

Pravděpodobnostní metody ve strojírenství

A.2 - Podmíněná pravděpodobnost, Bayesova věta



A.2 - Podmíněná pravděpodobnost, Bayesova věta

Klíčové pojmy:

- Podmíněná pravděpodobnost
- Stochastická nezávislost

Klíčové věty:

- Věta o úplné pravděpodobnosti
- Bayesova věta



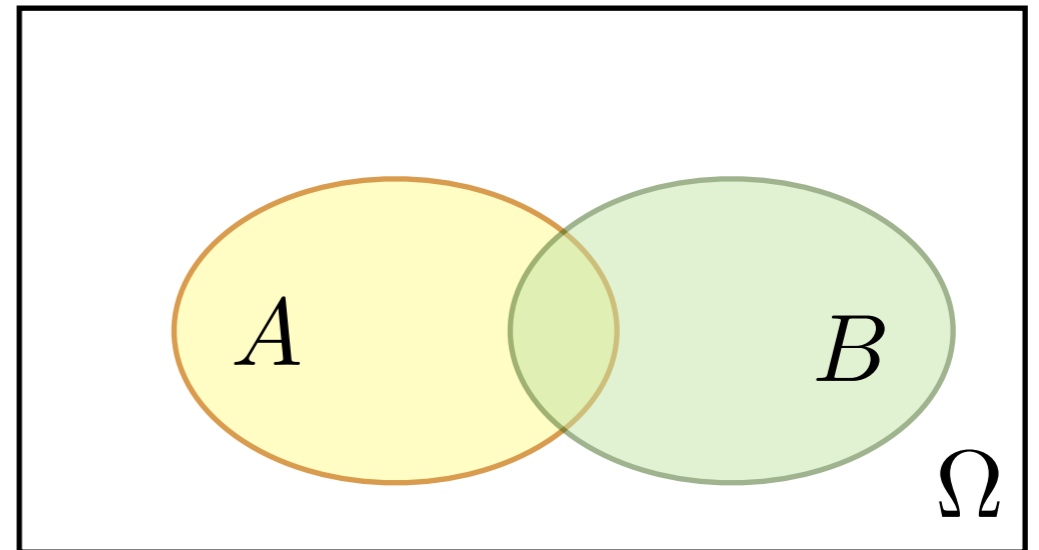
Podmíněná pravděpodobnost

$$P(A \cap B) = ?$$

$$P(A \cap B) = P(A) \cdot P(B|A)$$

$$P(B|A) = \frac{P(A \cap B)}{P(A)}$$

$$P(A|B) = \frac{P(A \cap B)}{P(B)}$$



Příklad:

Je známo, že v dlouhodobém průměru je mezi 1000 dodaných komponent 3,28% vadných výrobků pocházejících od výrobce A, 1,08% vadných výrobků od výrobce B, 59,64% bezvadných výrobků od výrobce A a zbytek (36%) jsou bezvadné výrobky od výrobce B.

Jaká je pravděpodobnost, že vybraný vadný výrobek je od výrobce A?



Podmíněná pravděpodobnost

Příklad:

Je známo, že v dlouhodobém průměru je mezi 1000 dodaných komponent 3,28% vadných výrobků pocházejících od výrobce A, 1,08% vadných výrobků od výrobce B, 59,64% bezvadných výrobků od výrobce A a zbytek (36%) jsou bezvadné výrobky od výrobce B.

Co je zadáno?

$$P(\text{výrobek je od A a je vadný}) = 0,0328 = P(A \cap V)$$

$$P(\text{výrobek je od B a je vadný}) = 0,0108 = P(B \cap V)$$

$$P(\text{výrobek je od A a je bezvadný}) = 0,5964 = P(A \cap V^C)$$

$$P(\text{výrobek je od B a je bezvadný}) = 0,36 = P(B \cap V^C)$$

	A	B
vada (V)	0,0328	0,0108
bez vady	0,5964	0,36



Podmíněná pravděpodobnost

Příklad:

Je známo, že v dlouhodobém průměru je mezi 1000 dodaných komponent 3,28% vadných výrobků pocházejících od výrobce A, 1,08% vadných výrobků od výrobce B, 59,64% bezvadných výrobků od výrobce A a zbytek (36%) jsou bezvadné výrobky od výrobce B.

Co je zadáno?	$P(\text{výrobek je od A a je vadný}) = 0,0328$	$= P(A \cap V)$
	$P(\text{výrobek je od B a je vadný}) = 0,0108$	$= P(B \cap V)$
Na co se ptáme?	$P(\text{výrobek je od A a je bezvadný}) = 0,5964$	$= P(A \cap V^C)$
	$P(\text{výrobek je od B a je bezvadný}) = 0,36$	$= P(B \cap V^C)$

Jaká je pravděpodobnost, že vybraný vadný výrobek je od výrobce A?

$$P(A|V) = ? = \frac{P(A \cap V)}{P(V)}$$

$$= \frac{0,0328}{0,0436} = 0,7523$$

	A	B	celkem	
vada (V)	0,0328	0,0108	0,0436	$= P(V)$
bez vady	0,5964	0,3600	0,9564	$= P(V^C)$
celkem	0,6292	0,3708	1,0000	$= P(A)$ $= P(B)$



Podmíněná pravděpodobnost

Příklad:

Je známo, že v dlouhodobém průměru je mezi 1000 dodaných komponent 3,28% vadných výrobků pocházejících od výrobce A, 1,08% vadných výrobků od výrobce B, 59,64% bezvadných výrobků od výrobce A a zbytek (36%) jsou bezvadné výrobky od výrobce B.

