

Laplace-Experiment

P(E) = |E| / |Ω| = Anzahl günstige Ergebnisse / Anzahl aller Ergebnisse → Gleichverteilung

Produkte

|A1 × A2 × ... × Ak| = |A1| * |A2| * ... * |Ak|

Summen

|A1 ∪ A2 ∪ ... ∪ Ak| = |A1| + |A2| + ... + |Ak|

Fakultät

n! := n * (n - 1) * ... * 2 * 1 ~ √(2 * π * n) * (n/e)^n

Binominalkoeffizient

(n choose k) := n! / ((n - k)! * k!)

Urnenmodel

	zurücklegen	nicht zurücklegen
geordnet	n^k	n! oder n! / (n - k)!
ungeordnet	(k + n - 1 choose k)	(n choose k) = n! / (k! * (n - k)!)

allgemeine Wahrscheinlichkeiten

P(E1 ∪ E2 ∪ E3 ∪ ...) = P(E1) + P(E2) + P(E3) + ...
∀ E1, E2 ⊆ Ω : P(E1 ∪ E2) = P(E1) + P(E2) - P(E1 ∩ E2)
E = {e1, e2, ...} → P(E) = P({e1}) + P({e2}) + ...

Z-Dichte

Die Funktion f_P : Ω → [0, 1] mit f_P(w) = P({w}) heisst Zähldichte von P.

P(E) = ∑_{e ∈ E} f_P(e)
P(E) = ∑_{e ∈ Ω} f_P(e) = 1

bedingte Wahrscheinlichkeit

Es sei B ⊆ Ω mit P(B) > 0. Dann heisst P(A|B) (elementare) bedingte Wahrscheinlichkeit von A unter B.

P(A|B) := P(A ∩ B) / P(B)

Formel von Bayes

P(A|B) = P(A) / P(B) * P(B|A)

totale Wahrscheinlichkeit

Es sei B_i (i ∈ I) eine Zerlegung von Ω (d.h. die B_i sind paarweise disjunkt und Ω = ∪_{i ∈ I} B_i) mit P(B_i) > 0.

P(A) = ∑_{i ∈ I} P(A|B_i) * P(B_i)

positive prädiktive Wert

Für 0 < P(A) < 1 gilt mit Ω = A ∪ A^c insbesondere:

P(A|B) = (P(A) * P(A|B)) / (P(B|A) * P(A) + P(B|A^c) * P(A^c))

stochastische Unabhängigkeit

Zwei Ereignisse A, B ⊆ Ω heissen stochastisch unabhängig, falls

P(A ∩ B) = P(A) * P(B) ≡ P(A|B) = P(A) ← (B ≠ ∅)

Mehrstufige Zufallsexperimente

Gegeben ist eine Urne mit 4 weissen und 2 schwarzen Kugeln. Wir ziehen dreimal ohne Zurücklegen: Was ist die Wahrscheinlichkeit A: "Dritte Kugel weiss"?
Ω = {w, s} × {w, s} × {w, s} und A = {(w, w, w), (w, s, w), (s, w, w), (s, s, w)}

P(A) = f(w, w, w) + f(w, s, w) + f(s, w, w) + f(s, s, w)

Verteilungsfunktion

Es sei X : Ω → X eine Zufallsvariable, wobei X ∈ ℝ eine endliche oder abzählbare Menge ist. Zudem sei f die Zähldichte von X.

F(x) = P(X ≤ x) = ∑_{t ∈ X : t ≤ x} f(t)

Erwartungswert, Varianz & Standardabweichung

E(X) = ∑_{x ∈ X} x * f(x) = ∑_{x ∈ X} x * P(X = x)
V(X) = ∑_{x ∈ X} (x - E)^2 * f(x) = ∑_{x ∈ X} (x - E)^2 * P(X = x) = E(X^2) - E(X)^2
σ(X) = √V(X)

Bernoulli-Verteilung

kann zwei Werte annehmen, 0 (Treffer) oder 1 (kein Treffer)

$$\begin{aligned}X &\sim B(p) : P(0) = 1 - p \\P(1) &= p \\E(X) &= p \\V(X) &= p * (1 - p)\end{aligned}$$

Binomial-Verteilung

Anzahl Treffer (Wahrscheinlichkeit p) in n unabhängigen Versuchen

$$\begin{aligned}X &\sim Bin(n, p) : P(X = k) = \binom{n}{k} * p^k * (1 - p)^{n-k}, k = 0, 1, \dots, n \\E(X) &= n * p \\V(X) &= n * p * (1 - p)\end{aligned}$$

