

Deskriptive Statistik

Teilbereiche der Statistik

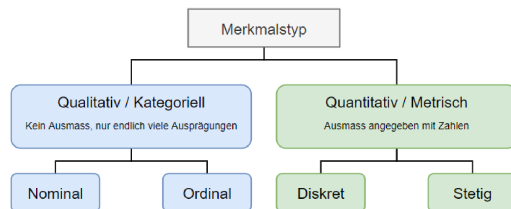
- **Deskriptive Statistik:** Beschreibung und übersichtliche Darstellung von Daten, Ermittlung von Kenngrößen und Datenvalidierung
- **Explorative Statistik:** Weiterführung und Verfeinerung der beschreibenden Statistik, insbesondere die Suche nach Strukturen und Besonderheiten
- **Induktive Statistik:** Versucht mithilfe der Wahrscheinlichkeitsrechnung über die erhobenen Daten hinaus allgemeinere Schlussfolgerungen zu ziehen

Statistische Grundbegriffe

- **Merkmalsträger/Statistische Einheiten:** Objekte, an denen interessierende Größen beobachtet und erfasst werden (z.B. Wohnungen, Menschen, Unternehmen)
- **Grundgesamtheit:** Alle statistischen Einheiten, über die man Aussagen gewinnen möchte. Kann endlich oder unendlich, real oder hypothetisch sein
- **Vollerhebung:** Eigenschaften werden bei jedem Individuum in der Grundgesamtheit erhoben
- **Stichprobe:** Untersuchte Teilmenge der Grundgesamtheit, soll diese möglichst genau repräsentieren
- **Stichprobenumfang:** Anzahl der Einheiten in der Stichprobe
- **Urliste:** Liste der beobachteten Stichprobenwerte
- **Merkmal:** Interessierende Grösse, die an den statistischen Einheiten beobachtet wird
- **Merkmalsausprägungen:** Verschiedene Werte, die jedes Merkmal annehmen kann

Merkmaltypen

- **Qualitativ/Kategorial:** eine Ausprägung, kein Ausmass angegeben
 - **Nominal:** Reine Kategorisierung, keine Ordnung
 - **Ordinal:** Ordnung vorhanden, Rangierung möglich
- **Quantitativ/Metrisch:** Es wird ein Ausmass mit Zahlen angegeben
 - **Diskret:** Endlich viele / abzählbar unendlich viele Ausprägungen
 - **Stetig:** Alle Ausprägungen in einem reellen Intervall



Merkmaltypen

- **Würfelfwurf (4-mal)** Messniveau: Metrisch diskret
 - Merkmalsausprägungen: Zahlen 1 bis 6
- **Parteiwahl (100 Menschen)** Messniveau: Nominal
 - Merkmalsausprägungen: BDP, CVP, FDP, GLP, etc.
- **Programmröbustheit (100 Tests)** Messniveau: Ordinal
 - Merkmalsausprägungen: schlecht, mittel, sehr gut
- **Programmlaufzeit (100 Tests)** Messniveau: Metrisch stetig
 - Merkmalsausprägungen: Laufzeiten

Häufigkeiten und Verteilungsfunktion

Grundlegende Begriffe

Symbole und Bezeichnungen

- Ω = Grundgesamtheit
- n = Anzahl Objekte (Stichprobenumfang)
- a = Ausprägungen
- a_i = i -te Ausprägung
- m = Anzahl verschiedener Merkmalsausprägungen
- d = Klassenbreite
- X = Stichprobenwerte
- x = Einzelner Stichprobenwert
- h = Absolute Häufigkeit
- f = Relative Häufigkeit
- H = Kumulative Absolute Häufigkeit
- F = Kumulative Relative Häufigkeit

Grundlegende Unterscheidungen

- **Diskrete vs. Stetige Merkmale:**
 - Diskret: PMF, Höhe = Wahrscheinlichkeit
 - Stetig: PDF, Fläche = Wahrscheinlichkeit
- **Nicht-klassiert vs. Klassiert:**
 - Nicht-klassiert: Einzelwerte
 - Klassiert: Intervalle mit Häufigkeitsdichten
- **Absolut vs. Relativ:**
 - Absolut: Konkrete Anzahlen
 - Relativ: Anteile (durch n geteilt)
- **Punktuell vs. Kumulativ:**
 - Punktuell: Häufigkeit an einem Punkt/in einer Klasse
 - Kumulativ: Aufsummierte Häufigkeiten bis zu einem Punkt

Absolute Häufigkeit $h_i = h(x)$

$$\sum_{i=1}^m h_i = n$$

h_i : Anzahl des Auftretens eines Wertes/einer Klasse a_i ($i = 1, \dots, m$)

Kumulative absolute Häufigkeit:

$$H(x) = \sum_{i: a_i \leq x} h_i$$

Relative Häufigkeit $f_i = \frac{h_i}{n}$

$$\sum_{i=1}^m f_i = 1$$

f_i = Anteil der absoluten Häufigkeit h_i am Stichprobenumfang n
Wertebereich: $0 \leq f_i \leq 1$

Kumulative relative Häufigkeit:

$$F(x) = \frac{H(x)}{n} = \sum_{i: a_i \leq x} f_i$$

Übersicht Häufigkeits- und Verteilungsfunktionen

Diskrete Merkmale:

- **PMF:** $f(x) = \frac{h(x)}{n}$, Höhe = rel. Häufigkeit
- **CDF:** $F(x) = \sum_{r \leq x} f(r)$, Treppenfunktion

Stetige/Klassierte Merkmale:

- **Absolute Häufigkeitsdichte:** $h = \frac{h_i}{d_i}$, Höhe im Histogramm
- **PDF:** $f = \frac{h_i}{n \cdot d_i} = \frac{f_i}{d_i}$, Fläche = rel. Häufigkeit
- **CDF:** $F(x) = \int_{-\infty}^x f(t) dt$, stetige Funktion

Zusammenhänge:

- $f(x) = F'(x)$ (für stetige Merkmale)
- $F(b) - F(a) = P(a < X \leq b)$ (Wahrscheinlichkeit im Intervall)
- Stets gilt: $0 \leq F(x) \leq 1$ und F monoton steigend

Häufigkeiten und Verteilungsfunktionen für stetige Merkmale

PMF (Probability Mass Function) relative Häufigkeitsfunktion

$$f(x) = P(X = x) = \frac{h(x)}{n}$$

- $f(x)$ ist die Wahrscheinlichkeit, dass X den Wert x annimmt
- Darstellung: Höhe der Säule/des Balkens entspricht $f(x)$
- Eigenschaften:
 - Summe = 1
 - $0 \leq f(x) \leq 1$
 - Keine Interpolation zwischen Werten

CDF (Cumulative Distribution Function)

$$F(x) = P(X \leq x) = \sum_{r \leq x} f(r)$$

- $F(x)$ ist die Wahrscheinlichkeit, dass X kleiner oder gleich x ist
- Darstellung: Treppenfunktion
- Eigenschaften:
 - Monoton steigend
 - Rechtsseitig stetig
 - Sprünge an den Ausprägungen
 - $0 \leq F(x) \leq 1$

Erstellen einer Häufigkeitsverteilung

1. Sammle alle verschiedenen Werte
2. Zähle absolute Häufigkeiten:
 - Wie oft kommt jeder Wert vor?
3. Berechne relative Häufigkeiten:
 - Teile jede absolute Häufigkeit durch n
4. Berechne kumulative Häufigkeiten:
 - Absolute: Summiere h_i von links nach rechts
 - Relative: Summiere f_i von links nach rechts

