、随机事件的频率 概率的统计定义	24
四、概率的公理化体系	27
五、概率的性质	28
习题 2	32
第三章 条件概率 事件的相互独立性 试验的相互独立性	34
第一节 条件概率 概率的乘法定理	34
第二节 全概率公式	37
第三节 贝叶斯公式	38
第四节 事件的相互独立性	40
第五节 重复独立试验 二项概率公式	44
习题 3	46
第四章 一维随机变数及其分布	49
第一节 一维随机变数及其分布函数	49
一、一维随机变数及其分布	49
二、一维随机变数的分布函数	53
第二节 离散型随机变数及离散型分布密度	57

第三节	二项分布 布哇松分布	59
第四节	连续型随机变数及连续型分布密度	64
第五节	正态分布	68
习题4	76
第五章	多维随机变数及其分布	79
第一节	两维随机变数及其分布函数	79
第二节	离散型随机变数及离散型分布密度	85
第三节	连续型随机变数及连续型分布密度	89
第四节	边缘分布	93
第五节	条件分布	97
第六节	随机变数的相互独立性	101
习题5	105
第六章	随机变数的函数及其分布	107
第一节	一维随机变数的函数及其分布	107
第二节	两维随机变数的函数及其分布	110
第三节	多维随机变数的函数及其分布	119
第四节	χ^2 分布 t 分布 F 分布	123
一、	χ^2 分布	123
二、	t 分布	126
三、	F 分布	131
习题6	135
第七章	随机变数的数字特征	138
第一节	数学期望	138
第二节	方差	145
一、	方差与标准差	145
二、	契比晓夫不等式	149
第三节	回归系数 相关系数 协方差	152
一、	线性回归 回归系数	152
二、	相关系数 协方差	155
第四节	矩	160
第五节	其它几个数字特征	166
一、	中值与分位数	166
二、	众值	169
习题7	170

数理统计部分

第八章 基本概念	173
第一节 总体与子样	173
第二节 统计推测 估计及检验	178
第三节 统计量	180
习题 8	187
第九章 估计	189
第一节 点估计	189
第二节 用矩法求估计子	189
第三节 用最大似然法求估计子	192
第四节 评价估计子优劣的标准	196
一、无偏估计子	196
二、一致最有效估计子	199
三、一致最小均方误差估计子	200
第五节 区间估计	201
第六节 容许域	210
习题 9	216
第十章 假设检验	220
第一节 检验问题的提出 利用适当的随机变数导出检验参数问题的检验方案	220
第二节 最大似然比值法	232
第三节 拟合优度检验	237
一、检验总体分布是正态分布的方法	238
1. 直观方法	238
2. 偏峰态检验	242
二、 χ^2 拟合优度检验	244
第四节 χ^2 拟合优度检验的两个特殊应用	249
一、联列表中相互独立性的检验	249
二、检验有限个总体具有同一分布	253
第五节 犯两类错误的概率 检验的优劣	256
第六节 非参数检验问题	263
一、符号检验	264
二、秩和检验	269

三、游程检验	273
习题 10	276
第十一章 方差分析	281
第一节 按一种标志分类时的方差分析	281
第二节 按两种标志分类时的方差分析(无交互作用的情形)	287
第三节 按两种标志分类时的方差分析(有交互作用的情形)	294
习题 11	299
第十二章 一元线性正态回归分析	301
第一节 问题的提出	301
第二节 点估计	301
第三节 区间估计	308
第四节 预测	311
第五节 判别	315
第六节 控制	319
第七节 检验	322
习题 12	326
习题答案	328
附表	345
I. 标准正态分布的分布函数值表	345
II. χ^2 分布的 $\chi^2_{(n)\alpha}$ 值表	346
III. t 分布的 $t_{(n)\alpha}$ 值表	347
IV. F 分布的 $F_{(m, n)\alpha}$ 值表	348
V. 二项分布的分布函数值表	352
VI. 布哇松分布的分布函数值表	362
VII. 正态总体的容许上、下限的 K 值表	364
VIII. 极值容许域的最小 n 值表	365
IX. 相关系数检验表	366
X. 符号检验表	367
XI. 秩和检验表	368
XII. 游程数检验表	369
附图	371
正态概率纸	371

