

Statistik

für Betriebswirtschaft, Internationales Management,
Wirtschaftsinformatik und Informatik

Sommersemester 2017

Hausaufgabe:
A 68-78

HSA Statistik SS 2017 Sessionlist		
Datum	Statistik für BW/IM/I/Winf	Nr.
15.03.2017	Einführung Statistik	1
22.03.2017	Differentialrechnung, 2-dim Diff.Rechnung	2
29.03.2017	univ. desk. Stat., Quantile, Plots	3
05.04.2017	Streuung, Konzentrationsmaße	4
12.04.2017	Kontingenztabellen, Mosaikplots, Korrelation	5
19.04.2017	Preisindizes, lineare Regression	6
26.04.2017	Wahrscheinlichkeitsbegriff	7
03.05.2017	Bedingte Wahrscheinlichkeit, Bayes	8
10.05.2017	diskrete Zufallsvariablen	9
17.05.2017	Stetige ZV, Gleichverteilung	10
24.05.2017	Pyramid	
31.05.2017	Normalverteilung, Verteilungsparameter	11
07.06.2017	Schätzfunktionen und Punktschätzer	12
14.06.2017	Konfidenzintervalle	13
21.06.2017	Wiederholung, Besprechung Probeklausur	14
28.06.2017	Prüfungswoche	15

Aufgabe 2.30

Das monatliche Einkommen betrage mindestens x_0 Geldeinheiten, wobei x_0 durch Tarifverträge, das soziale Netz und dergleichen bestimmt wird. Zur approximativen Beschreibung der Einkommensverteilung wird häufig eine Dichtefunktion der Form

$$f(x) = \begin{cases} \frac{c}{x^{\alpha+1}} & \text{für } x \geq x_0 \\ 0 & \text{sonst} \end{cases}$$

benutzt, wobei α ein positiver vorgegebener Parameter und c eine noch zu bestimmende Normierungskonstante ist.

- Bestimmen Sie c .
- Bestimmen Sie die Verteilungsfunktion F des Einkommens X .
- Setzen Sie speziell $\alpha = 1$ sowie $x_0 = 1\,000$ Euro und berechnen Sie die bedingte Wahrscheinlichkeit

$$P(X > 10\,000 | X \geq 5\,000),$$

d. h. den Anteil derjenigen unter den mindestens 5 000 Euro Verdienenden, die sogar über 10 000 Euro verdienen.

$$\begin{aligned} \text{a)} \quad \int_{-\infty}^{\infty} f(x) dx &= \int_{x_0}^{\infty} \frac{c}{x^{\alpha+1}} dx = c \cdot \int_{x_0}^{\infty} x^{-(\alpha+1)} dx \\ &= c \cdot \left[\frac{1}{-\alpha-1+1} x^{-\alpha-1+1} \right]_{x_0}^{\infty} \\ &= c \cdot \left[\frac{1}{-\alpha} x^{-\alpha} \right]_{x_0}^{\infty} = c \cdot \left(\frac{1}{-\alpha} \cdot 0 - \left(\frac{1}{-\alpha} \cdot x_0^{-\alpha} \right) \right) \\ &= \frac{c}{\alpha} x_0^{-\alpha} = 1 \\ \Leftrightarrow c &= \alpha \cdot x_0^{\alpha} \\ \Rightarrow f(x) &= \begin{cases} \frac{\alpha x_0^{\alpha}}{x^{\alpha+1}} & \text{für } x \geq x_0 \\ 0 & \text{sonst} \end{cases} \end{aligned}$$

b), c) \rightarrow Hausaufgabe

Lösung zu Aufgabe 2.30

- a) Nachdem die Fläche unterhalb des Graphen von $f(x)$ gleich eins sein muss, gilt:

$$1 = \int_{x_0}^{\infty} \frac{c}{x^{\alpha+1}} dx = \left[c \cdot \frac{1}{-\alpha-1+1} \cdot x^{-\alpha-1+1} \right]_{x_0}^{\infty} = \frac{c}{\alpha} \cdot x_0^{-\alpha},$$

woraus sich $c = \alpha x_0^{\alpha}$ ergibt.