Dichte: binopdf(k, n, p) | **Verteilungsfunktion:** binocdf(k, n, p)

geometrische-Verteilung

Versuche bis erster Treffer (Wahrscheinlichkeit p) in n unabhängigen Versuchen

$$\begin{aligned}X &\sim Geo(n, p) : P(X = k) = (1 - p)^{k-1} * p, k = 0, 1, \dots, n \\E(X) &= \frac{1}{p} \\V(X) &= \frac{1 - p}{p^2}\end{aligned}$$

Dichte: geopdf($k - 1, p$) | **Verteilungsfunktion:** geocdf($k - 1, p$)

Poisson-Verteilung

Verteilung für seltene Ereignisse mit im Schnitt λ Ereignisse pro Zeit/Ort

$$\begin{aligned}X &\sim Poi(\lambda) : P(X = k) = \frac{\lambda^k}{k!} * e^{-\lambda}, k = 0, 1, \dots, n \\E(X) &= \lambda \\V(X) &= \lambda\end{aligned}$$

Dichte: poisspdf(k, λ) | **Verteilungsfunktion:** poisscdf(k, λ)

stetige Zufallsvariable

→ kontinuierlicher Wertebereich

→ beschreibt Wahrscheinlichkeit das ZV Wert in Bereich annimmt.

→ Wahrscheinlichkeit als Dichte ausgedrückt.

$$\text{Dichtefunktion} : P(a \leq X \leq b) = \int_a^b f(x)dx$$

$$\text{Erwartungswert} : E(X) = \int_{-\infty}^{\infty} x * f(x)dx$$

$$\text{Varianz} : V(X) = \int_{-\infty}^{\infty} (x - E(X))^2 * f(x)dx = E(X^2) - E(X)^2$$

$$\text{Standardabweichung} : \sigma(X) = \sqrt{V(X)}$$

$$\text{Verteilungsfunktion} : F(x) = P(X \leq x) = \int_{-\infty}^x f(t)dt$$

stetige Gleichverteilung-Verteilung

die konstante Dichte für $s \leq x \leq t$ auf dem Intervall $[s, t]$.

$$X \sim U[s, t] : f(x) = \frac{1}{t - s}$$

$$E(x) = \frac{s + t}{2}$$

$$V(x) = \frac{1}{12} * (t - s)^2$$

Standardnormalverteilung

$$X \sim N(0, 1) : \varphi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} * e^{-\frac{x^2}{2}}$$

$$E(x) = 0$$

$$V(x) = 1$$

Dichte: normpdf(x) | **Verteilungsfunktion:** normcdf(x)

Normalverteilung

Die Normalverteilung mit Parametern μ und σ .

$$X \sim N(\mu, \sigma) : \varphi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma^2}} * e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}$$

$$E(x) = \mu$$

$$V(x) = \sigma$$

Dichte: normpdf(x, μ, σ) | **Verteilungsfunktion:** normcdf(x, μ, σ)

Standardisierung: $X \sim M(\mu, \sigma) \rightarrow X - \mu \sim N(0, \sigma) \rightarrow Z \sim N(0, 1)$ mit $Z = \frac{x - \mu}{\sigma}$

Quantil: Gegeben $\alpha \in (0, 1)$. Für welche z_α gilt $P(x \leq z_\alpha) = \alpha$

Matlab: $x = \text{norminv}(p)$

Exponentialverteilung

Die Wahrscheinlichkeit dass X einen Wert grösser als t annimt, sinkt exponentiell.

$$X \sim Exp(\lambda) : P(X \geq t) = e^{-\lambda t}$$
$$E(x) = \frac{1}{\lambda}$$
$$V(x) = \frac{1}{\lambda^2}$$

Dichte: $\text{exp pdf}(k, \frac{1}{\lambda})$ | Verteilungsfunktion: $\text{exp cdf}(k, \frac{1}{\lambda})$

Eigenschaften

$$E(X + Y) = E(X) + E(Y)$$
$$E(a * X) = a * E(X)$$
$$E(X + c) = E(X) + c$$
$$V(X + c) = V(X)$$
$$V(a * X) = a^2 * V(X)$$
$$E(g(X)) = \sum_x g(x) * P(X = x) \leftarrow [\mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}]$$
$$E(g(X)) \neq g(E(X))$$

Unabhängigkeit

$$P(X_1 \leq x_1, X_2 \leq x_2, \dots, X_n \leq x_n) = P(X_1 \leq x_1) * P(X_2 \leq x_2), \dots, P(X_n \leq x_n)$$
$$P(g(X, Y) = z) = \sum_{x \in \mathcal{X}} \sum_{y \in \mathcal{Y} : g(x, y) = z} f_X(x) * f_Y(y)$$
$$X \sim Poi(\lambda_1), Y \sim Poi(\lambda_2) \Rightarrow X + Y \sim Poi(\lambda_1 + \lambda_2)$$
$$X \sim Bin(n_1, p), Y \sim Bin(n_2, p) \Rightarrow X + Y \sim Bin(n_1 + n_2, p)$$

