

1 Grundlagen

1.1 Wahrscheinlichkeitsräume

D 1.1 Sigma-Algebra

- $\omega \in \mathcal{F}$
- $A \in \mathcal{F} \implies A^c \in \mathcal{F}$
- $A_1, A_2, \dots \in \mathcal{F} \implies \bigcup_{i=1}^{\infty} A_i \in \mathcal{F}$

D 1.2 Wahrscheinlichkeitsmass

- $\mathcal{P}[\omega] = 1$
- σ – Additivität $\mathcal{P}[A] = \sum_{i=1}^{\infty} \mathcal{P}[A_i]$
if $A = \bigcup_{i=1}^{\infty} A_i$ (disjunkte Vereinigung)

D 1.3 Wahrscheinlichkeitsraum

Sei ω ein Grundraum, \mathcal{F} eine σ -Algebra und \mathcal{P} ein Wahrscheinlichkeitsmass. Wir nennen das Tripel $(\omega, \mathcal{F}, \mathcal{P})$ Wahrscheinlichkeitsraum.

D 1.5 Laplace Modell

- $\mathcal{F} = \mathcal{P}(\omega)$
- $\mathbb{P} : \rightarrow [0, 1]$ ist definiert durch

$$\forall A \in \mathcal{F} \mathbb{P}[A] = \frac{|A|}{|\omega|}$$

1.2 Eigenschaften von Ereignissen

S 1.6 Für eine Sigma-Algebra \mathcal{F} auf ω gilt:

- $\emptyset \in \mathcal{F}$
- $A_1, A_2, \dots \in \mathcal{F} \implies \bigcap_{i=1}^{\infty} A_i \in \mathcal{F}$
- $A, B \in \mathcal{F} \implies A \cup B \in \mathcal{F}$
- $A, B \in \mathcal{F} \implies A \cap B \in \mathcal{F}$

1.3 Eigenschaften von Wahrscheinlichkeitsmassen

S 1.7

- $\mathbb{P}[\emptyset] = 0$
- A_1, \dots, A_k paarweise disjunkte Ereignisse,
 $\mathbb{P}[A_1 \cup \dots \cup A_k] = \mathbb{P}[A_1] + \dots + \mathbb{P}[A_k]$
- $\mathbb{P}[A^c] = 1 - \mathbb{P}[A]$
- $\mathbb{P}[A \cup B] = \mathbb{P}[A] + \mathbb{P}[B] - \mathbb{P}[A \cap B]$

S 1.8 Seien $A, B \in \mathcal{F}$ dann gilt

$$A \subset B \implies \mathbb{P}[A] \leq \mathbb{P}[B]$$

S 1.9 Sei A_1, A_2, \dots eine Folge von nicht notwendigerweise disjunkten Ereignissen, dann gilt:

$$\mathbb{P}\left[\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i\right] \leq \sum_{i=1}^{\infty} \mathbb{P}[A_i]$$

1.4 Bedingte Wahrscheinlichkeit

D 1.13 Bedingte Wahrscheinlichkeit

Sei $(\omega, \mathcal{F}, \mathbb{P})$ ein Wahrscheinlichkeitsraum. Seien A, B zwei Ereignisse mit $\mathbb{P}[B] > 0$

$$\mathbb{P}[A|B] = \frac{\mathbb{P}[A \cap B]}{\mathbb{P}[B]}$$

S 1.16 Gesetz der totalen Wahrscheinlichkeit

Sei B_1, \dots, B_n eine Partition des Grundraumes ω , so dass $\mathbb{P}[B_i] > 0$ für jedes $1 \leq i \leq n$ gilt. Dann gilt:

$$\forall A \in \mathcal{F} \mathbb{P}[A] = \sum_{i=1}^n \mathbb{P}[A|B_i] \mathbb{P}[B_i]$$

S 1.17 Satz von Bayes

Sei $B_1, \dots, B_n \in \mathcal{F}$ eine Partition von ω sodass, $\mathbb{P}[B_i] > 0$ für jedes i gilt. Für jedes Ereignis A mit $\mathbb{P}[A] > 0$ gilt

$$\forall i = 1, \dots, n \mathbb{P}[B_i|A] = \frac{\mathbb{P}[A|B_i] \mathbb{P}[B_i]}{\sum_{j=1}^n \mathbb{P}[A|B_j] \mathbb{P}[B_j]}$$

1.5 Unabhängigkeit

D 1.18 Unabhängigkeit

Sei $(\omega, \mathcal{F}, \mathbb{P})$ ein Wahrscheinlichkeitsraum. Zwei Ereignisse A und B heissen unabhängig falls

$$\mathbb{P}[A \cap B] = \mathbb{P}[A] \mathbb{P}[B]$$

S 1.20

Seien A, B $\in \mathcal{F}$ zwei Ereignisse mit $\mathbb{P}[A], \mathbb{P}[B] > 0$. Dann sind folgende Aussagen äquivalent:

1. $\mathbb{P}[A \cap B] = \mathbb{P}[A] \mathbb{P}[B]$
2. $\mathbb{P}[A|B] = \mathbb{P}[A]$
3. $\mathbb{P}[B|A] = \mathbb{P}[B]$

D 1.21

Sei I eine beliebige Indexmenge. Eine Familie von Ereignissen $(A_i)_{i \in I}$ heisst unabhängig falls

$$\forall J \subset I \text{ endlich} \quad \mathbb{P}\left[\bigcap_{j \in J} A_j\right] = \prod_{j \in J} \mathbb{P}[A_j]$$