概率论部分

概率论是数学的一个分支，它是研究随机现象规律性的基本理论的。随着科学技术的不断发展，在各门学科中，随机现象的研究已经日益感到必要。因此，今天概率论几乎已经成为科技工作者所必需具备的一种工具。在这部分内，将阐明概率论中的一些最基本的内容。为了便于学习，将先介绍一些排列、组合及集合的知识。

第一章 预备知识

第一节 排列与组合

先介绍一条乘法原理：如果一个过程可以分成两个阶段进行，第一个阶段有 m 种不同的做法，第二个阶段有 n 种不同的做法，且第一个阶段的任一种做法都可以与第二个阶段的任一种做法配成整个过程的一种做法，那么，整个过程应该有 $m \times n$ 种不同的做法。在排列组合问题中将反复使用这条乘法原理。

一、排 列

从 n 个不同的元素中，任意取出 r 个不同的元素($0 \leq r \leq n$)，按照任意的顺序排成一行，把这样一行叫做从 n 个不同元素中取 r 个不同元素组成的一种排列。现在来考虑所有这样的排列的种数。通常用 P_n^r 来表示这个种数。

先设 $0 < r < n$. 每一种排列由在 r 个有次序的位置上各放上这 n 个元素中的一个元素所组成, 并且要求各个位置上放的元素不重复. 放在第一个位置上的元素有 n 种不同的取法; 在它取定后, 由于不准重复, 因此放在第二个位置上的元素只有 $n-1$ 种不同的取法; 前两个位置上的元素取定后, 由于不准重复, 因此放在第三个位置上的元素, 只有 $n-2$ 种不同的取法; 依次类推, 前 $r-1$ 个位置上的元素取定后, 由于不准重复, 因此放在第 r 个位置上的元素, 只有 $n-r+1$ 种不同的取法. 按照上面讲过的乘法原理, 所求的排列总数为

$$P_n^r = n(n-1)\cdots(n-r+1).$$

如果使用惯用的记号 $p! = 1 \cdot 2 \cdot 3 \cdots p$ (读作“ p 阶乘”), 那么, 上式可以改写成

$$\begin{aligned} P_n^r &= \frac{n(n-1)\cdots(n-r+1)(n-r)(n-r-1)\cdots 3 \cdot 2 \cdot 1}{(n-r)(n-r-1)\cdots 3 \cdot 2 \cdot 1} \\ &= \frac{n!}{(n-r)!} \end{aligned}$$

当 $r=n$ 时, 所求的排列总数为 $n!$. 如果规定 $0! = 1$, 那么, 上述表达式对于 $r=n$ 仍旧成立. 又, 如果规定从 n 个不同元素中任取 0 个不同元素进行排列时的排列种数为 1 , 那么, 上述表达式对于 $r=0$ 也成立. 因此, 当 $0 \leq r \leq n$ 时, 上述排列问题的答案总可以表达成 $\frac{n!}{(n-r)!}$

[例 1] 计算从八个不同的元素中任取三个的排列种数.

解: 所求的排列种数为

$$P_8^3 = 8 \cdot 7 \cdot 6 = 336.$$

[例 2] 从 1、2、3、4、5、6、7 这七个数中任取三个不同的数组成的三位数中有几个是偶数?

解: 所得的三位数是偶数, 即它的个位上应该是 2、4、6 中的一个. 因此, 放在个位上的数有三种不同的取法. 放在个位上的数取定后, 放在十位上的数有六种取法. 放在个位、十位上的数取定后, 放在百位上的数有五种取法. 从而, 所求的个数为

$$3 \cdot 6 \cdot 5 = 90.$$

注意,在上述排列问题中,参加排列的元素是不允许重复的。但是,有时候需要考虑允许重复的情况。例如,电话号码中就允许各位上的数字重复。通常称这种情况下的排列为重复排列。下面来求出从 n 个不同元素中(允许重复地)取 r 个组成的重复排列的种数。从这 n 个元素中任取一个放在第一个位置上,然后把这个元素放回去,再从这 n 个元素中任取一个放在第二个位置上,然后再把这个元素放回去,按这种做法进行 r 次。按乘法原理,得到从 n 个不同的元素中(允许重复地)取 r 个组成的重复排列的种数为

$$\underbrace{n \cdot n \cdots n}_{r \text{ 个}} = n^r.$$

[例 3] 用 0、1、2、…、9 这十个数字可以组成多少个不同的三位数?(在组成的三位数中各个位置上的数字可以重复.)

