

Stochastik SS 2019

Dozent: Prof. Dr. ANITA BEHME

9. April 2019

Inhaltsverzeichnis

I	Grundbegriffe der Wahrscheinlichkeitstheorie	4
1	Wahrscheinlichkeitsräume	4
2	Zufallsvariablen	8
II	Erste Standardmodelle der WTheorie	13
1	Diskrete Gleichverteilungen	13
2	Urnenmodelle	13
2.1	Urnenmodell mit Zurücklegen: Multinomial-Verteilung	14
III	Test	16
	Anhang	18
	Index	18

Vorwort

Literatur

- *Georgii*: Stochastik (5. Auflage)
- *Schilling*: Wahrscheinlichkeit (1. Auflage)
- *Bauer*: Wahrscheinlichkeitstheorie (5. Auflage) (sehr maßtheoretisch!)

Ohne Maßtheorie!

- *Krengel*: Einführung in die Wahrscheinlichkeitstheorie und Statistik
- *Dehling & Haupt*: Einführung in die Wahrscheinlichkeitstheorie und Statistik

Was ist Stochastik?

Altgriechisch Stochastikos ($\sigma\tau\omicron\chi\alpha\sigma\tau\iota\kappa\omicron\varsigma$) und bedeutet sinngemäß “scharfsinning in Vermuten”.

Fragestellung insbesondere aus Glückspiel, Versicherungs-/Finanzmathematik, überall da wo Zufall/Risiko / Chance auftauchen.

Was ist Stochastik?

- Beschreibt zufällige Phänomene in einer exakten Sprache!
Beispiel: “Beim Würfeln erscheint jedes sechste Mal (im Schnitt) eine 6.” \rightarrow Gesetz der großen Zahlen (\nearrow später)
- Lässt sich mathematische Stochastik in zwei Teilgebiete unterteilen
Wahrscheinlichkeitstheorie (W-Theorie) & Statistik
 - *W-Theorie*: Beschreibt und untersucht konkret gegebene Zufallssituationen.
 - *Statistik*: Zieht Schlussfolgerungen aus Beobachtungen.

Statistik benötigt Modelle der W-Theorie und W-Theorie benötigt die Bestätigung der Modelle durch Statistik.

In diesem Semester konzentrieren wir uns nur auf die Wahrscheinlichkeitstheorie!

Kapitel I

Grundbegriffe der Wahrscheinlichkeitstheorie

1. Wahrscheinlichkeitsräume

Ergebnisraum

Welche der möglichen Ausgänge eines zufälligen Geschehens interessieren uns?

Würfeln? Augenzahl, nicht die Lage und die Fallhöhe

Definition 1.1 (Ergebnisraum)

Die Menge der relevanten Ergebnisse eines Zufallsgeschehens nennen wir Ergebnisraum und bezeichnen diesen mit Ω .

■ Beispiel

- Würfeln: $\Omega = \{1, 2, \dots, 6\}$
- Wartezeiten: $\Omega = \mathbb{R}_+ = [0, \infty)$ (überabzählbar!)

Ereignisse

Oft interessieren wir uns gar nicht für das konkrete Ergebnis des Zufallsexperiments, sondern nur für das Eintreten gewisser Ereignisse.

■ Beispiel

- Würfeln: Zahl ist ≥ 3
- Wartezeit: Wartezeit ≤ 5 Minuten

→ Teilmenge des Ereignisraums, also Element der Potenzmenge $\mathcal{P}(\Omega)$, denen eine Wahrscheinlichkeit zugeordnet werden kann, d.h. welche messbar (mb) sind.

Definition 1.2 (Ereignisraum, messbarer Raum)

Sei $\Omega \neq \emptyset$ ein Ergebnisraum und \mathcal{F} eine σ -Algebra auf Ω , d.h. eine Familie von Teilmenge von Ω , sodass

1. $\Omega \in \mathcal{F}$
2. $A \in \mathcal{F} \Rightarrow A^C \in \mathcal{F}$
3. $A_1, A_2, \dots \in \mathcal{F} \Rightarrow \bigcup_{i \geq 1} A_i \in \mathcal{F}$

Dann heißt (Ω, \mathcal{F}) Ereignisraum bzw. messbarer Raum.