Bem:

Drei Ereignisse A, B und C sind unabhängig falls alle 4 folgenden Gleichungen erfüllt sind

1. $\mathbb{P}[A \cap B] = \mathbb{P}[A] \mathbb{P}[B]$
2. $\mathbb{P}[A \cap C] = \mathbb{P}[A] \mathbb{P}[C]$
3. $\mathbb{P}[B \cap C] = \mathbb{P}[B] \mathbb{P}[C]$
4. $\mathbb{P}[A \cap B \cap C] = \mathbb{P}[A] \mathbb{P}[B] \mathbb{P}[C]$

2 Zufallsvariablen und Verteilungsfunktionen

2.1 Abstrakte Definition

D 2.1 Zufallsvariable

Sei $(\omega, \mathcal{F}, \mathbb{P})$ ein Wahrscheinlichkeitsraum. Eine Zufallsvariable ist eine Abbildung $X : \omega \rightarrow \mathbb{R}$ so dass, für alle $a \in \mathbb{R}$ gilt

$$\{w \in \omega : X(w) \leq a\} \in \mathcal{F}$$

Bem:

Für Ereignisse im Bezug auf Z:V

- $\{X \leq a\} = \{w \in \omega : X(w) \leq a\}$
- $\{a < X \leq b\} = \{w \in \omega : a < X(w) \leq b\}$
- $\{X \in \mathbb{Z}\} = \{w \in \omega : X(w) \in \mathbb{Z}\}$

$$\mathbb{P}[X \leq a] = \mathbb{P}[\{X \leq a\}] = \mathbb{P}[\{w \in \omega : X(w) \leq a\}]$$

2.2 Verteilungsfunktion

D 2.2 Verteilungsfunktion

Sei X eine Zufallsvariable auf einem W-Raum $(\omega, \mathcal{F}, \mathbb{P})$. Die Verteilungsfunktion von X ist eine Funktion $F_X : \mathbb{R} \rightarrow [0, 1]$, definiert durch

$$\forall a \in \mathbb{R} F_X(a) = \mathbb{P}[X \leq a]$$

S 2.3 Einfache Identität

Seien $a < b$ zwei reelle Zahlen. Dann gilt

$$\mathbb{P}[a < X \leq b] = F(b) - F(a)$$

T 2.4 Eigenschaften der Verteilungsfunktion

Sei X eine Z.V auf einem Wahrscheinlichkeitsraum. Die Verteilungsfunktion $F = F_X : \mathbb{R} \rightarrow [0, 1]$ von X erfüllt folgende Eigenschaften

- F ist monoton wachsend
- F ist rechtsstetig
- $\lim_{a \rightarrow -\infty} F(a) = 0$ und $\lim_{a \rightarrow \infty} F(a) = 1$

2.3 Unabhängigkeit von Zufallsvariablen

D 2.5

Seien X_1, \dots, X_n Zufallsvariablen auf einem W-Raum. Dann heissen X_1, \dots, X_n unabhängig falls

$$\forall x_1, x_2, \dots, x_n \in \mathbb{R}$$

$$\mathbb{P}[X_1 \leq x_1, \dots, X_n \leq x_n] = \mathbb{P}[X_1 \leq x_1] \dots \mathbb{P}[X_n \leq x_n]$$

S 2.7 Gruppieren von Zufallsvariablen

Seien X_1, \dots, X_n n unabhängige Zufallsvariablen. Seien $1 \leq i_1 < i_2 < \dots < i_k \leq n$ Indizes und ϕ_1, \dots, ϕ_k Abbildungen. Dann sind

$$Y_1 = \phi_1(X_{i_1}, \dots, X_{i_1}), Y_2 = \phi_2(X_{i_2}, \dots, X_{i_2}), \dots$$

$$Y_k = \phi_k(X_{i_{k-1}+1}, \dots, X_{i_k})$$

unabhängig

D 2.8

2.4 Konstruktion von Zufallsvariablen

Eine Folge von Zufallsvariablen X_1, X_2, \dots heisst

- unabhängig falls X_1, \dots, X_n unabhängig sind, für alle $n \in \mathbb{N}$
- unabhängig und identisch verteilt (i.i.d.) falls sie unabhängig ist und die Zufallsvariablen dieselbe Verteilungsfunktion haben d.h

$$\forall i, j F_{X_i} = F_{X_j}$$

3 Diskrete und stetige Variablen

3.1 Unstetigkeit/Stetigkeit der Verteilungsfunktion F

S 3.1 Wahrscheinlichkeit eines Punktes

Sei $X : \omega \rightarrow \mathbb{R}$ eine Zufallsvariable mit Verteilungsfunktion F. Für jedes a in \mathbb{R} gilt

$$\mathbb{P}[X = a] = F(a) - F(-a)$$

3.2 Fast sichere Ereignisse

D 3.2

Sei $A \in \mathcal{F}$ ein Ereignis. Wir sagen A tritt fast sicher ein falls

$$\mathbb{P}[A] = 1$$

3.3 Diskrete Zufallsvariablen

D 3.4 Diskrete Zufallsvariable

Eine Zufallsvariable $X : \omega \rightarrow \mathbb{R}$ heisst diskret falls eine endliche oder abzählbare Menge $W \subset \mathbb{R}$ existiert, sodass

$$\mathbb{P}[X \in W] = 1$$

Bem: [3.5] Wenn der Grundraum ω endlich oder abzählbar ist, dann ist jede Zufallsvariable $X : \omega \rightarrow \mathbb{R}$ diskret.