Würfelwurf Ein Würfel wird 20 Mal geworfen:

a_i	1	2	3	4	5	6	Total
h_i	4	3	4	0	6	3	20
f_i	4/20	3/20	4/20	0	6/20	3/20	1

Anwendung der Verteilungsfunktionen

1. Für kleine diskrete Datensätze: PMF und diskrete CDF verwenden
2. Für große stetige Datensätze:
 - Klassierung durchführen
 - PDF und stetige CDF berechnen
3. Bei klassierten Daten:
 - Klassenbreite beachten
 - Häufigkeitsdichten berechnen
4. Bei der Visualisierung:
 - Säulendiagramm für PMF
 - Histogramm für PDF
 - Treppenfunktion für diskrete CDF
 - Stetige Funktion für stetige CDF

Häufigkeiten und Verteilungsfunktionen für stetige/klassierte Merkmale

Klassierung von Daten Bei grossen Stichproben metrisch stetiger Merkmale teilt man die Stichprobenwerte in Klassen ein:

- Die Klassen sind aneinandergrenzende Intervalle
- Obere Intervallgrenzen zählen immer zum darauffolgenden Intervall
- Relative Häufigkeit eines Intervalls = Anzahl enthaltener Stichprobenwerte / Stichprobengrösse
- Die relative Häufigkeit eines Intervalls entspricht der Fläche des darüber liegenden Rechtecks im Histogramm

Klassenbildung (Faustregeln)

- Die Klassen sollten gleich breit gewählt werden
- Die Anzahl der Klassen sollte etwa zwischen 5 und 20 liegen
- Die Anzahl der Klassen sollte \sqrt{n} nicht wesentlich überschreiten
- Klassengrenzen sollten 'runde' Zahlen sein
- Werte auf Klassengrenzen kommen in die obere Klasse

Absolute Häufigkeitsdichte: $h = \frac{h_i}{d_i}$

Bei klassierten Daten wird die Häufigkeit als Rechtecksfläche über der Klassenbreite d_i dargestellt. Höhe des Rechtecks entspricht der absoluten Häufigkeitsdichte.

PDF (Probability Density Function) $f = \frac{f_i}{d_i}$

- $f(x)$ ist die Dichte der Verteilungsfunktion $F(x)$ (relative Häufigkeitsdichte)
- Darstellung: Fläche unter der Kurve entspricht $F(x)$
- Bei Histogramm: Rechteckfläche = relative Häufigkeit der Klasse

CDF Kumulative Verteilungsfunktion für klassierte Daten
Durch Integration der relativen Häufigkeitsfunktion (PDF) $f(x)$ erhält man die kumulative Verteilungsfunktion (CDF):

$$F(x) = \int_{-\infty}^x f(t)dt$$

Eigenschaften der CDF

- $F(x)$ ist stetig, monoton steigend und stückweise differenzierbar
- Die Werte von $F(x)$ an den rechten Klassengrenzen erhält man durch Kumulieren der relativen Häufigkeiten f_i im kompletten Intervall
- $F(x) = \sum_{r \leq x} f(r)$ mit der relativen Häufigkeitsfunktion (PMF)
- $0 \leq F(x) \leq 1$ für alle reellen Zahlen x
- Der Graph von $F(x)$ ist eine rechtsseitig stetige Treppenfunktion
- Es gibt eine reelle Zahl x mit $F(x) = 0$ und y mit $F(y) = 1$
- Der Anteil aller Stichprobenwerte x_i im Bereich $a < x_i \leq b$ berechnet sich als $F(b) - F(a)$

Berechnung der CDF für klassierte Daten

- Bestimme für jede Klasse: d_i, h_i, f_i
- Bestimme kumulative Häufigkeiten H_i
- CDF Berechnung:
 - Bestimme kumulative Häufigkeiten H_i
 - Teile durch Stichprobengrösse: $F(x) = \frac{H(x)}{n}$
- Werte der CDF:
 - An linker Klassengrenze: $F(x)$ entspricht kumulierter Häufigkeit bis vorherige Klasse
 - An rechter Klassengrenze: $F(x)$ entspricht kumulierter Häufigkeit bis aktuelle Klasse

Programmlaufzeiten Ein Programm wird auf 20 Rechnern ausgeführt. Folgende Laufzeiten (in ms) werden gemessen: 400, 399, 398, 400, 398, 399, 397, 400, 402, 399, 401, 399, 400, 402, 398, 400, 399, 401, 399, 399

a_i	397	398	399	400	401	402	Total
h_i	1	3	7	5	2	2	20
f_i	1/20	3/20	7/20	5/20	2/20	2/20	1
H_i	1	4	11	16	18	20	
F_i	1/20	4/20	11/20	16/20	18/20	1	

Kenngrossen

Arten von Kenngrossen

- Lagemasse:** Beschreiben das Zentrum der Verteilung
- Streuungsmasse:** Charakterisieren die Abweichung vom Zentrum
- Schiefemasse:** Beschreiben die Form der Verteilung

Quantile

Quantile Für eine reelle Zahl $0 \leq q \leq 1$ heisst eine Zahl R ein q -Quantil der Stichprobe x_1, x_2, \dots, x_n , falls:

- Der Anteil der Stichprobenwerte $x_i \leq R$ mindestens q ist
- Der Anteil der Stichprobenwerte $x_i \geq R$ mindestens $1 - q$ ist

Die 0.25, 0.5 und 0.75-Quantile werden auch 1., 2. und 3. Quartil genannt.

Quantil $Q = x_i = x_{[n \cdot q]}$

Position des Quantils: $i = [n \cdot q]$
 n : Anzahl der Beobachtungen
 q : Quantilswert (zB. 0.25 für Q_1)
 x_i : Beobachtung an Position i .

Interquartilsabstand

$IQR = Q_3 - Q_1$
 Q_3 : Oberes Quartil (75%)
 Q_1 : Unteres Quartil (25%)

Berechnung von Quantilen

- Für eine geordnete Stichprobe $x_{[1]} \leq x_{[2]} \leq \dots \leq x_{[n]}$:
- Berechne $n \cdot q$
 - Falls $n \cdot q$ eine ganze Zahl ist: $R_q = \frac{1}{2}(x_{n \cdot q} + x_{n \cdot q + 1})$
 - Falls $n \cdot q$ keine ganze Zahl ist: $R_q = x_{[n \cdot q]}$
 - Wobei $[n \cdot q]$ die nächstgrössere ganze Zahl ist

Berechnung von Lageparametern

- Sortiere die Daten aufsteigend
- Berechne den Mittelwert: Summe aller Werte / Anzahl Werte
- Bestimme den Median:
 - Bei ungerader Anzahl: mittlerer Wert
 - Bei gerader Anzahl: Mittelwert der beiden mittleren Werte
- Finde den Modus (häufigster Wert)
- Berechne die Quartile:
 - Q_1 : 25%-Quantil, Q_2 : Median, Q_3 : 75%-Quantil

Berechnung von Quantilen Datenreihe: 2, 4, 4, 5, 7, 8, 9, 10 ($n = 8$)

Berechnung Q_1 (25%-Quantil): $Q_1 = x_2 = 4$

$i = [8 \cdot 0.25] = [2] = 2$

Berechnung Q_2 (Median): $Q_2 = (5 + 7)/2 = 6$

n gerade \rightarrow Mittelwert von Position 4 und 5

Berechnung Q_3 (75%-Quantil): $Q_3 = x_6 = 8$

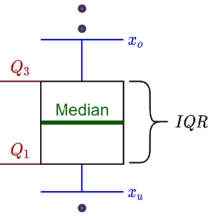
$i = [8 \cdot 0.75] = [6] = 6$

Interquartilsabstand: $IQR = Q_3 - Q_1 = 8 - 4 = 4$

Boxplot

Boxplot besteht aus:

- Box: Begrenzt durch Q_1 und Q_3
- Mittellinie: Median = $Q_2 = x_{med}$
- $IQR = Q_3 - Q_1$ (Interquartilsabstand)
- Antennen (Whisker):
 - Untere Antenne: x_u :
 $u = \min [Q_1 - 1.5 \cdot IQR, Q_1]$
 \rightarrow Minimum der Werte $\geq Q_1 - 1.5 \cdot IQR$
 - Obere Antenne: x_o :
 $o = \max [Q_3 + 1.5 \cdot IQR, Q_3]$
 \rightarrow Maximum der Werte $\leq Q_3 + 1.5 \cdot IQR$
- Ausreisser: alle Werte ausserhalb der Antennen: $x_i < x_u \vee x_i > x_o$



Erstellen eines Boxplots

- Berechne die Quartile Q_1, Q_2 (Median) und Q_3
- Bestimme den Interquartilsabstand $IQR = Q_3 - Q_1$
- Berechne die Grenzen für Ausreisser:
 - Untere Grenze: $Q_1 - 1.5 \cdot IQR$ und Obere Grenze: $Q_3 + 1.5 \cdot IQR$
- Zeichne Box mit:
 - Unterer Rand bei Q_1 , Mittellinie bei Q_2 , Oberer Rand bei Q_3
- Zeichne Antennen bis zum:
 - Kleinsten Wert \geq untere Grenze
 - Grössten Wert \leq obere Grenze
- Markiere alle Werte ausserhalb als Ausreisser

Boxplot - Praktisches Beispiel Messwerte: 2, 3, 5, 6, 7, 8, 9, 15, 50

- Sortiere Werte: 2, 3, 5, 6, 7, 8, 9, 15, 50
- Bestimme Quartile:
 - $Q_1 = 4$ (25%-Quantil), $Q_2 = 7$ (Median), $Q_3 = 12$ (75%-Quantil)
- $IQR = 12 - 4 = 8$
- Ausreisser-Grenzen:
 - Untere: $4 - 1.5 \cdot 8 = -8$
 - Obere: $12 + 1.5 \cdot 8 = 24$
- 50 ist ein Ausreisser (> 24)

Lagekennwerte/Lageparameter

Arithmetisches Mittel \bar{x} ist der Durchschnitt der Stichprobenwerte:

$$\bar{x} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i = \sum_{i=1}^m a_i \cdot f_i$$

- a_i : Klassenmitte
- x_i : Einzelner Stichprobenwert
- f_i : Relative Häufigkeit

Median Das 2. Quartil wird auch Median oder Zentralwert genannt:

$$\text{Median}(x_1, \dots, x_n) = x_{med} = \begin{cases} x_{[\frac{n+1}{2}]} & \text{falls } n \text{ ungerade} \\ \frac{1}{2}(x_{[\frac{n}{2}]} + x_{[\frac{n}{2}+1]}) & \text{falls } n \text{ gerade} \end{cases}$$

teilt Datensatz in zwei gleich grosse Hälften

Modus x_{mod} = Häufigster Wert in der Stichprobe

- Mittelwert reagiert empfindlich auf Ausreißer (A)
- Median ist robuster gegen Ausreißer
- Modus zeigt Häufungen, kann mehrfach auftreten

Streuungskennwerte

- s : Stichprobenstandardabweichung
- s_{kor} : Korrigierte Stichprobenstandardabweichung
- s^2 : Stichprobenvarianz
- s_{kor}^2 : Korrigierte Stichprobenvarianz
- \bar{x} : Arithmetisches Mittel
- x_i : Einzelner Stichprobenwert

Streuungsmasse

Stichprobenvarianz:

$$s^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2 - \bar{x}^2 = \overline{x^2} - \bar{x}^2$$

Korrigierte Stichprobenvarianz:

$$s_{kor}^2 = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2 = \frac{n}{n-1} s^2$$

Standardabweichung:

$$s = \sqrt{s^2} = \sqrt{\overline{x^2} - \bar{x}^2} \quad \text{bzw.} \quad s_{kor} = \sqrt{s_{kor}^2}$$

Berechnung der Stichprobenvarianz

1. Berechne den Mittelwert \bar{x}
2. Für jeden Wert x_i :
 - 2.1 Berechne Abweichung vom Mittelwert $(x_i - \bar{x})$
 - 2.2 Quadriere die Abweichung $(x_i - \bar{x})^2$
3. Summiere alle quadrierten Abweichungen
4. Teile durch $(n - 1)$ für korrigierte Varianz
5. Alternative Berechnung:
 - 5.1 Berechne $\overline{x^2}$ (Mittelwert der quadrierten Werte)
 - 5.2 Berechne $(\bar{x})^2$ (Quadrat des Mittelwerts)
 - 5.3 Varianz $= \overline{x^2} - (\bar{x})^2$

Berechnung von Varianz und Standardabweichung

Gegeben sei die Datenreihe: 2, 4, 4, 6, 9

Schritt 1: Mittelwert berechnen: $\bar{x} = \frac{2+4+4+6+9}{5} = 5$

Schritt 2: Abweichungen quadrieren:

x_i	$(x_i - \bar{x})$	$(x_i - \bar{x})^2$
2	-3	9
4	-1	1
4	-1	1
6	1	1
9	4	16

Schritt 3: Varianz berechnen: $s_{kor}^2 = \frac{9+1+1+1+16}{5-1} = \frac{28}{4} = 7$

Schritt 4: Standardabweichung berechnen: $s_{kor} = \sqrt{7} \approx 2.65$

Alternative Berechnung:

- $\overline{x^2} = \frac{4+16+16+36+81}{5} = 30.6$
- $(\bar{x})^2 = 5^2 = 25$
- $s^2 = 30.6 - 25 = 5.6$
- $s_{kor}^2 = \frac{5}{4} \cdot 5.6 = 7$

Form der Verteilung

Verteilungsformen

- **Symmetrisch:** Rechte und linke Hälfte spiegelbildlich
- **Linkssteil (rechtsschief):**
 - Daten links konzentriert
 - $x_{mod} < x_{med} < \bar{x}$
- **Rechtssteil (linksschief):**
 - Daten rechts konzentriert
 - $x_{mod} > x_{med} > \bar{x}$
- **Modalität:**
 - Unimodal: Ein Maximum
 - Bimodal/Multimodal: Mehrere Maxima

Deskriptive Statistik (mehrere Merkmale)

Bei vielen Fragestellungen sind verschiedene Merkmale bei einem Merkmalsträger interessant. Teilweise ist auch das Ziel der Untersuchungen, Zusammenhänge zwischen diesen Merkmalen zu finden.

Multivariate Daten

- **Bivariate Daten:** Zwei Merkmale pro Merkmalsträger
- **Multivariate Daten:** Mehrere Merkmale pro Merkmalsträger

Bivariate Daten

Grafische Darstellung

Darstellungsformen nach Merkmalstypen

- **Zwei kategoriale Merkmale:**
 - Kontingenztafeln
 - Mosaikplots
- **Ein kategorielles + ein metrisches Merkmal:**
 - Boxplots
 - Stripcharts
 - Kennwerte pro Kategorie
- **Zwei metrische Merkmale:**
 - Streudiagramm (Scatterplot)
 - Punktwolke in der (x,y)-Ebene

Analyse von Streudiagrammen

1. Untersuche die **Form** des Zusammenhangs:
 - Linear: Punkte streuen um Gerade
 - Gekrümmt: Punkte folgen einer Kurve
 - Mehrere Punktwolken vorhanden?
2. Bestimme die **Richtung**:
 - Positiv: y-Werte steigen mit x-Werten
 - Negativ: y-Werte fallen mit x-Werten
 - Kein Trend erkennbar
3. Beurteile die **Stärke**:
 - Wenig Streuung: starker Zusammenhang
 - Große Streuung: schwacher Zusammenhang
 - Auf Ausreißer achten

