

12. Übung zur Elementaren Stochastik

Prof. Dr. Ehrhard Behrends, WS 2009/10

Ausgabe: 11. 1. 2010

Abgabe: am 19. 01. 2010 bis 16.00 Uhr in den Fächern der Tutoren

Bei einigen Aufgaben gibt es eine *-Version. Die ist für die ambitionierteren Übungsteilnehmer gedacht. Das gilt auch für die **-Aufgaben, bei denen wird unter den richtigen Lösungen auch ein Preis verlost. Bitte für jedes n auf dem gleichen Zettel höchstens eine der Aufgaben n , n^* , n^{**} bearbeiten, $n = 1, 2, 3, 4$.

1. Es seien $X_n, X, Y_n, Y : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ Zufallsvariable. Man beweise oder widerlege:

a) Es gelte $X_n \rightarrow X$ fast sicher sowie $Y_n \rightarrow Y$ fast sicher. Dann gilt auch $3X_n + 4X_n Y_n \rightarrow 3X + 4XY$ fast sicher.

b) Es gelte $X_n \rightarrow X$ fast sicher sowie $Y_n \rightarrow Y$ fast sicher. Weiter seien die Y_n und Y bei keinem ω gleich Null. Dann gilt auch $X_n/Y_n \rightarrow X/Y$ fast sicher.

2. Es gelte $X_n \rightarrow X$ in Wahrscheinlichkeit. Dann gilt auch $X_n Y \rightarrow XY$ in Wahrscheinlichkeit.

2*. Es seien $X_n, X, Y_n, Y : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ Zufallsvariable. Man beweise oder widerlege:

Es gelte $X_n \rightarrow X$ in Wahrscheinlichkeit sowie $Y_n \rightarrow Y$ in Wahrscheinlichkeit. Dann gilt auch $X_n Y_n \rightarrow XY$ in Wahrscheinlichkeit.

3. Es seien $X_n, X, Y_n, Y : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ Zufallsvariable. Man beweise oder widerlege:

Es gelte $X_n \rightarrow X$ in Verteilung. Dann gilt auch $aX_n \rightarrow aX$ in Verteilung für jede reelle Zahl a .

3.** Es seien $X_n, X, Y_n, Y : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ Zufallsvariable. Man beweise oder widerlege:

Es gelte $X_n \rightarrow X$ in Verteilung sowie $Y_n \rightarrow Y$ in Verteilung. Dann gilt auch $X_n + Y_n \rightarrow X + Y$ in Verteilung.

4. Im Vorlesungsforum tauchte in der ersten Woche die folgende Frage auf:

Wie groß ist die Wahrscheinlichkeit, mit einem 4-seitigen fairen Würfel (die Seiten sind nummeriert mit den Zahlen 1, 2, 3, 4) mit 500 Würfeln unter die addierte Würfelzahl 1200 zu kommen?

Helfen Sie! (Wenigstens mit einer approximativen Lösung unter Verwendung des zentralen Grenzwertsatzes.)

Mögliche Klausurthemen:

Abschnitt I: σ -Algebra, Wahrscheinlichkeitsmaß, Wahrscheinlichkeitsraum, Simulation von W-Räumen,

Abschnitt II: Zufallsvariable, bedingte Wahrscheinlichkeiten, Unabhängigkeit (auch für mehr als zwei Ereignisse!), Bayes, das induzierte Maß einer ZV, Berechnung der zugehörigen Dichtefunktion, Erwartungswert, Streuung, Faltungen (diskret und kontinuierlich), elementare Kombinatorik

(vier Zählprobleme), hypergeometrische Verteilung, maximum-likelihood-Schätzer, Binomialverteilung, Poissonverteilung, Anwendungen des Satzes von de Moivre-Laplace, Exponentialverteilung, Normalverteilung, verschiedene Konvergenzbegriffe für Zufallsvariable, Anwendungen des zentralen Grenzwertsatzes.

Abschnitt III: Lemmata von Borel-Cantelli, Quantitatives zum schwachen Gesetz, starkes Gesetz.

Abschnitt IV: Korrelationskoeffizient, Regressionsgerade, Konfidenzintervall

Homepage der Veranstaltung: page.mi.fu-berlin.de/behrends/stochastik2009

Für den mathematischen „Arbeitsspeicher“ ...

Auf die folgenden Fragen sollte man jederzeit eine richtige Antwort geben können. Zur Not mit Hilfe eines vorbereiteten Zettels (der übrigens später bei der Klausur auch verwendet werden darf).

Arbeitsspeicher-Archiv: Nächste Seite

Was versteht man unter der „diskreten Faltung“ zweier Wahrscheinlichkeitsmaße auf $\mathbb{N}_0$, und in welchem Zusammenhang ist sie wichtig? Was ist die Faltung zweier Funktionen auf $\mathbb{R}^+$, und was lernt man aus der Faltung zweier Wahrscheinlichkeitsdichten auf $\mathbb{R}^+$? Was versteht man unter der Binomialverteilung? Unter welchen Bedingungen kann man die hypergeometrische Verteilung dadurch approximieren? Und wann die Poissonverteilung? Was besagt der Satz von deMoivre-Laplace? Was wird mit der Stirlingformel approximiert? Was ist eine gedächtnislose Wartezeit? Wie kann man die gedächtnislosen Wartezeiten beschreiben? Was weiß man über Summen, Maxima und Minima gedächtnisloser Wartezeiten?**Neu:** Was weiß man über unabhängige Summen von Normalverteilungen? Was versteht man unter a) fast sicherer Konvergenz, b) Konvergenz in Wahrscheinlichkeit, c) Konvergenz in Verteilung? Was besagt der zentrale Grenzwertsatz? Was besagt die Tchebycheff-Ungleichung? Was versteht man unter dem schwachen Gesetz der großen Zahlen?