D 3.6 Verteilung von X

Sei X eine diskrete Zufallsvariable mit Werten in einer endlichen oder abzählbaren Menge $W \subset \mathbb{R}$. Die Zahlenfolge $(p(x))_{x \in W}$ definiert durch

$$\forall x \in W p(x) := \mathbb{P}[X = x]$$

heisst Verteilung von X

S 3.7 Die Verteilung $(p(x))_{x \in W}$ einer diskreten Zufallsvariable erfüllt

$$\sum_{x \in W} p(x) = 1$$

S 3.9 Sei X eine diskrete Zufallsvariable, dessen Werte in einer endlichen oder abzählbaren Menge W liegen, und deren Verteilung p ist. Dann ist die

Verteilungsfunktion von X gegeben durch

forall X in R F_X(x) = sum_{y <= x, y in W} p(y)

3.4 Beispiele diskreter Zufallsvariablen

D 3.10 Bernoulli Verteilung

Es sei 0 <= p <= 1. Eine Zufallsvariable X heisst Bernoulli Zufallsvariable mit Parameter p, wenn sie Werte in W = {0, 1} annimmt und folgendes gilt

P[X = 0] = 1 - p und P[X = 1] = p

D 3.11 Binomialverteilung

Sei 0 <= p <= 1, sein n in N. Eine Zufallsvariable X heisst binomiale Zufallsvariable mit Parametern n und p, wenn sie Werte in W = {0, ..., n} annimmt und folgendes gilt

forall k in {0, ..., n} P[X = k] = binom(n, k) p^k (1 - p)^{n - k}

S 3.13 Sum von unab. Bern. und Binom. Z.V.

Sei 0 <= p <= 1, sein n in N. Seien X_1, ..., X_n unabhängige Bernoulli Z.V mit Parameter p. Dann ist

S_n := X_1 + ... + X_n

eine binomialverteilte Z.V mit parametern n und p.

Bem: [3.14] Bin(1, p) ist gerade Ber(p) verteilt. Falls X ~ Bin(m, p), Y ~ Bin(n, p) und X, Y unabhängig, dann ist X + Y ~ Bin(m + n, p) verteilt.

D 3.15 Geometrische Verteilung

Es sei 0 < p <= 1. Eine Zufallsvariable X heisst geometrische Zufallsvariable mit Parameter p, falls sie Werte in W = N \ {0} annimmt und folgendes gilt

forall k in N \ {0} P[X = k] = (1 - p)^{k - 1} . p

Bem: [3.16]

Für p=1 und k = 1 erscheint in der obigen Gleichung 0^0 = 1 , es gilt P[X = 1] = p

S 3.18

Sei X_1, X_2, ... eine Folge von unendlich vielen unabhängigen Bernoulli Z.V mit Parameter p. Dann ist

T := min{n >= 1 : X_n = 1}

eine geometrisch verteilte Zufallsvariable mit Parameter p.

Bem: [3.18A]

Sei T eine geometrische Verteilung mit Parameter p. Dann ist T > n, wenn die ersten n Bernoulli-Experimente fehlschlagen. Daher gilt

P[T > n] = (1 - p)^n

S 3.20 Gedächtnislosigkeit der Geo. Vert.

Sei T ~ Geom(p) für 0 < p < 1. Dann gilt

forall n >= 0 forall k >= 1 P[T >= n + k | T > n] = P[T >= k]

D 3.21

Sei lambda > 0 eine positive reelle Zahl. Eine Zufallsvariable X heisst Poisson-Zufallsvariable mit Parameter lambda, wenn sie Werte in W = N annimmt und folgendes gilt

forall k in N P[X = k] = lambda^k / k! exp^{-lambda}

S 3.23 Poisson-Approx. der Binom. verteil.

Sei lambda > 0. Für jedes n >= 1 seien X_n ~ Bin(n, lambda/n) Zufallsvariablen. Dann gilt

forall k in N lim_{n -> inf} P[X_n = k] = P[N = k]

3.5 Stetige Verteilungen

D 3.25 Stetig verteilte Zufallsvariablen

Eine Zufallsvariable X : omega -> R heisst stetig, wenn ihre Verteilungsfunktion F_X wie folgt geschrieben werden kann

F_X(a) = int_{-inf}^a f(x) dx für alle a in R

wobei f : R -> R_+ eine nicht-negative Funktion ist. Wir nennen dann f Dichte von X. Weiter gilt für f

1 = int_{-inf}^inf f(x) dx

Bem: [3.25A]

f(x) dx ist die Wahrscheinlichkeit, dass X Werte in [x, x + dx] annimmt. Die Stetigkeit von F_X folgt dabei aus der Definition (3.25). Ausserdem folgt aus Satz 3.1, dass

forall x in R P[X = x] = 0

Die Wahrscheinlichkeit für das Auftreten jedes einzelnen Werts der Zufallsvariablen beträgt exakt Null

Bem: [3.25B]

