

---

# Grundlagen der Wahrscheinlichkeitsrechnung

---

## Wahrscheinlichkeitsfunktion

Grundgesamtheit

Wk. für das Eintreten von  $\omega$ .

Def.:  $\Omega \neq \emptyset$  abzählbar.  $P: \Omega \rightarrow [0,1]$  mit  $\sum_{\omega \in \Omega} P(\omega) = 1$   
heißt Wahrscheinlichkeitsfunktion auf  $\Omega$ .

## Wahrscheinlichkeitsmaß (Kolmogorow)

$= \{A: A \subseteq \Omega\}$

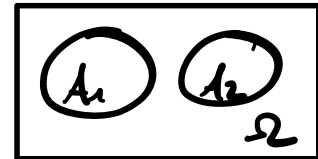
Def.:  $\Omega \neq \emptyset$  abzählbar.  $P: \mathcal{P}(\Omega) \rightarrow [0,1]$ ,  $P(A) := \sum_{\omega \in A} P(\omega)$  mit

(i)  $P(\Omega) = 1$  (Normiertheit)

(ii)  $(A_i)_{i=1}^{\infty} \subseteq \mathcal{P}(\Omega) \wedge A_i \cap A_j = \emptyset$  für alle  $i \neq j$ :  $P(\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i) = \sum_{i=1}^{\infty} P(A_i)$   
( $\sigma$ -Additivität)

heißt (diskretes) Wahrscheinlichkeitsmaß.

→ zählbar



## Anmerkung:

- Gegebene Wk.-Funktion  $P$  definiert mit  $P(A) := \sum_{\omega \in A} P(\omega)$  ein Wk.-Maß
- Gegebenes Wk.-Maß  $P$  definiert mit  $P(\omega) := P(\{\omega\})$ ,  $\omega \in \Omega$  eine Wk.-Funktion

## Laplace - Wahrscheinlichkeit

- Grundmenge  $\Omega = \{\omega_1, \dots, \omega_n\}$  ist endlich
- $P(\omega_1) = \dots = P(\omega_n) = \frac{1}{n}$

$$\Rightarrow \text{Für alle } A \in \mathcal{P}(\Omega): \quad P(A) = \frac{|A|}{|\Omega|} = \frac{\# \text{ günstige Ereignisse}}{\# \text{ Gesamtzahl Ereignisse}}$$

BSP: Wie groß ist die Wahrscheinlichkeit mit einem (idealen) 6-seitigen Würfel eine Primzahl zu würfeln?

$$P(\{\text{Primzahl}\}) = P(\{2, 3, 5\}) = \frac{3}{6} = \frac{1}{2} (\hat{=} 50\%)$$

**Aufgabe:** Beim Kartenspiel Skat gibt es insgesamt 32 einzigartige Karten mit 8 Werten (7, 8, 9, 10, Bube, Dame, König, Ass) und 4 Farben ( $\clubsuit$ ,  $\spadesuit$ ,  $\heartsuit$ ,  $\diamondsuit$ ), von denen jeweils 10 Karten an die drei Spieler ausgeteilt werden und 2 Karten verdeckt in den *Skat* gelegt werden. Wie groß sind die Wahrscheinlichkeiten dafür, dass

- (a) im *Skat* zwei Assen liegen? = A
- (b) Spieler 1 genau ein Ass erhält? = B
- (c) im *Skat* zwei Assen liegen und Spieler 1 genau ein Ass erhält? = C

(a) 
$$P(A) = \frac{\# \text{ 2 von 4 Assen}}{\# \text{ Alle Möglichkeiten für 2 Karten}} = \frac{\binom{4}{2}}{\binom{32}{2}} \approx \underline{\underline{0,0121}}$$

*von 4 Assen 2 auswählen*

*von 32 Karten 2 auswählen*

$$= \frac{\frac{4 \cdot 3}{2 \cdot 1}}{\frac{32 \cdot 31}{2 \cdot 1}} = \frac{3}{248}$$

