

1 Theorie

1.1 Wahrscheinlichkeitsraum

1.1.1 Definition

Ein Wahrscheinlichkeitsraum ist ein Tripel (Ω, \mathcal{A}, P) bestehend aus der Grundmenge Ω , einer σ -Algebra $\mathcal{A} \subseteq \mathcal{P}(\Omega)$ und einer Abbildung $P : \mathcal{A} \rightarrow [0, 1]$

$$(i) P(\Omega) = 1$$

$$(ii) P\left(\bigcup_i A_i\right) = \sum_i P(A_i), \text{ mit } A_i \cap A_j = \emptyset \text{ f\"ur } i \neq j$$

Die Elemente von Ω werden elementare Ereignisse und die von \mathcal{A} Ereignisse genannt. Mengen M mit $P(M) = 0$ werden Nullmengen genannt. Die Abbildung P wird Wahrscheinlichkeitsmaß genannt.

1.1.2 σ -Algebra

Es sei Ω eine Menge und $\mathcal{A} \subset \mathcal{P}(\Omega)$ ein System von Teilmengen (= Ereignissen). \mathcal{A} heißt σ -Algebra (Sigma-Algebra) falls gilt:

$$(i) \Omega \in \mathcal{A}$$

$$(ii) A \in \mathcal{A} \Rightarrow A^c \in \mathcal{A}$$

$$(iii) A_i \in \mathcal{A} \Rightarrow \bigcup_i A_i \in \mathcal{A}$$

$$(A^c = \Omega \setminus A)$$

1.1.3 Diskreter Wahrscheinlichkeitsraum

Ein diskreter Wahrscheinlichkeitsraum ist ein Wahrscheinlichkeitsraum (Ω, \mathcal{A}, P) , bei dem die Grundmenge Ω abzählbar ist und die Menge der Ereignisse $\mathcal{A} := \mathcal{P}(\Omega)$ der Potenzmenge entspricht.

1.1.4 Laplace Experiment

Ein Laplace-Experiment ist ein Zufallsexperiment bei dem der Ereignisraum Ω endlich viele Elemente und ein Ereignis $A \subseteq \Omega$ die Wahrscheinlichkeit $P(A) = \frac{\#A}{\#\Omega}$ hat.

1.2 Zufallsvariablen

1.2.1 Allgemeine Zufallsvariable

Sei (Ω, \mathcal{A}, P) ein Wahrscheinlichkeitsraum und (Ω', \mathcal{A}') ein Messraum. Eine Zufallsvariable ist eine Abbildung

$$X : \Omega \rightarrow \Omega'$$

so dass für alle Ereignisse $A' \in \mathcal{A}'$

$$X^{-1}(A') \in \mathcal{A}$$

ein Ereignis in \mathcal{A} ist. Urbilder von Ereignissen sind also Ereignisse.

1.2.2 Messraum

Ein Messraum ist ein Paar (Ω, \mathcal{A}) bestehend aus einer Menge Ω und einer Sigma-Algebra $\mathcal{A} \subset \mathcal{P}(\Omega)$.

1.2.3 Reelle Zufallsvariable

Unter einer reellen Zufallsvariable verstehen wir eine Zufallsvariable

$$X : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^n$$
$$X(\omega) := \left(X_1(\omega), \dots, X_n(\omega) \right),$$

wobei (Ω, \mathcal{A}, P) ein Wahrscheinlichkeitsraum ist und $(\mathbb{R}^n, \mathcal{B}(\mathbb{R}^n))$ der \mathbb{R}^n zusammen mit der Borel'schen Sigma-Algebra ist.

1.3 Erwartungswert

1.3.1 Definition

Für eine reelle, integrierbare Zufallsvariable X ist der Erwartungswert definiert durch

$$\mathbb{E}(X) := \int_{\Omega} X \, dP.$$

Ist (Ω, \mathcal{A}, P) ein diskreter Wahrscheinlichkeitsraum und $X : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ eine eindimensionale reelle Zufallsvariable, so ist

$$\mathbb{E}(X) = \sum_{\omega \in \Omega} X(\omega) \cdot P(\omega)$$

1.3.2 Eigenschaften

Sind $X, Y : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^n$ reelle, integrierbare Zufallsvariablen und $a, b \in \mathbb{R}$ konstant, so gilt:

$$\begin{aligned} \mathbb{E}(a \cdot X \pm b \cdot Y) &= a \cdot \mathbb{E}(X) \pm b \cdot \mathbb{E}(Y) \\ \forall x \in \Omega : X(x) \leq Y(x) &\Rightarrow \mathbb{E}(X) \leq \mathbb{E}(Y) \\ X, Y \text{ stoch. unabhängig} &\Rightarrow \mathbb{E}(X \cdot Y) = \mathbb{E}(X) \cdot \mathbb{E}(Y) \\ \mathbb{E}(1_A) &= P(A) \end{aligned}$$

1.4 Varianz

Für eine reelle Zufallsvariable X ist die Varianz definiert durch

$$\mathbb{V}(X) := \mathbb{E}((X - \mathbb{E}(X))^2) = \mathbb{E}(X^2) - \mathbb{E}(X)^2$$