Von f zu F_X : Sei X eine stetige Z.V und f die Dichte. F_X können wir mit

F_X(x) = int_{-inf}^x f(y) dy

Es liegt nahe, dass wir die Dichte mittels Ableiten herausfinden

T 3.26

Sei X eine Zufallsvariable. Die Verteilungsfunktion F_X sei stetig und Stückweise C^1, d.h es gibt x_0 = -inf < x_1 < ... < x_{n-1} < x_n = +inf, so dass F_X auf jedem Intervall (x_i, x_{i+1}) Element von C^1 ist. Dann ist X eine stetige Zufallsvariable und die Dichte f kann konstruiert werden, indem man folgendes festlegt

forall x in (x_i, x_{i+1}) f(x) = F'_X(x)

3.6 Beispiele stetiger Zufallsvariablen

D 3.27 Gleichverteilung auf [a, b]

Eine stetige Zufallsvariable X heisst gleichverteilt auf [a, b] falls ihre Dichte gegeben ist durch

f_{a,b}(x) = { 1/(b-a) x in [a,b], 0 x not in [a,b]

Wir schreiben X ~ U([a, b])

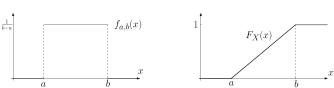


Abbildung 3.1: Dichte und Verteilungsfunktion einer gleichverteilten Zufallsvariable auf [a, b].

Bem: [3.27A]

- Die Wahrscheinlichkeit in einem Intervall [c, c + l] subset [a, b] zu fallen ist lediglich abhängig von dessen Länge l

P[X in [c, c + l]] = l / (b - a)

- Die Verteilungsfunktion X ist gegeben durch

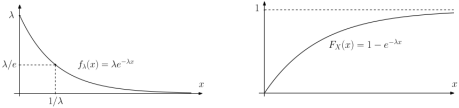
F_X(x) = { 0 x < a, (x-a)/(b-a) a <= x <= b, 1 x > b

D 3.28 Exponentialverteilung mit lambda > 0

Eine stetige Zufallsvariable T heisst exponentialverteilt mit Parameter lambda > 0 falls ihre Dichte gegeben ist durch

f_lambda(x) = { lambda exp^{-lambda x} x >= 0, 0 x < 0

Bem: [3.28A] Die Grafik zeigt die Dichte und Verteilungsfunktion einer exponentialverteilten Zufallsvariable mit Parameter lambda



T modelliert häufig die Lebensdauer oder Wartezeit eines allgemeinen Ergebnisses.

Eigenschaften:

- Die Wahrscheinlichkeit des Wartens ist exponentiell klein:

forall t >= 0 P[T > t] = exp^{-lambda t}

- T besitzt die Eigenschaft der Gedächtnislosigkeit

forall t, s > 0 P[T > t + s | T > t] = P[T > s]

D 3.29

Eine stetige Zufallsvariable X heisst normal verteilt

mit Parametern m und sigma^2 > 0 falls ihre Dichte gegeben ist durch

f_{m,sigma}(x) = 1 / sqrt(2 pi sigma^2) exp^{-((x-m)^2) / (2 sigma^2)}

Wir schreiben X ~ N(m, sigma^2)

Bem: [3.29A]

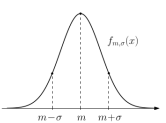


Abbildung 3.3: Dichte einer normalverteilten Zufallsvariable mit Parameter m und sigma^2.

Zum Beispiel bei einer physikalischen Messung kann der parameter sigma die Schwankung von X darstellen und generell zeigt ein kleines sigma eine genaue Messung an und ein grosses sigma eine ungenaue. Eigenschaften :

- Seien X_1, ..., X_n unabhängige normalverteilte Zufallsvariablen mit Parametern (m_1, sigma_1^2), ..., (m_n, sigma_n^2) dann ist

Z = m_0 + lambda_1 X_1 + ... + lambda_n X_n

eine normalverteilte Zufallsvariable mit Parametern m = m_0 + lambda_1 m_1 + ... + lambda_n m_n und sigma^2 = lambda_1^2 sigma_1^2 + ... + lambda_n^2 sigma_n^2

- Wir sprechen im Fall von X ~ N(0, 1), gerade von einer standardnormalverteilten Zufallsvariable. Man merke sich dann folgende Beziehung

Z = m + lambda . X

, wobei X eine normalverteilte Zufallsvariable mit Parametern m und sigma^2 ist.

- Falls X normalverteilt mit Parametern m und sigma^2 ist, dann liegt die "meiste" Wahrscheinlichkeitsmasse der Z.V im Intervall [m - 3 sigma, m + 3 sigma]. Es gilt gerade

P[|X - m| >= 3 sigma] <= 0.0027

4 Der Erwartungswert

4.1 Der allgemeine Erwartungswert

D 4.1

Sei X : omega -> R_+ eine Zufallsvariable mit nicht-negativen Werten. Dann heisst

E[X] = int_0^inf (1 - F_X(x)) dx

der Erwartungswert von X.

