Stochastik Wintersemester 2009
Leibniz Universität Hannover
Vorlesungsmitschrift

Dozent: Prof. Dr. R. Grübel

Mitschrift von
Ronald Becher

22. Oktober 2010

Zusammenfassung

Diese Mitschrift wird erstellt im Zuge der Vorlesung Stochastik A im Wintersemester 2010 an der Leibniz Universität Hannover. Obwohl mit großer Sorgfalt geschrieben, werden sich sicherlich Fehler einschleichen. Diese bitte ich zu melden, damit sie korrigiert werden können. Ihr könnt euch dazu an jeden der genannten Autoren (mit Ausnahme des Dozenten) wenden.

Dieses Skript wird primär über Github verteilt und „gepflegt“. Dort kann man es auch forken, verbessern und dann (idealerweise) ein „Pull Request“ losschicken. Siehe auch Github Guides. Auch wenn ihr gute Grafiken zur Verdeutlichung beitragen könnt, dürft ihr diese gerne schicken oder selbst einfügen (am besten als LaTeX-geeignete Datei (Tikz, SVG, PNG, . . .)).

Hinweis: Es wird o.B.d.A. davon abgeraten, die Vorlesung zu versäumen, nur weil eine Mitschrift angefertigt wird! Selbiges gilt für den übungsbetrieb! Stochastik besteht ihr nur, wenn ihr auch zu der Veranstaltung geht!

Inhaltsverzeichnis

Teil I

Ein mathematisches Modell für Zufallsexperimente

Man fasst die möglichen Ergebnisse ω zu einer Menge Ω zusammen; man nennt Ω den Ergebnisraum oder auch Stichprobenraum. Ereignisse werden durch Teilmengen von Ω beschrieben. Eine Aussage über das Ergebnis wird zu der Menge A aller $\omega \in \Omega$, für diese die Aussage richtig ist.

1 Beispiel - Würfelwurf

$$\Omega = \{1, 2, 3, 4, 5, 6\}$$

Das Ereignis “Es kommt eine gerade Zahl heraus” wird beschrieben durch

$$A = \{2, 4, 6\}$$

Das Ereignis “Es kommt eine 6 heraus”, wird (in Mengenschreibweise) beschrieben durch $A = \{6\}$. Solche Ereignisse, die nur aus einem Element bestehen, nennt man Elementarereignisse. Aussagen über das Ergebnis können ”logisch kombiniert”werden, auf der Ereignisseite (also in Teilmengen von Ω) wird dieser zu Mengenoperationen. Werden zwei Ereignisse A, B durch Mengen repräsentiert, so ist

$$\begin{aligned} A^c &\text{ das Ereignis “}A\text{ tritt nicht ein”} \\ A \cap B &\text{ das Ereignis “Beide Ereignisse können eintreten“} \\ A \cup B &\text{ eines der Ereignisse tritt ein} \ldots \end{aligned}$$

Hier kommt eine Grafik über eine Matrix .... oder ein Foto der Tafel A = Pasch
B = Augensumme kleiner 5
A geschnitten B

Man kann dies mit mehr als zwei Ereignissen machen. Wenn A, B, C Ereignisse sind, wodurch wird ”genau eins davon tritt ein” beschrieben?

$$A \cap B^c \cap C^c + A^c \cap B \cap C^c + A^c \cap B^c \cap C \tag{1}$$

2 Was ist Wahrscheinlichkeit?

Unsere zentrale Frage lautet nun: ”Was ist Wahrscheinlichkeit?”
Der Mathematiker wählt ein Axiomensystem (vgl. Geometrie/Raum). Ausgangspunkt hierfür

ist der Alltagsbegriff. Was bedeutet es also, wenn beim Wurf einer fairen Münze mit Wahrscheinlichkeit $\frac{1}{2}$ das Ergebnis "Kopf" kommt?

2.1 Frequentistische Auffassung

Bezeichnet $N_n(A)$ die Anzahl der Versuche bei n Wiederholungen des Experiments, bei dem A kommt, so sollte die **relative Häufigkeit** $\frac{1}{n}N_n(A)$ bei großem n in der Nähe der Wahrscheinlichkeit p des Ereignisss A liegen.

