

1 Der Begriff der Wahrscheinlichkeit

Stochastik befasst sich mit *Zufallsexperimenten*. Deren Ergebnisse sind unter „Versuchsbedingungen“ verschieden.

Bsp.

- *Kartenziehen, Würfeln, Roulette*
- *Simulation*
- *Komplexe Phänomene (zumindest approximativ): Börse, Data-Mining, Genetik, Wetter*

Ergebnisse von Zufallsexperimenten werden in *Ereignisse* zusammengefasst.

- *Ereignisraum* (Grundraum) Ω : Menge aller möglichen Ergebnisse des Zufallsexperiments
- *Elementarereignisse* ω : Elemente von Ω , also die möglichen Ergebnisse des Zufallsexperiments
- *Ereignis*: Teilmenge von Ω
- Operationen der Mengenlehre haben natürliche Interpretation in der Sprache der Ereignisse:

Durchschnitt	$A \cap B$	A und B
Vereinigung	$A \cup B$	A oder B
Komplement	A^c	Nicht A
Differenz	$A \setminus B$	A ohne B

Das Vorgehen der Stochastik zur Lösung eines Problems kann in drei Schritte unterteilt werden:

1. Man bestimmt die Wahrscheinlichkeiten gewisser Ereignisse A_i . Dabei sind Expertenwissen, Daten und Plausibilitäten wichtig.
2. Man berechnet aus den Wahrscheinlichkeiten $\mathcal{P}(B_j)$ die Wahrscheinlichkeiten von gewissen anderen Ereignissen B_j gemäss den Gesetzen der Wahrscheinlichkeitstheorie (oft vereinfachend unter Unabhängigkeitsannahme).
3. Man interpretiert die Wahrscheinlichkeiten $\mathcal{P}(B_j)$ im Hinblick auf die Problemstellung.

Das *Bestimmen von Wahrscheinlichkeiten* (siehe Schritt 1) wird oft konkreter formalisiert.

Bsp. (Laplace-Modell)

Die *Wahrscheinlichkeit von einem Ereignis A* ist gegeben durch

$$\mathcal{P}(A) = \frac{|A|}{|\Omega|} \quad \left(= \frac{\# \text{ günstige Fälle}}{\# \text{ mögliche Fälle}} \right). \quad (1.1)$$

Dem *Laplace-Modell* liegt die *uniforme Verteilung von Elementarereignissen* ω zugrunde:

$$\mathcal{P}(\{\omega\}) = \frac{1}{|\Omega|} \quad (1.2)$$

Andere Wahrscheinlichkeitsverteilungen werden mit Hilfe des Konzepts von *Zufallsvariablen* (siehe Kapitel 2) eingeführt. Es sei aber bereits hier festgehalten: die Stochastik geht weit über das Laplace-Modell hinaus. Für viele Anwendungen ist das Laplace-Modell ungeeignet.

1.1 Rechenregeln für Wahrscheinlichkeiten

Die drei Axiome sind:

- (A1) $\mathcal{P}(A) \geq 0$: Wahrscheinlichkeiten sind immer nicht-negativ.
- (A2) $\mathcal{P}(\Omega) = 1$: sicheres Ereignis Ω hat Wahrscheinlichkeit eins.
- (A3) $\mathcal{P}(A \cup B) = \mathcal{P}(A) + \mathcal{P}(B) \quad \forall$ Ereignisse A, B , die sich gegenseitig ausschliessen (d.h. $A \cup B = \emptyset$).

Weitere (abgeleitete) Regeln:

$$\mathcal{P}(A^c) = 1 - \mathcal{P}(A) \quad (1.3)$$

für jedes Ereignis A ,

$$\mathcal{P}(A \cup B) = \mathcal{P}(A) + \mathcal{P}(B) - \mathcal{P}(A \cap B) \quad (1.4)$$

für je zwei Ereignisse A und B ,

$$\mathcal{P}(A_1 \cup \dots \cup A_n) \leq \mathcal{P}(A_1) + \dots + \mathcal{P}(A_n) \quad (1.5)$$

für je n Ereignisse A_1, \dots, A

$$\mathcal{P}(B \setminus A) = \mathcal{P}(B) - \mathcal{P}(A) \quad (1.6)$$

für je zwei Ereignisse A und B mit $A \subset B$.

1.2 Unabhängigkeit von Ereignissen

Wenn zwischen zwei Ereignissen A und B kein kausaler Zusammenhang besteht (d.h. es gibt

keine gemeinsamen Ursachen oder Ausschlüsse), dann werden sie *unabhängig* genannt, genauer: Zwei Ereignisse A und B heissen (*stochastisch*) *unabhängig* wenn für jedes $k \leq n$ und all $1 \leq i_1 < \dots < i_k \leq n$ gilt

$$\mathcal{P}(A_{i_1} \cap \dots \cap A_{i_k}) = \mathcal{P}(A_{i_1}) \cdot \dots \cdot \mathcal{P}(A_{i_k}).$$

Achtung: Zwei *unabhängige* Ereignisse A und B sind *nicht disjunkt* (und umgekehrt), vorausgesetzt die W'keiten $\mathcal{P}(A), \mathcal{P}(B) \neq 0$.