Bem: [4.2]

Der Erwartungswert kann sowohl endliche als auch nicht endliche Werte annehmen. Für allgemeinen ZV. definieren wir den Erwartungswert durch Zerlegen in einen positiven und negativen Teil. Die

Beiden Zufallsvariablen sind wie folgt definiert :

$$X_+(\omega) = \begin{cases} X(\omega) & \text{falls } X(\omega) \geq 0 \\ 0 & \text{falls } X(\omega) < 0 \end{cases}$$

und

$$X_-(\omega) = \begin{cases} -X(\omega) & \text{falls } X(\omega) \leq 0 \\ 0 & \text{falls } X(\omega) > 0 \end{cases}$$

X_+ und X_- sind nicht negative Zufallsvariablen. Zudem gilt $X = X_+ - X_-$ als auch $|X| = X_+ + X_-$

S 4.3

Sei X eine nicht-negative Zufallsvariable. Dann gilt

$$\mathbb{E}[X] \geq 0$$

D 4.4 Sei X eine Zufallsvariable. Falls $\mathbb{E}[|X|] < \infty$, dann heisst

$$\mathbb{E}[X] = \mathbb{E}[X_+] - \mathbb{E}[X_-]$$

Erwartungswert von X .

B 4.5

Sei X eine Bernoulli Z.V mit Parameter p

$$\mathbb{E}[X] = p$$

Sei X Poisson-verteilt mit Parameter $\lambda > 0$

$$\mathbb{E}[X] = \lambda$$

Sei $A \in \mathcal{F}$ ein Ereignis. Sei $\mathbb{1}_A$ die Indikatorfunktion auf A ,

$$\forall \omega \in \Omega \quad \mathbb{1}_A(\omega) = \begin{cases} 0 & \text{falls } \omega \notin A \\ 1 & \text{falls } \omega \in A \end{cases}$$

Dann ist $\mathbb{1}_A$ eine Zufallsvariable. Per Definition gilt

$$\mathbb{P}[X = 0] = 1 - \mathbb{P}[A] \text{ und } \mathbb{P}[X = 1] = \mathbb{P}[A]$$

Somit ist $\mathbb{1}_A$ eine Bernoulli Z.V mit Parameter $\mathbb{P}[A] \implies \mathbb{E}[\mathbb{1}_A] = \mathbb{P}[A]$

4.2 Erwartungswert einer diskreten Zufallsvariable

S 4.6 Sei $X : \omega \rightarrow \mathbb{R}$ eine diskrete Zufallsvariable dessen Werte in W (endlich oder abzählbar) fast sicher liegen.Dann gilt

$$\mathbb{E}[X] = \sum_{x \in W} x \cdot \mathbb{P}[X = x]$$

S 4.7 Sei $X : \omega \rightarrow \mathbb{R}$ eine diskrete Zufallsvariable mit Werten in W (endlich oder abzählbar). Für jedes $\phi : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ gilt

$$\mathbb{E}[\phi(X)] = \sum_{x \in W} \phi(x) \mathbb{P}[(X = x)]$$

4.3 Erwartungswert stetiger Zufallsvariablen

S 4.8 Sei X eine stetige Zufallsvariable mit Dichte f . Dann gilt

$$\mathbb{E}[X] = \int_{-\infty}^{\infty} x \cdot f(x) dx$$

B 4.8A Gleichverteilung auf $[a, b]$

$$\mathbb{E}[X] = \frac{a + b}{2}$$

Exponentialverteilung mit $\lambda > 0$

$$\mathbb{E}[X] = \frac{1}{\lambda}$$

T 4.9 Sei X eine stetige Zufallsvariable mit Dichte f . Sei $\phi : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ eine Abbildung, sodass $\phi(X)$ eine Zufallsvariable ist. Dann gilt

$$\mathbb{E}[\phi(X)] = \int_{-\infty}^{\infty} \phi(x) f(x) dx$$

4.4 Rechnen mit Zufallsvariablen

T 4.10 linearität des Erwartungswert

Seien $X, Y : \omega \rightarrow \mathbb{R}$ Zufallsvariablen, sei $\lambda \in \mathbb{R}$. Falls die Erwartungswerte wohldefiniert sind gilt

$$\begin{aligned} \bullet \mathbb{E}[\lambda \cdot X] &= \lambda \cdot \mathbb{E}[X] \\ \bullet \mathbb{E}[X + Y] &= \mathbb{E}[X] + \mathbb{E}[Y] \end{aligned}$$

Bem: [4.11]

Die Zufallsvariablen müssen dabei nicht unabhängig sein.

Bem: [4.12]

Anwendung1 : Der Erwartungswert einer binomial-verteilten Zufallsvariable. Sei $n \geq 1$ und $0 \leq p \leq 1$. Sei S eine binomialverteilte Zufallsvariable mit Parametern n und p .

$$\mathbb{E}[S] = \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} p^k (1-p)^{n-k}$$

Wir können allerdings davon ausgehen, dass S die gleiche Verteilung hat wie $S_n = X_1 + \dots + X_n$ wobei X_1, \dots, X_n u.i.v Bernoulli Z.V mit Parameter p sind. Durch anwendung der linearität erhalten wir

$$\mathbb{E}[S] = \mathbb{E}[S_n] = np$$

Anwendung2 : Rechnen mit Normalverteilungen mit Parameter m und σ^2 . Wenn X eine Normalverteilung mit Parametern m und σ^2 ist, dann hat sie die gleiche Verteilung wie $m + \sigma \cdot Y$, wobei Y eine standardnormalverteilte Z.V ist. Aus der Linearität des Erwartungswertes folgt

$$\mathbb{E}[X] = \mathbb{E}[m + \sigma \cdot Y] = m + \sigma \mathbb{E}[Y]$$

Also müssen wir nur $\mathbb{E}[Y]$ berechnen.