(b) 
$$P(B) = \frac{\# \text{ Hände mit 1 Ass}}{\# \text{ Mögliche Hände}} = \frac{\binom{4}{1} \cdot \binom{28}{9}}{\binom{32}{10}} = \frac{385}{899} \approx \underline{\underline{0,0428}}$$

*von 4 Assen 1 auswählen*

*von 28 Nicht-Assen 9 auswählen*

*von 32 Karten 10 auswählen*

(c) 
$$P(C) = P(A \cap B) = \frac{\binom{4}{1} \cdot \binom{28}{9} \cdot \binom{3}{2}}{\binom{32}{10} \cdot \binom{22}{2}} = \frac{5}{899}$$

*von 4 Assen 1 auf die Hand*

*von 28 Nicht-Assen 9 auf die Hand*

*von den (übrigen) 3 Assen 2 in dem Skat*

*von 32 Karten 10 auf die Hand*

*von den verbleibenden 22 Karten 2 in dem Skat*

**Aufgabe (Geburtstagsparadoxon):** Wie groß ist die Wahrscheinlichkeit, dass unter  $k$  Personen mindestens 2 am gleichen Tag Geburtstag haben? = A

**Anmerkung:** Gehen Sie von 365 Tagen aus. Verwenden Sie die Näherung  $1 - x \approx e^{-x}$  für „kleine  $x$ “.

$$P(A) = 1 - P(\text{„alle an unterschiedlichen Tagen“}) = \dots = \left(1 - \frac{\sqrt[365]{k}}{\sqrt[365]{365}}\right)$$

$$k=1: \dots = 1 - \frac{365}{365} = 0$$

$$k=2: \dots = 1 - \frac{365}{365} \cdot \frac{364}{365} = \dots$$

$$\vdots$$

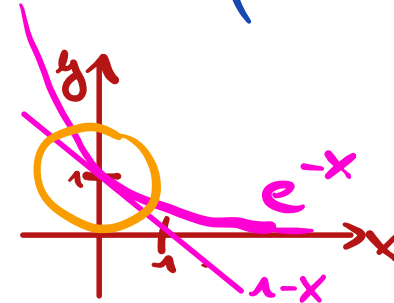
$$k: \dots = 1 - \frac{365}{365} \cdot \frac{364}{365} \cdot \frac{365-(k-1)}{365} = 1 - \prod_{j=0}^{k-1} \frac{365-j}{365} = 1 - \prod_{j=0}^{k-1} \left(1 - \frac{j}{365}\right)$$

$$\geq 1 - \prod_{j=0}^{k-1} e^{-\frac{j}{365}} = 1 - e^{-\sum_{j=0}^{k-1} \frac{j}{365}} = 1 - e^{-\frac{1}{365} \cdot \sum_{j=0}^{k-1} j}$$

$$= 1 - e^{-\frac{1}{365} \cdot \frac{(k-1) \cdot k}{2}} = 1 - e^{-\frac{1}{730} \cdot k(k-1)} \geq P$$

$$k=18: P(A) \approx \underline{\underline{0,3424}}$$

↑  
damit sich eine Wette lohnt



$$1 - e^{-\frac{1}{730} \cdot k(k-1)} \geq p$$

$$| + e^{\dots} | 1-p$$

$$1-p \geq e^{-\frac{1}{730} \cdot k(k-1)}$$

$$| \ln(\dots) |$$

$$\ln(1-p) \geq -\frac{1}{730} \cdot k(k-1)$$

$$| \cdot (-730) |$$

$$-730 \cdot \ln(1-p) \leq k^2 - k = \left(k - \frac{1}{2}\right)^2 - \frac{1}{4} \quad | + \frac{1}{4}$$

