3. Zufallsvariablen (ZV)

Lernziele:

- Sie haben einen Vorstellung von dem Begriff Zufallsvariable.
- Sie kennen die Eigenschaften und Unterschiede diskreter und stetiger Verteilungsfunktionen von ZVs.
- Sie können zu einer Dichtefunktion die Verteilungsfunktion einer ZV bestimmen und umgekehrt.
- Sie können mit Hilfe der Verteilungsfunktion Wahrscheinlichkeiten berechnen.
- Sie kennen die Bedeutung von Erwartungswert und Varianz einer ZV, auch in Zusammenhang mit der Chebyshev-Ungleichung.
- Sie verstehen die Bedeutung der Unabhängigkeit von ZVs.
- Sie wenden die Eigenschaften von Erwartungswerten und Varianzen auf transformierte ZVs und Summen von ZVs richtig an.

Literatur:

- Teschl Band 2, Kap. 27
- Arens et al., Kap 38.1 - 38.3
- Zucchini, Kap. 4

3.1 Zufallsvariable

Abbildung des "abstrakten" Ergebnisraums Ω auf $\mathbb{R}$.

Definition Zufallsvariable:

Eine Abbildung $X : \Omega \to \mathbb{R}, \quad \omega \mapsto X(\omega) = x$ heißt Zufallsvariable (ZV).
$x \in \mathbb{R}$ heißt Realisation der ZV X.

- **Diskrete ZV:** $X(\Omega) = \{x_1, \dots, x_n\}$ $(n \in \mathbb{N})$
  z. B. $X =$ "Augensumme beim Würfeln mit 2 Würfeln"
- **Stetige ZV:** $X(\Omega) \subseteq \mathbb{R}$
  z. B. $X =$ "Körpergröße eines Menschen"
- **Eindimensionale ZV:** $X : \Omega \to \mathbb{R}$
- **Mehrdimensionale ZV:** $X : \Omega \to \mathbb{R}^p$
  z. B. $(X_1, X_2) =$ ("Anzahl der Jungen","Anzahl der Mädchen")

3.2 Verteilungsfunktion

Die Wahrscheinlichkeit $P(B)$ für ein Ereignis B in $\mathbb{R}$ wird zurückgeführt auf die Wahrscheinlichkeit der entsprechenden Ereignisse in Ω:

$$P(B) = P(X \in B) = P(X^{-1}(B))$$

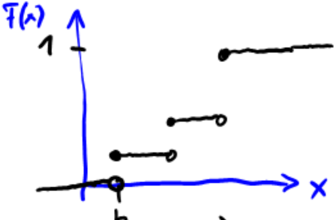
Definition Verteilungsfunktion:

Für jedes $x \in \mathbb{R}$ ist die Verteilungsfunktion $F : \mathbb{R} \to [0,1]$ einer ZV X definiert durch

$$F(x) = P(X \leq x)$$

kumulierte Wahrscheinlichkeiten

Eigenschaften der Verteilungsfunktion:



- $0 \leq F(x) \leq 1$
- $\lim\limits_{x \to -\infty} F(x) = 0, \quad \lim\limits_{x \to \infty} F(x) = 1$
- rechtsseitig stetig, d.h. $\lim\limits_{x \to b+} F(x) = F(b)$
- monoton wachsend
- $P(X > x) = 1 - F(x) = 1 - P(X \leq x)$

$F(b) = P(X \leq b)$

- $P(a < X \leq b) = F(b) - F(a) = P(X \leq b) - P(X \leq a)$

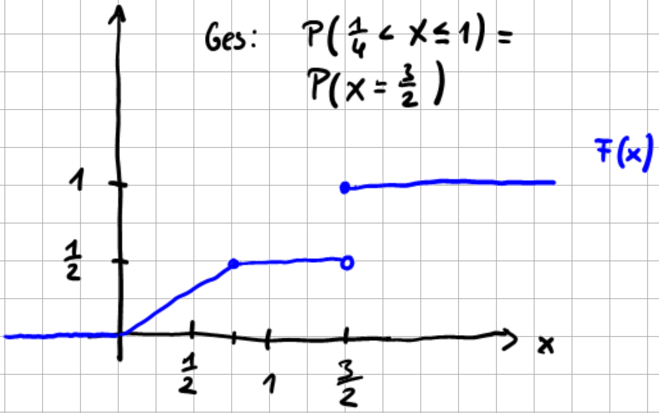
Beispiel:

$$F(x) = \begin{cases} 0 & , \; x < 0 \\ \frac{2}{3}x & , \; 0 \le x < \frac{3}{4} \\ \frac{1}{2} & , \; \frac{3}{4} \le x < \frac{3}{2} \\ 1 & , \; x \ge \frac{3}{2} \end{cases}$$

rechtsseitig stetig ✓

Ges: $P(\frac{1}{4} < X \le 1) =$

$P(X = \frac{3}{2})$



Berechnen Sie $P\left(\frac{1}{4} < X \leq 1\right)$ und $P\left(X = \frac{3}{2}\right)$

$$P\left(\tfrac{1}{4} < X \leq 1\right) = F(1) - F\left(\tfrac{1}{4}\right) = \frac{1}{2} - \frac{2}{3} \cdot \frac{1}{4} = \frac{2}{6} = \frac{1}{3}$$

$$P\left(X = \tfrac{3}{2}\right) = P\left(X \leq \tfrac{3}{2}\right) - P\left(X < \tfrac{3}{2}\right) = F\left(\tfrac{3}{2}\right) - \lim_{x \to \frac{3}{2}-} F(x)$$

$$= 1 - \frac{1}{2} = \frac{1}{2}$$ (Sprunghöhe)

$$P\left(X = \tfrac{1}{2}\right) = P\left(X \leq \tfrac{1}{2}\right) - \lim_{x \to \frac{1}{2}-} F(x) = \frac{1}{3} - \frac{1}{3} = 0$$

(stetiger Übergang)

3.2.1 Diskrete Zufallsvariablen

Definition Wahrscheinlichkeitsverteilung:

Für eine diskrete ZV X mit $X(\Omega) = \{x_1, \ldots, x_n\}$ (n endlich oder abzählbar unendlich) ist die Wahrscheinlichkeitsfunktion definiert durch

$$p(x) = \begin{cases} P(X = x_i), & \text{falls } x = x_i \in X(\Omega) \\ 0, & \text{sonst} \end{cases}$$

Eigenschaften der Wahrscheinlichkeitsverteilung:

- $0 \leq p(x) \leq 1$
- $\sum\limits_{i=1}^{n} p(x_i) = 1$

Es gilt:

- $F(x) = P(X \leq x) = \sum\limits_{x_i \leq x} p(x_i)$
- $F(x)$ ist eine rechtsseitig stetige Treppenfunktion mit Sprüngen bei den Realisationen x_i.

3.2.2 Stetige Zufallsvariablen

Definition Wahrscheinlichkeitsdichte:

Für eine stetige ZV X ist die Wahrscheinlichkeitsdichte $f : \mathbb{R} \to [0, \infty[$ definiert durch

$$P(a < X < b) = \int_a^b f(x)\,\mathrm{d}x$$

Eigenschaften der Wahrscheinlichkeitsdichte:

- $f(x) \geq 0$
- $\int\limits_{-\infty}^{\infty} f(x)\,\mathrm{d}x = 1$

Es gilt:

- $F(x) = P(X \leq x) = \int\limits_{-\infty}^{x} f(t)\,\mathrm{d}t$ und $F'(x) = f(x)$
- $F(x)$ ist stetig und $P(a < X \leq b) = P(a \leq X \leq b) = P(a \leq X < b) = P(a < X < b) = F(b) - F(a)$

Beispiel 3.2.2:
An einer Bushaltestelle fahren die Busse im 10 Minutentakt.
Mit welcher Wahrscheinlichkeit muss eine Person, die zu einem zufälligen Zeitpunkt an die Bushaltestelle kommt $x \in [0, 10[$ Minuten auf den nächsten Bus warten?
Wie groß ist die Wahrscheinlichkeit, dass die Person zwischen 3 und 5 Minuten warten muss?

Was unterscheidet diskrete und stetige Zufallsvariablen?