Wahrscheinlichkeiten

Ordne Ereignissen Wahrscheinlichkeiten zu mittels der Abbildung

$$\mathbb{P} : \mathcal{F} \rightarrow [0, 1]$$

sodass

$$\text{Normierung } \mathbb{P}(\Omega) = 1 \quad (\text{N})$$

$$\sigma\text{-Additivität für paarweise disjunkte Ereignisse} \quad (\text{A})$$

$$A_1, A_2, \dots \in \mathcal{F} \Rightarrow \mathbb{P}\left(\bigcup_{i \geq 1} A_i\right) = \sum_{i \geq 1} \mathbb{P}(A_i)$$

Gleichung (N), Gleichung (A) und die Nichtnegativität von \mathbb{P} werden als KOLMOGOROVsche Axiome bezeichnet (nach Kolomogorov: Grundbegriffe der Wahrscheinlichkeitstheorie, 1933)

Definition 1.3 (Wahrscheinlichkeitsmaß, Wahrscheinlichkeitsverteilung)

Sei (Ω, \mathcal{F}) ein Ereignisraum und $\mathbb{P} : \mathcal{F} \rightarrow [0, 1]$ eine Abbildung mit Eigenschaften Gleichung (N) und Gleichung (A). Dann heißt \mathbb{P} Wahrscheinlichkeitsmaß oder auch Wahrscheinlichkeitsverteilung.

Aus der Definition folgen direkt:

Satz 1.4 (Rechenregeln für W-Maße)

Sei \mathbb{P} ein W-Maß, Ereignisse $(\Omega, \mathcal{F}), A, B, A_1, A_2, \dots \in \mathcal{F}$. Dann gelten:

1. $\mathbb{P}(\emptyset) = 0$
2. Monotonie: $A \subseteq B \Rightarrow \mathbb{P}(A) \leq \mathbb{P}(B)$
3. endliche σ -Additivität: $\mathbb{P}(A \cup B) + \mathbb{P}(A \cap B) = \mathbb{P}(A) + \mathbb{P}(B)$ und insbesondere $\mathbb{P}(A) + \mathbb{P}(A^C) = 1$
4. σ -Subadditivität:

$$\mathbb{P}\left(\bigcup_{i \geq 1} A_i\right) \leq \sum_{i \geq 1} \mathbb{P}(A_i)$$

5. σ -Stetigkeit: Wenn $A_n \uparrow A$ (d.h. $A_1 \subseteq A_2 \subseteq \dots$ und $A = \bigcup_{i=1}^{\infty} (A_i)$) oder $A_n \downarrow A$, so gilt:

$$\mathbb{P}(A_n) \longrightarrow \mathbb{P}(A), n \rightarrow \infty$$

Beweis. In der Vorlesung wurde nur auf Schillings MINT Vorlesung verwiesen. Der folgende Beweis wurde ergänzt.

Beweise erst folgende Aussage: $A \cap B = \emptyset \implies \mathbb{P}(A \uplus B) = \mathbb{P}(A) + \mathbb{P}(B)$.

Es kann σ -Additivität verwendet werden, indem "fehlende" Mengen durch \emptyset ergänzt werden:

$$\mathbb{P}(A \uplus B) = \mathbb{P}(A \uplus B \uplus \emptyset \uplus \emptyset \dots) = \mathbb{P}(A) + \mathbb{P}(B) + \mathbb{P}(\emptyset) + \dots = \mathbb{P}(A) + \mathbb{P}(B),$$

wobei Maßeigenschaften verwendet wurden.

1. Definition des Maßes.

2. Da $A \subseteq B$ ist auch $B = A \uplus (B \setminus A) = A \uplus (B \setminus (A \cap B))$. Wende wieder Aussage von oben an, damit folgt

$$\mathbb{P}(B) = \mathbb{P}(A \uplus (B \setminus A)) = \mathbb{P}(A) + \mathbb{P}(B \setminus A) \geq \mathbb{P}(A) \quad (*)$$

3. Zerlege $A \cup B$ geschickt, dann sieht man mit oben gezeigter Aussage und Gleichung $(*)$

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(A \cup B) + \mathbb{P}(A \cap B) &= \mathbb{P}(A \uplus (B \setminus (A \cap B))) + \mathbb{P}(A \cap B) \\ &= \mathbb{P}(A) + \mathbb{P}(B \setminus (A \cap B)) + \mathbb{P}(A \cap B) \\ &= \mathbb{P}(A) + \mathbb{P}(B). \end{aligned}$$

Im letzten Schritt wurde Gleichung $(*)$ verwendet.