$$\mathbb{E}[Y] = \int_{-\infty}^{\infty} x \cdot f_{0,1}(x) dx = 0$$

da $Xx \cdot f_{0,1}(x)$ eine ungerade funktion ist.

$$\mathbb{E}[X] = m$$

T 4.13 Seien X, Y zwei Zufallsvariablen. Falls X und Y unabhängig sind, dann gilt

$$\mathbb{E}[XY] = \mathbb{E}[X]\mathbb{E}[Y]$$

4.5 Extremwert Formel

S 4.14 Stetige Extremwertformel

Sei X eine Zufallsvariable, sodass $X \geq 0$ fast sicher gilt. Dann gilt

$$\mathbb{E}[X] = \int_0^{\infty} \mathbb{P}[X \geq x] dx$$

Bem: [4.14A] Anwendungen: Ausrechnen von Erwartungswert einer exponential-verteilten Zufallsvariable. Sei T eine exponential-verteilte Zufallsvariable mit Paramter $\lambda \geq 0$

$$\mathbb{E}[T] = \int_0^{\infty} \mathbb{P}[X \geq x] dx = \int_0^{\infty} \exp^{-\lambda x} dx = \frac{1}{\lambda}$$

S 4.15 Diskrete Extremwertformel

Sei X eine diskrete Zufallsvariable mit Werten in $\mathbb{N} = \{0, 1, 2, \dots\}$. Dann gilt folgende Identität

$$\mathbb{E}[X] = \sum_{n=1}^{\infty} \mathbb{P}[X \geq n]$$

4.6 Charakterisierung der Eigenschaften von Z.V

S 4.16

Sei X eine Zufallsvariable. Sei $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}_+$ eine Abbildung, sodass $\int_{-\infty}^{+\infty} f(x) dx = 1$. Dann sind folgende Aussagen äquivalent

- X ist stetig mit Dichte f ,
- Für jede stückweise stetige, beschränkte Abbildung $\phi : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ gilt

$$\mathbb{E}[\phi(X)] = \int_{-\infty}^{\infty} \phi(x) f(x) dx$$

T 4.17

Seien X, Y zwei diskrete Zufallsvariablen. Die folgenden Aussagen sind äquivalent

- X, Y sind unabhängig
- Für jedes $\phi : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}, \psi : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ beschränkt und stückweise stetig gilt

$$\mathbb{E}[\phi(X)\psi(Y)] = \mathbb{E}[\phi(X)]\mathbb{E}[\psi(Y)]$$

T 4.18

Seien X_1, \dots, X_n n Zufallsvariablen. Die folgenden Aussagen sind äquivalent

- X_1, \dots, X_n sind unabhängig
- Für jedes $\phi_1(X_1), \dots, \phi_n(X_n) : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ beschränkt gilt

$$\mathbb{E}[\phi_1(X_1), \dots, \phi_n(X_n)] = \mathbb{E}[\phi_1(X_1)] \dots \mathbb{E}[\phi_n(X_n)]$$

4.7 Ungleichungen

S 4.19

Seien X, Y zwei Zufallsvariablen, sodass

$$X \leq Y \text{ f.s.}$$

gilt. Falls beide Erwartungswerte wohldefiniert sind folgt dann

$$\mathbb{E}[X] \leq \mathbb{E}[Y] \text{ f.s.}$$

T 4.20 Markow-Ungleichung

Sei X eine nicht-negative Zufallsvariable. Für jedes $a > 0$ gilt dann

$$\mathbb{P}[X \geq a] \leq \frac{\mathbb{E}[X]}{a}$$

T 4.21 Jensen Ungleichung

Sei X eine Zufallsvariable. Sei $\phi : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ eine konvexe Funktion. Falls $\mathbb{E}[\phi(X)]$ und $\mathbb{E}[X]$ wohldefiniert sind, gilt

$$\phi(\mathbb{E}[X]) \leq \mathbb{E}[\phi(X)]$$

4.8 Varianz

D 4.22 Sei X eine Zufallsvariable, sodass $\mathbb{E}[X^2] < \infty$. Wir definieren die Varianz von X durch

$$\sigma_X^2 = \mathbb{E}[(X - m)^2], \text{ wobei } m = \mathbb{E}[X]$$

Die Wurzel aus σ_X^2 nennen wir die Standardabweichung von X

S 4.24 Chebychev Ungleichung

Sei X eine Zufallsvariable mit $\mathbb{E}[X^2] < \infty$. Dann gilt für jedes $a \geq 0$

$$\mathbb{P}[|X - m| \geq a] \leq \frac{\sigma_X^2}{a^2}, \text{ wobei } m = \mathbb{E}[X]$$