Co je zadáno?	$P(\text{výrobek je od A a je vadný}) = 0,0328$	$= P(A \cap V)$
	$P(\text{výrobek je od B a je vadný}) = 0,0108$	$= P(B \cap V)$
Na co se ptáme?	$P(\text{výrobek je od A a je bezvadný}) = 0,5964$	$= P(A \cap V^C)$
	$P(\text{výrobek je od B a je bezvadný}) = 0,36$	$= P(B \cap V^C)$

Jaká je pravděpodobnost, že vybraný vadný výrobek je od výrobce A?

$$P(A|V) = ? = \frac{P(A \cap V)}{P(V)}$$

$$= \frac{0,0328}{0,0436} = 0,7523$$

	A	B	celkem	
vada (V)	0,0328	0,0108	0,0436	$= P(V)$
bez vady	0,5964	0,3600	0,9564	$= P(V^C)$
celkem	0,6292	0,3708	1,0000	$= P(A)$ $= P(B)$

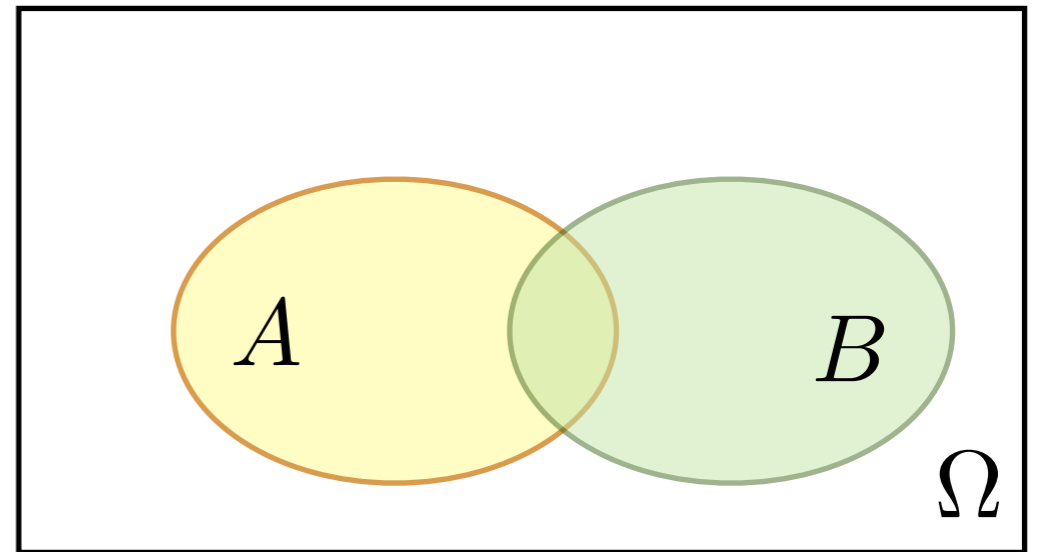


Stochastická nezávislost

$$P(A \cap B) = P(A) \cdot P(B|A)$$

$$P(B|A) = \frac{P(A \cap B)}{P(A)}$$

$$P(A|B) = \frac{P(A \cap B)}{P(B)}$$



Obecně je $P(A|B) \neq P(A) \Rightarrow$ potom říkáme, že A a B jsou **stochasticky závislé**

Pokud ale $P(A|B) = P(A) \Rightarrow$ potom říkáme, že A a B jsou **stochasticky nezávislé**

Jsou-li jevy A a B stochasticky nezávislé, potom platí $P(A \cap B) = P(A) \cdot P(B)$ a naopak.



Stochastická nezávislost

Příklad:

Je známo, že v dlouhodobém průměru je mezi 1000 dodaných komponent 3,28% vadných výrobků pocházejících od výrobce A, 1,08% vadných výrobků od výrobce B, 59,64% bezvadných výrobků od výrobce A a zbytek (36%) jsou bezvadné výrobky od výrobce B.

Jaká je pravděpodobnost, že vybraný vadný výrobek je od výrobce A?

$$P(A|V) = ? = \frac{P(A \cap V)}{P(V)}$$
$$= \frac{0,0328}{0,0436} = 0,7523$$

	A	B	celkem
vada (V)	0,0328	0,0108	0,0436
bez vady	0,5964	0,3600	0,9564
celkem	0,6292	0,3708	1,0000

$$= P(A)$$

Lze považovat výskyt vady stochasticky závislý na výrobci?

Zde je $P(A|V) \neq P(A) \Rightarrow A$ a V jsou stochasticky závislé.



Stochastická nezávislost

Příklad:

Bylo dotazováno 800 absolventů ČVUT a UK. Z výzkumu plyne, že 336 dotazovaných jsou absolventi ČVUT kteří pracují dále ve svém oboru, 224 dotázaných absolvovalo UK a pracují také ve svém oboru. Ve 144 případech odpovědí bylo zjištěno, že absolventi ČVUT ve svém oboru nepracují a zbývajících 96 jsou absolventi UK, kteří také nepracují ve svém oboru.

Lze považovat uplatnění se v oboru studia stochasticky závislé na absolvované univerzitě?

	ČVUT	UK	celkem
v oboru	336	224	560
mimo obor	144	96	240
celkem	480	320	800



Stochastická nezávislost

Příklad:

Bylo dotazováno 800 absolventů ČVUT a UK. Z výzkumu plyne, že 336 dotazovaných jsou absolventi ČVUT kteří pracují dále ve svém oboru, 224 dotázaných absolvovalo UK a pracují také ve svém oboru. Ve 144 případech odpovědí bylo zjištěno, že absolventi ČVUT ve svém oboru nepracují a zbývajících 96 jsou absolventi UK, kteří také nepracují ve svém oboru.

Lze považovat uplatnění se v oboru studia stochasticky závislé na absolvované univerzitě?

	ČVUT	UK	celkem
v oboru	0,42	0,28	0,7
mimo obor	0,18	0,12	0,3
celkem	0,6	0,4	1,0



Stochastická nezávislost

Příklad:

Bylo dotazováno 800 absolventů ČVUT a UK. Z výzkumu plyne, že 336 dotazovaných jsou absolventi ČVUT kteří pracují dále ve svém oboru, 224 dotázaných absolvovalo UK a pracují také ve svém oboru. Ve 144 případech odpovědí bylo zjištěno, že absolventi ČVUT ve svém oboru nepracují a zbývajících 96 jsou absolventi UK, kteří také nepracují ve svém oboru.