4. Folgt aus endlicher σ -Additivität, da $\mathbb{P}\left(\bigcap_{i \geq 1} A_i\right) \geq 0$.

5. Definiere $F_1 := A_1, F_2 := A_2 \setminus A_1, \dots, F_{i+1} := A_{i+1} \setminus A_i$. Die F_i Mengen sind paarweise disjunkt und damit folgt für $m \rightarrow \infty$

$$A_m = \biguplus_{i=1}^m F_i \Rightarrow A = \biguplus_{i=1}^{\infty} F_i = \biguplus_{i=1}^{\infty} A_i$$

und

$$\mathbb{P}(A) = \mathbb{P}\left(\biguplus_{i=1}^{\infty} F_i\right) = \sum_{i=1}^{\infty} \mathbb{P}(F_i) = \lim_{m \rightarrow \infty} \lim_{m \rightarrow \infty} \mathbb{P}\left(\biguplus_{i=1}^m F_i\right) = \lim_{m \rightarrow \infty} \lim_{m \rightarrow \infty} \mathbb{P}(A_m). \quad \square$$

■ Beispiel 1.5

Für ein beliebiges Ereignisraum (Ω, \mathcal{F}) ($\Omega \neq \emptyset$) und eine beliebiges Element $\xi \in \Omega$ definiere

$$\delta_{\xi}(A) := \begin{cases} 1 & \xi \in A \\ 0 & \text{sonst} \end{cases}$$

eine (degeneriertes) W-Maß auf (Ω, \mathcal{F}) , welches wir als DIRAC-Maß oder DIRAC-Verteilung bezeichnen.

■ Beispiel 1.6

Würfel mit fairem, 6-(gleich)seitigem Würfel mit Ergebnismenge $\Omega = \{1, \dots, 6\}$ und Ereignisraum $\mathcal{F} = \mathcal{P}(\Omega)$ setzen wir als Symmetriegründen

$$\mathbb{P}(A) = \frac{\#A}{6}.$$

(Wobei $\#A$ oder auch $|A|$ die Kardinalität von A ist.) Das definiert ein W-Maß.

■ Beispiel 1.7

Wartezeit an der Bushaltestelle mit Ergebnisraum $\Omega = \mathbb{R}_+$ und Ereignisraum BORELSche σ -Algebra $\mathcal{B}(\mathbb{R}_+) = \mathcal{F}$. Eine möglichen W-Maß können wir dann durch

$$\mathbb{P}(A) = \int_A \lambda e^{-\lambda x} dx$$

für einen Parameter $\lambda > 0$ festlegen. (Offenbar gilt $\mathbb{P}(\Omega) = 1$ und die σ -Additivität aufgrund der

Additivität des Integrals.) Wir bezeichnen diese Maß als Exponentialverteilung. (Warum gerade dieses Maß für Wartezeiten gut geeignet ist \nearrow später)

Satz 1.8 (Konstruktion von WMaßen durch Dichten)

Sei (Ω, \mathcal{F}) ein Ereignisraum.

- Ω abzählbar, $\mathcal{F} = \mathcal{P}(\Omega)$: Sei $\rho = (\rho(\omega))_{\omega \in \Omega}$ eine Folge in $[0, 1]$ in $\sum_{\omega \in \Omega} \rho(\omega) = 1$, dann definiert

$$\mathbb{P}(A) = \sum_{\omega \in \Omega} \rho(\omega), A \in \mathcal{F}$$

ein (diskretes) WMaß \mathbb{P} auf (Ω, \mathcal{F}) . ρ wird als Zähldichte bezeichnet.

- Umgekehrt definiert jedes WMaß \mathbb{P} auf (Ω, \mathcal{F}) definiert Folge $\rho(\omega) = \mathbb{P}(\{\omega\})$, $\omega \in \Omega$ eine Folge ρ mit den obigen Eigenschaften.
- $\Omega \subset \mathbb{R}^n$, $\mathcal{F} = \mathcal{B}(\Omega)$: Sei $\rho : \Omega \rightarrow [0, \infty)$ eine Funktion, sodass

$$1. \int_{\Omega} \rho(x) dx = 1$$

$$2. \{x \in \Omega : f(x) \leq c\} \in \mathcal{B}(\Omega) \text{ für alle } c > 0$$

dann definiert ρ ein WMaß \mathbb{P} auf (Ω, \mathcal{F}) durch

$$\mathbb{P}(A) = \int_A \rho(x) dx = \int_A \rho d\lambda, \quad A \in \mathcal{B}(\Omega).$$

Das Integral interpretieren wir stets als Lebesgue-Integral bzw. Lebesgue-Maß λ . ρ bezeichnet wir als Dichte, Dichtefunktion/Wahrscheinlichkeitsdichte von \mathbb{P} und nennen ein solches \mathbb{P} (absolut)stetig (bzgl. denn Lebesgue-Maß).

