

Wahrscheinlichkeitstheorie und Statistik (Stochastik)



Dr. rer. nat. Johannes Riesterer

Einleitung

Was ist Stochastik?

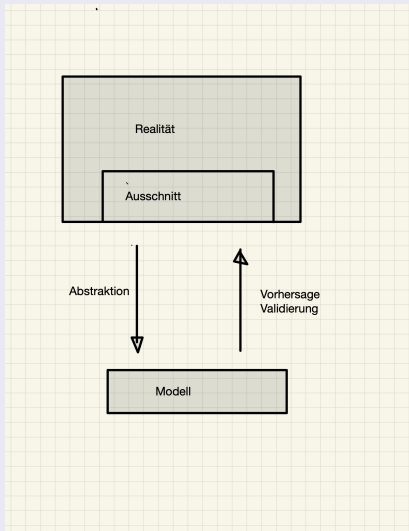
Wahrscheinlichkeitstheorie

Beschreibung und Untersuchung von zufälligen Vorgängen und Modellen.

Statistik

Umgang mit dem Zufall und Schlussfolgern aus Beobachtungen

Mathematik und Realität



Was ist Zufall

Keine kausale Erklärung für den Ausgang eines Vorganges vorhanden (Nicht-Deterministisch)

Kausalität (Wikipedia)

Kausalität ist die Beziehung zwischen Ursache und Wirkung. Sie betrifft die Abfolge von Ereignissen und Zuständen, die aufeinander bezogen sind. Demnach ist A die Ursache für die Wirkung B, wenn B von A herbeigeführt wird.



Figure: Quelle: Wikipedia

Stochastik vs. Kausalität

In den seltensten Fällen lassen sich aus stochastischen Zusammenhängen kausale Zusammenhänge ableiten. ACHTUNG: Populisten tun dies jedoch ständig!

Stochastik vs. Kausalität

Beobachtung: Bei Regen tragen die Menschen einen Regenschirm.
Es folgt NICHT: Wenn man einen Regenschirm aufspannt, fängt es an zu regnen. Ebenso folgt NICHT: Wenn es regnet, sieht man Menschen mit Regenschirmen.



Figure: Quelle: Wikipedia

Gibt es überhaupt Zufall?

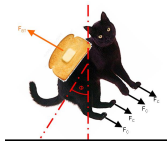


Figure: Quelle: <https://www.laurentinews.de/wp-content/uploads/2014/03/katze-toast1.jpg>

Zufall hängt von der betrachteten Skala ab.
Physik \Rightarrow Skalen können nicht beliebig klein werden.

[Wikipedia://Brownsche Molekularbewegung.](https://de.wikipedia.org/wiki/Brownsche_Molekularbewegung)

Motivation

Maschinelles Lernen. Maschinelle Vorhersage. Informationstheorie. Prozesstheorie. Optimierungstheorie. Mustererkennung. Komplexitätstheorie, bildgebende Verfahren, Physik.

Motivation

Wie programmiere und trainiere ich einen "intelligenten" Spam-Filter? Ab wie vielen richtig beantworteten Ja-Nein-Fragen ist der von meinem Kommilitonen gebaute Roboter wirklich intelligent und hat nicht nur zufällig die richtige Antwort gewählt? Wie bewertet Google Webseiten? Warum wird das Rauschen von Sensoren ständig als Normalverteilt angenommen? Macht es Sinn auf Rot zu setzen, nachdem 100 mal Schwarz im Roulette fiel? Kann man Geschwafel quantifizieren? Wie kann man mit einer Münze Integrale lösen und was hat das mit Hollywood zu tun?

Literatur

- Stochastik für Informatiker; L. Dümbgen; Springer
- Einführung in die Wahrscheinlichkeitstheorie und Statistik; Hans-Otto Georgii; De Gruyter Studium
- Achim Klenke; Wahrscheinlichkeitstheorie; Springer



Bessere Entscheidungen durch Mathematik?!?

Gegeben sind 3 geschlossene Türen. Hinter einer ist der Hauptgewinn, hinter zwei eine Ziege. Der Spieler darf sich zuerst für eine Tür entscheiden. Danach öffnet der Moderator eine der nicht gewählten Türen, hinter der nicht der Hauptgewinn ist und fragt den Spieler, ob er seine vorige Entscheidung revidieren und die andere geschlossene Tür öffnen möchte.

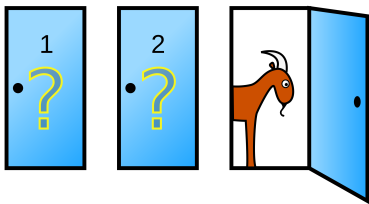


Figure: Quelle: Wikipedia

Bessere Entscheidungen durch Mathematik?!?

Hat der Spieler eine höhere Gewinnchance, wenn er die Tür wechselt?

Bessere Entscheidungen durch Mathematik?!?

Wechseln hat eine höhere Gewinnchance!

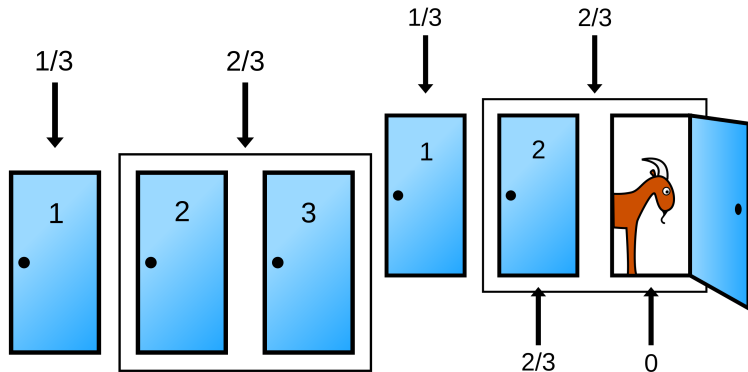


Figure: Quelle: Wikipedia