Diskrete ZV	Stetige ZV

3.3 Erwartungswert

Definition Erwartungswert:

Der Erwartungswert $E[X] = \mu$ einer ZV X ist der Schwerpunkt ihrer Verteilung.

$$\text{Für diskrete ZV:} \quad E[X] = \sum_{i=1}^{n} x_i \cdot p(x_i)$$

$$\text{Für stetige ZV:} \quad E[X] = \int_{-\infty}^{\infty} x \cdot f(x)\,\mathrm{d}x$$

Beispiele 3.3:

(1) Bei einem Gewinnspiel mit 2 Würfeln entspricht der Gewinn der maximal gewürfelten Augenzahl. Jeder Spieler muss einen Einsatz d zahlen. Wie groß muss der Einsatz sein, damit das Spiel fair ist, d.h. der Einsatz dem zu erwartenden Gewinn entspricht?

Beispiele 3.3:

(2) Wie groß ist die durchschnittliche Wartezeit auf einen Bus, der im 10 Minutentakt fährt?

Satz 3.1:

Sei $Y = g(X)$ eine Funktion der ZV X. Dann gilt

- für diskrete ZV: $E[g(X)] = \sum\limits_{i=1}^{n} g(x_i) \cdot p(x_i)$
- für stetige ZV: $E[g(X)] = \int\limits_{-\infty}^{\infty} g(x) \cdot f(x)\,\mathrm{d}x$

Eigenschaften des Erwartungswerts:

- $E[b] = b$
- $E[aX + b] = aE[X] + b$
- $E[X_1 + \cdots + X_n] = \sum\limits_{i=1}^{n} E[X_i]$

Beispiele 3.3:

(3) X sei die Ausfallzeit eines Rechners in einem Rechnernetz mit Dichtefunktion $f(x) = \begin{cases} 1, & \text{falls } 0 < x < 1 \\ 0, & \text{sonst} \end{cases}$

Wie hoch sind die durchschnittlich zu erwartenden Kosten $g(X) = X^3$ (in Hundert Euro) für einen Rechnerausfall?

Beispiele 3.3:

(4) Auf 20 verschiedene Prozessoren, die mit gleicher Wahrscheinlichkeit ausgewählt werden, sollen $k = 10$ Stapelaufträge verteilt werden. Berechnen Sie den Erwartungswert für die Anzahl verschiedener Prozessoren in der Auswahl.
Dabei ist die Anzahl Y verschiedener Prozessoren

$$Y = \sum_{i=1}^{20} X_i \quad \text{mit}\, X_i = \begin{cases} 1, & \text{falls Prozessor } i \text{ mind. einmal ausgewählt} \\ 0, & \text{sonst} \end{cases}$$

3.4 Varianz und Kovarianz

Definition Varianz:

Die Varianz einer ZV X mit Erwartungswert μ ist ein quadratisches Streuungsmaß und ist definiert durch

$$\sigma^2 = Var[X] = E[(X - \mu)^2].$$

Die Standardabweichung $\sigma = \sqrt{Var[X]}$ hat im Gegensatz zur Varianz die gleiche Dimension wie die ZV X.

Satz 3.2: Verschiebungssatz

$$\boxed{Var[X] = E[X^2] - (E[X])^2}$$

Eigenschaften der Varianz:

- $Var[b] = 0$
- $Var[aX + b] = a^2 Var[X]$

Z-Transformation, Standardisierung:

Sei X eine ZV mit Erwartungswert μ und Varianz σ^2. Dann ist

$$Z = \frac{X - \mu}{\sigma}$$

die sog. standardisierte ZV mit Erwartungswert 0 und Varianz 1.

Definition Kovarianz:

Die Kovarianz zweier ZV (X, Y) ist definiert durch

$$Cov[X, Y] = E[(X - E[X])[(Y - E[Y])]$$

Die Kovarianz beschreibt die Abhängigkeit zweier ZV X und Y. Je stärker diese korrelieren, desto (betragsmäßig) größer ist die Kovarianz.
X, Y (stochastisch) unabhängig $\Longrightarrow Cov[X, Y] = 0$

Satz 3.3: Verschiebungssatz Kovarianz

$$\boxed{Cov[X, Y] = E[XY] - E[X] \cdot E[Y]}$$

Eigenschaften der Kovarianz:

- $Cov[X, Y] = Cov[Y, X]$
- $Cov[X, X] = Var[X]$
- $Cov[aX, Y] = a\, Cov[X, Y]$

Für die Varianz einer Summe von ZV gilt:

- $$Var[X_1 + \cdots + X_n] = \sum_{i=1}^{n} \sum_{j=1}^{n} Cov[X_i, X_j]$$
  $$Var[X_1 + X_2] = Var[X_1] + Var[X_2] + 2Cov[X_1, X_2]$$
- Falls X_i, X_j paarweise unabhängig:
  $$\boxed{Var[X_1 + \cdots + X_n] = \sum_{i=1}^{n} Var[X_i]}$$

Beispiel 3.4:

Ein Kommunikationssystem besteht aus 10 Komponenten, die unabhängig voneinander mit Wahrscheinlichkeit $p = 0.1$ funktionieren. Bestimmen Sie die Varianz der ZV $Y =$ "Anzahl der funktionsfähigen Komponenten":

$$Y = \sum_{i=1}^{10} X_i \quad \text{mit}\, X_i = \begin{cases} 1, & \text{falls Komponente } i \text{ funktioniert} \\ 0, & \text{sonst} \end{cases}$$

Übersicht: Eigenschaften von Erwartungswert und Varianz

Erwartungswert

- $E[aX + b] = aE[X] + b$
- $E[X_1 + \cdots + X_n] = \sum_{i=1}^{n} E[X_i]$
- Falls X_1, X_2 unabhängig:

  $E[X_1 X_2] = E[X_1] \cdot E[X_2]$

Varianz

- $Var[aX + b] = a^2 Var[X]$
- Falls X_i, X_j paarweise unabhängig:

  $Var[X_1 + \cdots + X_n] = \sum_{i=1}^{n} Var[X_i]$

3.5 Quantile

Definition p-Quantil:

Sei X eine ZV mit Verteilungsfunktion $F(x)$ und $0 < p < 1$.
Dann ist das p-Quantil definiert als der kleinste Wert $x_p \in \mathbb{R}$ für den gilt:

$$F(x_p) \geq p.$$

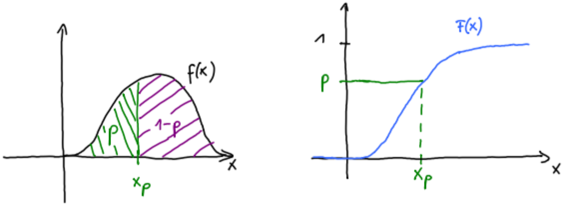


Abbildung: p-Quantil einer stetigen ZV mit **streng** monoton wachsendem $F(x)$:

$$x_p = F^{-1}(p)$$

Beispiel 3.5:
Gegeben ist die Verteilungsfunktion

$$F(x) = \begin{cases} 0, & x < 0 \\ \frac{2}{3}x, & 0 \leq x < \frac{3}{4} \\ \frac{1}{2}, & 0 \leq \frac{3}{4} \leq x < \frac{3}{2} \\ 1, & 0 \leq x \geq \frac{3}{2} \end{cases}$$

Bestimmen Sie das 1., 2. und 3. Quartil.

3.6 Chebyshev-Ungl., schwaches Gesetz der großen Zahlen

Satz 3.4: Chebyshev-Ungleichung

Sei X eine ZV mit Erwartungswert μ und Varianz σ^2. Dann gilt für eine beliebige reelle Zahl $k > 0$:

$$P(|X - \mu| \geq k\sigma) \leq \frac{1}{k^2}$$

Mit der Chebyshev-Ungleichung und

$\mu = E[X_i] \quad (i = 1, \ldots, n) \quad \Longrightarrow \quad \mu = E\left[\frac{X_1 + \cdots + X_n}{n}\right] = E[\bar{X}]$ folgt

Satz 3.5: Schwaches Gesetz der großen Zahlen

Sei $X_1, X_2, \ldots$ eine Folge von unabhängigen, identisch verteilten Zufallsvariablen mit Erwartungswert $E[X_i] = \mu$ und Varianz $Var[X_i] = \sigma^2$.
Dann gilt für ein beliebig kleines $\epsilon > 0$:

$$P\left(\left|\bar{X} - \mu\right| > \epsilon\right) \to 0 \quad \text{für } n \to \infty$$

d.h. der MW $\bar{X}$ konvergiert stochastisch gegen den EW μ.