Additionstheorem der Normalverteilung

$$a_1 X_1 + a_2 X_2 + \dots + a_n X_n \sim N(a_1 \mu_1 + a_2 \mu_2 + \dots + a_n \mu_n, \sqrt{a_1^2 \sigma_1^2 + a_2^2 \sigma_2^2 + \dots + a_n^2 \sigma_n^2})$$

Eigenschaft von Erwartungswert und Varianz

Es seien X und Y Zufallsvariablen und $a, c \in \mathbb{R}$. Dan gilt:

$$E(X + Y) = E(X) + E(Y)$$
$$E(aX) = aE(X)$$
$$E(X + c) = E(X) + c$$
$$V(X + c) = V(X)$$
$$V(aX) = a^2 V(X)$$

Falls X und Y unabhängig sind: $V(X + Y) = V(X) + V(Y)$

Wenn X diskret ist und f_X die Zählchte von X: $E(g(X)) = \sum_x g(x) * f_X(x)$

Wenn X stetig ist und f_X ide Dichte von X: $E(g(X)) = \int_{-\infty}^{\infty} g(x) * f_X(x) dx$

Ungleichung von Tschabyscheff

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

Diese Abschätzung gilt für alle möglichen Verteilungen von X. Sie ist deshalb in manchen Fällen recht grob.

Grenzwertsätze: Gesetz der Grossen Zahlen

$$P(|\frac{X}{n} - p| \geq \epsilon) \rightarrow 0 (n \rightarrow \infty)$$

Zentraler Grenzwertsatz

$$S_n = X_{1..} + X_n \mu_n = n . \mu$$
$$\sigma_n = \sqrt{n} . \sigma \frac{S_n - \mu_n}{\sqrt{n} . \sigma} \sim N(0, 1)$$

Moivre und Laplace Grenzwertsatz

$Bin(n, p)$ als Summe von n $B(p)$ variablen

$$P(a \leq X \leq b) \approx \sigma(\frac{b - np}{\sqrt{np(1 - p)}}) - \sigma(\frac{a - np}{\sqrt{np(1 - p)}})$$

T Verteilung

Benutzt um σ zu Schätzen: (t verteilt mit $n-1$ Freiheitsgraden)

$$T = \sqrt{n} \frac{\overline{X} - \mu}{\sqrt{\frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (X_i - \overline{X})^2}}$$

Statistische Tests

1. Man stellt die Nullhypothese H_0 und die Alternativhypothese H_1 auf. Das bestmögliche Ergebnis ist die Widerlegung von H_0
2. Man wählt ein Testverfahren zb Experimente oder Stichproben
3. Aufgrund des gewählten Tests bestimmt man die so genannte Testgrösse
4. Man wählt ein Signifikanzniveau α und bestimmt aufgrund dessen den Verwerfungsbereich. Dieser wird so festgelegt, dass bei Zutreffen von H_0 die Testgrösse mit Wahrscheinlichkeit $\leq \alpha$ dort drin liegt.
5. Liegt der gemäss (3) berechnete Wert der Testgrösse im Verwerfungsbereich, so lehnen wir H_0 ab. Man sagt in diesem Fall, auch, das Ergebniss des Tests sei signifikant auf dem α -niveau

Konfidenzintervall

$$\frac{X - np}{\sqrt{np(1-p)}} \sim N(0, 1)$$

$$\alpha = \frac{1+Q}{2}$$

$$\left[\frac{1}{n + z_\alpha^2} \left(X + \frac{z_\alpha^2}{2} - z_\alpha \sqrt{\frac{X(n-X)}{n} + \frac{z_\alpha^2}{4}} \right), \frac{1}{n + z_\alpha^2} \left(X + \frac{z_\alpha^2}{2} + z_\alpha \sqrt{\frac{X(n-X)}{n} + \frac{z_\alpha^2}{4}} \right) \right]$$
$$\left[\frac{k}{n} - \frac{z_\alpha}{n} \sqrt{\frac{k(n-k)}{n}}, \frac{k}{n} + \frac{z_\alpha}{n} \sqrt{\frac{k(n-k)}{n}} \right]$$

Hypothesen

H_0 Nullhypothese / H_1 Alternativhypothese

Fehler 1 Art: H_0 trifft zu aber verwerfen.

Fehler 2 Art: H_0 trifft **nicht** zu aber nicht verwerfen

Signifikanzniveau α Verwerfungsbereich - Wahrscheinlichkeit für F. 1 Art höchstens α

$X \in V_{bereich} \rightarrow H_0$ ungültig das Gegenteil gilt auch. Gegenteil ist aber zu schwach für definitven Beweis.