

Inhaltsverzeichnis

(Ausschnitt)

8 Messbarkeit und Bildwahrscheinlichkeit

- Messbare Abbildungen
- Bildwahrscheinlichkeit

Messbare Abbildungen II

- Bestimmung der Wahrscheinlichkeit eines Ereignisses $A' \subseteq \Omega'$ wie folgt:
 - ▶ Feststellen, welche Elemente $\omega \in \Omega$ unter der Abbildung X auf Elemente $\omega' \in A'$ abgebildet werden.
 - ▶ Wahrscheinlichkeit von A' ergibt sich dann als Wahrscheinlichkeit der erhaltenen Teilmenge $\{\omega \in \Omega \mid X(\omega) \in A'\}$ von Ω , also als $P(\{\omega \in \Omega \mid X(\omega) \in A'\})$.

Definition 8.1 (Urbild)

Es seien $X : \Omega \rightarrow \Omega'$ eine Abbildung, $A' \subseteq \Omega'$. Dann heißt

$$X^{-1}(A') := \{\omega \in \Omega \mid X(\omega) \in A'\}$$

das **Urbild** von A' bzgl. X .

Messbare Abbildungen I

- Häufig von Interesse:
Nicht der Ausgang eines Zufallsexperiments selbst, sondern eine **Funktion** dieses Ausgangs, d.h. eine Abbildung $X : \Omega \rightarrow \Omega'$ vom Ergebnisraum Ω in eine andere Menge Ω' .
- Beispiele:
 - ▶ Augensumme beim gleichzeitigen Werfen von zwei Würfeln
 - ▶ Anzahl „Wappen“ bei mehrmaligem Münzwurf
 - ▶ Resultierender Gewinn zu gegebener Tippreihe beim Lottospiel
 - ▶ Anzahl der weißen Kugeln bei wiederholter Ziehung von Kugeln aus Urne mit schwarzen und weißen Kugeln (mit oder ohne Zurücklegen)
- Wahrscheinlichkeitsbegriff des ursprünglichen Zufallsexperiments (Ω, \mathcal{F}, P) soll in die Wertemenge/Bildmenge Ω' der Abbildung X „transportiert“ werden.

Messbare Abbildungen III

- Zur Funktionsfähigkeit des „Wahrscheinlichkeitstransports“ nötig:
Geeignetes Mengensystem ($\rightsquigarrow \sigma$ -Algebra) \mathcal{F}' über Ω' , welches „kompatibel“ zur σ -Algebra \mathcal{F} über Ω und zur Abbildung X ist.
- „Kompatibilitätsanforderung“ ergibt sich nach Konstruktion:
Damit $P(\{\omega \in \Omega \mid X(\omega) \in A'\}) = P(X^{-1}(A'))$ für $A' \in \mathcal{F}'$ definiert ist, muss $X^{-1}(A') \in \mathcal{F}$ gelten für alle $A' \in \mathcal{F}'$.
- Beschriebene Eigenschaft der Kombination \mathcal{F} , \mathcal{F}' und X heißt **Messbarkeit**:

Definition 8.2 (Messbarkeit, messbare Abbildung)

Es seien (Ω, \mathcal{F}) und (Ω', \mathcal{F}') zwei Messräume. Eine Abbildung $X : \Omega \rightarrow \Omega'$ heißt $\mathcal{F} - \mathcal{F}'$ -**messbar**, wenn gilt:

$$X^{-1}(A') \in \mathcal{F} \text{ für alle } A' \in \mathcal{F}' .$$

Bildwahrscheinlichkeit

Definition 8.3 (Bildwahrscheinlichkeit)

Es seien (Ω, \mathcal{F}, P) ein Wahrscheinlichkeitsraum, (Ω', \mathcal{F}') ein Messraum, X eine $\mathcal{F} - \mathcal{F}'$ -messbare Abbildung. Dann heißt das durch

$$P_X : \mathcal{F}' \rightarrow \mathbb{R}; P_X(A') := P(X^{-1}(A'))$$

definierte Wahrscheinlichkeitsmaß P_X **Bildwahrscheinlichkeit** von P bezüglich X . $(\Omega', \mathcal{F}', P_X)$ ist damit ebenfalls ein Wahrscheinlichkeitsraum.