Korrelation

Kovarianz Die Kovarianz ist ein Maß für den linearen Zusammenhang:

$$s_{xy} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})$$

Alternative Berechnungsformel:

$$s_{xy} = \overline{xy} - \bar{x}\bar{y}$$

mit $\overline{xy} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i y_i$

Korrelationskoeffizient nach Pearson Der Pearson-Korrelationskoeffizient normiert die Kovarianz:

$$r_{xy} = \frac{s_{xy}}{s_x \cdot s_y}$$

Eigenschaften:

- $-1 \leq r_{xy} \leq 1$
- $r_{xy} \approx 1$: starker positiver linearer Zusammenhang
- $r_{xy} \approx -1$: starker negativer linearer Zusammenhang
- $r_{xy} \approx 0$: kein linearer Zusammenhang

Rangkorrelationskoeffizient nach Spearman Für monotone Zusammenhänge wird der Spearman-Koeffizient verwendet:

$$r_{Sp} = \frac{s_{rg(xy)}}{s_{rg(x)} \cdot s_{rg(y)}}$$

Bei unterschiedlichen Rängen gilt vereinfacht:

$$r_{Sp} = 1 - \frac{6 \sum_{i=1}^n d_i^2}{n(n^2 - 1)}$$

mit $d_i = rg(x_i) - rg(y_i)$ (Rangdifferenzen)

Unterschied Pearson und Spearman

- **Pearson:**
 - Misst linearen Zusammenhang
 - Empfindlich gegen Ausreißer
 - Für metrische Daten
- **Spearman:**
 - Misst monotonen Zusammenhang
 - Robust gegen Ausreißer
 - Auch für ordinale Daten

Scheinkorrelation Eine Korrelation zwischen zwei Merkmalen bedeutet nicht automatisch einen kausalen Zusammenhang:

- Ein drittes Merkmal könnte beide beeinflussen
- Der Zusammenhang könnte zufällig sein
- Ausreißer können das Ergebnis verzerren

Mehrere Merkmale

- Darstellung multivariater Daten
- **Kategorielle Merkmale:**
 - Mehrdimensionale Kontingenztafeln
 - Farbliche Codierung zusätzlicher Dimensionen
 - **Metrische Merkmale:**
 - Matrix von Streudiagrammen
 - Korrelationsmatrix

Kombinatorik

Bei vielen Wahrscheinlichkeitsproblemen ist es möglich, durch geschicktes Abzählen Wahrscheinlichkeiten zu ermitteln. Dazu sind kombinatorische Überlegungen erforderlich.

Grundbegriffe

- Fakultät** Die Fakultät $n!$ ist für eine natürliche Zahl n rekursiv definiert:
- Startwert: $0! = 1$
 - Für $n \geq 1$: $n! = n \cdot (n - 1)!$
- Beispiel: $4! = 4 \cdot 3! = 4 \cdot 3 \cdot 2! = 4 \cdot 3 \cdot 2 \cdot 1! = 4 \cdot 3 \cdot 2 \cdot 1 \cdot 0! = 24$

Binomialkoeffizient Der Binomialkoeffizient $\binom{n}{k}$ ist für natürliche Zahlen $0 \leq k \leq n$ definiert als:

$$\binom{n}{k} = \frac{n!}{(n - k)! \cdot k!}$$

Er gibt die Anzahl Möglichkeiten an, aus n Objekten k Objekte auszuwählen.

Grundlegende Abzählmethoden

Systematik der Kombinatorik Man unterscheidet vier grundlegende Abzählprobleme:

	Mit Wiederholung	Ohne Wiederholung
Variation (Reihenfolge wichtig)	n^k	$\frac{n!}{(n - k)!}$
Kombination (Reihenfolge unwichtig)	$\binom{n + k - 1}{k}$	$\binom{n}{k}$

- Bestimmung der Abzählmethode** 1. **Analysiere das Problem:**
- n : Anzahl verfügbarer Objekte
 - k : Anzahl auszuwählender Objekte
2. **Prüfe die Reihenfolge:**
- Ist die Reihenfolge wichtig? \rightarrow Variation
 - Ist nur die Auswahl wichtig? \rightarrow Kombination
3. **Prüfe Wiederholungen:**
- Dürfen Objekte mehrfach vorkommen? \rightarrow Mit Wiederholung
 - Darf jedes Objekt nur einmal? \rightarrow Ohne Wiederholung
4. **Wähle die passende Formel**

- Variation mit Wiederholung** **Zahlenschloss:** 6 Stellen, Ziffern 0-9 möglich
- $n = 10$ Ziffern
 - $k = 6$ Stellen
 - Reihenfolge wichtig
 - Wiederholung erlaubt
 - Lösung: $10^6 = 1\,000\,000$ Möglichkeiten

- Variation ohne Wiederholung** **Schwimmwettkampf:** Erste 3 Plätze bei 10 Schwimmern
- $n = 10$ Schwimmer
 - $k = 3$ Plätze
 - Reihenfolge wichtig
 - Keine Wiederholung möglich
 - Lösung: $\frac{10!}{7!} = 720$ Möglichkeiten

- Kombination mit Wiederholung** **Zahnarzt:** 3 Spielzeuge aus 5 verschiedenen Arten
- $n = 5$ Arten
 - $k = 3$ Spielzeuge
 - Reihenfolge unwichtig
 - Wiederholung möglich
 - Lösung: $\binom{7}{3} = 35$ Möglichkeiten

- Kombination ohne Wiederholung** **Lotto:** 6 aus 49
- $n = 49$ Zahlen
 - $k = 6$ Auswahl
 - Reihenfolge unwichtig
 - Keine Wiederholung
 - Lösung: $\binom{49}{6} = 13\,983\,816$ Möglichkeiten

Eigenschaften der Binomialkoeffizienten

- Eigenschaften** Für den Binomialkoeffizienten gelten:
- Leere Menge: $\binom{n}{0} = 1$
 - Symmetrie: $\binom{n}{k} = \binom{n}{n - k}$
 - Pascal'sche Rekursion: $\binom{n + 1}{k + 1} = \binom{n}{k} + \binom{n}{k + 1}$
 - Summe: $\sum_{k = 0}^n \binom{n}{k} = 2^n$

- Berechnung von Binomialkoeffizienten** 1. **Prüfe Spezialfälle:**
- $\binom{n}{0} = \binom{n}{n} = 1$
 - $\binom{n}{1} = n$
2. **Nutze Symmetrie:**
- $\binom{n}{k} = \binom{n}{n - k}$
3. **Pascal'sches Dreieck**
- Baue schrittweise auf
 - Nutze Rekursionsformel
4. **Direkte Berechnung**
- Nur wenn nötig
 - Kürze vor dem Ausrechnen

Elementare Wahrscheinlichkeitsrechnung

Diskrete Wahrscheinlichkeitsräume

- Ergebnisraum und Zähl-dichte** Ein Zufallsexperiment ist ein Vorgang, bei dem folgende Bedingungen erfüllt sind:
- Der Vorgang lässt sich unter den gleichen äußeren Bedingungen beliebig oft wiederholen
 - Es sind mehrere sich gegenseitig ausschließende Ergebnisse möglich
 - Das Ergebnis lässt sich nicht mit Sicherheit voraussagen, sondern ist zufallsbedingt
- Der **Ergebnisraum** Ω ist die Menge aller möglichen Ergebnisse des Zufallsexperiments.
- Die **Zähl-dichte** $\rho : \Omega \rightarrow [0, 1]$ ordnet jedem Ergebnis $\omega \in \Omega$ seine Wahrscheinlichkeit zu, wobei $\sum_{\omega \in \Omega} \rho(\omega) = 1$ gilt.