Lze považovat uplatnění se v oboru studia stochasticky závislé na absolvované univerzitě?

$$P(T \cap O) = 0,42 = 0,6 \cdot 0,7 = P(T) \cdot P(O)$$

$$P(T^C \cap O) = 0,28 = 0,4 \cdot 0,7 = P(T^C) \cdot P(O)$$

$$P(T \cap O^C) = 0,18 = 0,6 \cdot 0,3 = P(T) \cdot P(O^C)$$

$$P(T^C \cap O^C) = 0,12 = 0,4 \cdot 0,3 = P(T^C) \cdot P(O^C)$$

=> Jevy T a O jsou stochasticky nezávislé

	T	T^C	celkem
O	0,42	0,28	0,7
O^C	0,18	0,12	0,3
celkem	0,6	0,4	1,0



Věta o úplné pravděpodobnosti

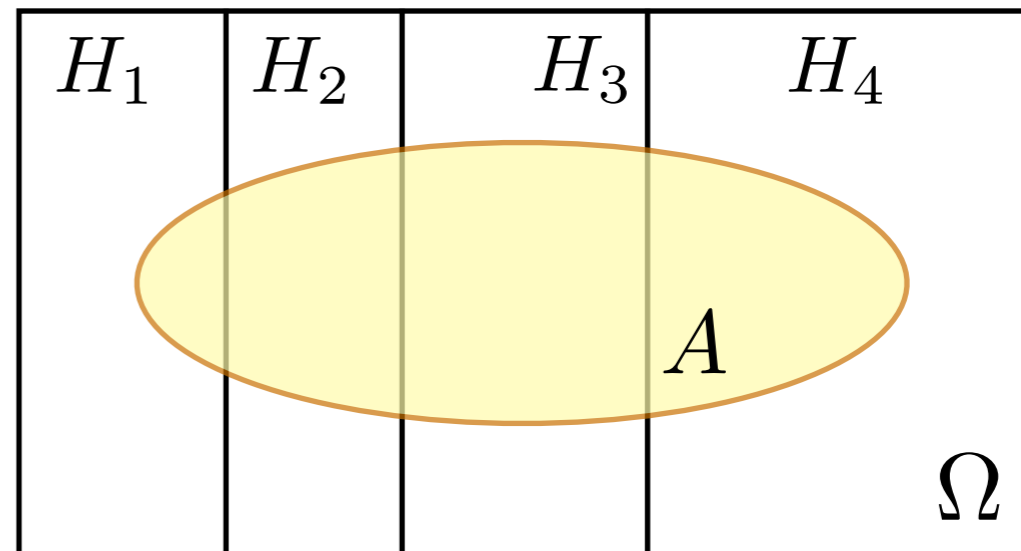
Úplné pokrytí Ω : $\{H_1, H_2, H_3, H_4\}$: $H_i \cap H_j = \emptyset$, $H_1 \cup H_2 \cup H_3 \cup H_4 = \Omega$

Předpokládejme, že známe

$$P(H_1), P(H_2), P(H_3), P(H_4)$$

Musí být

$$P(H_1) + P(H_2) + P(H_3) + P(H_4) = 1$$



Obecně: Úplným pokrytím množiny elementárních jevů Ω rozumíme takovou množinu $\{H_i\}_{i=1}^n$ jevů z jevového pole \mathcal{F} , které jsou vzájemně po dvou disjunktní, tedy je $H_i \cap H_j = \emptyset$, $i \neq j$, $i, j = 1, 2, \dots, n$, a platí

$$\bigcup_{i=1}^n H_i = \Omega.$$

Dále předpokládejme, že máme náhodný jev $A \in \mathcal{F}$, jehož pravděpodobnost nás zajímá.



Věta o úplné pravděpodobnosti

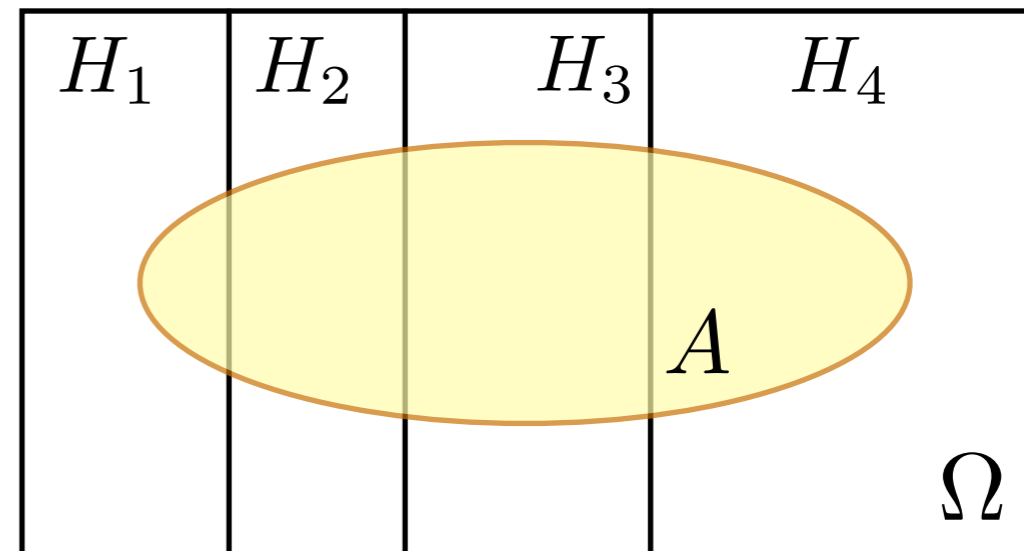
Úplné pokrytí Ω : $\{H_1, H_2, H_3, H_4\}$: $H_i \cap H_j = \emptyset$, $H_1 \cup H_2 \cup H_3 \cup H_4 = \Omega$

Předpokládejme, že známe

$$P(H_1), P(H_2), P(H_3), P(H_4)$$

Musí být

$$P(H_1) + P(H_2) + P(H_3) + P(H_4) = 1$$



Jev A lze rozložit na několik disjunktčních jevů:

$$A = (A \cap H_1) \cup (A \cap H_2) \cup (A \cap H_3) \cup (A \cap H_4)$$

a tedy platí $P(A) = P(A \cap H_1) + P(A \cap H_2) + P(A \cap H_3) + P(A \cap H_4) = \bigcup_{i=1}^4 P(A \cap H_i)$