- Gilt $\mathcal{F} = \mathcal{P}(\Omega)$, so ist offensichtlich jede Abbildung $X : \Omega \rightarrow \Omega'$ $\mathcal{F} - \mathcal{F}'$ -messbar für beliebige σ -Algebren \mathcal{F}' über Ω' .

Inhaltsverzeichnis

(Ausschnitt)

9 Eindimensionale Zufallsvariablen

- Borelsche sigma-Algebra
- Wahrscheinlichkeitsverteilungen
- Verteilungsfunktionen
- Diskrete Zufallsvariablen
- Stetige Zufallsvariablen
- (Lineare) Abbildungen von Zufallsvariablen
- Momente von Zufallsvariablen
- Quantile von Zufallsvariablen
- Spezielle diskrete Verteilungen
- Spezielle stetige Verteilungen
- Verwendung spezieller Verteilungen

Einbettung der deskriptiven Statistik in die Wahrscheinlichkeitsrechnung

- Ist Ω die (endliche) Menge von Merkmalsträgern einer deskriptiven statistischen Untersuchung, $\mathcal{F} = \mathcal{P}(\Omega)$ und P die Laplace-Wahrscheinlichkeit

$$P : \mathcal{P}(\Omega) \rightarrow \mathbb{R}; B \mapsto \frac{\#B}{\#\Omega},$$

so kann jedes Merkmal X mit Merkmalsraum $A = \{a_1, \dots, a_m\}$ als $\mathcal{P}(\Omega) - \mathcal{P}(A)$ -messbare Abbildung $X : \Omega \rightarrow A$ verstanden werden.

- $(A, \mathcal{P}(A), P_X)$ ist dann ein diskreter Wahrscheinlichkeitsraum mit Wahrscheinlichkeitsfunktion $p(a_j) = r(a_j)$ bzw. — äquivalent — $P_X(\{a_j\}) = r(a_j)$ für $j \in \{1, \dots, m\}$.
- Durch $(A, \mathcal{P}(A), P_X)$ wird damit die Erhebung des Merkmalswerts eines rein zufällig (gleichwahrscheinlich) ausgewählten Merkmalsträgers modelliert.

Borelsche σ -Algebra I

- Häufiger Wertebereich von Abbildungen aus Wahrscheinlichkeitsräumen: \mathbb{R}
- $\mathcal{P}(\mathbb{R})$ als σ -Algebra (aus technischen Gründen) aber ungeeignet!
- Alternative σ -Algebra über \mathbb{R} : „Borelsche“ σ -Algebra \mathcal{B}
- \mathcal{B} ist die kleinste σ -Algebra über \mathbb{R} , die alle Intervalle

$$\begin{array}{cccc} (a, b) & (a, b] & [a, b) & [a, b] \\ (-\infty, a) & (-\infty, a] & (a, \infty) & [a, \infty) \end{array}$$

für $a, b \in \mathbb{R}$ (mit $a < b$) enthält.

Borelsche σ -Algebra II

- Aufgrund der Eigenschaften von σ -Algebren sind auch alle
 - ▶ Einpunktmengen $\{x\}$ für $x \in \mathbb{R}$,
 - ▶ endliche Mengen $\{x_1, \dots, x_m\} \subseteq \mathbb{R}$,
 - ▶ abzählbar unendliche Mengen sowie endliche und abzählbare Schnitte und Vereinigungen von Intervallen
 in \mathcal{B} enthalten.
- Abbildungen $X : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ aus einem Wahrscheinlichkeitsraum (Ω, \mathcal{F}, P) heißen (eindimensionale) **Zufallsvariablen**, wenn sie $\mathcal{F} - \mathcal{B}$ -messbar sind:

Eindimensionale Zufallsvariablen und deren Verteilung II

- $P_X(B)$ gibt nach Definition 8.3 für $B \in \mathcal{B}$ die Wahrscheinlichkeit an, als Ausgang des zugrundeliegenden Zufallsexperiments ein $\omega \in \Omega$ zu erhalten, das zu einer Realisation $X(\omega) \in B$ führt.
- Demzufolge sind folgende Kurzschreibweisen geläufig:
 - ▶ $P\{X \in B\} := P(\{X \in B\}) := P_X(B)$ für alle $B \in \mathcal{B}$,
 - ▶ $P\{X = x\} := P(\{X = x\}) := P_X(\{x\})$ für alle $x \in \mathbb{R}$,
 - ▶ $P\{X < x\} := P(\{X < x\}) := P_X((-\infty, x))$ für alle $x \in \mathbb{R}$, analog für $P\{X \leq x\}$, $P\{X > x\}$ und $P\{X \geq x\}$.
- In vielen Anwendungen interessiert man sich nur noch für die Bildwahrscheinlichkeit P_X der Zufallsvariablen X bzw. den (resultierenden) Wahrscheinlichkeitsraum $(\mathbb{R}, \mathcal{B}, P_X)$. Häufig wird X dann nur noch durch die Angabe von P_X festgelegt und auf die Definition des zugrundeliegenden Wahrscheinlichkeitsraums (Ω, \mathcal{F}, P) verzichtet.
- Verteilungen P_X von Zufallsvariablen als Abbildungen von \mathcal{B} nach \mathbb{R} allerdings schlecht handhabbar.

Eindimensionale Zufallsvariablen und deren Verteilung I

Definition 9.1 (Zufallsvariable, Verteilung, Realisation)

Seien (Ω, \mathcal{F}, P) ein Wahrscheinlichkeitsraum, $X : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ eine $\mathcal{F} - \mathcal{B}$ -messbare Abbildung. Dann heißen X (**eindimensionale**) **Zufallsvariable** über (Ω, \mathcal{F}, P) und die gemäß Definition 8.3 gebildete Bildwahrscheinlichkeit

$$P_X : \mathcal{B} \rightarrow \mathbb{R}; B \mapsto P(X^{-1}(B))$$

Wahrscheinlichkeitsverteilung oder kürzer **Verteilung** von X . $(\mathbb{R}, \mathcal{B}, P_X)$ ist damit ebenfalls ein Wahrscheinlichkeitsraum.

Liegt nach Durchführung des Zufallsexperiments (Ω, \mathcal{F}, P) das Ergebnis $\omega \in \Omega$ vor, so heißt der zugehörige Wert $x = X(\omega)$ die **Realisierung** oder **Realisation** von X .

Verteilungsfunktionen

- Man kann zeigen, dass Wahrscheinlichkeitsmaße P_X auf \mathcal{B} bereits (z.B.) durch die Angabe aller Wahrscheinlichkeiten der Form $P_X((-\infty, x]) = P(\{X \leq x\})$ für $x \in \mathbb{R}$ eindeutig bestimmt sind!
- Daher überwiegend „Identifikation“ der Verteilung P_X mit Hilfe einer Abbildung $\mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ mit $x \mapsto P_X((-\infty, x])$ für $x \in \mathbb{R}$:

Definition 9.2 (Verteilungsfunktion)

Es seien X eine Zufallsvariable über dem Wahrscheinlichkeitsraum (Ω, \mathcal{F}, P) und P_X die Wahrscheinlichkeitsverteilung von X . Dann heißt die Abbildung

$$F_X : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}; F_X(x) := P_X((-\infty, x]) = P(\{X \leq x\})$$

Verteilungsfunktion der Zufallsvariablen X .

Eigenschaften von Verteilungsfunktionen I

- Die Verteilungsfunktion F_X einer (eindimensionalen) Zufallsvariablen X hat folgende Eigenschaften:

- F_X ist monoton wachsend, d.h. für $x, y \in \mathbb{R}$ gilt:

$$x < y \Rightarrow F_X(x) \leq F_X(y)$$

- F_X ist rechtsseitig stetig, d.h. für alle $x \in \mathbb{R}$ gilt:

$$\lim_{\substack{h \rightarrow 0 \\ h > 0}} F_X(x+h) = F_X(x)$$

- $\lim_{x \rightarrow \infty} F_X(x) = F_X(\infty) = 1$

- $\lim_{x \rightarrow -\infty} F_X(x) = F_X(-\infty) = 0$

- Als abkürzende Schreibweise für die linksseitigen Grenzwerte verwendet man

$$F_X(x-0) := \lim_{\substack{h \rightarrow 0 \\ h > 0}} F_X(x-h) \quad \text{für alle } x \in \mathbb{R}.$$

Diskrete Zufallsvariablen

- Einfacher, aber geläufiger Spezialfall für Zufallsvariable X über Wahrscheinlichkeitsraum (Ω, \mathcal{F}, P) : **Wertebereich**

$$X(\Omega) := \{x \in \mathbb{R} \mid x = X(\omega) \text{ für (mindestens) ein } \omega \in \Omega\}$$

ist endlich oder abzählbar unendlich (bzw. etwas allgemeiner: es gibt eine endliche oder abzählbar unendliche Menge B mit $P(\{X \in B\}) = 1$).

