

Stochastische Unabhängigkeit

- Analog zur Unabhängigkeit von Merkmalen in deskriptiver Statistik:

Definition 7.2 (Stochastische Unabhängigkeit)

Es seien (Ω, \mathcal{F}, P) ein Wahrscheinlichkeitsraum und $A, B \in \mathcal{F}$. A und B heißen **stochastisch unabhängig** bezüglich P , wenn gilt:

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

- Ebenfalls analog zur deskriptiven Statistik sind Ereignisse genau dann unabhängig, wenn sich ihre unbedingten Wahrscheinlichkeiten nicht von den bedingten Wahrscheinlichkeiten — sofern sie definiert sind — unterscheiden:

Satz 7.4

Es seien (Ω, \mathcal{F}, P) ein Wahrscheinlichkeitsraum und $A, B \in \mathcal{F}$. Dann gilt

- ▶ falls $P(A) > 0$:
 A und B sind stochastisch unabhängig bzgl. $P \Leftrightarrow P(B|A) = P(B)$
- ▶ falls $P(B) > 0$:
 A und B sind stochastisch unabhängig bzgl. $P \Leftrightarrow P(A|B) = P(A)$

- Der Begriff „Stochastische Unabhängigkeit“ ist auch für Familien mit mehr als zwei Ereignissen von Bedeutung:

Definition 7.3

Es seien (Ω, \mathcal{F}, P) ein Wahrscheinlichkeitsraum und $(A_i)_{i \in I}$ eine Familie von Ereignissen aus \mathcal{F} . Die Familie heißt **stochastisch unabhängig**, wenn für jede endliche Teilmenge $K \subseteq I$ gilt:

$$P\left(\bigcap_{i \in K} A_i\right) = \prod_{i \in K} P(A_i)$$

- Besteht die Familie $(A_i)_{i \in I}$ in Definition 7.3 nur aus den drei Ereignissen A_1, A_2, A_3 , so ist die Familie also stochastisch unabhängig, falls
 - 1 $P(A_1 \cap A_2) = P(A_1) \cdot P(A_2)$
 - 2 $P(A_1 \cap A_3) = P(A_1) \cdot P(A_3)$
 - 3 $P(A_2 \cap A_3) = P(A_2) \cdot P(A_3)$
 - 4 $P(A_1 \cap A_2 \cap A_3) = P(A_1) \cdot P(A_2) \cdot P(A_3)$

gilt.

Insbesondere genügt **nicht** die paarweise stochastische Unabhängigkeit der Ereignisse A_1, A_2, A_3 !

Inhaltsverzeichnis

(Ausschnitt)

8 Messbarkeit und Bildwahrscheinlichkeit

- Messbare Abbildungen
- Bildwahrscheinlichkeit

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 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 III

- Zur Funktionsfähigkeit des „Wahrscheinlichkeitstransports“ nötig:
Geeignetes Mengensystem (\rightsquigarrow σ -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' .

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.

Inhaltsverzeichnis

(Ausschnitt)

- 9 Eindimensionale Zufallsvariablen
 - Borelsche sigma-Algebra
 - Wahrscheinlichkeitsverteilungen
 - Verteilungsfunktionen
 - Diskrete Zufallsvariablen
 - Stetige Zufallsvariablen
 - Abbildungen von Zufallsvariablen
 - Momente von Zufallsvariablen
 - Quantile von Zufallsvariablen
 - Spezielle diskrete Verteilungen
 - Spezielle stetige Verteilungen
 - Verwendung spezieller Verteilungen

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
 - ▶ Einpunktengen $\{x\}$ 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 Intervallenin \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 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 .

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.

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 überwiegt „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:

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

- 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

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

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:
 - ▶ $P_X((-\infty, b]) = P(\{X \leq b\}) = F_X(b)$
 - ▶ $P_X((-\infty, b)) = P(\{X < b\}) = F_X(b - 0)$
 - ▶ $P_X([a, \infty)) = P(\{X \geq a\}) = 1 - F_X(a - 0)$
 - ▶ $P_X((a, \infty)) = P(\{X > a\}) = 1 - F_X(a)$
 - ▶ $P_X([a, b]) = P(\{a \leq X \leq b\}) = F_X(b) - F_X(a - 0)$
 - ▶ $P_X((a, b]) = P(\{a < X \leq b\}) = F_X(b) - F_X(a)$
 - ▶ $P_X([a, b)) = P(\{a \leq X < b\}) = F_X(b - 0) - F_X(a - 0)$
 - ▶ $P_X((a, b)) = P(\{a < X < b\}) = F_X(b - 0) - F_X(a)$
- Insbesondere gilt für $x \in \mathbb{R}$ auch:

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

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 6.2 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 $p_X(x)$ **Punktwahrscheinlichkeiten**.