S 4.25 Grundlegende Eigenschaften der Varianz

- Sei X eine Zufallsvariable mit $\mathbb{E}[X^2] < \infty$. Dann gilt

$$\sigma_X^2 = \mathbb{E}[X^2] - \mathbb{E}[X]^2$$

- Sei X eine Zufallsvariable mit $\mathbb{E}[X^2] < \infty$ und sei $\lambda \in \mathbb{R}$. Dann gilt

$$\sigma_{\lambda X}^2 = \lambda^2 \cdot \sigma_X^2$$

- Seien X_1, \dots, X_n n -viele paarweise unabhängige Zufallsvariablen und $S = X_1 + \dots + X_n$. Dann gilt

$$\sigma_S^2 = \sigma_{X_1}^2 + \dots + \sigma_{X_n}^2$$

- $\text{Var}[Z + b] = \text{Var}[Z] \quad \forall b \in \mathbb{R}$

4.9 Kovarianz

D 4.26

Seien X, Y zwei Zufallsvariablen mit endlichen zweiten Momenten $\mathbb{E}[X^2] < \infty$ und $\mathbb{E}[Y^2] < \infty$. Wir

definieren die Kovarianz zwischen X und Y durch

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

Bem: [4.26A]
Es gilt X,Y unabhängig ==> Cov(X,Y) = 0

5 Gemeinsame Verteilung

5.1 Diskrete gemeinsame Verteilungen

D 5.1
Seien X1,...,Xn n diskrete Zufallsvariablen, sei Wi subset of R endlich oder abzählbar, wobei Xi in Wi fast sicher gilt. Die gemeinsame Verteilung von (X1,...,Xn) ist eine Familie p = (p(x1,...,xn))x1 in W1,...,xn in Wn, wobei jedes Mitglied definiert ist durch

p(x1,...,xn) = P[X1 = x1,...,Xn = xn]

S 5.2
Eine gemeinsame Verteilung von Zufallsvariablen X1,...,Xn erfüllt

sum_{x1 in W1,...,xn in Wn} p(x1,...,xn) = 1

5.2 Verteilung des Bildes

S 5.3
Sei n >= 1 und seien phi : R^n -> R Abbildungen. Seien X1,...,Xn n diskrete Zufallsvariablen in (Omega, F, P), welche fast sicher Werte in endlichen oder abzählbaren Mengen W1,...,Wn annehmen. Dann ist Z = phi(X1,...,Xn) eine diskrete Zufallsvariable, welche fast sicher Werte in W = phi(W1 x ... x Wn) annimmt. Zudem ist die Verteilung von Z gegeben durch

forall z in W P[Z = z] =

sum_{x1 in W1,...,xn in Wn, phi(x1,...,xn) = z} P[X1 = x1,...,Xn = xn]

5.3 Randverteilung

S 5.4
Seien X1,...,Xn n diskrete Zufallsvariablen mit gemeinsamer Verteilung p = (p(x1,...,xn))x1 in W1,...,xn in Wn. Für jedes i gilt
forall z in Wi P[Xi = z] =

sum_{x1,...,xi-1,xi+1,...,xn} p(x1,...,xi-1,z,xi+1,...,xn)

5.4 Erwartungswert des Bildes

S 5.5
Seien X1,...,Xn n diskrete Zufallsvariablen mit gemeinsamer Verteilung p = (p(x1,...,xn))x1 in W1,...,xn in Wn. Sei phi : R^n -> R,

dann gilt
E[phi(X1,...,Xn)] =
sum_{x1,...,xn} phi(x1,...,xn)p(x1,...,xn)
solange die Summe wohldefiniert ist.

5.5 Unabhängigkeit

S 5.6
Seien X1,...,Xn n diskrete Zufallsvariablen mit gemeinsamer Verteilung p = (p(x1,...,xn))x1 in W1,...,xn in Wn. Die folgenden Aussagen sind äquivalent
• X1,dots,Xn sind unabhängig
• p(x1,...,xn) = P[X1 = x1]...P[Xn = xn] für jedes x1 in W1,...,xn in Wn
•

5.6 Stetige Gemeinsame Verteilung

D 5.7
Sei n >= 1. Wir sagen, dass die Zufallsvariablen X1,...,Xn : Omega -> R eine stetige gemeinsame Verteilung besitzen, falls eine Abbildung f : R^n -> R+ existiert, sodass

P[X1 <= a1,...,Xn <= b] =

int_{-inf}^{a1}...int_{-inf}^{an} f(x1,...,xn)dxn...dx1

für jedes a1,...,an in R gilt. Obige Abbildung f nennen wir gerade gemeinsame Dichte von (X1,...,Xn)

S 5.9
Sei f die gemeinsame Dichte der Zufallsvariablen (X1,...,Xn). Dann gilt

int_{-inf}^{inf}...int_{-inf}^{inf} f(x1,...,xn)dxn...dx1 = 1

Bem: [5.9a]
Nehme zum Beispiel zwei Zufallsvariablen X,Y. Intuitiv beschreibt f(x,y)dxdy dabei die Wahrscheinlichkeit, dass ein Zufallspunkt (X,Y) einem Rechteck [x,x+dx] x [y,y+dy] liegt.

5.7 Erwartungswert unter Abbildungen

S 5.10
Sei phi : R -> R eine Abbildung. Falls X1,...,Xn eine gemeinsame Dichte f besitzen, dann lässt sich der Erwartungswert der Zufallsvariable Z = phi(X1,...,Xn) mittels

E[phi(X,Y)] =

int_{-inf}^{inf}...int_{-inf}^{inf} phi(x1,...,xn)...f(x1,...,xn)dx1...dxn

berechnen (solange das Integral wohldefiniert ist)
5.8 Unabhängigkeit stetiger Zufallsvariablen

T 5.11
Seien X1,...,Xn Zufallsvariablen mit Dichten f1,...,fn. Dann sind folgende Aussagen äquivalent
• X1,...,Xn sind unabhängig
• X1,...,Xn sind insgesamt stetig mit gemeinsamer Dichte

f(x1,...,xn) = f1(x1)...fn(xn)

Bem: [5.12]
Somit sind zwei unabhängige stetige Zufallsvariablen automatisch gemeinsam stetig.