- b)

$$F(x) = \int_{x_0}^x \frac{\alpha x_0^{\alpha}}{t^{\alpha+1}} dt = 1 - \left(\frac{x_0}{x} \right)^{\alpha} \quad (\text{für } x \geq x_0).$$

- c)

$$\begin{aligned} P(X > 10\,000 | X \geq 5\,000) &= \frac{P(X > 10\,000)}{P(X \geq 5\,000)} \\ &= \frac{1 - (1 - \frac{1}{10})}{1 - (1 - \frac{1}{5})} = \frac{1}{2}. \end{aligned}$$

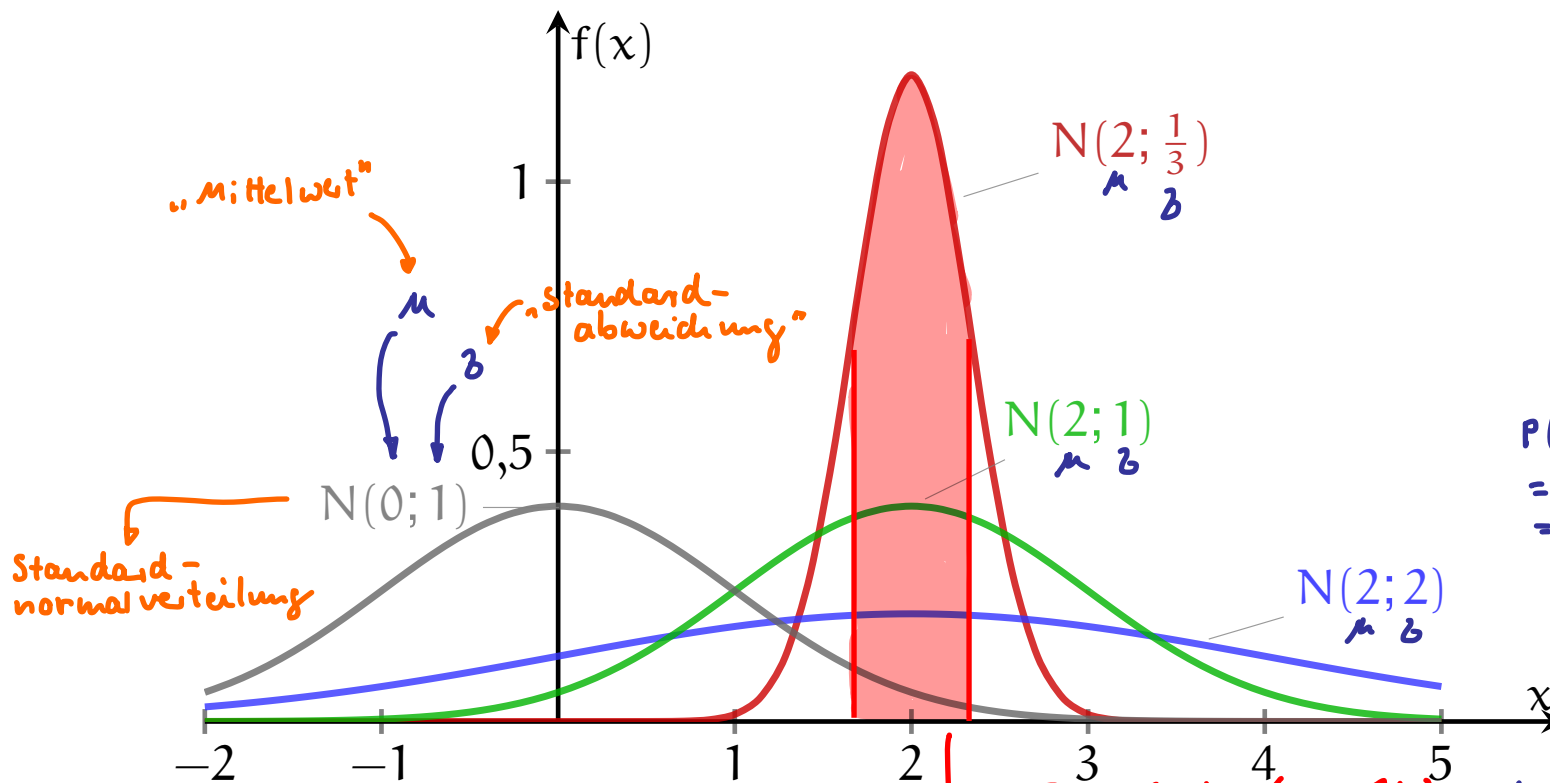


Eine Zufallsvariable X mit einer Dichtefunktion

$$f(x) = \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} \cdot e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}$$

σ → Sigma
 e^{-x^2}

und $\sigma > 0$ heißt **normalverteilt**.



Kurzschreibweise: $X \sim N(\mu; \sigma)$

1-Sigma-Bereich

$$P\left(2 - \frac{1}{3} \leq x \leq 2 + \frac{1}{3}\right) \approx F\left(2 + \frac{1}{3}\right) - F\left(2 - \frac{1}{3}\right)$$

$$= \Phi\left(\frac{2 + \frac{1}{3} - 2}{\frac{1}{3}}\right) - \Phi\left(\frac{2 - \frac{1}{3} - 2}{\frac{1}{3}}\right) = \Phi(1) - \Phi(-1)$$