Beweis. • Der diskrete Fall ist klar.

- Im stetigen Fall folgt die Behauptung aus den bekannten Eigenschaften des Lebesgue-Integrals (\nearrow Schilling MINT, Lemma 8.9) \square

► Bemerkung

- Die Eineindeutige Beziehung zwischen Dichte und WMaß überträgt sich nicht auf den stetigen Fall.
 - Nicht jedes WMaß auf $(\Omega, \mathcal{B}(\Omega))$, $\Omega \subset \mathbb{R}^n$ besitzt eine Dichte.
 - Zwei Dichtefunktionen definieren dasselbe WMaß, wenn sie sich nur auf einer Menge von Lebesgue-Maß 0 unterscheiden.
- Jede auf $\Omega \subset \mathbb{R}^n$ definiert Dichtefunktion ρ lässt sich auf ganz \mathbb{R}^n fortsetzen durch $\rho(x) = 0$, $x \notin \Omega$. Das erzeugte WMaß auf $(\mathbb{R}^n, \mathcal{B}(\Omega))$ lässt mit den WMaß auf $(\Omega,)$ identifizieren.
- Mittels Dirac-Maß δ_x können auch jedes diskrete WMaß auf $\Omega \subset \mathbb{R}^n$ als WMaß auf \mathbb{R}^n , $\mathcal{B}(\mathbb{R}^n)$

intepretieren

$$\mathbb{P}(A) = \sum_{\omega \in A} \rho(\omega) = \int_A d \left(\sum_{\omega \in \Omega} \rho(\omega) \delta_\omega \right)$$

stetige und diskrete WMaße lassen sich kombiniere z.B.

$$\mathbb{P}(A) = \frac{1}{2} \delta_0 + \frac{1}{2} \int_A \mathbb{1}_{[0,1]}(x) dx, A \in \mathcal{B}(\mathbb{R})$$

ein WMaß auf $(\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$.

Abschließend erinnern wir uns an:

Satz 1.9 (Eindeutigkeitssatz für WMaße)

Sei (Ω, \mathcal{F}) Ereignisraum und \mathbb{P} ein WMaß auf (Ω, \mathcal{F}) . Sei $\mathcal{F} = \omega(\mathcal{G})$ für ein \cap -stabiles Erzeugendensystem $\mathcal{G} \subset \mathcal{P}(\Omega)$. Dann ist \mathbb{P} bereits durch seine Einschränkung $\mathbb{P}|_{\mathcal{G}}$ eindeutig bestimmt.

Beweis. ↗ Schhiling MINT, Satz 4.5. □

Insbesondere definiert z.B.

$$\mathbb{P}([0, a]) = \int_0^a \lambda e^{-\lambda x} dx = 1 - e^{-\lambda a}, a > 0$$

bereits die Exponentialverteilung aus Beispiel 1.7.

Definition 1.10 (Gleichverteilung)

Ist Ω endlich, so heißt das WMaß mit konstanter Zähldichte $\rho(\omega) = 1/|\Omega|$ die (diskrete) Gleichverteilung auf Ω und wird mit $U(\Omega)$ notiert (U = Uniform). Ist $\Omega \subset \mathbb{R}^n$ eine Borelmenge mit Lebesgue-Maß $0 < \lambda^n(\Omega) < \infty$ so heißt das WMaß auf $(\Omega, \mathcal{B}(\Omega))$ mit konstanter Dichtefunktion $\rho(x) = 1/\lambda^n(x)$ die (stetige) Gleichverteilung auf Ω . Sie wird ebenso mit $U(\Omega)$ notiert.

WRäume

Definition 1.11 (Wahrscheinlichkeitsraum)

Ein Tripel $(\Omega, \mathcal{F}, \mathbb{P})$ mit Ω, \mathcal{F} Ereignisraum und \mathbb{P} WMaß auf (Ω, \mathcal{F}) , nennen wir Wahrscheinlichkeitsraum.