$$\frac{1}{4} - 730 \cdot \ln(1-p) \leq \left(k - \frac{1}{2}\right)^2$$

$$| \sqrt{\dots} | + \frac{1}{2}$$

$$k \geq \frac{1}{2} + \sqrt{\frac{1}{4} - 730 \cdot \ln(1-p)} \quad (\text{neg. Wurzel entfällt, weil } k \geq 0)$$

$$p = 95\% : k \geq 48$$

$$p = 50\% : k \geq 23$$

$$p = 25\% : k \geq 16$$

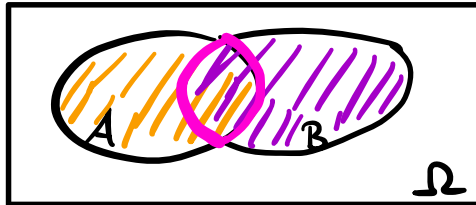
## Eigenschaften von Wahrscheinlichkeitsmaßen

Seien  $A, B \subseteq \Omega$  Ereignisse und  $P$  ein Wahrscheinlichkeitsmaß.

(1)  $P(\emptyset) = 0$ ,  $P(\Omega) = 1$

(2)  $P(\bar{A}) = 1 - P(A)$

(3)  $P(A \cup B) = \underbrace{P(A)} + \underbrace{P(B)} - \underbrace{P(A \cap B)}$  (Siebformel)



(4)  $P(\overline{A \cap B}) = P(\bar{A} \cup \bar{B})$

$P(\overline{A \cup B}) = P(\bar{A} \cap \bar{B})$

(Regel von de Morgan)

**Aufgabe:** Seien  $A, B \subseteq \Omega$  Ereignisse.

- (a) Berechnen Sie  $P(A)$ ,  $P(B)$  und  $P(A \cap B)$ , wenn  $P(A \cup B) = 0,7$ ,  $P(A \setminus B) = 0,4$  und  $P(\bar{A} \cap B) = 0,1$ .
- (b) Berechnen Sie  $P(A)$ ,  $P(\bar{B})$  und  $P(A \cup B)$ , falls  $P(A \cap B) = 0,2$ ,  $P(\bar{A} \cap B) = 0,2$  und  $P(A \setminus B) = 0,3$ .
- (c)  $A$  und  $B$  seien disjunkte Ereignisse mit  $P(A) = 0,3$  und  $P(B) = 0,4$ . Berechnen Sie  $P(\overline{A \cup B})$ ,  $P(\bar{A} \cup \bar{B})$  und  $P(\bar{A} \cap B)$ .

$$(a) \quad P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A \cap B) = 0,7 \quad (I)$$

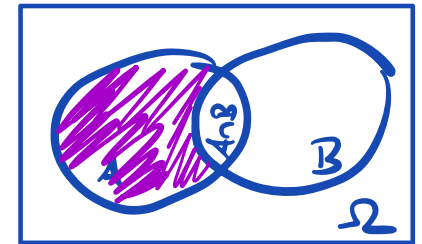
$$P(A \setminus B) = P(A) - P(A \cap B) = 0,4 \quad (II)$$

$$P(\bar{A} \cap B) = P(B \setminus A) = P(B) - P(A \cap B) = 0,1 \quad (III)$$

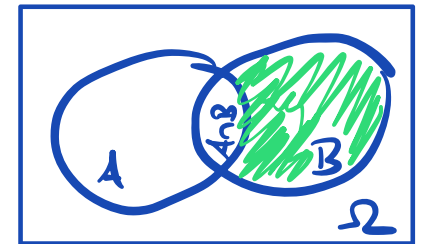
$$(I) - (II) : \underline{\underline{P(B) = 0,3}}$$

$$(I) - (III) : \underline{\underline{P(A) = 0,6}}$$

$$P(A) = 0,6 \text{ in (II): } 0,6 - P(A \cap B) = 0,4 \Rightarrow P(A \cap B) = \underline{\underline{0,2}}$$