$$= 2\Phi(1) - 1 = 2 \cdot 0.8414 - 1 = 0.6828$$

2 Sigma-Bereich

$$P(\mu - 2\sigma \leq x \leq \mu + 2\sigma)$$

$$= 2\Phi(2) - 1$$

$$= 2 \cdot 0.9773 - 1 = 0.9546$$

3 Sigma-Bereich

$$P(\mu - 3\sigma \leq x \leq \mu + 3\sigma)$$

$$= 2\Phi(3) - 1$$

$$\approx 2 \cdot 0.9987 - 1 = 0.9974$$

1. Einführung
 2. Differenzieren 2
 3. Deskriptive Statistik
 4. W-Theorie
 - Kombinatorik
 - Zufall und Wahrscheinlichkeit
 - Zufallsvariablen und Verteilungen
 - Verteilungsparameter
 5. Induktive Statistik
- Quellen
Tabellen



Normalverteilung

C.F. Gauß



1. Einführung
 2. Differenzieren 2
 3. Deskriptive Statistik
 4. W-Theorie
 - Kombinatorik
 - Zufall und Wahrscheinlichkeit
 - Zufallsvariablen und Verteilungen
 - Verteilungsparameter
 5. Induktive Statistik
- Quellen
- Tabellen

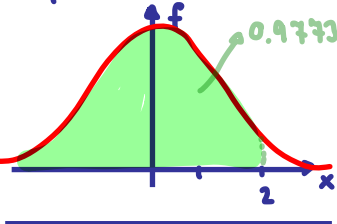
Verteilungsfunktion Φ der Standardnormalverteilung



Dabei bedeutet $\Phi(x)$ zum Beispiel: $\Phi(2,13) = \Phi(2,1 + 0,03) = 0,9834$. Diesen Wert findet man in der Zeile mit $x_1 = 2,1$ und der Spalte mit $x_2 = 0,03$.