2. Zufallsvariablen

Zufallsvariablen dienen dazu von einen gegebenen Ereignisraum (Ω, \mathcal{F}) zu einem Modellausschnitt Ω', \mathcal{F}' überzugehen. Es handelt sich also um Abbildungen $X : \Omega \rightarrow \Omega'$. Damit wir auch jedem Ereignis in \mathcal{F}' eine Wheat zuordnen können, benötigen wir

$$A' \in \mathcal{F}' \Rightarrow X' A' \in \mathcal{F}$$

d.h. X sollte messbar sein.

Definition 2.1 (Zufallsvariable)

Seien (Ω, \mathcal{F}) und (Ω', \mathcal{F}') Ereignisräume. Dann heißt jede messbare Abbildung

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

Zufallsvariable (von (Ω, \mathcal{F})) nach (Ω', \mathcal{F}') / auf (Ω', \mathcal{F}') oder Zufallselement.

■ Beispiel 2.2

1. Ist Ω abzählbar und $\mathcal{F} = \mathcal{P}(\Omega)$, so ist jede Abbildung $X : \Omega \rightarrow \Omega'$ messbar und damit eine Zufallsvariable.
2. Ist $\Omega \subset \mathbb{R}^n$ und $\mathcal{F} = \mathcal{B}(\Omega)$, so ist jede stetige Funktion $X : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ messbar und damit eine Zufallsvariable.

Satz 2.3

Sei $(\Omega, \mathcal{F}, \mathbb{P})$ ein WRaum und X eine Zufallsvariable von (Ω, \mathcal{F}) nach (Ω', \mathcal{F}') . Dann definiert

$$\mathbb{P}'(A') := \mathbb{P}(X^{-1}(A')) = \mathbb{P}(\{X \in A'\}), A' \in \mathcal{F}'$$

ein WMaß auf (Ω', \mathcal{F}') auf (Ω', \mathcal{F}') , welches wir als WVerteilung von X unter \mathbb{P} bezeichnet.

Beweis. Aufgrund der Messbarkeit von X ist die Definition sinnvoll. Zudem gelten

$$\mathbb{P}'(\Omega') = \mathbb{P}(X^{-1}(\Omega')) = \mathbb{P}(\Omega) = 1$$

und für $A'_1, A'_2, \dots \in \mathcal{F}'$ paarweise disjunkt.

$$\begin{aligned} \mathbb{P}'\left(\bigcup_{i \geq 1} A'_i\right) &= \mathbb{P}\left(X^{-1}\left(\bigcup_{i \geq 1} A'_i\right)\right) \\ &= \mathbb{P}\left(\bigcup_{i \geq 1} X^{-1}(A'_i)\right) \\ &= \sum_{i \geq 1} \mathbb{P}(X^{-1}A'_i) \end{aligned}$$

da auch $X^{-1}A'_1, X^{-1}A'_2, \dots$ paarweise disjunkt

$$= \sum_{i \geq 1} \mathbb{P}'(A'_i)$$

Also ist \mathbb{P}' ein WMaß. □

► Bemerkung

- Aus Gründen der Lesbarkeit schreiben wir in der Folge $\mathbb{P}(X \in A) = \mathbb{P}(\{\omega : X(\omega) \in A\})$
- Ist X die Identität, so fallen die Begriffe WMaß und WVerteilung zusammen.
- In der (weiterführenden) Literatur zu WTheorie wird oft auf die Angabe eines zugrundeliegenden WRaumes verzichtet und stattdessen eine “Zufallsvariable mit Verteilung \mathbb{P} auf Ω ” eingeführt. Gemeint ist (fast) immer X als Identität auf $(\Omega, \mathcal{F}, \mathbb{P})$ mit $\mathcal{F} = \mathcal{P}(\Omega)/\mathcal{B}(\Omega)$.

- Für die Verteilung von X unter \mathbb{P} schreibe \mathbb{P}_X und $X \sim \mathbb{P}_X$ für die Tatsache, dass X gemäß \mathbb{P}_X verteilt ist.

Definition 2.4 (identisch verteilt, reellen Zufallsvariablen)

Zwei Zufallsvariablen sind identisch verteilt, wenn sie dieselbe Verteilung haben. Von besonderem Interesse sind für uns die Zufallsvariablen, die nach $(\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$ abbilden, sogenannte reelle Zufallsvariablen.