Beispiel

Anzahl „Wappen“ bei dreimaligem Münzwurf

- Zufallsexperiment: Dreimaliger Münzwurf mit fairer Münze („**W**appen“ oder „**Z**ahl“)
 - ▶ $\Omega = \{WWW, WWZ, WZW, WZZ, ZWW, ZWZ, ZZW, ZZZ\}$
 - ▶ $\mathcal{F} = \mathcal{P}(\Omega)$
 - ▶ $P : \mathcal{F} \rightarrow \mathbb{R}; P(A) = \frac{|A|}{|\Omega|}$

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

$$\begin{aligned} X(WWW) &= 3, & X(WWZ) &= 2, & X(WZW) &= 2, & X(WZZ) &= 1, \\ X(ZWW) &= 2, & X(ZWZ) &= 1, & X(ZZW) &= 1, & X(ZZZ) &= 0. \end{aligned}$$

- 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 Punktwahrscheinlichkeiten sind

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

Diskrete Zufallsvariablen (Forts.) I

- $T(X)$ ist endlich oder abzählbar unendlich, die Elemente von $T(X)$ werden daher im Folgenden häufig mit x_i bezeichnet (für $i \in \{1, \dots, n\}$ bzw. $i \in \mathbb{N}$), Summationen über Trägerpunkte mit dem Symbol \sum_{x_i} .
- Ist $p_X : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ die Wahrscheinlichkeitsfunktion einer diskreten Zufallsvariablen X , so gilt $P_X(A) = \sum_{x_i \in A \cap T(X)} p_X(x_i)$ für alle $A \in \mathcal{B}$.
- Spezieller gilt für die Verteilungsfunktion F_X einer diskreten Zufallsvariablen

$$F_X(x) = \sum_{\substack{x_i \in T(X) \\ x_i \leq x}} p_X(x_i) \quad \text{für alle } x \in \mathbb{R}.$$

Verteilungsfunktionen diskreter Zufallsvariablen sind damit (vergleichbar mit empirischen Verteilungsfunktionen) Treppenfunktionen mit **Sprunghöhen** $p_X(x_i)$ an den **Sprungstellen** (=Trägerpunkten) $x_i \in T(X)$.

Diskrete Zufallsvariablen (Forts.) II

- *Im Münzwurf-Beispiel:*

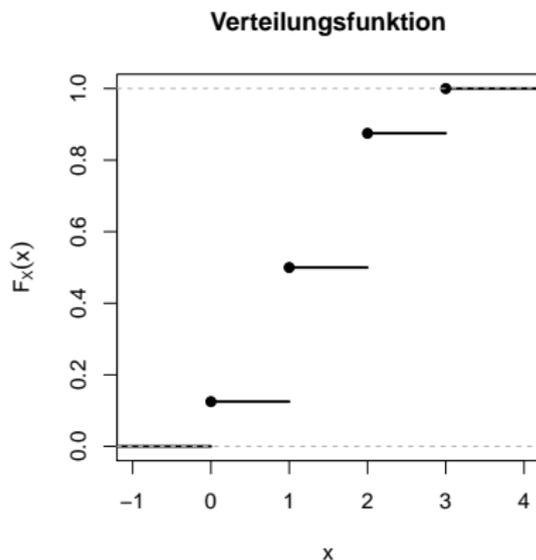
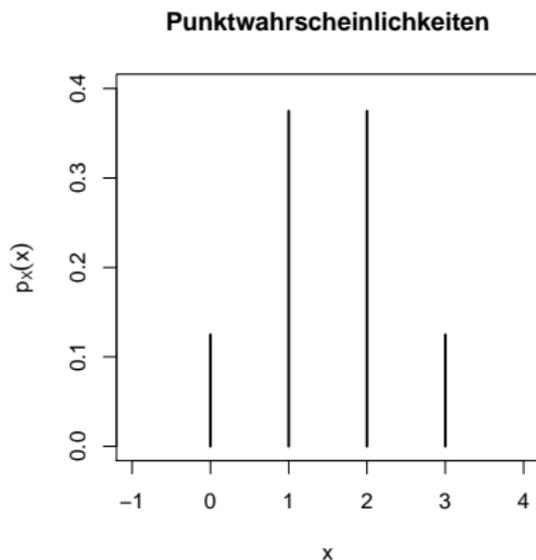
$$F_X(x) = \begin{cases} 0 & \text{für } x < 0 \\ \frac{1}{8} & \text{für } 0 \leq x < 1 \\ \frac{1}{2} & \text{für } 1 \leq x < 2 \\ \frac{7}{8} & \text{für } 2 \leq x < 3 \\ 1 & \text{für } x \geq 3 \end{cases}$$

- Ist der Träger $T(X)$ endlich und die Anzahl der Elemente in $T(X)$ klein, so werden die Punktwahrscheinlichkeiten häufig in Tabellenform angegeben.
- *Im Münzwurf-Beispiel:*

x_i	0	1	2	3
$p_X(x_i)$	$\frac{1}{8}$	$\frac{3}{8}$	$\frac{3}{8}$	$\frac{1}{8}$

Diskrete Zufallsvariablen (Forts.) III

- Grafische Darstellung im Münzwurf-Beispiel:



Stetige Zufallsvariablen I

- Weiterer wichtiger Spezialfall: **stetige** Zufallsvariablen
- Wertebereich stetiger Zufallsvariablen ist immer ein Kontinuum: es gibt **keine** endliche oder abzählbar unendliche Menge $B \subseteq \mathbb{R}$ mit $P_X(B) = 1$, stattdessen gilt sogar $P_X(B) = 0$ für alle endlichen oder abzählbar unendlichen Teilmengen $B \subseteq \mathbb{R}$.
- Verteilungsfunktionen stetiger Zufallsvariablen sind nicht (wie bei diskreten Zufallsvariablen) als Summe von Wahrscheinlichkeitsfunktionswerten darstellbar, sondern als Integral über eine sogenannte *Dichtefunktion*:

Stetige Zufallsvariablen II

Definition 9.4 (Stetige Zufallsvariable, Dichtefunktion)

Seien (Ω, \mathcal{F}, P) ein Wahrscheinlichkeitsraum und X eine Zufallsvariable über (Ω, \mathcal{F}, P) . Gibt es eine nichtnegative Abbildung $f_X : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ mit

$$F_X(x) = \int_{-\infty}^x f_X(t) dt \quad \text{für alle } x \in \mathbb{R}, \quad (2)$$

so heißt die Zufallsvariable X **stetig**. Jede nichtnegative Abbildung f_X mit der Eigenschaft (2) heißt **Dichtefunktion** von X .

Stetige Zufallsvariablen III

- Aus Definition 9.4 lassen sich weitere Eigenschaften von stetigen Zufallsvariablen bzw. Dichtefunktionen ableiten, zum Beispiel:
 - ▶ $P_X(\{x\}) = 0$ für alle $x \in \mathbb{R}$.
 - ▶ $F_X(x - 0) = F_X(x)$ für alle $x \in \mathbb{R}$, F_X ist also stetig auf \mathbb{R} .
 - ▶ $P(\{a \leq X \leq b\}) = P(\{a < X \leq b\}) = P(\{a \leq X < b\}) = P(\{a < X < b\})$
 $= F_X(b) - F_X(a) = \int_a^b f_X(t) dt$ für alle $a, b \in \mathbb{R}$ mit $a \leq b$.
 - ▶ (Mindestens) in allen Stetigkeitsstellen $x \in \mathbb{R}$ von f_X ist F_X differenzierbar und es gilt $F_X'(x) = f_X(x)$.
- Wahrscheinlichkeit von Intervallen stimmt mit Fläche zwischen Intervall und Dichtefunktion (analog zu Histogrammen bei deskriptiver Statistik mit klassierten Daten) überein.

Stetige Zufallsvariablen IV

- Dichtefunktion f_X zu einer Verteilungsfunktion F_X ist nicht eindeutig bestimmt; Abänderungen von f_X an endlich oder abzählbar unendlich vielen Stellen sind beliebig möglich!
- **Aber:** Ist $f_X : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ nichtnegative uneigentlich integrierbare Abbildung mit $\int_{-\infty}^{+\infty} f_X(x) dx = 1$, so gibt es genau eine Verteilungsfunktion $F_X : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, zu der f_X Dichtefunktion ist.
- Neben diskreten und stetigen Zufallsvariablen sind auch Mischformen (mit einem diskreten und stetigen Anteil) möglich, auf die hier aber nicht näher eingegangen wird!

- **Beispiel:** Die Abbildung

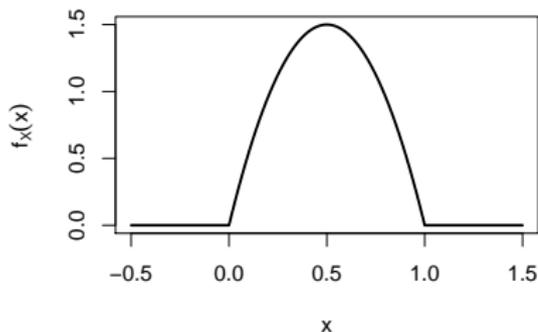
$$f_X : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}; f_X(x) := \begin{cases} 6(x - x^2) & \text{für } 0 \leq x \leq 1 \\ 0 & \text{sonst} \end{cases}$$

ist nichtnegativ und uneigentlich integrierbar mit $\int_{-\infty}^{+\infty} f_X(x) dx = 1$, also eine Dichtefunktion.

- Die Verteilungsfunktion F_X zu f_X erhält man als

$$F_X : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}; F_X(x) = \int_{-\infty}^x f_X(t) dt = \begin{cases} 0 & \text{für } x < 0 \\ 3x^2 - 2x^3 & \text{für } 0 \leq x \leq 1 \\ 1 & \text{für } x > 1 \end{cases} .$$

Dichtefunktion



Verteilungsfunktion