解:注意到百位上不能放 0,又,各个位置上的数字可以重复,便得到所求的个数为

$$9 \cdot 10 \cdot 10 = 900.$$

[例 4] 上例内的这些三位数中,

- (1) 没有重复数字的有几个?
- (2) 三个数字都相同的有几个?
- (3) 恰好有两个数字相同的有几个?

解: (1) 百位上的数字有九种不同的取法。在百位上的数字取定后,由于不准重复,但 0 可以添入供选用,所以,十位上的数字有九种不同的取法。在百位、十位上的数字取定后,由于不准重复(如果在十位上没有用到 0 的话,0 当然仍可以选用),所以,个位上的数字有八种不同的取法,因此,所要的个数为

$$9 \cdot 9 \cdot 8 = 648.$$

(2) 由于百位上的数字有九种不同的取法,且按三个数字都相同的要求,百位上的数字取定后,十位、个位上的数字随之而定,因此,所要的个数为 9。

(3) 只有百位上的数字与十位上的数字相同的三位数的个数

为 $9 \cdot 9$ ；只有十位上的数字与个位上的数字相同的三位数的个数为 $9 \cdot 9$ ；只有百位上的数字与个位上的数字相同的三位数的个数为 $9 \cdot 9$ 。因此，恰好有两个数字相同的三位数的个数为

$$9 \cdot 9 + 9 \cdot 9 + 9 \cdot 9 = 243.$$

二、组 合

从 n 个不同的元素中任取 r 个 ($0 < r \leq n$) 构成一组。这里，不考虑这 r 个元素的次序，问有多少种取法？这就是组合问题。称每个这样的组为一个组合。

组合问题与排列问题的不同之处在于：在排列问题中要考虑取得的元素的前后次序，而组合问题中不考虑这种次序。

第一目中已经算得：从 n 个不同元素中任取 r 个不同的元素组成的排列种数为 $n(n-1)\cdots(n-r+1)$ 。按组合问题中的要求，由取定的 r 个不同元素组成的各种排列只能算是同一个组合，又把 r 个不同元素进行排列的种数为 $r!$ 。因此，上述

$$n(n-1)\cdots(n-r+1)$$

种排列中每 $r!$ 种只是一种组合。从而，上述组合问题的答案为

$$\frac{n(n-1)\cdots(n-r+1)}{r!} = \frac{n!}{(n-r)!r!}.$$

如果规定从 n 个不同的元素中任取 0 个的组合个数为 1 ，那么，上述表达式对于 $r=0$ 也成立。这里，注意到，已经规定过 $0!=1$ 。上述

组合问题的答案是一个自然数，通常把它记作 C_n^r 或 $\binom{n}{r}$ 。即：

$$C_n^r = \binom{n}{r} = \frac{n!}{(n-r)!r!}.$$

按 $\binom{n}{r}$ 的这个表达式立即看出

$$\binom{n}{n-r} = \binom{n}{r}.$$

当 r 接近 n 时，可以利用这个等式把 $\binom{n}{r}$ 化成 $\binom{n}{n-r}$ 来计算。

[例 5] 有五本不同的数学书、八本不同的物理书。从中任取两本数学书、四本物理书。问有多少种不同的取法？

解：从五本数学书中任取两本，有

$$\binom{5}{2} = \frac{5 \times 4}{1 \times 2} = 10$$

种不同的取法。从八本物理书中任取四本，有

$$\binom{8}{4} = \frac{8 \times 7 \times 6 \times 5}{1 \times 2 \times 3 \times 4} = 70$$