Předpokládejme dále, že známe $P(A|H_1), P(A|H_2), P(A|H_3), P(A|H_4)$

a víme, že je $P(A \cap H_i) = P(A|H_i) \cdot P(H_i)$, $i = 1, 2, 3, 4$. Potom dostáváme

$$P(A) = P(A|H_1)P(H_1) + P(A|H_2)P(H_2) + P(A|H_3)P(H_3) + P(A|H_4)P(H_4) = \sum_{i=1}^4 P(A|H_i)P(H_i)$$



Věta o úplné pravděpodobnosti

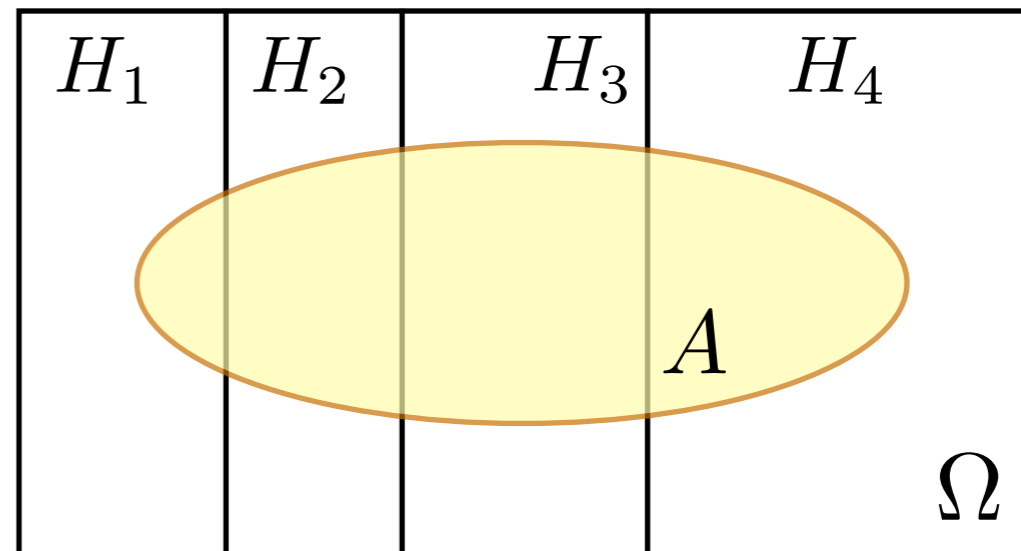
Úplné pokrytí Ω : $\{H_1, H_2, H_3, H_4\}$: $H_i \cap H_j = \emptyset$, $H_1 \cup H_2 \cup H_3 \cup H_4 = \Omega$

Předpokládejme, že známe

$$P(H_1), P(H_2), P(H_3), P(H_4)$$

Musí být

$$P(H_1) + P(H_2) + P(H_3) + P(H_4) = 1$$



Obecně: Mějme náhodný jev $A \in \mathcal{F}$. Je-li $\{H_i\}_{i=1}^n$ úplné pokrytí množiny Ω ,

$$\text{potom platí } P(A) = \sum_{i=1}^n P(A|H_i)P(H_i).$$



Věta o úplné pravděpodobnosti

Příklad:

Na trhu jsou výrobky od čtyř výrobců v pořadí A, B, C a D v poměru 1:2:4:5. Zmetkovitost je u těchto výrobců po řadě 0,5%, 0,8%, 0,3% a 0,3%. Jaká je pravděpodobnost, že náhodně vybraný výrobek na trhu bude vadný?

- Experiment spočívá v tom, že náhodně vybereme jeden výrobek na trhu.
- Trh lze rozdělit na 12 dílů: 1 od výrobce A, 2 díly od výrobce B, 4 díly od C a 5 dílů od D.
- Nikdo jiný na trh nedodává a výrobek má vždy pouze jednoho výrobce. Tím dostáváme úplné pokrytí trhu: $H_1=A$, $H_2=B$, $H_3=C$, $H_4=D$.
- Z poměru výrobců na trhu odhadneme pravděpodobnosti toho, že náhodně vybraný výrobek je od daného výrobce:
 $P(H_1)=1/12$, $P(H_2)=1/6$, $P(H_3)=1/3$, $P(H_4)=5/12$.
- Ze zadání známe i pravděpodobnosti výroby vadného výrobku u jednotlivých výrobců:
 $P(A|H_1)=0,005$, $P(A|H_2)=0,008$, $P(A|H_3)=0,003$, $P(A|H_4)=0,003$.
- Tedy podle věty o úplné pravděpodobnosti je
 $P(A)=0,005 \cdot 1/12 + 0,008 \cdot 2/12 + 0,003 \cdot 4/12 + 0,003 \cdot 5/12 = 0,004$.

Vybrali jsme vadný výrobek. Nyní se ptáme: jaká je pravděpodobnost, že je od výrobce A?



Bayesova věta

Příklad:

Na trhu jsou výrobky od čtyř výrobců v pořadí A, B, C a D v poměru 1:2:4:5. Zmetkovitost je u těchto výrobců po řadě 0,5%, 0,8%, 0,3% a 0,3%. Jaká je pravděpodobnost, že náhodně vybraný vadný výrobek na trhu byl vyroben výrobcem A?

- Otázka zní: Jaká je pravděpodobnost $P(H_1|A)= ?$
- Známe $P(H_1)=1/12$ (= pravděpodobnost toho, že vybereme výrobek od výrobce A před provedením experimentu – tzv. „*apriorní pravděpodobnost*“)
- Víme, s jakou pravděpodobností výrobce A vyrábí zmetky: $P(A|H_1)=0,005$.
- Tedy jsme schopni vyjádřit pravděpodobnost, s jakou se na trhu vyskytuje vadný výrobek od výrobce A: $P(A \cap H_1)=P(A|H_1) \cdot P(H_1)=0,005 \cdot 1/12$
- Podle věty o úplné pravděpodobnosti jsme spočetli $P(A)=0,004$.
- Dosazením do vzorce pro podmíněnou pravděpodobnost dostaneme výsledek:

$$P(H_1|A) = \frac{P(A \cap H_1)}{P(A)} = \frac{P(A|H_1)P(H_1)}{P(A)} = \frac{0,005}{12 \cdot 0,004} = 0,1042$$