2.2 Subjektivistische Auffassung

p drückt den "Grad meines Glaubens" an das Eintreten von A auf einer Skala von 0 ("kein Glaube") bis 1 ("Gewissheit") aus. Kann über Wetten formalisiert werden.
Anmerkung: Diese beiden Auffassungen sind nicht disjunkt!

Für relative Häufigkeiten gilt

$$\begin{aligned}
0 \leq \frac{1}{n}N_n(A) &\leq 1 \\
\frac{1}{n}N_n(\Omega) &= 1 \\
\frac{1}{n}N_n(\emptyset) &= 0 \\
\frac{1}{n}N_n(A+B) = \frac{1}{n}N_n(A) &+ \frac{1}{n}N_n(B)
\end{aligned}$$

3 Definition: Kolmogorov-Axiome

Gegeben seien ein (nicht leerer) Ergebnisraum Ω und ein System $\mathcal{A}$ von Teilmengen von Ω, das System der Ereignisse (bei endlichen oder abzählbar unendlichen Ω ist $\mathcal{A}$ einfach die Potenzmenge $\wp(\Omega)$, also die Menge **aller** Teilmengen von Ω). Eine **Wahrscheinlichkeit** oder besser ein **Wahrscheinlichkeitsmaß** (WMaß) ist eine Abbildung $P : \mathcal{A} \to \mathbb{R}$ mit folgenden Eigenschaften:

(A1) $P(A) \geq 0 \ \forall A \in \mathcal{A}, \ P(\Omega) = 1$ (P steht für "probability")

(A2) Für alle paarweise disjunkten Ereignisse $A_1, A_2, A_3, \ldots$ gilt

$$P(\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i) = P(\sum_{i=1}^{\infty} A_i) = \sum_{i=1}^{\infty} P(A_i)$$

Dies nennt man "σ-Additivität".

4 Wahrscheinlichkeitsraum

Das Tripel $(\Omega, \mathcal{A}, P)$ nennt man einen **Wahrscheinlichkeitsraum**.
Es folgen nun erste Folgerungen aus den Axiomen.

5 Satz

1. $P(\emptyset) = 0$
2. $P(A) \leq 1 \forall A \in \mathcal{A}$
3. $P(A^c) = 1 - P(A) \forall A \in \mathcal{A}$ (Übergang zum **Gegenereignis**)
4. $A \subset B \Rightarrow P(A) \leq P(B)$ (Monotonie)
5. $P(A_1 + A_2 + \ldots + A_n) = P(A_1) + P(A_2) + \ldots + P(A_n)$ für paarweise disjunkte $A_1, \ldots, A_n \in \mathcal{A}$ (endliche Additivität)
6. Boolesche Ungleichung: $P(A_1 \cup \ldots \cup A_n) \leq P(A_1) + \ldots + P(A_n)$
7. Die **Siebformel**

$$\mathsf{P}\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_i\right) = \sum_{k=1}^{n} (-1)^{k+1} \sum_{\substack{I \subseteq \{1,\ldots,n\}, \\ |I|=k}} \mathsf{P}\left(\bigcap_{i \in I} A_i\right)$$

5.1 Beweis

1. Mit (A2) und $A_j = \emptyset \forall j$ erhält man $P(\emptyset) = \sum_{i=1}^{\infty} P(\emptyset)$. Wegen $P(\emptyset) \in \mathbb{R}$ bedeutet dies $P(\emptyset) = 0$.
2. Verwende (A2) mit $A_j = \emptyset$ für $j > k$ und dann Teil (a):

$$\begin{aligned} P(A_1 \cup \ldots \cup A_k) = \\ P(A_1 \cup \ldots \cup A_k \cup \emptyset \cup \emptyset \ldots) = \\ P(A_1) + \ldots + P(A_k) + P(\emptyset) + \ldots = \\ P(A_1) + \ldots + P(A_k) \end{aligned}$$

3. $1 = P(\Omega) = P(A + A^c) = P(A) + P(A^c)$
4. $B = A + B \cap A^c$
   $P(B) = P(A) + (P(B \cap A^c) \geq P(A)$
5. bei $n = 2$: $P(A \cup B) \neq P(A) + P(B)$

Hinweis: Jetzt seid ihr so weit in dieser Mitschrift gekommen, bitte gleicht diese mit eurer handschriftlichen Mitschrift ab und sendet mir eure Verbesserungen. Gerne auch gleich in LaTeX ;-)