$$X \sim N(0; 1)$$

$$P(X \leq 2) = F(2) = \Phi(2.00) = 0.9773$$



gegeben: ZV $X \sim N(0; 1)$

gesucht: x , so dass

$$P(X \leq x) = 0.90$$

$$\Leftrightarrow F(x) = 0.90$$

$$\Rightarrow x \approx 1.285$$

Beispiel: $X \sim N(100; 15)$

$$P(X \leq 115)$$

$$= F(115) = \Phi\left(\frac{115-100}{\sqrt{15}}\right) = \Phi(2.0)$$

$$= \Phi(1.00) = 0.8414$$

$$P(X \geq 140)$$

$$= 1 - F(140)$$

$$= 1 - \Phi\left(\frac{140-100}{\sqrt{15}}\right)$$

$$\approx 1 - \Phi(2.67)$$

$$\approx 1 - 0.9962 = 0.0038$$

$$P(X \leq 70) = F(70)$$

$$= \Phi\left(\frac{70-100}{\sqrt{15}}\right) = \Phi(-2)$$

$$= 1 - \Phi(2) = 1 - 0.9773 = 0.0227$$

$x_1 \backslash x_2$	0	0.01	0.02	0.03	0.04	0.05	0.06	0.07	0.08	0.09
0	0.5000	0.5040	0.5080	0.5120	0.5160	0.5199	0.5239	0.5279	0.5319	0.5359
0.1	0.5398	0.5438	0.5478	0.5517	0.5557	0.5596	0.5636	0.5675	0.5714	0.5754
0.2	0.5793	0.5832	0.5871	0.5910	0.5948	0.5987	0.6026	0.6064	0.6103	0.6141
0.3	0.6179	0.6217	0.6255	0.6293	0.6331	0.6368	0.6406	0.6443	0.6480	0.6517
0.4	0.6554	0.6591	0.6628	0.6664	0.6700	0.6737	0.6773	0.6808	0.6844	0.6879
0.5	0.6915	0.6950	0.6985	0.7020	0.7054	0.7089	0.7123	0.7157	0.7191	0.7224
0.6	0.7258	0.7291	0.7324	0.7357	0.7389	0.7422	0.7454	0.7486	0.7518	0.7549
0.7	0.7580	0.7612	0.7642	0.7673	0.7704	0.7734	0.7764	0.7794	0.7823	0.7852
0.8	0.7882	0.7910	0.7939	0.7967	0.7996	0.8023	0.8051	0.8079	0.8106	0.8133
0.9	0.8159	0.8186	0.8212	0.8238	0.8264	0.8290	0.8315	0.8340	0.8365	0.8389
1	0.8414	0.8438	0.8461	0.8485	0.8508	0.8532	0.8554	0.8577	0.8599	0.8622
1.1	0.8643	0.8665	0.8687	0.8708	0.8729	0.8749	0.8770	0.8790	0.8810	0.8830
1.2	0.8849	0.8869	0.8888	0.8907	0.8925	0.8944	0.8962	0.8980	0.8997	0.9015
1.3	0.9032	0.9049	0.9066	0.9083	0.9099	0.9115	0.9131	0.9147	0.9162	0.9177
1.4	0.9193	0.9207	0.9222	0.9237	0.9251	0.9265	0.9279	0.9292	0.9306	0.9319
1.5	0.9332	0.9345	0.9358	0.9370	0.9382	0.9394	0.9406	0.9418	0.9430	0.9441
1.6	0.9452	0.9463	0.9474	0.9485	0.9495	0.9505	0.9516	0.9526	0.9535	0.9545
1.7	0.9554	0.9564	0.9573	0.9582	0.9591	0.9600	0.9608	0.9616	0.9625	0.9633
1.8	0.9641	0.9649	0.9656	0.9664	0.9671	0.9679	0.9686	0.9693	0.9700	0.9706
1.9	0.9713	0.9719	0.9726	0.9732	0.9738	0.9744	0.9750	0.9756	0.9762	0.9767
2	0.9773	0.9778	0.9783	0.9788	0.9793	0.9798	0.9803	0.9808	0.9812	0.9817
2.1	0.9821	0.9826	0.9830	0.9834	0.9838	0.9842	0.9846	0.9850	0.9854	0.9857
2.2	0.9861	0.9865	0.9868	0.9871	0.9875	0.9878	0.9881	0.9884	0.9887	0.9890
2.3	0.9893	0.9896	0.9898	0.9901	0.9904	0.9906	0.9909	0.9911	0.9914	0.9916
2.4	0.9918	0.9920	0.9922	0.9925	0.9927	0.9929	0.9931	0.9933	0.9934	0.9936
2.5	0.9938	0.9940	0.9941	0.9943	0.9945	0.9946	0.9948	0.9949	0.9951	0.9952
2.6	0.9953	0.9955	0.9956	0.9957	0.9959	0.9960	0.9961	0.9962	0.9963	0.9964
2.7	0.9965	0.9966	0.9967	0.9968	0.9969	0.9970	0.9971	0.9972	0.9973	0.9974
2.8	0.9975	0.9975	0.9976	0.9977	0.9978	0.9978	0.9979	0.9980	0.9980	0.9981
2.9	0.9981	0.9982	0.9983	0.9983	0.9984	0.9984	0.9985	0.9985	0.9986	0.9986
3	0.9987	0.9987	0.9987	0.9988	0.9988	0.9989	0.9989	0.9989	0.9990	0.9990
3.1	0.9990	0.9991	0.9991	0.9991	0.9992	0.9992	0.9992	0.9992	0.9993	0.9993
3.2	0.9993	0.9993	0.9994	0.9994	0.9994	0.9994	0.9995	0.9995	0.9995	0.9995

- 1. Einführung
- 2. Differenzieren 2
- 3. Deskriptive Statistik
- 4. W-Theorie
 - Kombinatorik
 - Zufall und Wahrscheinlichkeit
 - Zufallsvariablen und Verteilungen
 - Verteilungsparameter
- 5. Induktive Statistik
- Quellen
- Tabellen



- 1. Einführung
- 2. Differenzieren 2
- 3. Deskriptive Statistik
- 4. W-Theorie
 - Kombinatorik
 - Zufall und Wahrscheinlichkeit
 - Zufallsvariablen und Verteilungen
 - Verteilungsparameter
- 5. Induktive Statistik
- Quellen
- Tabellen

- ▶ Dichte ist symmetrisch zu μ :

$$f(\mu - x) = f(\mu + x)$$

- ▣ μ ist Lage-, σ ist Streuungsparameter

- ▶ **Standardnormalverteilung:**

$N(0; 1)$ mit Verteilungsfunktion $\Phi(x)$ (\rightarrow Tabelle 3)

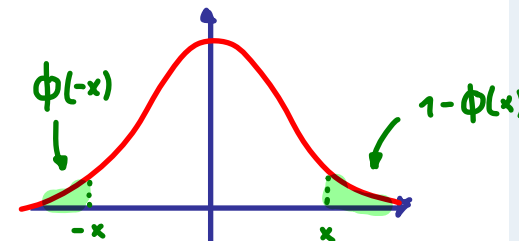
- ▶ Kenntnis von $\Phi(x)$, μ und σ genügt, denn:

$$X \sim N(\mu; \sigma) \iff \frac{X - \mu}{\sigma} \sim N(0; 1) \implies$$

$$F(x) = \Phi\left(\frac{x - \mu}{\sigma}\right)$$

- ▶ Tabelle enthält nur positive x : Deswegen

$$\Phi(-x) = 1 - \Phi(x)$$





Beispiel:

Projektdauer $X \sim N(39; 2)$.

Wahrscheinlichkeit für Projektdauer zwischen 37 und 41 Wochen?