(= pravděpodobnost toho, že jsme vybrali výrobek od výrobce A poté, co známe výsledek experimentu – tzv. „*aposteriorní pravděpodobnost*“)



Bayesova věta

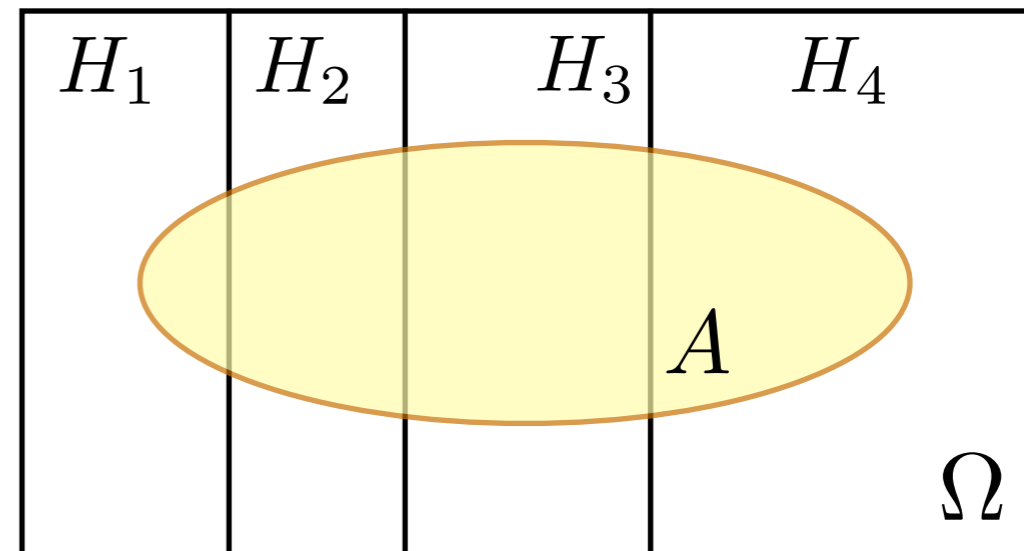
Úplné pokrytí Ω : $\{H_1, H_2, H_3, H_4\}$: $H_i \cap H_j = \emptyset$, $H_1 \cup H_2 \cup H_3 \cup H_4 = \Omega$

Předpokládejme, že známe

$$P(H_1), P(H_2), P(H_3), P(H_4)$$

Musí být

$$P(H_1) + P(H_2) + P(H_3) + P(H_4) = 1$$



Věta o úplné pravděpodobnosti: Mějme náhodný jev $A \in \mathcal{F}$. Je-li $\{H_i\}_{i=1}^n$

úplné pokrytí množiny Ω , potom platí
$$P(A) = \sum_{i=1}^n P(A|H_i)P(H_i).$$

Bayesova věta: Mějme náhodný jev $A \in \mathcal{F}$ takový, že $P(A) \neq 0$. Je-li $\{H_i\}_{i=1}^n$

úplné pokrytí množiny Ω , potom pro libovolné $i = 1, 2, \dots, n$ platí

$$P(H_i|A) = \frac{P(A|H_i)P(H_i)}{\sum_{j=1}^n P(A|H_j)P(H_j)}$$



Bayesova věta

Uvažujme sledovaný výsledek Z (výskyt určité vlastnosti, stavu)

Provedeme experiment, test, který skončí výsledkem E .

$$\text{aposteriorní pravděpodobnost } Z = \frac{\text{věrohodnost } E \text{ při } Z \cdot \text{apriorní pravděpodobnost } Z}{\text{evidence } E}$$

Příklad:

Chcete koupit ojetý vůz určité značky a cca 5 let starý. Je známo, že takovéto vozy mají vadnou převodovku přibližně ve 30 % případů. Ke koupi přizvete kamaráda automechanika, který vybraný vůz projede a řekne svůj názor. Kamarád však není dokonalý a zhruba v 10 % případů označí jako bezvadný vůz, který má vadu. Na druhou stranu, v 85 % pozná bezvadný vůz. **Jakou máte šanci, pokud dáte na radu kamaráda, že koupíte vůz s vadou?**

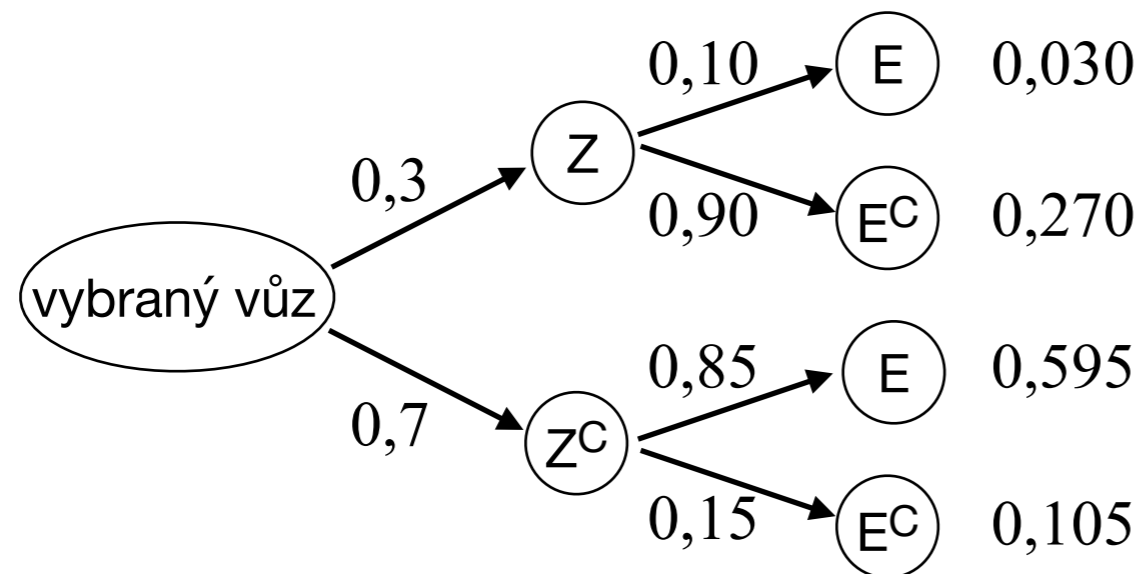
Uvažujme sledovaný výsledek $Z = \text{vada}$ (Z, Z^c tvoří úplné pokrytí)