$P(A \setminus B)$



$P(\bar{A} \cap B) = P(B \setminus A)$



$$(b)(I) \quad 0,2 = P(A \cap B)$$

$$(II) \quad 0,2 = P(\bar{A} \cap B) = P(B) - P(A \cap B)$$

$$(III) \quad 0,3 = P(A \setminus B) = P(A) - P(A \cap B)$$

---

$$(I) \text{ in } (II): \quad 0,2 = P(B) - 0,2 \Rightarrow P(B) = 0,4 \Rightarrow P(B) = \underline{\underline{0,6}}$$

$$(I) \text{ in } (III): \quad 0,3 = P(A) - 0,2 \Rightarrow P(A) = \underline{\underline{0,5}}$$

$$P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A \cap B) = 0,5 + 0,6 - 0,2 = \underline{\underline{0,9}}$$

$$(c) \quad P(A \cap B) = P(\emptyset) = 0$$

$$P(\overline{A \cup B}) = 1 - P(A \cup B) = 1 - (P(A) + P(B) - P(A \cap B)) = 1 - (0,3 + 0,4 - 0) = \underline{\underline{0,3}}$$

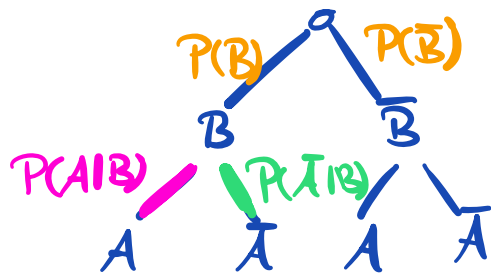
$$P(\overline{A \cap B}) = P(\overline{A \cap B}) = 1 - P(A \cap B) = \underline{\underline{1}}$$

*Regel von de Morgan*

$$P(\bar{A} \cap B) = P(B) - P(A \cap B) = 0,4 - 0 = \underline{\underline{0,4}}$$

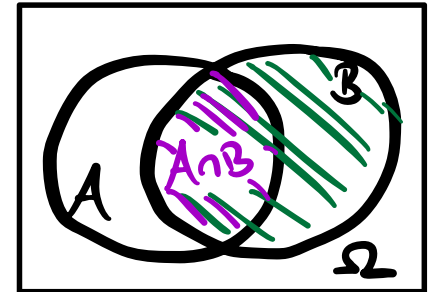
# Bedingte Wahrscheinlichkeiten

Seien  $A, B \subseteq \Omega$  Ereignisse. Die Wahrscheinlichkeit von  $A$  unter der Bedingung  $B$  ist definiert durch



$$P(A|B) := \frac{P(A \cap B)}{P(B)}$$

$$\begin{aligned} P(A \cap B) &= P(A|B) \cdot P(B) \\ &= P(B|A) \cdot P(A) \end{aligned}$$



**Aufgabe:** Ein Automobilhersteller möchte ein neues Automobil auf den Markt bringen und schätzt den Markterfolg auf 54% ein. Er möchte das Modell daher zunächst auf einem Testmarkt einführen, da er weiß, dass später erfolgreiche Automodelle zu 73% auf dem Testmarkt Erfolg hatten. Allerdings waren auch 35% der Flops zuvor im Testmarkt erfolgreich. Wie groß ist die Wahrscheinlichkeit, dass das neue Automodell im Testmarkt Erfolg und auf dem eigentlichen Markt kein Erfolg hat?