... und hier noch Beispiele aus den „Arbeitsspeichern“ anderer Teilbereiche der Mathematik:

Ist $\mathcal{E}$ ein Mengensystem, d.h. eine Teilmenge der Potenzmenge einer Menge M , wie ist dann $\bigcup_{E \in \mathcal{E}} E$ definiert? Und wie $\bigcap_{E \in \mathcal{E}} E$? Was ist eine offene, was eine abgeschlossene Teilmenge des $\mathbb{R}^n$? Was besagt der Hauptsatz der Differential- und Integralrechnung? Was ist eine stetige Funktion? Was versteht man unter dem Zwischenwertsatz? Was ist $f^{-1}(A)$, wie ist die inverse Abbildung f^{-1} definiert (falls sie existiert)? Was heißt Konvergenz für Folgen und Reihen. Was ist eine absolut konvergente Reihe? Warum ist dieser Begriff für die Stochastik wichtig? Was ist eine Folge in einer Menge M ? Unter welchen Bedingungen weiß man, dass der Grenzwert einer Folge von stetigen (bzw. differenzierbaren) Funktionen wieder stetig (bzw. differenzierbar) ist? **Neu:**

Stochastik am Computer: Anregungen

Viele Definitionen, Ergebnisse und Verfahren sind besser zu verstehen, wenn man zur Illustration Computer-Simulationen zur Verfügung hat. Es wird empfohlen, sich solche Simulationen selbst zu schreiben, viele Routinen findet man schon vorgefertigt in den meisten Programmpaketen.

Unterprogramme: Zufallszahlen erzeugen können (Laplace, Bernoulli, Poisson, geometrisch, Exponentialverteilung, Normalverteilung, ...); Häufigkeitsverteilungen skizzieren können (so genannte Histogramme). Monte-Carlo-Verfahren zur approximativen Integration. **Neu:** Testen Sie das Programm zur Simulation von Poissonverteilungen des 11. Übungszettels.

Projekte: Test des Zufallszahlengenerators (etwa einige Millionen gleichverteilte Zufallszahlen in $\{1, 2, 3, 4, 5, 6\}$ erzeugen und prüfen, ob alle Ergebnisse in etwa gleich oft vorkommen); einige Millionen Poissonverteilte Zufallszahlen erzeugen und ein Histogramm erstellen, ... Integrale ausrechnen mit Monte-Carlo-Verfahren

und Güte-Test durch Vergleich mit dem exakten Ergebnis; Testläufe zum Übereinstimmungsparadoxon; p gleichverteilt in $[0, 1]$ wählen, dann für verschiedene k testen, wie groß die (experimentelle) bedingte Wahrscheinlichkeit für $k + 1$ Erfolge bei k Erfolgen ist. Testen Sie experimentell die Güte der Approximation beim Wallisprodukt und bei der Stirlingformel. **Neu:** Testen Sie experimentell den Satz von deMoivre-Laplace. **Neu:** Überzeugen Sie sich durch Skizzieren entsprechender Histogramme, dass geeignet normierte unabhängige Summen identisch verteilter Zufallsvariable der Standard-Normalverteilung immer ähnlicher werden.

Arbeitsspeicher-Archiv

Was ist eine σ -Algebra? Wie ist die σ -Algebra der Borelmengen definiert? Was ist ein Wahrscheinlichkeitsraum? Wie kann man einen Wahrscheinlichkeitsraum einfach definieren, wenn Ω höchstens abzählbar ist? Was versteht man unter a) der Gleichverteilung auf $\{1, \dots, n\}$, b) einem Laplaceraum, c) der Bernoulliverteilung, e) der Poissonverteilung, f) der geometrischen Verteilung? Wie kann man auf einem Intervall, versehen mit der σ -Algebra der Borelmengen, einen Wahrscheinlichkeitsraum mit Hilfe einer Dichtefunktion definieren? Was versteht man unter a) Gleichverteilung, b) Exponentialverteilung, c) Normalverteilung? Was wird mit dem Buffonschen Nadelexperiment approximativ berechnet? Was ist eine Zufallsvariable? Wie ist der durch eine Zufallsvariable induzierte Wahrscheinlichkeitsraum definiert? Wie ist der Erwartungswert einer Zufallsvariablen im Fall diskreter Räume und bei Räumen mit Dichte definiert? Was sind Varianz und Streuung? Wie viele Möglichkeiten gibt es, k Elemente aus einer n -elementigen Menge auszuwählen? In welchen Fällen verwendet man die hypergeometrische Verteilung? Was ist eine maximum-likelihood-Schätzung? Was ist das Übereinstimmungs-Paradoxon? Was versteht man unter „bedingter Wahrscheinlichkeit“? Wann heißen zwei Ereignisse unabhängig? Was bedeutet es, dass n Ereignisse unabhängig sind? Wann sind zwei (oder allgemeiner: n) Zufallsvariable unabhängig? Was weiß man über den Erwartungswert des Produkts zweier *unabhängiger* Zufallsvariablen, was über die Varianz der Summe? Was ist das „Wurzel- n -Gesetz“?