Provedeme diagnostický test, který skončí výsledkem E pokud není diagnostikována vada, E^c pokud vada diagnostikována je.

$$P(Z|E) = \frac{P(E|Z)P(Z)}{P(E)}$$



Bayesova věta



$$P(Z|E) = \frac{0,03}{0,03+0,595} = 0,048$$

Příklad:

Chcete koupit ojetý vůz určité značky a cca 5 let starý. Je známo, že takovéto vozy mají vadnou převodovku přibližně ve 30 % případů. Ke koupi přizvete kamaráda automechanika, který vybraný vůz projede a řekne svůj názor. Kamarád však není dokonalý a zhruba v 10 % případů označí jako bezvadný vůz, který má vadu. Na druhou stranu, v 85 % pozná bezvadný vůz. Jakou máte šanci, pokud dáte na radu kamaráda, že koupíte vůz s vadou?

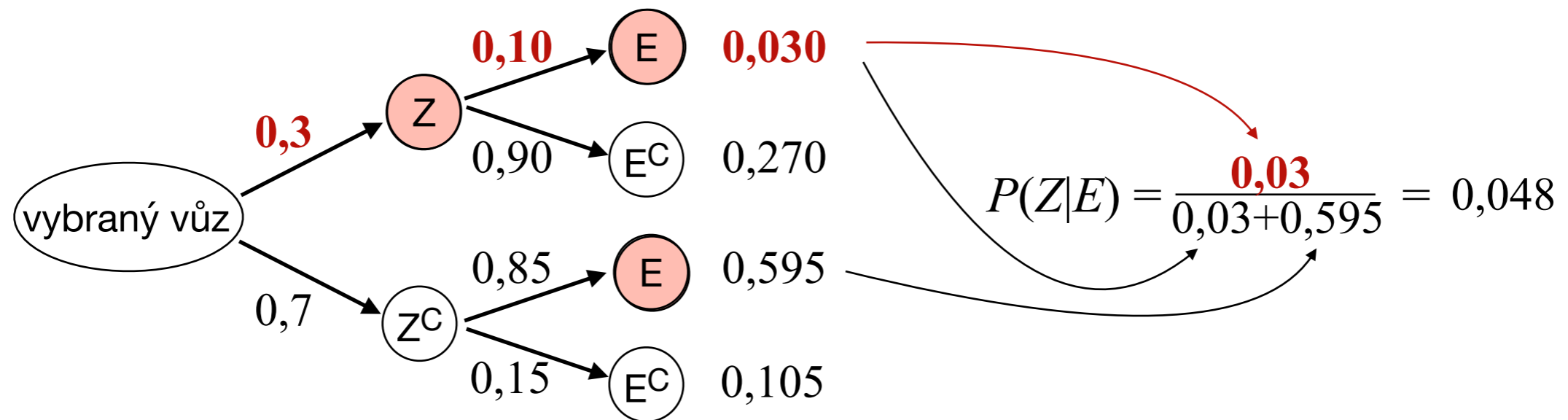
Uvažujme sledovaný výsledek $Z = \text{vada}$ (Z, Z^C tvoří úplné pokrytí)

Provedeme diagnostický test, který skončí výsledkem E pokud není diagnostikována vada, E^C pokud vada diagnostikována je.

$$P(Z|E) = \frac{P(E|Z)P(Z)}{P(E)}$$



Bayesova věta



Příklad:

Chcete koupit ojetý vůz určité značky a cca 5 let starý. Je známo, že takovéto vozy mají vadnou převodovku přibližně ve 30 % případů. Ke koupi přizvete kamaráda automechanika, který vybraný vůz projede a řekne svůj názor. Kamarád však není dokonalý a zhruba v 10 % případů označí jako bezvadný vůz, který má vadu. Na druhou stranu, v 85 % pozná bezvadný vůz. Jakou máte šanci, pokud dáte na radu kamaráda, že koupíte vůz s vadou?

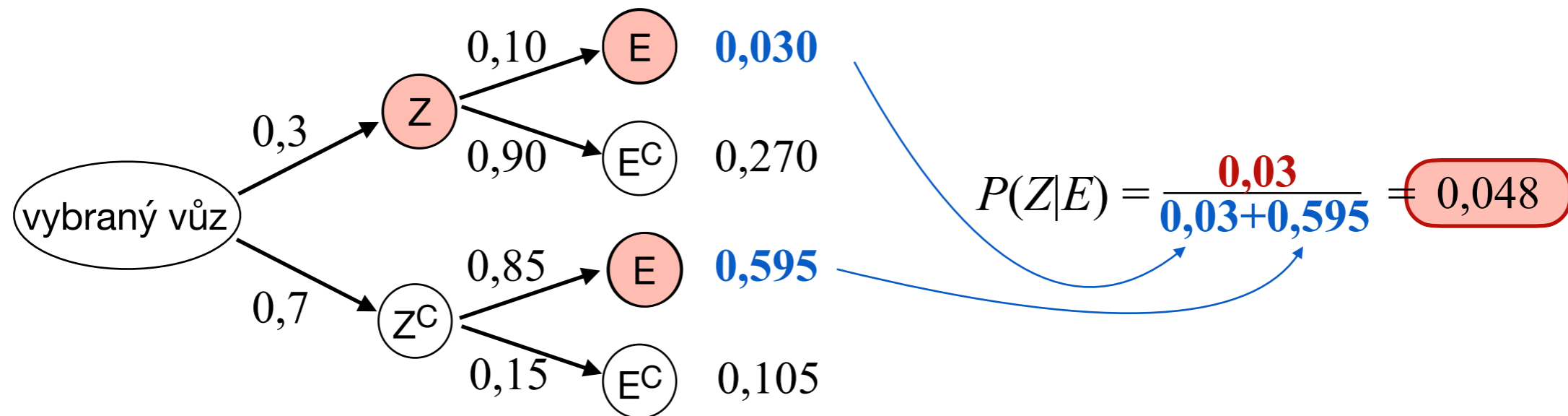
Uvažujme sledovaný výsledek $Z = \text{vada}$ (Z, Z^C tvoří úplné pokrytí)