Ereignisse und Wahrscheinlichkeitsraum Ein **Ereignis** ist eine Teilmenge des Ergebnisraums Ω . Der **Ereignisraum** 2^Ω ist die Menge aller möglichen Ereignisse (Potenzmenge von Ω).

Das **Wahrscheinlichkeitsmaß** $P : 2^\Omega \rightarrow [0, 1]$ ist definiert durch:

$$P(M) = \sum_{\omega \in M} \rho(\omega) \text{ für } M \subseteq \Omega$$

Ein **Laplace-Raum** liegt vor, wenn alle Elementarereignisse gleich wahrscheinlich sind:

$$P(M) = \frac{|M|}{|\Omega|}$$

- Eigenschaften von Wahrscheinlichkeitsräumen** Für einen diskreten Wahrscheinlichkeitsraum (Ω, P) gelten:
- (A1) Unmögliches Ereignis: $P(\emptyset) = 0$
 - (A2) Sicheres Ereignis: $P(\Omega) = 1$
 - (A3) Komplementäres Ereignis: $P(\Omega \setminus A) = 1 - P(A)$
 - (A4) Vereinigung: $P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A \cap B)$
 - (A5) Sigma-Additivität: Für paarweise disjunkte Ereignisse gilt:
 $P(A_1 \cup A_2 \cup A_3 \cup \dots) = P(A_1) + P(A_2) + P(A_3) + \dots$

Zufallsvariablen

Zufallsvariablen Eine **Zufallsvariable** X ist eine Funktion $X : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$, die jedem Ergebnis eine reelle Zahl zuordnet.

Die **Wahrscheinlichkeitsfunktion** (PMF) ist definiert durch:

$$f(x) = P(X = x) = P(\{\omega \in \Omega : X(\omega) = x\})$$

Die **Verteilungsfunktion** (CDF) ist definiert durch:

$$F(x) = P(X \leq x) = \sum_{t \leq x} f(t)$$

- Eigenschaften von PMF und CDF**
- $\sum_{x \in \mathbb{R}} f(x) = 1$ und $F(x) = \sum_{t \leq x} f(t)$
 - $\lim_{x \rightarrow \infty} F(x) = 1$ und $\lim_{x \rightarrow -\infty} F(x) = 0$
 - Monotonie: $x \leq y \Rightarrow F(x) \leq F(y)$
 - $P(a < X \leq b) = F(b) - F(a)$

Kenngrößen

Erwartungswert und Varianz Für eine diskrete Zufallsvariable X sind definiert:
Erwartungswert:

$$E(X) = \sum_{x \in \mathbb{R}} x \cdot f(x)$$

Varianz:

$$V(X) = E((X - E(X))^2) = \sum_{x \in \mathbb{R}} (x - E(X))^2 \cdot f(x)$$

Standardabweichung:

$$S(X) = \sqrt{V(X)}$$

Rechenregeln für Erwartungswert und Varianz

- Linearität: $E(aX + b) = aE(X) + b$
- Verschiebungssatz: $V(X) = E(X^2) - (E(X))^2$
- Lineare Transformation: $V(aX + b) = a^2V(X)$

Bedingte Wahrscheinlichkeit

Bedingte Wahrscheinlichkeit Die **bedingte Wahrscheinlichkeit** von B unter der Bedingung A ist:

$$P(B|A) = \frac{P(A \cap B)}{P(A)} \quad \text{für } P(A) > 0$$

Multiplikationssatz

$$P(A \cap B) = P(A) \cdot P(B|A) = P(B) \cdot P(A|B)$$

Satz von der totalen Wahrscheinlichkeit

$$P(B) = P(A) \cdot P(B|A) + P(\bar{A}) \cdot P(B|\bar{A})$$

Satz von Bayes

$$P(A|B) = \frac{P(A) \cdot P(B|A)}{P(B)}$$

Ereignisbäume 1. **Aufbau**

- Von links nach rechts zeichnen
- Alle Verzweigungen vollständig angeben
- Übergangswahrscheinlichkeiten an Äste schreiben

2. **Pfadwahrscheinlichkeiten**

- Multiplikation entlang des Pfades
- Für jedes Endereignis alle Pfade addieren
- Summe aller Pfadwahrscheinlichkeiten = 1

Stochastische Unabhängigkeit

Stochastische Unabhängigkeit Zwei Ereignisse A und B heißen **stochastisch unabhängig**, falls:

$$P(A \cap B) = P(A) \cdot P(B)$$

Zwei Zufallsvariablen X und Y heißen **stochastisch unabhängig**, falls für alle $x, y \in \mathbb{R}$:

$$P(X = x, Y = y) = P(X = x) \cdot P(Y = y)$$

Eigenschaften der stochastischen Unabhängigkeit Für unabhängige Ereignisse A und B gilt:

- A und $\Omega \setminus B$ sind unabhängig
- $\Omega \setminus A$ und $\Omega \setminus B$ sind unabhängig
- $P(A|B) = P(A)$ falls $P(B) > 0$

Für unabhängige Zufallsvariablen X und Y gilt:

- $E(X \cdot Y) = E(X) \cdot E(Y)$
- $V(X + Y) = V(X) + V(Y)$

Spezielle Verteilungen

Diskrete und Stetige Zufallsvariablen

Diskrete und Stetige Zufallsvariablen Bei einer **diskreten Zufallsvariable** gibt es immer Lücken zwischen den Werten; sie kann nur bestimmte Werte annehmen.

Eine **stetige Zufallsvariable** hat ein kontinuierliches Spektrum von möglichen Werten.

Berechnung von Wahrscheinlichkeiten:

- Diskret: $P(X = x) = f(x)$ (PMF)
- Stetig: $P(X \leq x) = \int_{-\infty}^x f(t)dt$ (CDF)

Gegenüberstellung von diskreten und stetigen Zufallsvariablen

	Diskrete ZV	Stetige ZV
Dichtefunktion	$f(x) = P(X = x)$	$f(x) = P'$
Verteilungsfunktion	$F(x) = \sum_{x \leq X} f(x)$	$F(x) = \int_{-\infty}^x f(t)dt$
Wahrscheinlichkeiten	$P(a \leq X \leq b) = \sum_{a \leq x \leq b} f(x)$	$P(a \leq X \leq b) = \int_a^b f(t)dt$
Erwartungswert	$E(X) = \sum_{x \in \mathbb{R}} x \cdot f(x)$	$E(X) = \int_{-\infty}^{\infty} x \cdot f(x)dx$
Varianz	$V(X) = \sum_{x \in \mathbb{R}} (x - E(X))^2 \cdot f(x)$	$V(X) = \int_{-\infty}^{\infty} (x - E(X))^2 \cdot f(x)dx$

Diskrete Verteilungen

Übersicht der diskreten Verteilungen

Verteilung	Notation	$E(X)$	$V(X)$
Hypergeometrisch	$H(N, M, n)$	$n \cdot \frac{M}{N}$	$n \cdot \frac{M}{N} \cdot (1 - \frac{M}{N}) \cdot \frac{N-n}{N-1}$
Binomial	$B(n, p)$	$n \cdot p$	$n \cdot p \cdot q$
Poisson	$Poi(\lambda)$	λ	λ

Hypergeometrische Verteilung Ziehen **ohne Zurücklegen** aus einer endlichen Grundgesamtheit.

Parameter:

- N : Grundgesamtheit
- M : Anzahl Merkmalsträger
- n : Stichprobenumfang

Wahrscheinlichkeitsfunktion:

$$P(X = k) = \frac{\binom{M}{k} \cdot \binom{N-M}{n-k}}{\binom{N}{n}}$$

Kenngrößen:

- $E(X) = n \cdot \frac{M}{N}$
- $V(X) = n \cdot \frac{M}{N} \cdot (1 - \frac{M}{N}) \cdot \frac{N-n}{N-1}$

Notation: $X \sim H(N, M, n)$

Binomialverteilung n -malige **unabhängige Wiederholung** eines Bernoulli-Experiments.