1.5 Verteilungen

1.5.1 Normalverteilung

Die Normalverteilung $N(\mu, \sigma^2)$ auf \mathbb{R} ist definiert durch

$$\begin{aligned} \text{Dichte: } f(x) &:= \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{1}{2}\left(\frac{x-\mu}{\sigma}\right)^2} \\ \Rightarrow \text{Verteilung: } F(x) = N(\mu, \sigma^2)(-\infty, x) &= \int_{-\infty}^x \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{1}{2}\left(\frac{t-\mu}{\sigma}\right)^2} dt \end{aligned}$$

Erwartungswert und Varianz bei $X \sim N(\mu, \sigma^2)$:

$$\begin{aligned} \mathbb{E}(X) &= \mu \\ \mathbb{V}(X) &= \sigma^2 \end{aligned}$$

1.5.2 Verteilungsfunktion

Für eine reelle Zufallsvariable X heißt

$$\begin{aligned} F_X : \Omega &\rightarrow [0, 1] \\ F_X(x) &:= P(X \leq x) := P_X((-\infty, x]) = P(X^{-1}((-\infty, x])) \end{aligned}$$

Verteilungsfunktion von X .

1.5.3 Gleichverteilung

Die Gleichverteilung $U(a, b)$ auf einem Intervall $(a, b) \subset \mathbb{R}$ ist definiert durch

$$\begin{aligned} \text{Dichte: } f(x) &:= \frac{1_{(a,b)}}{|b-a|} \\ \text{Verteilung: } F(x) = P_f((-\infty, x]) &= \int_{-\infty}^x \frac{1_{(a,b)}}{|b-a|} dt \\ &= \begin{cases} 0 & \text{für } x \leq a \\ \frac{x-a}{|b-a|} & \text{für } a \leq x \leq b \\ 1 & \text{für } x \geq b \end{cases} \end{aligned}$$

Erwartungswert und Varianz bei $X \sim U(a, b)$:

$$\begin{aligned} \mathbb{E}(X) &= \frac{a+b}{2} \\ \mathbb{V}(X) = \mathbb{E}(X^2) - (\mathbb{E}(X))^2 &= \frac{1}{3} \frac{b^3 - a^3}{b-a} - \left(\frac{a+b}{2}\right)^2 \\ &= \frac{1}{12}(b-a)^2 \end{aligned}$$

1.5.4 Dichte

Sei $\Omega \subset \mathbb{R}^n$ und (Ω, \mathcal{A}) ein Messraum, wobei alle $A \in \mathcal{A}$ Lebesgue-messbar sind. Eine Funktion $f : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ heißt Dichte, falls für ihr Lebesgue-Integral $\int_{\Omega} f d\mu = 1$ gilt.

1.6 Schwaches Gesetz der großen Zahlen

1.6.1 Definition

Seien $X_i : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ unabhängige, reelle Zufallsvariablen mit $\mathbb{E}(X_i) = \mu < \infty$ und $\mathbb{V}(X_i) = \sigma < \infty$, dann gilt

$$P\left(\left|\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i - \mu\right| \geq \epsilon\right) \leq \frac{\sigma}{n \cdot \epsilon^2} \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0$$

(stochastische Konvergenz).

1.6.2 Bedeutung

Das schwache Gesetz der großen Zahlen besagt, dass das arithmetische Mittel einer großen Stichprobe einer Zufallsvariable mit einer beliebig kleinen Wahrscheinlichkeit dem Erwartungswert der Zufallsvariable entspricht.

Gegenteilige (äquivalente) Formulierung:

Die Wahrscheinlichkeit, dass die Differenz zwischen beobachteter relativer Häufigkeit und theoretischer Wahrscheinlichkeit kleiner ist als eine beliebig kleine positive Zahl ϵ , ist für eine unendlich große Stichprobe praktisch 1.

1.7 Zentraler Grenzwertsatz

1.7.1 Definition

Sei (Ω, \mathcal{A}, P) ein Wahrscheinlichkeitsraum und $X_n : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ eine Folge stochastisch unabhängiger, identisch verteilter, reeller Zufallsvariablen mit $\mathbb{E}(X_n) = \mu$ und $\mathbb{V}(X_n) = \sigma^2$. Dann gilt für das arithmetische Mittel $S_n := \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i$

$$P_{\frac{\sqrt{n}}{\sigma}(S_n - \mu)} \rightarrow P_{N(0,1)}$$

wobei $P_{N(0,1)}$ das Wahrscheinlichkeits-Maß mit der Dichte $\frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{1}{2}x^2}$ ist.

1.7.2 Bedeutung

Die Summe von n identisch verteilten, stochastisch unabhängigen Zufallsvariablen ist näherungsweise normalverteilt.

Beispiel Würfel:

Die Augensumme von $n \rightarrow \infty$ Würfeln ist normalverteilt, wenn alle Würfel voneinander stochastisch unabhängig und gleichverteilt sind.