Provedeme diagnostický test, který skončí výsledkem E pokud není diagnostikována vada, E^C pokud vada diagnostikována je.

$$P(Z|E) = \frac{P(E|Z)P(Z)}{P(E)}$$



Bayesova věta



Příklad:

Chcete koupit ojetý vůz určité značky a cca 5 let starý. Je známo, že takovéto vozy mají vadnou převodovku přibližně ve 30 % případů. Ke koupi přizvete kamaráda automechanika, který vybraný vůz projede a řekne svůj názor. Kamarád však není dokonalý a zhruba v 10 % případů označí jako bezvadný vůz, který má vadu. Na druhou stranu, v 85 % pozná bezvadný vůz. Jakou máte šanci, pokud dáte na radu kamaráda, že koupíte vůz s vadou?

Uvažujme sledovaný výsledek $Z = \text{vada}$ (Z, Z^c tvoří úplné pokrytí)

Provedeme diagnostický test, který skončí výsledkem E pokud není diagnostikována vada, E^c pokud vada diagnostikována je.

$$P(Z|E) = \frac{P(E|Z)P(Z)}{P(E)}$$

Tedy dáme-li na radu kamaráda automechanika, naše riziko koupě vadného vozu se sníží ze 30 % na 4,8 %.

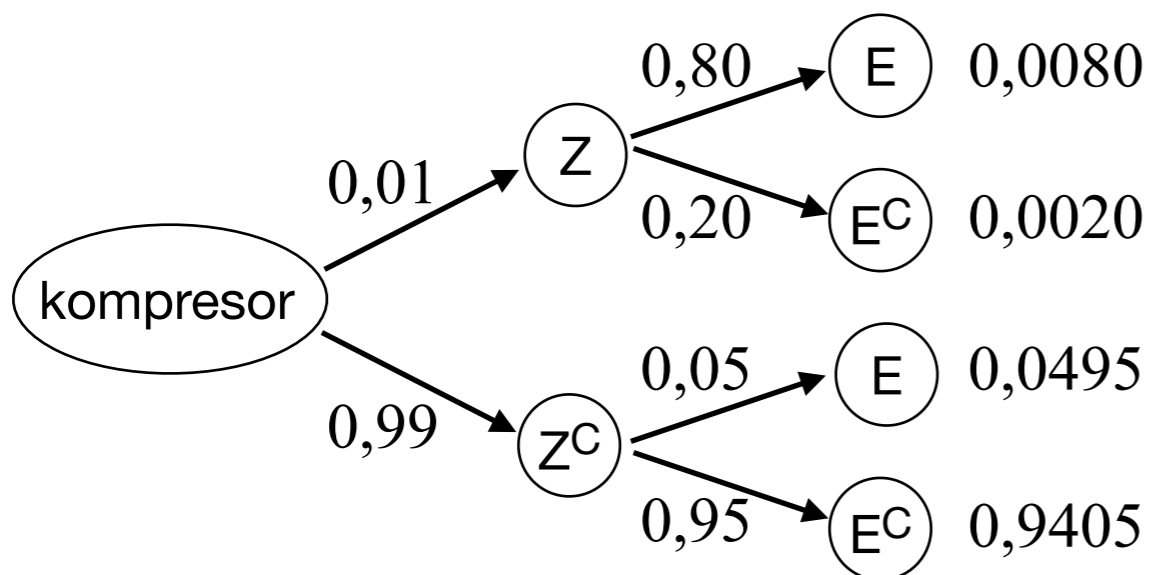


Bayesova věta

Příklad:

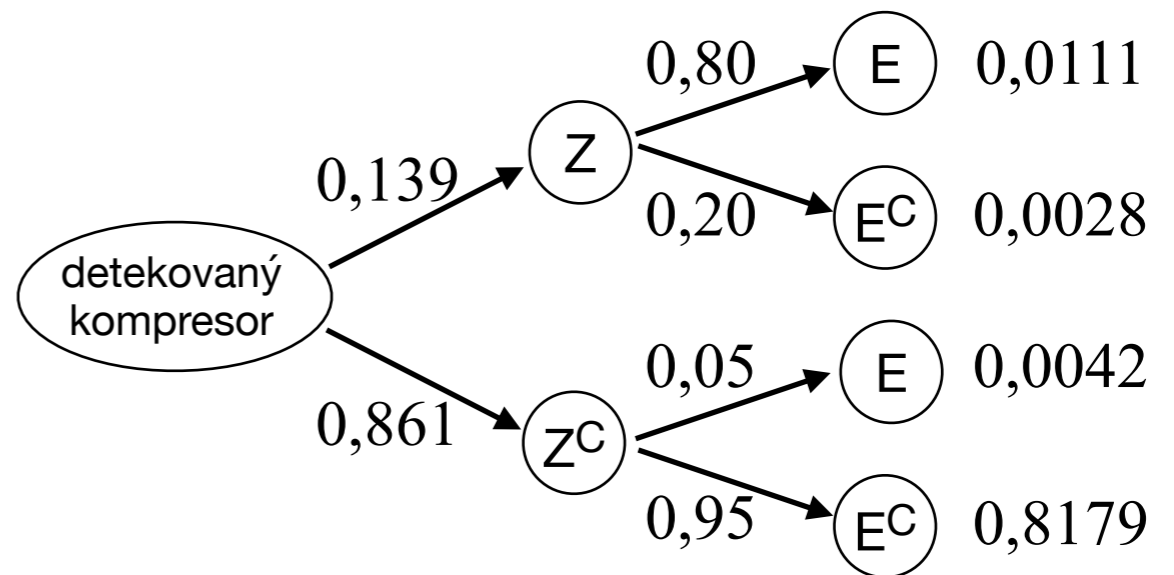
Tělo kompresoru musí být 100% hermeticky uzavřeno. V průměru jeden ze sta kompresorů trochu netěsní a je třeba jej rozložit a znovu složit. Zkouška těsnosti odhalí vadný výrobek s pravděpodobností 0,8. Naproti tomu, s pravděpodobností 0,05 označí chybně jako vadný bezvadný výrobek. Jaká je pravděpodobnost vady u výrobku, který zkouška označila jako vadný?