Parameter:

- n : Anzahl Versuche
- p : Erfolgswahrscheinlichkeit
- $q = 1 - p$: Gegenwahrscheinlichkeit

Wahrscheinlichkeitsfunktion:

$$P(X = k) = \binom{n}{k} \cdot p^k \cdot q^{n-k}$$

Kenngrößen:

- $E(X) = n \cdot p$
- $V(X) = n \cdot p \cdot q$

Notation: $X \sim B(n, p)$

Poissonverteilung Modelliert **seltene Ereignisse** in einem festen Intervall.

Parameter:

- λ : Erwartungswert/Rate pro Intervall

Wahrscheinlichkeitsfunktion:

$$P(X = k) = \frac{\lambda^k}{k!} \cdot e^{-\lambda}$$

Kenngrößen:

- $E(X) = \lambda$
- $V(X) = \lambda$

Notation: $X \sim Poi(\lambda)$

Stetige Verteilungen

Normalverteilung Die Dichtefunktion der Normalverteilung ist:

varphi_{mu,sigma}(x) = 1 / (sqrt(2*pi) * sigma) * e^{-1/2 * (x-mu)^2 / sigma^2}

- Parameter:**
- mu: Erwartungswert (Lage)
 - sigma: Standardabweichung (Streuung)

- Eigenschaften:**
- Symmetrisch um mu
 - Wendepunkte bei mu +/- sigma
 - Ca. 68% der Werte in [mu - sigma, mu + sigma]
 - Ca. 95% der Werte in [mu - 2sigma, mu + 2sigma]
 - Ca. 99,7% der Werte in [mu - 3sigma, mu + 3sigma]

Notation: X ~ N(mu, sigma)

Zentraler Grenzwertsatz und Approximationen

- Zentraler Grenzwertsatz** Für die Summe S_n = X_1 + ... + X_n von n unabhängigen, identisch verteilten Zufallsvariablen mit E(X_i) = mu und V(X_i) = sigma^2 gilt:
- S_n ist approximativ normalverteilt
 - E(S_n) = n*mu
 - V(S_n) = n*sigma^2

- Für das arithmetische Mittel X_bar_n = S_n/n gilt:
- X_bar_n ist approximativ normalverteilt
 - E(X_bar_n) = mu
 - V(X_bar_n) = sigma^2/n

Approximationsregeln Binomialverteilung -> Normalverteilung:

- Bedingung: npq > 9
- B(n, p) approx N(np, sqrt(npq))
- Stetigkeitskorrektur beachten!

Binomialverteilung -> Poissonverteilung:

- Bedingung: n >= 50 und p <= 0.1
- B(n, p) approx Poi(np)

Hypergeometrisch -> Binomialverteilung:

- Bedingung: n <= N/20
- H(N, M, n) approx B(n, M/N)

Wahl der richtigen Verteilung 1. Diskrete Verteilungen:

- Ziehen ohne Zurücklegen: Hypergeometrisch
- Unabhängige Versuche: Binomial
- Seltene Ereignisse: Poisson

2. Approximationen prüfen:

- npq > 9: Normal-Approximation möglich
- n >= 50, p <= 0.1: Poisson-Approximation möglich
- n <= N/20: Binomial-Approximation möglich

3. Stetigkeitskorrektur:

- Bei Normal-Approximation: +/- 0.5 an den Grenzen
- P(X <= k) approx P(X <= k + 0.5)
- P(X = k) approx P(k - 0.5 <= X <= k + 0.5)

Die Methode der kleinsten Quadrate

Einführung

Einführung

Die Methode der kleinsten Quadrate ist eine weit verbreitete Optimierungsmethode zur Modellierung mathematischer Zusammenhänge in großen Datenmengen. Das Ziel ist es, optimale Parameter zu finden, die den funktionalen Zusammenhang zwischen Messdaten am besten beschreiben. Bei der linearen Regression wird beispielsweise ein linearer Zusammenhang zwischen den Daten vermutet und versucht, eine optimale Gerade in die Datenmenge einzupassen.

Lineare Regression

Lineare Regression

Gegeben sind Datenpunkte (x_i; y_i) mit 1 <= i <= n, die näherungsweise auf einer Geraden liegen. Die Residuen oder Fehler epsilon_i = y_i - g(x_i) dieser Datenpunkte sind die Abstände in y-Richtung zwischen y_i und der Geraden g.

Die "bestmögliche" Gerade, die Ausgleichs- oder Regressionsgerade, ist diejenige Gerade, für die die Summe der quadrierten Residuen sum_{i=1}^n epsilon_i^2 am kleinsten ist:

sum_{i=1}^n (y_i - g(x_i))^2 = sum_{i=1}^n (y_i - y_hat_i)^2

- mit:
- y_i: beobachtete y-Werte
 - y_hat_i: prognostizierte bzw. erklärte y-Werte
 - epsilon_i: Residuen (oder auch Fehler)

Parameter der Regressionsgerade

Die Regressionsgerade g(x) = mx + d mit den Parametern m und d ist die Gerade, für die die Residualvarianz s_epsilon^2 minimal ist.

Parameter:

Steigung: m = s_xy / s_x^2

y-Achsenabschnitt: d = y_bar - m*x_bar

Wichtige Kenngrößen:

Arithmetische Mittel: x_bar = 1/n sum_{i=1}^n x_i und y_bar = 1/n sum_{i=1}^n y_i

Varianz der x_i-Werte: s_x^2 = 1/n sum_{i=1}^n (x_i - x_bar)^2 = (1/n sum_{i=1}^n x_i^2) - x_bar^2

Varianz der y_i-Werte: s_y^2 = 1/n sum_{i=1}^n (y_i - y_bar)^2 = (1/n sum_{i=1}^n y_i^2) - y_bar^2

Kovarianz: s_xy = 1/n sum_{i=1}^n (x_i - x_bar)(y_i - y_bar) = (1/n sum_{i=1}^n x_i y_i) - x_bar y_bar

Residualvarianz:

s_epsilon^2 = s_y^2 - (s_xy^2 / s_x^2)

Varianzzerlegung und Bestimmtheitsmass

Varianzzerlegung

Die Totale Varianz setzt sich zusammen aus der Residualvarianz und der Varianz der prognostizierten Werte:

s_y^2 = s_epsilon^2 + s_y_hat^2
mit:
s_y_hat^2: Totale Varianz
s_y_hat^2: prognostizierte (erklärte) Varianz
s_epsilon^2: Residualvarianz

Bestimmtheitsmass

Das Bestimmtheitsmass R^2 beurteilt die globale Anpassungsgüte einer Regression über den Anteil der prognostizierten Varianz s_y_hat^2 an der totalen Varianz s_y^2:

R^2 = s_y_hat^2 / s_y^2 = s_xy^2 / (s_x^2 s_y^2) = r_xy^2

Das Bestimmtheitsmass R^2 stimmt überein mit dem Quadrat des Korrelationskoeffizienten (nach Bravais-Pearson).

Interpretation:

- R^2 = 0.75 bedeutet, dass 75% der gesamten Varianz durch die Regression erklärt sind
- Die restlichen 25% sind Zufallsstreuung

Residuenbetrachtung

Residuenplot

Die Residuen werden bezogen auf die prognostizierten y-Werte y_hat dargestellt. Auf der horizontalen Achse werden die prognostizierten y-Werte y_hat und auf der vertikalen Achse die Residuen angetragen.