Da die halboffenen Intervalle $\mathcal{B}(\mathbb{R})$ erzeugen, ist die Verteilung einer reellen Zufallsvariable durch die Werte $(-\infty, c], c \in \mathbb{R}$ eindeutig festgelegt.

Definition 2.5 ((kommutative) Verteilungsfunktion von \mathbb{P})

Sei $(\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}), \mathbb{P})$ WRaum, so heißt

$$F : \mathbb{R} \rightarrow [0, 1] \text{ mit } x \mapsto \mathbb{P}((-\infty, x])$$

(kommutative) Verteilungsfunktion von \mathbb{P} .

Ist X eine reelle Zufallsvariable auf beliebigem WRaum $(\Omega, \mathcal{F}, \mathbb{P})$, so heißt

$$F : \mathbb{R} \rightarrow [0, 1] \text{ mit } x \mapsto \mathbb{P}(X \leq x) = \mathbb{P}(X \in (-\infty, x])$$

die (kommutative) Verteilungsfunktion von X .

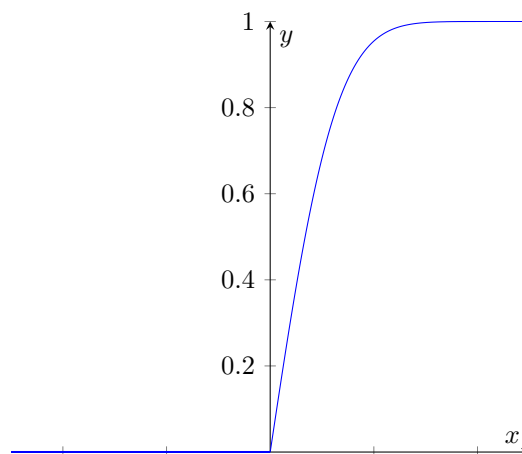
■ Beispiel 2.6

$(\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}), \mathbb{P})$ mit \mathbb{P} Exponentialverteilung mit Parameter $\lambda > 0$

$$\mathbb{P}(A) = \int_{A \cap [0, \infty)} \lambda e^{-\lambda x} dx \quad A \in \mathcal{B}(\mathbb{R})$$

Dann ist

$$F(x) = \mathbb{P}((-\infty, x]) = \begin{cases} 0 & x \leq 0 \\ \int_0^x \lambda e^{-\lambda y} dy = 1 - e^{-\lambda x} & x > 0 \end{cases}$$



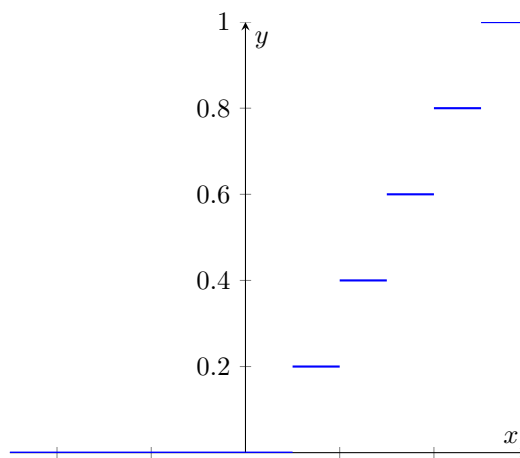
■ **Beispiel 2.7**

Das Würfeln mit einem fairen, sechseitigen Würfel kann mittels einer reellen Zufallsvariablen

$$X : \{1, 2, \dots, 6\} \rightarrow \mathbb{R} \text{ mit } x \mapsto x$$

modelliert werden. Es folgt als Verteilungsfunktion

$$\begin{aligned} F(x) &= \mathbb{P}(X \leq x) = \mathbb{P}(X^{-1}(-\infty, x]) = \mathbb{P}((-\infty, x]) \\ &= \frac{1}{6} \sum_{i=1}^6 \mathbb{1}_{i \leq x} \end{aligned}$$



Allgemein:

Satz 2.8

Ist \mathbb{P} ein WMaß auf $(\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$ und F die zugehörige Verteilungsfunktion, so gelten

1. F ist monoton wachsend
2. F ist rechtsseitig stetig
3. $\lim_{x \rightarrow -\infty} F(x) = 0$, $\lim_{x \rightarrow \infty} F(x) = 1$

Umgekehrt existiert zu jeder Funktion $F : \mathbb{R} \rightarrow [0, 1]$ mit Eigenschaften 1-3 eine reelle Zufallsvariable auf $((0, 1), \mathcal{B}((0, 1)), \mathbb{U}((0, 1)))$ mit Verteilungsfunktion F .