1.3 Interpretation von Wahrscheinlichkeiten

Die beiden wichtigsten Interpretationen sind:

- frequentistisch: „Idealisierung der relative Häufigkeiten bei vielen unabhängigen Wiederholungen“
- subjektive: „Mass für den Glauben, dass ein Ereignis eintreten wird“ (Bayes'sch)

2 Zufallsvariable und Wahrscheinlichkeitsverteilung

Ergebnisse eines physikalischen Versuchs (Zufallsexperiment) sind oft Zahlen (Messungen). Diese werden als Beobachtung von so genannten Zufallsvariablen interpretiert, d.h. beobachtet wird nicht das ω welches bei einem Zufallsexperiment herauskommt, sondern die Werte aller beobachteten Zufallsvariablen.

2.1 Definition einer Zufallsvariablen

Eine Zufallsvariable X ist ein Zufallsexperiment mit möglichen Werten in \mathbb{R} , bzw. in einer Teilmenge von \mathbb{R} , z.B. $\mathbb{N}_0 = \{0, 1, \dots\}$. Deren Wert ist im Voraus nicht bekannt, sondern hängt vom Ergebnis eines Zufallsexperiments ab. Mathematisch ist eine Zufallsvariable einfach nur eine Abbildung von Ω nach \mathbb{R} :

$$X : \Omega \rightarrow \mathbb{R}, \\ \omega \mapsto X(\omega).$$

Das heisst wenn das Ergebnis ω herauskommt, nimmt die Zufallsvariable den Wert $X(\omega)$ an.

Bsp. (Wert einer zuf. gez. Jasskarte.)

Sei $\Omega = \{\text{Jasskarten}\}$; ein $\omega \in \Omega$ ist z.B. ein Schulten-As; Zufallsvariable X :

$$\begin{aligned} \text{As irgendeiner Farbe} &\mapsto 11 \\ \text{König irgendeiner Farbe} &\mapsto 4 \\ \text{„Brettchen“ irgendeiner Farbe} &\mapsto 0. \end{aligned}$$

2.2 Wahrscheinlichkeitsverteilung auf \mathbb{R}

Eine Zufallsvariable X legt eine Wahrscheinlichkeit Q auf \mathbb{R} fest, die sogenannte *Verteilung* von X :

$$\begin{aligned} Q(B) &= \mathcal{P}(\{\omega; X(\omega) \in B\}) \\ &= \mathcal{P}(X \in B) \end{aligned}$$

Bsp. (Wert einer zuf. gez. Jk. Forts.)

In obigem Beispiel ist beispielsweise

$$\begin{aligned} Q(11) &= \mathcal{P}(\text{As irgendeiner Farbe}) \\ &= \frac{4}{36}. \end{aligned}$$

Die *kumulative Verteilungsfunktion* ist definiert als

$$\begin{aligned} F(b) &= \mathcal{P}(X \leq b) \\ &= Q((-\infty, b]). \end{aligned}$$

Sie enthält dieselbe Information wie die Verteilung $Q(\cdot)$, ist aber einfacher darzustellen. Die Umkehrung der Verteilungsfunktion stellen die sogenannten Quantile dar, für $\alpha \in (0, 1)$ ist das α -Quantil von X definiert als das kleinste $x \in \mathbb{R}$ für welches $F(x) \geq \alpha$ gilt, also

$$\begin{aligned} q_\alpha &:= q(\alpha) \\ &:= \min\{x \in \mathbb{R} \mid F(x) \geq \alpha\} \end{aligned}$$

Es gilt

$$F(q_\alpha)$$

bzw. äquivalent dazu

$$q_\alpha = F^{-1}(\alpha).$$

Das $\frac{1}{2}$ -Quantil von X heisst auch *Median* von X .

2.3 Diskrete und stetige Zufallsvariablen

Eine Zufallsvariable X heisst *diskret*, falls die Menge W der möglichen Werte von X endlich oder abzählbar ist. Zum Beispiel $W = \{0, 1, 2, \dots, 100\}$ oder $W = \mathbb{N}_0 = \{0, 1, 2, \dots\}$. Die Verteilung einer diskreten Zufallsvariablen ist festgelegt durch die Angabe der sogenannten *Wahrscheinlichkeitsfunktion*:

$$p(x) := \mathcal{P}(X = x), \quad x \in W.$$

Offensichtlich ist die kumulative Verteilungsfunktion eine Treppenfunktion mit Sprüngen an den Stellen $x \in W$ mit Sprunghöhen $p(x)$, also nicht stetig. Ferner gilt

$$Q(B) = \sum_{x \in B} p(x).$$

Eine Zufallsvariable X heisst *stetig* falls die Menge der möglichen Werte W ein Intervall enthält. Zum Beispiel $W = [0, 1]$ oder $W = \mathbb{R}$.

2.4 Erwartungswert und Varianz

Eine Verteilung einer Zufallsvariablen X kann durch mindestens zwei Kennzahlen zusammengefasst werden, eine für die Lage (der Erwartungswert)