种不同的取法。因此，按乘法原理，所求的取法的种数为

$$\binom{5}{2} \binom{8}{4} = 10 \times 70 = 700.$$

第二节 集 合

数学中经常会用到由某些特定的事物组成的集体。称这种集体为**集合**，简称**集**。本书中，常用大写拉丁字母来表示集合。称组成集合的各个事物为这集合的**元素**。如果集合 A 是由元素 e_1, e_2, \dots 等组成的，那么，记作

$$A = \{e_1, e_2, \dots\}.$$

如果 e 是集合 A 的一个元素，那么，记作

$$e \in A,$$

读作“ e 属于 A ”。如果 e 不是集合 A 的元素，那么，记作

$$e \notin A,$$

读作“ e 不属于 A ”。有的书上也将“ $e \notin A$ ”记作“ $e \bar{\in} A$ ”。

在讨论集合时，除非另有声明，重复的元素只算一次。例如，把 $\{1, 2, 2, 3\}$ 与 $\{1, 2, 3\}$ 看作是同一个集合。

如果一个集合内只有有限多个元素，那么，称这集合为**有限集**。如果一个集合内有无限多个元素，那么，称这集合为**无限集**。特殊地，如果一个无限集内的元素能与全体自然数构成一一对应的对应，那么，称这个无限集为**可数集**。

例如, $\{2, 3, 4\}$ 是以三个数字 2、3、4 为元素的有限集;

$$\left\{ \frac{1}{3}, \frac{1}{4}, \frac{1}{5}, \dots \right\}$$

是以数字 $\frac{1}{3}$ 、 $\frac{1}{4}$ 、 $\frac{1}{5}$ 、 \dots 为元素的可数集; 全体实数组成一个无限集; 区间 (a, b) 就是由所有大于 a 且小于 b 的全体实数组成的无限集. 后两个集都不是可数集.

如果属于集合 A 的任一个元素都属于集合 B , 那么, 称 A 是 B 的子集, 或者说, B 含有 A , 或者说 A 包含在 B 内, 记作

$$A \subset B \quad (\text{或} \quad B \supset A).$$

(图 1-1). 例如, 全体偶数组成的集合是全体整数组成的集合的子集; 区间 $(1, 2)$ 是区间 $(1, 4)$ 的子集. 显然, 当 $A \subset B$ 且 $B \subset C$ 时, $A \subset C$

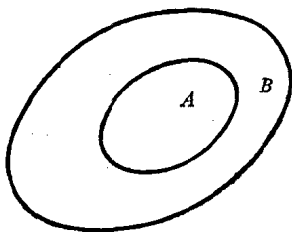


图 1-1

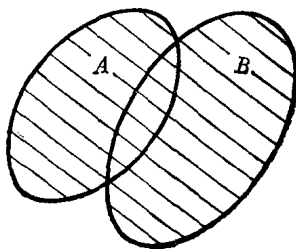


图 1-2

为了以后讨论问题时方便, 把不含任何元素的“集体”也作为一个集合. 称它为空集. 本书上把空集记作 V , (有的书上把空集记作 \emptyset). 又, 把空集作为任一个集合 A 的子集, 即, 对于任一个集 $A, V \subset A$.

如果对于两个集合 $A, B, A \subset B$ 及 $B \subset A$ 都成立, 那么, 称 A, B 相等, 记作 $A = B$.

由至少属于集合 A 、集合 B 中的一个的元素的全体所组成的集合称为 A 与 B 的并集, 记作

$$A \cup B.$$

图 1-2 中阴影部分表示 $A \cup B$. 例如, 集合 $\{1, 2, 3, 4\}$ 与集合

$\{2, 4, 6\}$ 的并集为集合 $\{1, 2, 3, 4, 6\}$; 区间 $(1, 3)$ 与区间 $(2, 4)$ 的并集为区间 $(1, 4)$; 区间 $(-\infty, 3)$ 与区间 $(-\infty, 1)$ 的并集为区间 $(-\infty, 3)$; 区间 $(-1, 0)$ 与区间 $(2, 3)$ 的并集为“大于 -1 且小于 0 ”或“大于 2 且小于 3 ”的全体实数组成的集; xOy 面上坐标满足 $1 < x < 2$ 的点的全体组成的集合与坐标满足 $1 < y < 3$ 的点的全体组成的集合的并集为图 1-3 中阴影部分表示的集合(边界不在内).