Lösung:

$$\begin{aligned} P(37 \leq X \leq 41) &= F(41) - F(37) \\ &= \Phi\left(\frac{41-39}{2}\right) - \Phi\left(\frac{37-39}{2}\right) \\ &= \Phi(1) - \Phi(-1) \\ &= \Phi(1) - [1 - \Phi(1)] \\ &= 2 \cdot \Phi(1) - 1 \\ &= 2 \cdot 0,8413 - 1 \\ &= 0,6826 \end{aligned}$$

- 1. Einführung
- 2. Differenzieren 2
- 3. Deskriptive Statistik
- 4. W-Theorie
 - Kombinatorik
 - Zufall und Wahrscheinlichkeit
 - Zufallsvariablen und Verteilungen
 - Verteilungsparameter
- 5. Induktive Statistik
- Quellen
- Tabellen

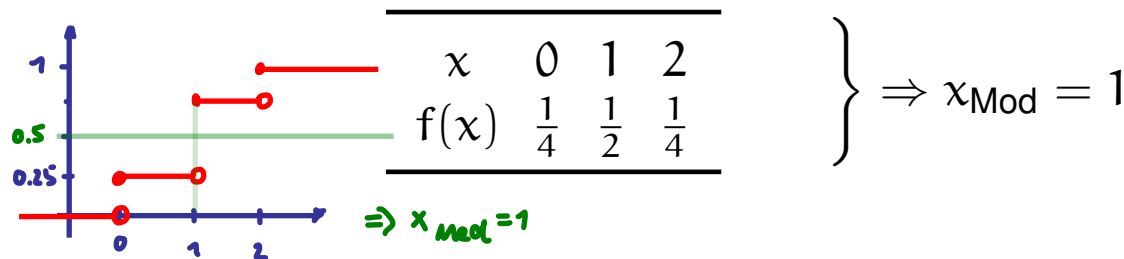


- 1. Einführung
- 2. Differenzieren 2
- 3. Deskriptive Statistik
- 4. W-Theorie
 - Kombinatorik
 - Zufall und Wahrscheinlichkeit
 - Zufallsvariablen und Verteilungen
 - Verteilungsparameter
- 5. Induktive Statistik
- Quellen
- Tabellen

a) **Modus** x_{Mod} : $f(x_{\text{Mod}}) \geq f(x)$ für alle x
(i.A. nicht eindeutig, z.B. Gleichverteilung)

Beispiele:

- Normalverteilung: $x_{\text{Mod}} = \mu$
- Diskrete Verteilung mit:



b) **Median** x_{Med} : $F(x_{\text{Med}}) = \frac{1}{2}$ bzw. kleinstes x mit $F(x) > \frac{1}{2}$

Beispiele:

- Normalverteilung: $x_{\text{Med}} = \mu$
- Diskrete Verteilung
oben: $F(0) = \frac{1}{4} < \frac{1}{2}$, $F(1) = \frac{3}{4} > \frac{1}{2} \Rightarrow x_{\text{Med}} = 1$



- 1. Einführung
- 2. Differenzieren 2
- 3. Deskriptive Statistik
- 4. W-Theorie
 - Kombinatorik
 - Zufall und Wahrscheinlichkeit
 - Zufallsvariablen und Verteilungen
 - Verteilungsparameter
- 5. Induktive Statistik
- Quellen
- Tabellen

c) **α -Fraktile** x_α : $F(x_\alpha) = \alpha$ (für stetige Verteilungen)

Beispiel: $X \sim N(0; 1)$, $Y \sim N(3; 2)$

$$\begin{aligned}x_{0,975} &= 1,96 && \text{(Tab. 3)} \\x_{0,025} &= -x_{0,975} = -1,96 \\y_{0,025} &= 2 \cdot x_{0,025} + 3 = -0,92\end{aligned}$$

Hinweise:

- $x_{\text{Med}} = x_{0,5}$
- Wenn x_α nicht vertafelt \rightarrow **Interpolation:**

$$x_\alpha \approx x_a + (x_b - x_a) \cdot \frac{\alpha - a}{b - a}$$

mit a : größte vertafelte Zahl $< \alpha$
 b : kleinste vertafelte Zahl $> \alpha$

Beispiel: $X \sim N(0; 1)$; $x_{0,6} \approx$
 $0,25 + (0,26 - 0,25) \cdot \frac{0,6 - 0,5987}{0,6026 - 0,5987} = 0,2533$

Lageparameter: Erwartungswert

deskr. Statistik: arithm. Mittel $\bar{x} = \frac{1}{n} \sum x_i = \sum a_i \cdot f_i$

d) Erwartungswert $E(X)$ bzw. μ :

$$E(X) = \begin{cases} \sum_i x_i f(x_i), & \text{falls } X \text{ diskret} \\ \int_{-\infty}^{\infty} x f(x) dx, & \text{falls } X \text{ stetig} \end{cases}$$