$A = \{ \text{Erfolg auf Testmarkt} \}$

$B = \{ \text{Erfolg auf realem Markt} \}$

$$P(B) = 0,54 \Leftrightarrow P(\bar{B}) = 0,46$$

$$P(A|B) = 0,73$$

$$P(A|\bar{B}) = 0,35$$

ges.:  $P(A \cap \bar{B}) = P(A|\bar{B}) \cdot P(\bar{B}) = 0,35 \cdot 0,46 = \underline{0,161}$

Def. Bedingte Wkk.

$$P(A|B) = \frac{P(A \cap B)}{P(B)} \quad | \cdot P(B)$$

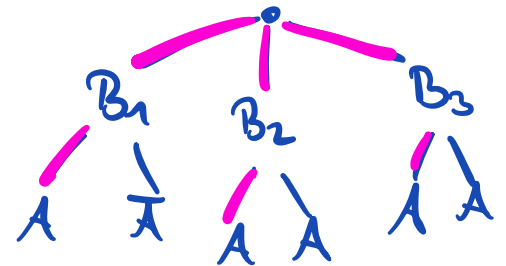
$$\Leftrightarrow P(A|B) \cdot P(B) = P(A \cap B)$$

## Satz der Totalen Wahrscheinlichkeit

Sei  $A \subseteq \Omega$  und die Folge  $(B_i)$  eine Zerlegung von  $\Omega$ , d. h.

$\Omega = \bigcup_{i \in J} B_i$  mit  $B_i \cap B_j = \emptyset$  für  $i \neq j$  und  $P(B_i) > 0$ . Dann gilt:

$$P(A) = \sum_{i \in J} P(A|B_i) \cdot P(B_i)$$



# Satz von Bayes ( $\hat{=}$ Ereignisreihenfolge umdrehen)

Seien  $A, B \subseteq \Omega$  mit  $P(A) > 0$  und  $P(B) > 0$ . Es gilt:

$$P(A \cap B) = \boxed{P(A|B) \cdot P(B) = P(B|A) \cdot P(A)} = P(A \cap B)$$



Beweis:

$$P(A|B) = \frac{P(A \cap B)}{P(B)} \Rightarrow P(A \cap B) = P(A|B) \cdot P(B)$$
$$P(B|A) = \frac{P(A \cap B)}{P(A)} \Rightarrow P(A \cap B) = P(B|A) \cdot P(A)$$

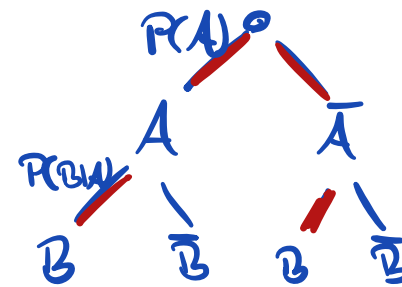
||

**Aufgabe:** Bewerber an einer Hochschule müssen eine Aufnahmeprüfung absolvieren, um aufgenommen zu werden. Es ist bekannt, dass von den fähigen Bewerbern 80% die Prüfung bestehen von den unfähigen 25%. Es bewerben sich 40% fähige Kandidaten.

- (a) Wieviele Prozent aller Bewerber werden aufgenommen?  
 (b) Wie groß ist der Anteil der fähigen Studenten unter den Aufgenommenen?

$A = \{ \text{Bewerber ist fähig} \}$

$B = \{ \text{Bewerber besteht Prüfung} \}$



$$P(B|A) = 0,8$$

$$P(B|\bar{A}) = 0,25$$

$$P(A) = 0,4$$

$$(a) P(B) = \underbrace{P(B|A)}_{0,8} \cdot \underbrace{P(A)}_{0,4} + \underbrace{P(B|\bar{A})}_{0,25} \cdot \underbrace{P(\bar{A})}_{1-0,4} = 0,32 + 0,15 = \underline{\underline{0,47}}$$

$$(b) (P(A|B) \cdot P(B) = P(B|A) \cdot P(A) \Rightarrow) P(A|B) = \frac{\overbrace{P(B|A)}^{0,8} \cdot \overbrace{P(A)}^{0,4}}{\underbrace{P(B)}_{0,47}} = \underline{\underline{0,68}}$$

**Aufgabe:** Von 100 Menschen leiden im Mittel 9 Personen an der Stoffwechselkrankheit Diabetes Typ 2. Jede vierte Person ist Raucher. In einer Studie wurde nun festgestellt, dass im Mittel 18 von 125 Rauchern an Typ-2-Diabetes leiden.