由同时属于集合 A 与集合 B 的元素的全体组成的集合称为 A 、 B 的交集, 记作

$$A \cap B \quad (\text{或 } AB).$$

图 1-4 中的阴影部分表示

$$A \cap B.$$

例如, 区间 $(-\infty, 3)$ 与区间 $(1, +\infty)$ 的交集为区间 $(1, 3)$; 平面上, 圆 $x^2 + y^2 = 1$ 内部的点的全体组成的集合与

横坐标 x 大于零的点的全体组成的集合的交集为图 1-5 中阴影部分表示的半圆形区域(边界不在内).

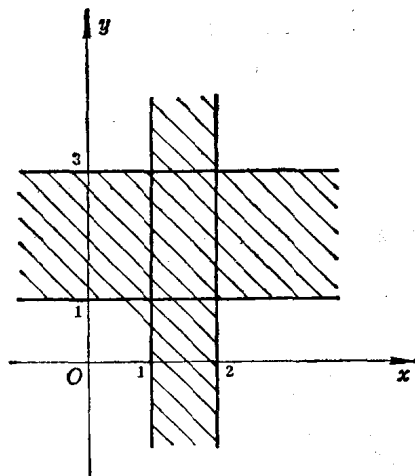


图 1-3

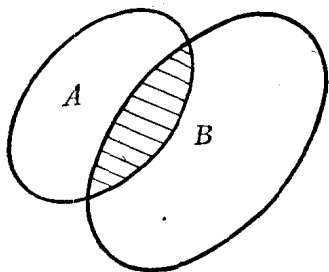


图 1-4

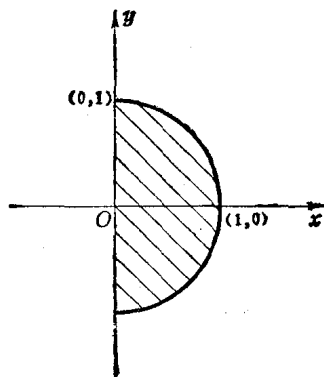


图 1-5

如果 $A \cap B = \emptyset$, 即, A 、 B 无公共元素, 那么, 称 A 、 B 互不相交. 例如, 全体正数组成的集合与全体负数组成的集合互不相交; 区间 $(1, 2)$ 与区间 $(2, 3)$ 互不相交.

集合的并及交满足下列两个分配律:

$$(A \cup B) \cap C = (A \cap C) \cup (B \cap C),$$

$$(A \cap B) \cup C = (A \cup C) \cap (B \cup C).$$

证: 下列诸关系式是相互等价的:

$$e \in (A \cup B) \cap C,$$

$$e \in A \cup B \text{ 且 } e \in C,$$

$$e \in A \cap C, e \in B \cap C \text{ 中至少有一个成立,}$$

$$e \in (A \cap C) \cup (B \cap C).$$

这就证实了第一个分配律. 图 1-6 表明了这个分配律的直观含义. 图中阴影部分表示 $(A \cup B) \cap C$.

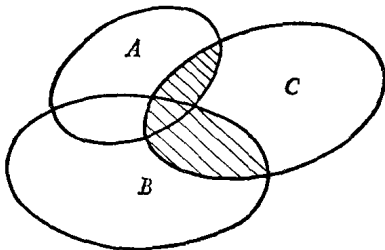


图 1-6

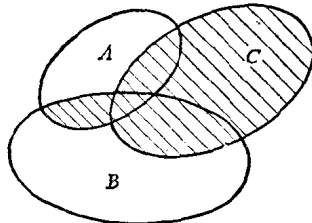


图 1-7

下列诸关系式是相互等价的:

$$e \in (A \cap B) \cup C,$$

$$e \in A \cap B, e \in C \text{ 中至少有一个成立,}$$

$$“e \in A \text{ 或 } e \in C” \text{ 且 } “e \in B \text{ 或 } e \in C”,$$

$$e \in A \cup C \text{ 且 } e \in B \cup C,$$

$$e \in (A \cup C) \cap (B \cup C).$$

这就证实了第二个分配律. 图 1-7 表明了这个分配律的直观含义. 图中阴影部分表示 $(A \cap B) \cup C$.

集合的并及交可以从对于两个集合推广到对于有限多个集合