Beispiel: Diskrete Verteilung mit

x	0	1	2
$f(x)$	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{2}$	$\frac{1}{4}$

$$\Rightarrow E(X) = 0 \cdot \frac{1}{4} + 1 \cdot \frac{1}{2} + 2 \cdot \frac{1}{4} = 1$$

Beispiel: Für eine **exponentialverteilte** Zufallsvariable X mit der Dichte

$$f(x) = \begin{cases} \lambda \cdot e^{-\lambda x} & \text{für } x \geq 0 \\ 0 & \text{sonst} \end{cases} \quad \text{folgt}$$

$$\begin{aligned} E(X) &= \int_{-\infty}^{\infty} x \cdot f(x) dx = \lambda \int_0^{\infty} x \cdot e^{-\lambda x} dx = \lambda \left[-\frac{1}{\lambda} x e^{-\lambda x} - \int_0^{\infty} 1 \cdot \left(-\frac{1}{\lambda} e^{-\lambda x} \right) dx \right] \\ &= -x e^{-\lambda x} - \frac{1}{\lambda} e^{-\lambda x} \Big|_0^{\infty} = -0 - \left(-0 - \frac{1}{\lambda} \right) = \frac{1}{\lambda} \end{aligned}$$



- 1. Einführung
- 2. Differenzieren 2
- 3. Deskriptive Statistik
- 4. W-Theorie
 - Kombinatorik
 - Zufall und Wahrscheinlichkeit
 - Zufallsvariablen und Verteilungen
- Verteilungsparameter

5. Induktive Statistik

Quellen

Tabellen

Beispiel: Glücksspiel, Einsatz 10€

Auszahlungsverteilung ($X \hat{=}$ Gewinn)

x	-10	0	200
f(x)	0.9	0.08	0.02

Erwartungswert:

$$E[X] = -10 \cdot 0.9 + 0 \cdot 0.08 + 200 \cdot 0.02 \\ = -5 \text{ €}$$

Beispiel: Erwartungswert der Gleichverteilung

X ist gleichverteilt mit $f(x) = \begin{cases} \frac{1}{b-a} & \text{für } a \leq x \leq b \\ 0 & \text{sonst} \end{cases}$

$$E[X] = \int_{-\infty}^{\infty} x \cdot f(x) dx = \int_a^b x \cdot \left(\frac{1}{b-a}\right) dx \\ = \frac{1}{b-a} \left[\frac{1}{2} x^2 \right]_a^b = \frac{1}{b-a} \left(\frac{1}{2} b^2 - \frac{1}{2} a^2 \right) \\ = \frac{1}{2} \frac{b^2 - a^2}{b-a} = \frac{1}{2} \frac{(b-a)(b+a)}{(b-a)} = \frac{b+a}{2}$$

$$E[X] = \frac{b+a}{2}$$

Erwartungswert
der Gleichverteilung

Beispiel: Varianz einer Gleichverteilung

$$X \text{ mit } f(x) = \begin{cases} \frac{1}{b} & 0 \leq x \leq b \\ 0 & \text{sonst} \end{cases} \Rightarrow E[X] = \frac{b}{2}$$

$$\text{Var}[X] = \int_{-\infty}^{\infty} (x - E[X])^2 \cdot f(x) dx$$

$$= \int_0^b \left(x - \frac{b}{2}\right)^2 \cdot \frac{1}{b} dx$$

$$= \frac{1}{b} \left[\frac{1}{3} \left(x - \frac{b}{2}\right)^3 \right]_0^b = \frac{1}{b} \cdot \frac{1}{3} \left(\left(b - \frac{b}{2}\right)^3 - \left(0 - \frac{b}{2}\right)^3 \right)$$

$$= \frac{1}{b} \cdot \frac{1}{3} \cdot \left(\frac{b^3}{8} + \frac{b^3}{8} \right) = \frac{1 \cdot b^3}{b \cdot 3 \cdot 4} = \frac{b^2}{12}$$



- 1. Einführung
- 2. Differenzieren 2
- 3. Deskriptive Statistik
- 4. W-Theorie
 - Kombinatorik
 - Zufall und Wahrscheinlichkeit
 - Zufallsvariablen und Verteilungen
 - Verteilungsparameter
- 5. Induktive Statistik
- Quellen
- Tabellen

- ▶ Ist f **symmetrisch** bzgl. a , so gilt $E(X) = a$
Beispiel: f der Gleichverteilung symmetrisch bzgl. $\frac{a+b}{2} \Rightarrow E(X) = \frac{a+b}{2}$