- (a) Verwenden Sie den Satz der totalen Wahrscheinlichkeit, um zu zeigen, dass die Wahrscheinlichkeit, an Typ-2-Diabetes zu erkranken, für Raucher **doppelt** so groß ist wie für Nichtraucher.
- (b) Zeigen Sie, dass 40% der Typ-2-Diabetiker Raucher sind.

$$\begin{aligned}
 A &= \{ \text{Person hat Diabetes} \} & | & \text{(b) z.z.: } P(B|A) = 0,4 \\
 B &= \{ \text{Person raucht} \} & | & (P(B|A) \cdot P(A) = P(A|B) \cdot P(B)) \\
 & & & P(B|A) = \frac{\overset{18}{\underset{125}{P(A|B)}} \cdot \overset{0,25}{P(B)}}{\underset{0,09}{P(A)}} = \underline{\underline{0,4}}
 \end{aligned}$$

← gesucht

$$P(A) = 0,09$$

$$P(B) = 0,25$$

$$P(A|B) = \frac{18}{125}$$

$$(a) \text{ z.z.: } P(A|B) = 2 \cdot \boxed{P(A|\bar{B})}$$

$$\underbrace{P(A)}_{0,09} = \underbrace{P(A|B)}_{\frac{18}{125}} \cdot \underbrace{P(B)}_{0,25} + \underbrace{P(A|\bar{B})}_{?} \cdot \underbrace{P(\bar{B})}_{1-0,25}$$

$$0,09 = \frac{9}{250} + P(A|\bar{B}) \cdot 0,75 \Rightarrow P(A|\bar{B}) = \frac{0,09 - \frac{9}{250}}{0,75} = \underline{\underline{\frac{9}{125}}}$$

## Unabhängigkeit von Ereignissen

Seien  $A, B \subseteq \Omega$  Ereignisse.  $A$  und  $B$  sind genau dann unabhängig, falls:

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

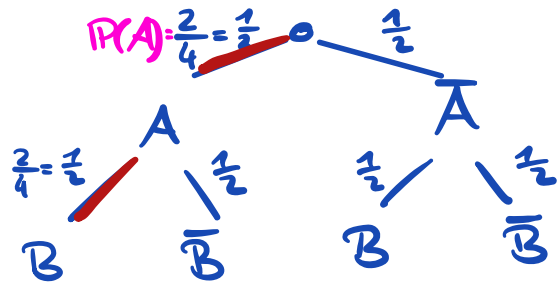
Anmerkung: Ist die Gleichung nicht erfüllt, sind  $A$  und  $B$  abhängig.

$$A, B \text{ unabh.} \Leftrightarrow \bar{A}, B \text{ unabh.} \Leftrightarrow A, \bar{B} \text{ unabh.} \Leftrightarrow \bar{A}, \bar{B} \text{ unabh.}$$



**Aufgabe:** Betrachtet wird das zweimalige Ziehen (mit/ohne Zurücklegen) aus einer Urne mit vier Kugeln, davon zwei schwarz und zwei rot. Sind die Ereignisse  $A = \{\text{Die erste Kugel ist schwarz}\}$  und  $B = \{\text{Die zweite Kugel ist rot}\}$  stochastisch unabhängig?

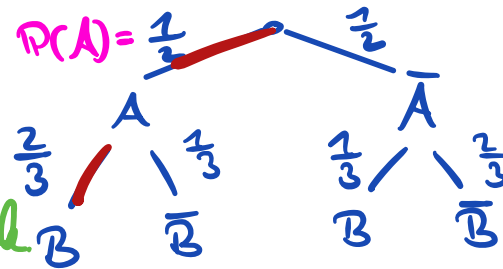
mit Zurücklegen



ohne Zurücklegen

⊗ *Auswahl Wähl.*

⊗ *bedingte Wähl.*



$$P(A) = \frac{1}{2}$$

$$\otimes P(B) = \underbrace{P(B|A)}_{\frac{2}{3}} \cdot \underbrace{P(A)}_{\frac{1}{2}} + \underbrace{P(B|\bar{A})}_{\frac{1}{3}} \cdot \underbrace{P(\bar{A})}_{\frac{1}{2}} = \frac{1}{2}$$