- Analog zu Definition 6.3 heißen solche Zufallsvariablen „diskret“.

Definition 9.3 (Diskrete ZV, Wahrscheinlichkeitsfunktion, Träger)

Seien (Ω, \mathcal{F}, P) ein Wahrscheinlichkeitsraum, X eine Zufallsvariable über (Ω, \mathcal{F}, P) und $B \subseteq \mathbb{R}$ endlich oder abzählbar unendlich mit $P(\{X \in B\}) = 1$. Dann nennt man

- X eine **diskrete** Zufallsvariable,
- $p_X : \mathbb{R} \rightarrow [0, 1]$; $p_X(x) := P_X(\{x\})$ die **Wahrscheinlichkeitsfunktion** von X ,
- $T(X) := \{x \in \mathbb{R} \mid p_X(x) > 0\}$ den **Träger** von X sowie alle Elemente $x \in T(X)$ **Trägerpunkte** von X und deren zugehörige Wahrscheinlichkeitsfunktionswerte $p_X(x)$ **Punkt Wahrscheinlichkeiten**.

Eigenschaften von Verteilungsfunktionen II

- Analog zur empirischen Verteilungsfunktion (deskriptive Statistik, Folie 46) können Intervallwahrscheinlichkeiten leicht mit der Verteilungsfunktion F_X einer Zufallsvariablen X berechnet werden.

- Für $a, b \in \mathbb{R}$ mit $a < b$ gilt:

$$\triangleright P_X((-\infty, b]) = P(\{X \leq b\}) = F_X(b)$$

$$\triangleright P_X((-\infty, b)) = P(\{X < b\}) = F_X(b-0)$$

$$\triangleright P_X([a, \infty)) = P(\{X \geq a\}) = 1 - F_X(a-0)$$

$$\triangleright P_X((a, \infty)) = P(\{X > a\}) = 1 - F_X(a)$$

$$\triangleright P_X([a, b]) = P(\{a \leq X \leq b\}) = F_X(b) - F_X(a-0)$$

$$\triangleright P_X((a, b]) = P(\{a < X \leq b\}) = F_X(b) - F_X(a)$$

$$\triangleright P_X([a, b)) = P(\{a \leq X < b\}) = F_X(b-0) - F_X(a-0)$$

$$\triangleright P_X((a, b)) = P(\{a < X < b\}) = F_X(b-0) - F_X(a)$$

- Insbesondere gilt für $x \in \mathbb{R}$ auch:

$$P_X(\{x\}) = P(\{X = x\}) = F_X(x) - F_X(x-0)$$

Beispiel

Anzahl „Wappen“ bei dreimaligem Münzwurf

- Zufallsexperiment: Dreimaliger Münzwurf mit fairer Münze („Wappen“ oder „Zahl“)

$$\triangleright \Omega = \{WWW, WWZ, WZW, WZZ, ZWW, ZWZ, ZZW, ZZZ\}$$

$$\triangleright \mathcal{F} = \mathcal{P}(\Omega)$$

$$\triangleright P : \mathcal{F} \rightarrow \mathbb{R}; P(A) = \frac{|A|}{|\Omega|}$$

- Zufallsvariable $X : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$: Anzahl der auftretenden Wappen, also

$$X(WWW) = 3, \quad X(WWZ) = 2, \quad X(WZW) = 2, \quad X(WZZ) = 1,$$

$$X(ZWW) = 2, \quad X(ZWZ) = 1, \quad X(ZZW) = 1, \quad X(ZZZ) = 0.$$

- Für $X(\Omega) = \{0, 1, 2, 3\}$ gilt offensichtlich $P(X(\Omega)) = 1$, also X diskret.
- Konkreter ist $T(X) = \{0, 1, 2, 3\}$ und die Punkt Wahrscheinlichkeiten sind

$$p_X(0) = \frac{1}{8}, \quad p_X(1) = \frac{3}{8}, \quad p_X(2) = \frac{3}{8}, \quad p_X(3) = \frac{1}{8}.$$