- ▶ Lineare Transformation:

$$E(a + bX) = a + b \cdot E(X)$$

- ▶ Summenbildung:

$$E\left(\sum_{i=1}^n X_i\right) = \sum_{i=1}^n E(X_i)$$

Beispiel: X gleichverteilt in $[0; 10]$, $Y \sim N(1; 1)$; $Z = X + 5Y$

$$E(Z) = E(X + 5Y) = E(X) + E(5Y) = E(X) + 5 \cdot E(Y) = \frac{10+0}{2} + 5 \cdot 1 = 10$$

- ▶ Unabhängigkeit:

$$X, Y \text{ unabhängig} \Rightarrow E(X \cdot Y) = E(X) \cdot E(Y)$$



deskriptiv: mittlere quadr. Abweichung

► **Varianz** $\text{Var}(X)$ bzw. σ^2 :

$$\text{Var}(X) = E([X - E(X)]^2) = \begin{cases} \sum_i [x_i - E(X)]^2 f(x_i), & \text{wenn } X \text{ diskret} \\ \int_{-\infty}^{\infty} [x - E(X)]^2 f(x) dx, & \text{wenn } X \text{ stetig} \end{cases}$$

- 1. Einführung
- 2. Differenzieren 2
- 3. Deskriptive Statistik
- 4. W-Theorie
 - Kombinatorik
 - Zufall und Wahrscheinlichkeit
 - Zufallsvariablen und Verteilungen
- Verteilungsparameter

► **Standardabweichung** $\text{Sta}(X)$ bzw. σ :

$$\text{Sta}(X) = \sqrt{\text{Var}(X)}$$

Beispiel: Diskrete Verteilung

x	0	1	2
$f(x)$	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{2}$	$\frac{1}{4}$

} : $E(X) = 0 \cdot \frac{1}{4} + 1 \cdot \frac{1}{2} + 2 \cdot \frac{1}{4} = 1$

$$\text{Var}(X) = (0 - 1)^2 \cdot \frac{1}{4} + (1 - 1)^2 \cdot \frac{1}{2} + (2 - 1)^2 \cdot \frac{1}{4} = \frac{1}{2}$$

Beispiel: Für eine **exponentialverteilte** Zufallsvariable X (Dichte siehe Erwartungswert) folgt

$$\begin{aligned} \text{Var}(X) &= \int_{-\infty}^{\infty} (x - E(X))^2 f(x) dx = \lambda \int_0^{\infty} (x - \frac{1}{\lambda})^2 \cdot e^{-\lambda x} dx \\ &= e^{-\lambda x} \left(-x^2 + \frac{2x}{\lambda} - (\frac{1}{\lambda})^2 - \frac{2}{\lambda^2} - \frac{2x}{\lambda} + \frac{2}{\lambda^2} \right) \Big|_0^{\infty} \\ &= 0 - \left(-0^2 - (\frac{1}{\lambda})^2 \right) = \frac{1}{\lambda^2} \end{aligned}$$

- 5. Induktive Statistik
- Quellen
- Tabellen



- 1. Einführung
- 2. Differenzieren 2
- 3. Deskriptive Statistik
- 4. W-Theorie
 - Kombinatorik
 - Zufall und Wahrscheinlichkeit
 - Zufallsvariablen und Verteilungen
 - Verteilungsparameter
- 5. Induktive Statistik

Quellen

Tabellen

► Verschiebungssatz:

$$\text{Var}(X) = E(X^2) - [E(X)]^2$$

Beispiel: Diskrete Verteilung

x	0	1	2	
f(x)	1/4	1/2	1/4	:

$$\begin{aligned} E(X^2) &= 0^2 \cdot \frac{1}{4} + 1^2 \cdot \frac{1}{2} + 2^2 \cdot \frac{1}{4} \\ &= \frac{3}{2} \end{aligned}$$

$$\Rightarrow E(X^2) - [E(X)]^2 = \frac{3}{2} - 1^2 = \frac{1}{2} = \text{Var}(X)$$

► Lineare Transformation:

$$\text{Var}(a + bX) = b^2 \text{Var}(X)$$

► **Summenbildung** gilt nur, wenn die X_i unabhängig! Dann:

$$\text{Var}\left(\sum_{i=1}^n X_i\right) = \sum_{i=1}^n \text{Var}(X_i)$$



Verteilungsfunktion Φ der Standardnormalverteilung

Dabei bedeutet $\Phi(x)$ zum Beispiel: $\Phi(2,13) = \Phi(2,1 + 0,03) = 0,9834$. Diesen Wert findet man in der Zeile mit $x_1 = 2,1$ und der Spalte mit $x_2 = 0,03$.