$$\otimes P(A \cap B) = \underbrace{P(B|A)}_{\frac{2}{3}} \cdot \underbrace{P(A)}_{\frac{1}{2}} = \frac{1}{3}$$

$$P(A) = \frac{1}{2}$$

$$\otimes P(B) = \underbrace{P(B|A)}_{\frac{1}{2}} \cdot \underbrace{P(A)}_{\frac{1}{2}} + \underbrace{P(B|\bar{A})}_{\frac{1}{2}} \cdot \underbrace{P(\bar{A})}_{\frac{1}{2}} = \frac{1}{2}$$

$$\otimes P(A \cap B) = \underbrace{P(B|A)}_{\frac{1}{2}} \cdot \underbrace{P(A)}_{\frac{1}{2}} = \frac{1}{4}$$

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

$$\Rightarrow A, B \text{ unabh.}$$

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

$$\Rightarrow A, B \text{ abhängig}$$

**Aufgabe:** Drei Jäger mit den Trefferquoten 0.3, bzw. 0.4 bzw. 0.5 schießen gleichzeitig und unabhängig voneinander auf ein Wildschwein, welches von genau einer Kugel getroffen zu Boden geht. Wie ist die Beute „gerecht“ aufzuteilen, wenn bei der anschließenden Untersuchung nicht festzustellen ist, von welchem der Schützen das Schwein erlegt wurde?

$$A = \{\text{Genau 1 Treffer}\}$$

$$P(B_1) = 0,3$$

$$B_i = \{\text{Jäger } i \text{ trifft}\}$$

$$P(B_2) = 0,4$$

$$P(B_3) = 0,5$$

$$\text{ges.: } P(B_i | A) = \frac{P(B_i \cap A)}{P(A)}$$

$$= \frac{P(B_i \cap \bar{B}_j \cap \bar{B}_k)}{P(B_i \cap \bar{B}_j \cap \bar{B}_k) + P(\bar{B}_i \cap B_j \cap \bar{B}_k) + P(\bar{B}_i \cap \bar{B}_j \cap B_k)}, \quad i \neq j \neq k \neq i$$

unabh.

$$= \frac{P(B_i) \cdot P(\bar{B}_j) \cdot P(\bar{B}_k)}{P(B_i) \cdot P(\bar{B}_j) \cdot P(\bar{B}_k) + P(\bar{B}_i) \cdot P(B_j) \cdot P(\bar{B}_k) + P(\bar{B}_i) \cdot P(\bar{B}_j) \cdot P(B_k)}$$

$$P(B_1|A) = \frac{0,3 \cdot 0,6 \cdot 0,5}{0,3 \cdot 0,6 \cdot 0,5 + 0,7 \cdot 0,4 \cdot 0,5 + 0,7 \cdot 0,6 \cdot 0,5} = \frac{9}{44} (\approx 20\%)$$

$$P(B_2|A) = \frac{0,7 \cdot 0,4 \cdot 0,5}{0,3 \cdot 0,6 \cdot 0,5 + 0,7 \cdot 0,4 \cdot 0,5 + 0,7 \cdot 0,6 \cdot 0,5} = \frac{7}{22} (\approx 32\%)$$

$$P(B_3|A) = \frac{0,7 \cdot 0,6 \cdot 0,5}{0,3 \cdot 0,6 \cdot 0,5 + 0,7 \cdot 0,4 \cdot 0,5 + 0,7 \cdot 0,6 \cdot 0,5} = \frac{21}{44} (\approx 48\%)$$