Beurteilungskriterien:

- Residuen sollten unsystematisch (d.h. zufällig) streuen
- Überall etwa gleich um die horizontale Achse streuen
- Beträgsmäßig kleine Residuen sollten häufiger sein als große

Nichtlineares Verhalten

Linearisierung

Oft können nichtlineare Regressionsmodelle durch geeignete Transformation auf ein lineares Modell zurückgeführt werden.

Wichtige Transformationen:

Ausgangsfunktion	Transformation
y = q * x^m	log(y) = log(q) + m * log(x)
y = q * m^x	log(y) = log(q) + log(m) * x
y = q * e^{m * x}	ln(y) = ln(q) + m * x
y = 1 / (q + m * x)	V = q + m * x; V = 1/y
y = q + m * ln(x)	y = q + m * U; U = ln(x)
y = 1 / (q * m^x)	log(1/y) = log(q) + log(m) * x

Allgemeines Vorgehen

Matrix-Darstellung

Für die Methode der kleinsten Quadrate mit mehreren Variablen wird ein lineares Gleichungssystem aufgestellt:

$y = Xp + \epsilon$
mit:
 p : Vektor der Parameter
 y : Vektor der Messwerte
 ϵ : Vektor der Residuen
 X : Matrix der Eingangswerte

Die Lösung ist:
 $p = (X^T X)^{-1} X^T y$
falls $(X^T X)$ invertierbar

Vorgehen bei Mehrfachregression

- 1. Aufstellen der Matrix X mit den Eingangswerten
- 2. Berechnung der Parameter $p = (X^T X)^{-1} X^T y$
- 3. Berechnung der Residuen $\epsilon = y - Xp$
- 4. Überprüfung der Modellgüte durch:
 - Bestimmtheitsmass R^2
 - Residuenanalyse
 - Plausibilität der Parameter

Schliessende Statistik – Parameter- und Intervallschätzung

Zufallsstichproben

Grundlagen der Zufallsstichproben

Die Grundgesamtheit ist eine Menge von gleichartigen Objekten oder Elementen. Sie kann endlich oder unendlich viele Objekte enthalten. Eine Stichprobe vom Umfang n wird entnommen, um Informationen über die Grundgesamtheit zu gewinnen. Dies ist oft notwendig weil:

- Der Zeit- und Kostenaufwand für eine Vollerhebung zu hoch ist
- Die Anzahl Objekte zu groß ist
- Die Objekte bei der Untersuchung zerstört werden

Einfache Zufallsstichprobe

Eine einfache Zufallsstichprobe vom Umfang n ist eine Folge von Zufallsvariablen X_1, X_2, \dots, X_n (Stichprobenvariablen). Dabei bezeichnet X_i die Merkmalsausprägung des i -ten Elements in der Stichprobe. Die beobachteten Merkmalswerte x_1, x_2, \dots, x_n der n Elemente sind Realisierungen der Zufallsvariablen und heißen Stichprobenwerte. Wichtige Eigenschaften:

- Jedes Element hat die gleiche Chance, ausgewählt zu werden
- Die Ziehungen sind stochastisch unabhängig
- Alle X_i folgen derselben Verteilung $F(x)$ der Grundgesamtheit

Parameterschätzungen

Schätzfunktionen

Schätzfunktion

Eine Schätzfunktion $\Theta = g(X_1, X_2, \dots, X_n)$ ist eine spezielle Stichprobenfunktion zur Schätzung eines Parameters θ der Grundgesamtheit. Der Schätzwert $\hat{\theta} = g(x_1, x_2, \dots, x_n)$ ergibt sich durch Einsetzen der konkreten Stichprobenwerte. Wichtig: θ ist der wahre, unbekannte Parameterwert der Grundgesamtheit.

Kriterien für eine optimale Schätzfunktion

Optimale Schätzfunktionen

Eine Schätzfunktion sollte folgende Eigenschaften haben:

1. Erwartungstreu: $E(\Theta) = \theta$
2. Effizient: Kleinste Varianz unter allen erwartungstreuen Schätzern
3. Konsistent: $E(\Theta) \rightarrow \theta$ und $V(\Theta) \rightarrow 0$ für $n \rightarrow \infty$

Interpretation:

- Erwartungstreue bedeutet, dass im Mittel der richtige Wert geschätzt wird
- Effizienz bedeutet möglichst geringe Streuung der Schätzung
- Konsistenz bedeutet, dass die Schätzung mit wachsendem Stichprobenumfang immer genauer wird

Wichtige Schätzfunktionen

Schätzfunktionen für wichtige Parameter

Erwartungswert:

$$\bar{X} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i \qquad \hat{\mu} = \bar{x} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i$$

Eigenschaften:

- Erwartungstreu: $E(\bar{X}) = \mu$
- Konsistent: $V(\bar{X}) = \frac{\sigma^2}{n} \rightarrow 0$ für $n \rightarrow \infty$

Varianz:

$$S^2 = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2 \qquad \hat{\sigma}^2 = s^2 = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2$$

Eigenschaften:

- Erwartungstreu: $E(S^2) = \sigma^2$
- Konsistent: $V(S^2) \rightarrow 0$ für $n \rightarrow \infty$

Anteilswert: (bei Bernoulli-Verteilung)

$$\bar{X} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i \qquad \hat{p} = \bar{x} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i$$

Maximum-Likelihood-Schätzung

Likelihood-Funktion

Für eine Stichprobe vom Umfang n mit den Werten x_1, x_2, \dots, x_n ist die Likelihood-Funktion definiert als:

$$L(\theta) = f_X(x_1|\theta) \cdot f_X(x_2|\theta) \cdot \dots \cdot f_X(x_n|\theta)$$

wobei $f_X(x|\theta)$ die Wahrscheinlichkeitsdichte der Verteilung ist.

Maximum-Likelihood-Schätzung

1. Likelihood-Funktion $L(\theta)$ aufstellen
 2. Log-Likelihood $\ln(L(\theta))$ bilden (vereinfacht die Rechnung)
 3. Ableitung $\frac{d}{d\theta} \ln(L(\theta)) = 0$ setzen
 4. Nach θ auflösen für $\hat{\theta}_{ML}$
 5. Maximum überprüfen durch zweite Ableitung
- Beispiel für Normalverteilung:**
1. $L(\mu, \sigma^2) = \prod_{i=1}^n \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma^2}} e^{-\frac{(x_i - \mu)^2}{2\sigma^2}}$
 2. $\ln(L) = -\frac{n}{2} \ln(2\pi\sigma^2) - \frac{1}{2\sigma^2} \sum (x_i - \mu)^2$
 3. $\frac{\partial}{\partial \mu} \ln(L) = 0$ und $\frac{\partial}{\partial \sigma^2} \ln(L) = 0$
 4. Ergibt: $\hat{\mu}_{ML} = \bar{x}$ und $\hat{\sigma}_{ML}^2 = \frac{1}{n} \sum (x_i - \bar{x})^2$

Vertrauensintervalle

Vertrauensintervall

Ein Vertrauensintervall $[\Theta_u, \Theta_o]$ zum Niveau γ ist ein zufälliges Intervall mit:

$$P(\Theta_u \leq \theta \leq \Theta_o) = \gamma$$

γ : Vertrauensniveau (statistische Sicherheit)
 $\alpha = 1 - \gamma$: Irrtumswahrscheinlichkeit
 Θ_u, Θ_o : Unter- und Obergrenze