Beweis. Ist F Verteilungsfunktion, so folgt mit Satz 1.4

$$x \leq y \Rightarrow F(x) = \mathbb{P}((-\infty, x]) \stackrel{1.4.3}{\leq} \mathbb{P}((-\infty, y]) = F(y)$$

und

$$\lim_{m \searrow c} F(x) = \lim_{m \searrow c} \mathbb{P}((-\infty, x]) \stackrel{\sigma\text{-Stetigkeit}}{=} \mathbb{P}((-\infty, c]) = F(c)$$

sowie

$$\begin{aligned}\lim_{x \rightarrow -\infty} F(x) &\stackrel{1.4.5}{=} \mathbb{P}(\emptyset) \stackrel{1.4.1}{=} 0 \\ \lim_{x \rightarrow \infty} F(x) &\stackrel{1.4.5}{=} \mathbb{P}(\mathbb{R}) = 1.\end{aligned}\tag{1}$$

Umgekehrt wähle

$$X(u) := \inf\{x \in \mathbb{R} : F(x) \geq u\}, \quad u \in (0, 1)\tag{2}$$

Dann ist X eine “linkseitige Inverse” von F (auch Quantilfunktion / verallgemeinerte Inverse). Wegen 3 gilt:

$$-\infty < X(u) < \infty$$

und zudem

$$\{X \leq x\} = (0, F(x)) \cap (0, 1) \in \mathcal{B}((0, 1))$$

Da diese halboffene Mengen ein Erzeugendensystem von $\mathcal{B}(\mathbb{R})$ bilden, folgt bereits die Messbarkeit von X , also ist X eine ZV. Insbesondere hat die Menge $\{X \leq x\}$ gerade LEBESGUE-Maß $F(x)$ und damit hat X die Verteilungsfunktion F . \square

Folgerung 2.9

Ist \mathbb{P} WMaß auf $(\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$ und F die zugehörige Verteilungsfunktion. Dann besitzt \mathbb{P} genau eine Dichtefunktion ρ , wenn F stetig differenzierbar ist, denn dann gelten

$$F(x) = \int_{-\infty}^x \rho(x) \, dx, \quad \text{bzw.} \quad \rho(x) = F'(x)$$

Beweis. Folgt aus Satz 1.8, der Definition 2.5 der Verteilungsfunktion und dem Eindeutigkeitssatz Satz 1.9. \square

Kapitel II

Erste Standardmodelle der WTheorie

Diskrete Verteilungen

1. Diskrete Gleichverteilungen

Erinnerung:

► **Erinnerung (Definition I.1.10)**

Ist Ω endlich, so heißt WMaß mit Zähldichte

$$\rho(\omega) = \frac{1}{|\Omega|}, \omega \in \Omega$$

(diskrete) Gleichverteilung auf $\Omega \rightarrow U(\Omega)$

Es gilt das für jedes $A \in \mathcal{P}(\Omega)$

$$\mathbb{P}(A) = \frac{|A|}{|\Omega|}$$

Anwendungsbeispiele sind faires Würfeln, fairer Münzwurf, Zahlenlotto, ...

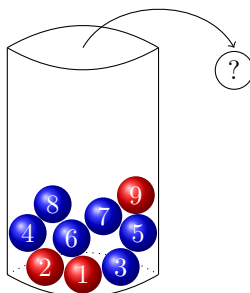
2. Urnenmodelle

Ein “Urnenmodell” ist eine abstrakte Darstellung von Zufallsexperimenten, bei denen zufällig Stichproben aus einer gegebenen Menge “gezogen” werden.

Definition (Urne)

Eine Urne ist ein Behältnis in welchem sich farbige/nummerierte Kugeln befinden, die ansonsten ununterscheidbar sind.

Aus der Urne ziehe man blind/zufällig eine oder mehrere Kugeln und notiere Farbe/Zahl.