$x_1 \setminus x_2$	0	0.01	0.02	0.03	0.04	0.05	0.06	0.07	0.08	0.09
0	0.50000	0.50399	0.50798	0.51197	0.51595	0.51994	0.52392	0.52790	0.53188	0.53586
0.1	0.53983	0.54380	0.54776	0.55172	0.55567	0.55962	0.56356	0.56749	0.57142	0.57535
0.2	0.57926	0.58317	0.58706	0.59095	0.59483	0.59871	0.60257	0.60642	0.61026	0.61409
0.3	0.61791	0.62172	0.62552	0.62930	0.63307	0.63683	0.64058	0.64431	0.64803	0.65173
0.4	0.65542	0.65910	0.66276	0.66640	0.67003	0.67364	0.67724	0.68082	0.68439	0.68793
0.5	0.69146	0.69497	0.69847	0.70194	0.70540	0.70884	0.71226	0.71566	0.71904	0.72240
0.6	0.72575	0.72907	0.73237	0.73565	0.73891	0.74215	0.74537	0.74857	0.75175	0.75490
0.7	0.75804	0.76115	0.76424	0.76730	0.77035	0.77337	0.77637	0.77935	0.78230	0.78524
0.8	0.78814	0.79103	0.79389	0.79673	0.79955	0.80234	0.80511	0.80785	0.81057	0.81327
0.9	0.81594	0.81859	0.82121	0.82381	0.82639	0.82894	0.83147	0.83398	0.83646	0.83891
1	0.84134	0.84375	0.84614	0.84850	0.85083	0.85314	0.85543	0.85769	0.85993	0.86214
1.1	0.86433	0.86650	0.86864	0.87076	0.87286	0.87493	0.87698	0.87900	0.88100	0.88298
1.2	0.88493	0.88686	0.88877	0.89065	0.89251	0.89435	0.89617	0.89796	0.89973	0.90147
1.3	0.90320	0.90490	0.90658	0.90824	0.90988	0.91149	0.91309	0.91466	0.91621	0.91774
1.4	0.91924	0.92073	0.92220	0.92364	0.92507	0.92647	0.92785	0.92922	0.93056	0.93189
1.5	0.93319	0.93448	0.93574	0.93699	0.93822	0.93943	0.94062	0.94179	0.94295	0.94408
1.6	0.94520	0.94630	0.94738	0.94845	0.94950	0.95053	0.95154	0.95254	0.95352	0.95449
1.7	0.95543	0.95637	0.95728	0.95818	0.95907	0.95994	0.96080	0.96164	0.96246	0.96327
1.8	0.96407	0.96485	0.96562	0.96638	0.96712	0.96784	0.96856	0.96926	0.96995	0.97062
1.9	0.97128	0.97193	0.97257	0.97320	0.97381	0.97441	0.97500	0.97558	0.97615	0.97670
2	0.97725	0.97778	0.97831	0.97882	0.97932	0.97982	0.98030	0.98077	0.98124	0.98169
2.1	0.98214	0.98257	0.98300	0.98341	0.98382	0.98422	0.98461	0.98500	0.98537	0.98574
2.2	0.98610	0.98645	0.98679	0.98713	0.98745	0.98778	0.98809	0.98840	0.98870	0.98899
2.3	0.98928	0.98956	0.98983	0.99010	0.99036	0.99061	0.99086	0.99111	0.99134	0.99158
2.4	0.99180	0.99202	0.99224	0.99245	0.99266	0.99286	0.99305	0.99324	0.99343	0.99361
2.5	0.99379	0.99396	0.99413	0.99430	0.99446	0.99461	0.99477	0.99492	0.99506	0.99520
2.6	0.99534	0.99547	0.99560	0.99573	0.99585	0.99598	0.99609	0.99621	0.99632	0.99643
2.7	0.99653	0.99664	0.99674	0.99683	0.99693	0.99702	0.99711	0.99720	0.99728	0.99736
2.8	0.99744	0.99752	0.99760	0.99767	0.99774	0.99781	0.99788	0.99795	0.99801	0.99807
2.9	0.99813	0.99819	0.99825	0.99831	0.99836	0.99841	0.99846	0.99851	0.99856	0.99861
3	0.99865	0.99869	0.99874	0.99878	0.99882	0.99886	0.99889	0.99893	0.99897	0.99900
3.1	0.99903	0.99906	0.99910	0.99913	0.99916	0.99918	0.99921	0.99924	0.99926	0.99929
3.2	0.99931	0.99934	0.99936	0.99938	0.99940	0.99942	0.99944	0.99946	0.99948	0.99950
3.3	0.99952	0.99953	0.99955	0.99957	0.99958	0.99960	0.99961	0.99962	0.99964	0.99965
3.4	0.99966	0.99968	0.99969	0.99970	0.99971	0.99972	0.99973	0.99974	0.99975	0.99976



1. Einführung
2. Differenzieren 2
3. Deskriptive Statistik
4. W-Theorie
5. Induktive Statistik

Quellen

Tabellen

Binomialverteilung

Poissonverteilung

Standardnormalverteilung

χ^2 -Verteilung

t-Verteilung

F-Verteilung