Vertrauensintervall-Typen

Fall	Verteilung	Test-Statistik	Grenzen
μ (σ^2 bekannt)	Standard-normalvert.	$U = \frac{\bar{X} - \mu}{\sigma/\sqrt{n}}$	$\bar{x} \pm c \frac{\sigma}{\sqrt{n}}$ $c = u_p$
μ (σ^2 unbek.)	t-Verteilung mit $f = n - 1$	$T = \frac{\bar{X} - \mu}{S/\sqrt{n}}$	$\bar{x} \pm c \frac{s}{\sqrt{n}}$ $c = t_{p,f}$
σ^2	χ^2 -Verteilung mit $f = n - 1$	$Z = \frac{(n-1)S^2}{\sigma^2}$	$[\frac{(n-1)s^2}{c_2}, \frac{(n-1)s^2}{c_1}]$ $c_1 = \chi^2_{p_1, f}, c_2 = \chi^2_{p_2, f}$

mit $p = \frac{1+\gamma}{2}$, $p_1 = \frac{1-\gamma}{2}$, $p_2 = \frac{1+\gamma}{2}$

Vertrauensintervalle berechnen

1. Verteilungstyp bestimmen:
 - Parameter (μ oder σ^2)
 - σ^2 bekannt oder unbekannt
2. Quantile bestimmen:
 - γ und α beachten
 - Richtige Tabelle wählen
 - Freiheitsgrade $f = n - 1$ beachten
3. Intervallgrenzen berechnen:
 - Standardfehler berechnen
 - Grenzen Θ_u und Θ_o bestimmen

Stichprobenumfang bestimmen

- Bei gegebener Genauigkeit d und Vertrauensniveau γ :
 - σ^2 bekannt: $n \geq (\frac{2c\sigma}{d})^2$
 - Auf nächste ganze Zahl aufrunden
 - c aus entsprechender Verteilung
- Bei unbekannter Varianz:
 - Vorerhebung durchführen
 - Varianz schätzen
 - t-Verteilung verwenden

Vertrauensintervall für Mittelwert

Gegeben: $n = 25$ Messungen, $\bar{x} = 102$, $s = 4$, $\gamma = 0.95$

- Verteilungstyp: t-Verteilung (σ^2 unbekannt)
 - $f = 24$ Freiheitsgrade
 - $p = 0.975$
 - $c = t_{(0.975;24)} = 2.064$
- Grenzen berechnen:
 - $e = 2.064 \cdot \frac{4}{\sqrt{25}} = 1.652$
 - $[102 - 1.652; 102 + 1.652]$
 - $[100.348; 103.652]$

Schliessende Statistik – Hypothesentests

Einführung

Problemstellung

Ein statistisches Verfahren zur Überprüfung einer Behauptung bzw. Hypothese auf Basis einer Stichprobe.

Die zentrale Frage lautet: Ist es plausibel, die in der Stichprobe beobachteten Abweichungen von der Behauptung als zufällig zu betrachten? Liegen sie 'im Rahmen'?

Typische Anwendungen:

- Überprüfung von Herstellerangaben (z.B. mittlerer Benzinverbrauch)
- Vergleich von Verfahren oder Methoden
- Qualitätskontrolle
- Wirksamkeitsanalysen

Vorgehen bei einem Hypothesentest

Ablauf eines Hypothesentests

- Nullhypothese H_0 formulieren:
 - Zu überprüfende Behauptung
 - Im Zweifelsfall wird H_0 bevorzugt (Im Zweifel für den Angeklagten)
- Alternativhypothese H_A formulieren:
 - Einseitig: $\mu > \mu_0$ oder $\mu < \mu_0$
 - Zweiseitig: $\mu \neq \mu_0$
- Testvariable definieren:
 - Standardisierte Form wählen
 - Passende Zeile aus Tabelle wählen
- Wahrscheinlichkeitsverteilung bestimmen:
 - Normalverteilung, t-Verteilung oder χ^2 -Verteilung
 - Freiheitsgrade beachten
- Signifikanzniveau α festlegen:
 - Üblich: $\alpha = 5\%$ oder 1%
- Kritische Grenzen bestimmen:
 - Einseitig: ein Wert c
 - Zweiseitig: zwei Werte c_u und c_o
- Testwert berechnen:
 - Stichprobenwerte einsetzen
 - Standardisierung durchführen
- Testentscheidung treffen:
 - Im Annahmebereich: H_0 wird angenommen
 - Im kritischen Bereich: H_0 wird abgelehnt

Übersicht über verschiedene Parametertests

Fall	Verteilung	Testvariable	Verteilung unter H_0
$\mu = \mu_0$ σ^2 bekannt	Normal	$U = \frac{\bar{X} - \mu_0}{\sigma / \sqrt{n}}$	Standard-normalverteilung
$\mu = \mu_0$ σ^2 unbekannt	Normal	$T = \frac{\bar{X} - \mu_0}{S / \sqrt{n}}$	t-Verteilung $f = n - 1$
$\sigma^2 = \sigma_0^2$	Normal	$Z = \frac{(n-1)S^2}{\sigma_0^2}$	χ^2 -Verteilung $f = n - 1$
$p = p_0$	Bernoulli	$U = \frac{\bar{X} - p_0}{\sqrt{p_0(1-p_0)/n}}$	Standard-normalverteilung

Hypothesentests für die Gleichheit der unbekannten Mittelwerte

Abhängige Stichproben

Zwei Stichproben heissen voneinander abhängig, wenn:

- Die Stichproben den gleichen Umfang haben
- Jedem Wert der einen Stichprobe genau ein Wert der anderen Stichprobe entspricht und umgekehrt

Beispiele:

- Vorher-Nachher-Messungen
- Paarweise Vergleiche
- Messungen am gleichen Objekt

Testverfahren für zwei Stichproben

- Abhängige Stichproben:
 - Differenzen bilden: $D_i = X_i - Y_i$
 - Test auf Mittelwert der Differenzen
 - t-Test für eine Stichprobe
- Unabhängige Stichproben:
 - Beide Stichproben separat betrachten
 - Varianzen gleich oder verschieden?
 - Zweistichproben-t-Test

Mögliche Fehlerquellen

Fehlerarten

	H_0 annehmen	H_0 ablehnen
H_0 wahr	Richtige Entscheidung	Fehler 1. Art (α)
H_0 falsch	Fehler 2. Art (β)	Richtige Entscheidung

Fehler 1. Art (Produzentenrisiko):

- H_0 wird abgelehnt, obwohl sie wahr ist
- Wahrscheinlichkeit = α (Signifikanzniveau)

Fehler 2. Art (Konsumentenrisiko):

- H_0 wird angenommen, obwohl sie falsch ist
- Wahrscheinlichkeit = β (abhängig vom wahren Wert)

Zusammenhang:

- Verkleinerung von α führt zu Vergrößerung von β
- Teststärke $1 - \beta$ gibt Wahrscheinlichkeit für richtige Ablehnung an

Allgemeine Bemerkungen

p-Wert

Der p-Wert ist die Wahrscheinlichkeit, einen mindestens so extremen Testwert zu erhalten wenn H_0 wahr ist.

Interpretation:

- $p \geq \alpha$: H_0 wird angenommen
- $p < \alpha$: H_0 wird abgelehnt
- Je kleiner p, desto stärker die Evidenz gegen H_0

Wichtige Hinweise für Hypothesentests

- Signifikant heißt "nicht zufallsbedingt":
 - Signifikante Unterschiede müssen nicht relevant sein
 - Bei großen Stichproben können kleine Unterschiede signifikant sein
- Hypothesentests erklären keine Unterschiede:
 - Nur Feststellung der Signifikanz
 - Keine Erklärung der Ursachen
 - Keine Kontrolle des Studiendesigns
- Zufallsstichproben sind essentiell:
 - Repräsentativität wichtig
 - "Praktische" Stichproben können verzerren
- Vergleich zu Vertrauensintervallen:
 - Tests: Ausgangspunkt ist behaupteter Wert
 - Intervalle: Ausgangspunkt ist Schätzwert