6 Asympthotische Resultate

T 6.1
Sei E[|x1|] < inf. Setze m = E[X1] dann gilt

lim_{n -> inf} (X1 + ... + Xn) / n = m a.s

Bem: [6.2]
In der Aussage des Satzes mag es überraschen, dass die Annahme und die Definition von m sich nur auf X1 beziehen. Da die Zufallsvariable aber u.i.v sind, haben wir auch E[|Xi|] < inf und m = E[Xi] für jedes i.

B 6.2A
Sei X1,X2,... eine Folge von u.i.v Bernoulli Z.V mit Paramter p. Dann ist

lim_{n -> inf} (X1 + ... + Xn) / n = p a.s

B 6.2B
Sei T1,T2,... eine u.i.v Folge von exponential verteilten Zufallsvariablen mit Paramter lambda. Dann gilt

lim_{n -> inf} (T1 + ... + Tn) / n = lambda a.s

D 6.3
Seien (Xn)n in N und X Zufallsvariablen. Wir schreiben

Xn approx X as n -> inf

falls für jedes x in R
lim_{n -> inf} P[Xn <= x] = P[X <= x]

B 6.3A
Für jedes n, sei Xn eine Bernoulli Zufallsvariable mit Parameter pn in [0,1]. Falls lim_{n -> inf} pn = p gilt, erhalten wir

Xn approx X für n -> inf

T 6.4 ZGWS
Nehme an, dass der Erwartungswert E[X1^2] wohldefiniert und endlich ist. Setze m = E[X1] und

sigma^2 = Var(X1), dann gilt folgender Grenzwert
P[(Sn - n * m) / sqrt(sigma^2 n) <= a] -> Phi(a) = 1 / sqrt(2 * pi) int_{-inf}^a e^{-x^2/2} dx

D 1.1
Ein Schätzer ist eine Zufallsvariable T : Omega -> R der Form

T = t(X1,...,Xn)

wobei t : R^n -> R **D 1.2**
Ein Schätzer T heisst erwartungstreu für theta, falls für alle theta in Theta gilt

E[T] = theta

Bem: [1.2A]
Interpretation: Im Mittel(über alle denkbaren Realisationen W) schätzt T also richtig, und zwar unabhängig davon, welches Model P_theta zu Grunde liegt.
D 1.3 Sei theta in Theta und T ein Schätzer. Der Bias(erwartete Schätzfehler) von T im Modell P_theta ist definiert als

E_theta - theta

Der mittlere quadratische Schätzfehler(MSE) von T im Modell P_theta ist definiert als
MSE_theta[T] := E[(T - theta)^2]

Bem: [1.3A]
Man kann den MSE zerlegen als
(MSE)_theta[T] = E_theta[(T - theta)^2] = Var_theta[T] + (E_theta[T] - theta)^2

D 1.4
Die Likelihood-Funktion ist

L(x1,...,xn; theta) := { p_X(x1,...,xn; theta) falls disk, f_X(x1,...,xn; theta) falls stet }

wobei
p_X(x1,...,xn; theta) = prod_{i=1}^n p_X(xi; theta)

f_X(x1,...,xn; theta) = prod_{i=1}^n f_X(xi; theta)

D 1.5
Für jedes x1,...,xn, sei t_ML(x1,...,xn) in R der Wert, der theta -> L(x1,...,xn; theta) als Funktion von theta maximiert. D.h

L(x1,...,xn; t_ML(x1,...,xn)) = max_{theta in Theta} L(x1,...,xn; theta)

Ein Maximum-Likelihood-Schätzer (ML-Schätzer) T_ML für theta wird definiert durch
T_ML = t_ML(X1,...,Xn)

D 2.1

Sei $\alpha \in [0, 1]$ Ein Konfidenzintervall für θ mit Niveau $1 - \alpha$ ist ein Zufallsintervall $I = [A, B]$, sodass gilt

$$\forall \theta \in \Theta \mathbb{P}_\theta[A \leq \theta \leq B] \geq 1 - \alpha$$

wobei A, B Zufallsvariablen der Form $A = a(X_1, \dots, X_n), B = b(X_1, \dots, X_n)$ mittels $a, b : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ sind. **Bem:** [2.2]

In der obigen Gleichung ist der Parameter θ deterministisch und nicht zufällig. Die stochastischen Elemente sind gerade die Schranken $A = a(X_1, \dots, X_n)$ und $B = b(X_1, \dots, X_n)$ **D 2.3**

Eine stetige Zufallsvariable X heisst χ^2 -Verteilt mit m Freiheitsgraden falls ihre Dichte gegeben ist durch

$$f_X(y) = \frac{1}{2^{\frac{m}{2}} \Gamma(\frac{m}{2}) y^{\frac{m}{2}-1} e^{-\frac{1}{2}y}} \text{ für } y \geq 0$$

Dabei ist die Gamma-Funktion für $v \geq 0$ definiert durch

$$\Gamma(v) := \int_0^\infty t^{v-1} e^{-t} dt$$

ES gilt $\Gamma(n) = (n - 1)!$ für $v = n \in \mathbb{N}$ **Bem:** [2.3A]