běžný test na lince:



$$P(Z|E) = \frac{0,0080}{0,0080+0,0495} = 0,1391$$

test ve zkušebně:



$$P(Z|E) = \frac{0,0111}{0,0111+0,0042} = 0,7255$$

konfirmační test ve zkušebně: $P(Z|E) = 0,9769$



Diagnostické testy

Snažíme se detekovat nějaký jev Z (vadu, nemoc) pomocí diagnostického testu E

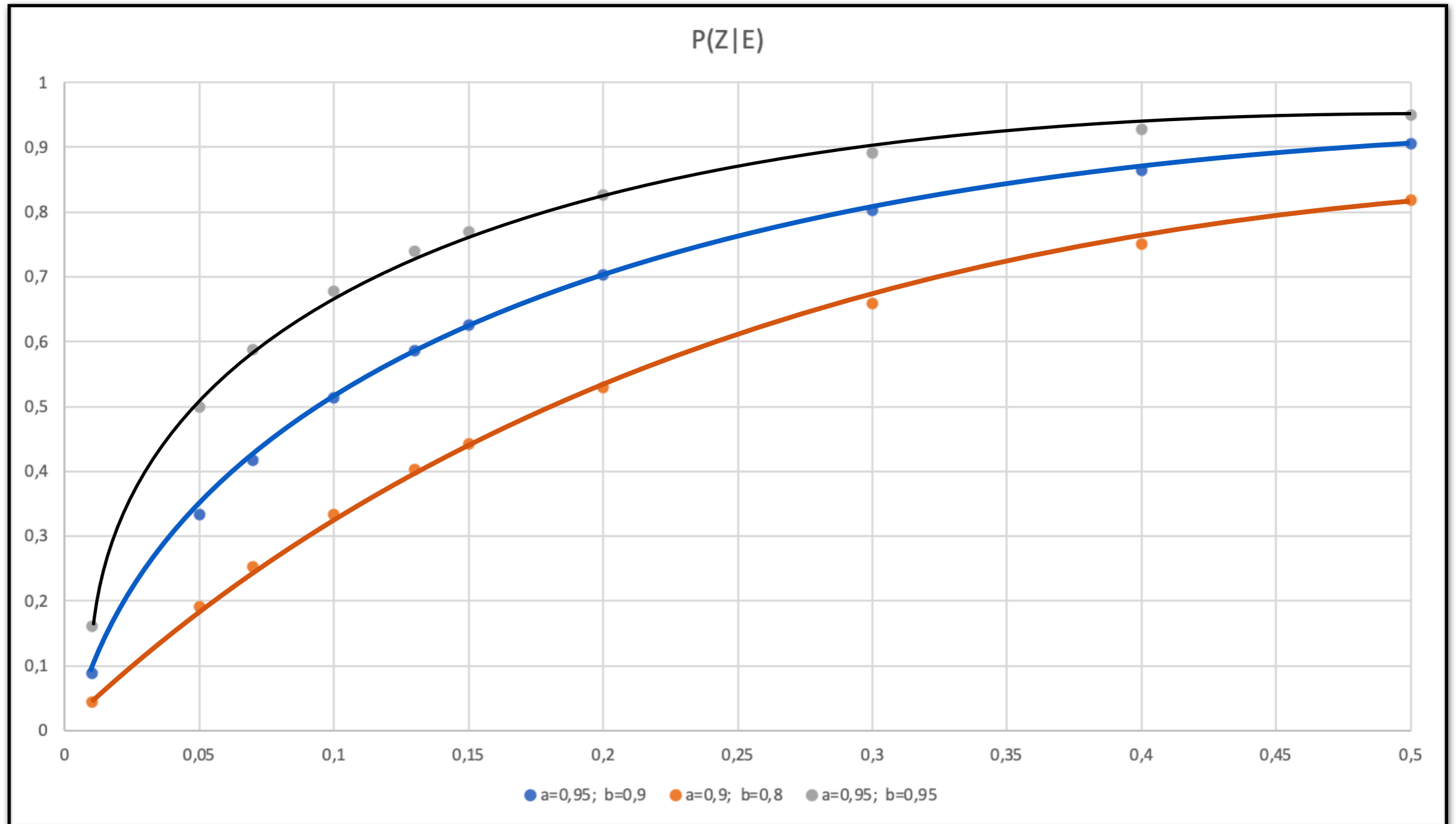
- Předpokládáme, že apriorní pravděpodobnost (= prevalence jevu Z) je známa a je rovna p .
- $P(E | Z) = a$ = pravděpodobnost toho, že test správně detekuje jev Z (=senzitivita testu)
- $P(E^C | Z^C) = b$ = pravděpodobnost toho, že test správně detekuje nepřítomnost jevu Z (=specifita testu)
- $P(E) = P(E|Z).P(Z) + P(E|Z^C).P(Z^C) = a.p + (1-b).(1-p)$ = pravděpodobnost pozitivního testu (=evidence)
- $P(E | Z^C) =$ pravděpodobnost falešně pozitivního výsledku je $(1-b)$
- $P(E^C | Z) =$ pravděpodobnost falešně negativního výsledku je $(1-a)$
- $P(Z|E) = \frac{P(E|Z)P(Z)}{P(E)}$ = pravděpodobnost toho, že pozitivně testovaný člověk bude skutečně nemocný.

Příklad:

Prevalence nemoci v populaci je 10 %. Testy použité k její detekci mají vysokou senzitivitu 95 % a specifitu 90 %. Přesto pravděpodobnost, že pozitivně testovaný člověk tuto nemoc opravdu má, je pouhých 51,4 %



Diagnostické testy



Prevalence nemoci v populaci je 20 %. Testy použité k její detekci mají vysokou senzitivitu 95 % a specifitu 90 %. Přesto pravděpodobnost, že pozitivně testovaný člověk tuto nemoc opravdu má, je 70 %