2.1. Urnenmodell mit Zurücklegen: Multinomial-Verteilung

Gegeben: Urne mit N Kugeln, verschiedenfarbig mit Farben aus E , $|E| \geq 2$

Ziehe: n Stichproben/Kugeln, wobei nach jedem Zug die Kugel wieder zurückgelegt wird. Uns interessiert die Farbe in jedem Zug, setze also

$$\Omega = E^n \text{ und } \mathcal{F} = \mathcal{P}(\Omega)$$

Zur Bestimmung einer geeigneten WMaßes, nummerieren wir die Kugeln mit $1, \dots, N$, so dass alle Kugeln der Farbe $a \in E$ eine Nummer aus $F_a \subset \{1, \dots, N\}$ tragen. Würden wir die Nummern notieren, so wäre

$$\bar{\Omega} = \{1, \dots, N\}^n \text{ und } \bar{\mathcal{F}} = \mathcal{P}(\bar{\Omega})$$

und wir könnten die Gleichverteilung $\bar{\mathbb{P}} = U(\bar{\Omega})$ als WMaß für einem einzelnen Zug verwenden. Für den Übergang zu Ω konstruieren wir Zufallsvariablen. Die Farbe im i -ten Zug wird beschrieben durch

$$X_i : \bar{\Omega} \rightarrow E \text{ mit } \bar{\omega} = (\bar{\omega}_1, \dots, \bar{\omega}_n) \mapsto a \text{ falls } \bar{\omega}_i \in F_a$$

Der Zufallsvektor

$$X = (X_1, \dots, X_n) : \bar{\Omega} \rightarrow \Omega$$

beschreibt dann die Abfolge der Farben. Für jedes $\omega \in \Omega$ gilt dann

$$\{X = \omega\} = F_{\omega_1} \times \dots \times F_{\omega_n} = \bigtimes_{i=1}^n F_{\omega_i}$$

und damit

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(\{\omega\}) &= \bar{\mathbb{P}}(X^{-1}(\{\omega\})) = \bar{\mathbb{P}}(X = \omega) \\ &= \frac{|F_{\omega_1}| \cdots |F_{\omega_n}|}{|\bar{\Omega}|} \\ &= \prod_{i=1}^n \frac{|F_{\omega_i}|}{N} =: \prod_{i=1}^n \rho(\omega_i) \end{aligned}$$

Zähldichten, die sich als Produkt von Zähldichten schreiben lassen, werden auch als Produktdichten bezeichnet (\nearrow §3 Unabhängigkeit).

Sehr oft interessiert bei einem Urnenexperiment nicht die Reihenfolge der gezogenen Farben, sondern nur die Anzahl der Kugeln in Farbe $a \in E$ nach n Zügen. Dies entspricht

$$\hat{\Omega} = \left\{ k = (k_a)_{a \in E} \in \mathbb{N}_0^{|E|} : \sum_{a \in E} k_a = n \right\} \text{ und } \hat{\mathcal{F}} = \mathcal{P}(\hat{\Omega})$$

Den Übergang $\Omega \rightarrow \hat{\Omega}$ beschreiben wir durch die Zufallsvariablen

$$Y_a(\omega) : \Omega \rightarrow \mathbb{N}_0 \text{ mit } \omega = (\omega_1, \dots, \omega_n) \mapsto \sum_{a \in E} \mathbb{1}_{\{a\}}(\omega_i)$$

und

$$Y = (Y_a)_{a \in E} : \Omega \rightarrow \hat{\Omega}$$

Kapitel III

Test

Anhang

Index

- (absolut)stetig (bzgl. denn Lebesgue-Maß), 7
- (diskrete) Gleichverteilung, 8, 13
- (kummulative) Verteilungsfunktion von \mathbb{P} , 10
- (stetige) Gleichverteilung, 8
- DIRAC-Maß, 6
- DIRAC-Verteilung, 6
- KOLMOGOROVsche Axiome, 5
- Dichte, 7
- Dichtefunktion, 7
- Ereignisraum, 4
- Ergebnisraum, 4
- Exponentialverteilung, 7
- identisch verteilt, 10
- messbar, 4
- messbarer Raum, 4
- Produktdichten, 14
- Quantilfunktion, 12
- reelle Zufallsvariablen, 10
- verallgemeinerte Inverse, 12
- Wahrscheinlichkeitsdichte, 7
- Wahrscheinlichkeitsmaß, 5
- Wahrscheinlichkeitsraum, 8
- Wahrscheinlichkeitsverteilung, 5
- WVerteilung von X unter \mathbb{P} , 9
- Zähldichte, 7
- Zufallselement, 9