

# Wahrscheinlichkeit und Statistik

Janis Hutz

<https://janishutz.com>

18. März 2026

## 1 Basics

### 1.1 Wahrscheinlichkeitsräume

**Begriff**  $\Omega$  Grundraum,  $\omega \in \Omega$  Elementarereignis

**D 1.1** (Sigma-Algebra)  $\mathcal{F} \subseteq \mathcal{P}(\Omega)$  ist  $\sigma$ -Algebra, falls:

- E1.  $\Omega \in \mathcal{F}$
- E2.  $A \in \mathcal{F} \Rightarrow A^C \in \mathcal{F}$  ( $A$  Ereignis  $\Rightarrow$  nicht  $A$  auch)
- E3.  $A_1, A_2, \dots \in \mathcal{F} \Rightarrow \bigcup_{i=1}^{\infty} A_i \in \mathcal{F}$   
( $A_1, \dots$  Ereignisse  $\Rightarrow A_1$  oder  $A_2$  oder  $\dots$  ein Ereignis)

**Bsp**  $\sigma$ -Algebren bei 1x Würfeln ( $\Omega = \{1, 2, 3, 4, 5, 6\}$ )

- $\mathcal{F} = \{\emptyset, \{1, 2, 3, 4, 5, 6\}\}$
- $\mathcal{F} = \mathcal{P}(\Omega)$ , dabei  $|\mathcal{F}| = 64$
- $\mathcal{F} = \{\emptyset, \{1, 2\}, \{3, 4, 5, 6\}, \Omega\}$

Keine  $\sigma$ -Algebren sind bspw:

- $\mathcal{F} = \{\Omega\}$  (Komplementärereignis  $\emptyset$  fehlt, E2 verletzt)
- $\mathcal{F} = \{\emptyset, \{1, 2, 3\}, \{4, 5, 6\}, \{1\}, \{2, 3, 4, 5, 6\}, \Omega\}$   
(E3 verletzt, da bspw  $\{4, 5, 6\} \cup \{1\} \notin \mathcal{F}$ )

#### 1.1.1 Wahrscheinlichkeitsmass

**D 1.2** (W.M)  $\mathbb{P}: \mathcal{F} \rightarrow [0, 1]$  mit  $A \mapsto \mathbb{P}[A]$ , notiert  $(\Omega, \mathcal{F})$ , falls folgende Eigenschaften gelten

- E1.  $\mathbb{P}[\Omega] = 1$
- E2. ( $\sigma$ -Additivität)  $\mathbb{P}[A] = \sum_{i=1}^{\infty} \mathbb{P}[A_i]$ , falls  $A = \bigcup_{i=1}^{\infty} A_i$  (disjunkte Vereinigung)

**Bsp** Wieder mit Würfeln und  $\mathcal{F} = \mathcal{P}(\Omega)$ , sind W.M:

- Abbildung  $\forall A \in \mathcal{F} \quad \mathbb{P}[A] = \frac{|A|}{6}$
- Abbildung  $\forall A \in \mathcal{F} \quad \mathbb{P}[A] = \sum_{i \in A} p_i$  ( $p_i$  dabei prob. Zahl  $i$  würfeln;  $p_i = \frac{1}{6} \forall i \in \Omega$  ist für fairen Würfel)

#### 1.1.2 Wahrscheinlichkeitsraum

**D 1.3** (W.R) ein Tripel  $(\Omega, \mathcal{F}, \mathbb{P})$

**Begriff**  $A$  Ereignis, tritt (nicht) ein (für  $\omega$ ), if  $\omega \in (\notin) A$

**B 1.4**  $A = \emptyset$  tritt niemals ein,  $A = \Omega$  immer.

### 1.2 Beispiele von Wahrscheinlichkeitsräumen

**D 1.5** (Laplace Modell)  $(\Omega, \mathcal{F}, \mathbb{P})$ , sodass  $\mathcal{F} = \mathcal{P}(\Omega)$  und  $\mathbb{P}: \mathcal{F} \rightarrow [0, 1] \stackrel{\text{def}}{=} \forall A \in \mathcal{F} \quad \mathbb{P}[A] = \frac{|A|}{|\Omega|}$ ,  $\mathbb{P}$  ist W.M.

**Bsp** Auf Kreis mit  $n \geq 3$  Punkten, Modell für Nachbarn ist:  $A = \{\{1, 2\}, \dots, \{n-1, n\}, \{n, 1\}\}$  für  $\Omega = \{E \subseteq \{1, \dots, n\} \mid |E| = 2\}$ , also  $\mathbb{P}[A] = \frac{n}{\binom{n}{2}} = \frac{2}{n-1}$

**Bsp** W. 1. mal Kopf ist bei Wurf  $k$ :  $p_k = p^{k-1}(1-p)$

### 1.3 Eigenschaften/Interp. von Ereignissen

**T 1.6**  $\mathcal{F}$   $\sigma$ -Algebra. Es gilt: E4.  $\emptyset \in \mathcal{F}$

E5.  $A_1, A_2, \dots \in \mathcal{F} \Rightarrow \bigcap_{i=1}^{\infty} A_i \in \mathcal{F}$

E6.  $A, B \in \mathcal{F} \Rightarrow A \cup B \in \mathcal{F}$

E7.  $A, B \in \mathcal{F} \Rightarrow A \cap B \in \mathcal{F}$

$A^C$	$A$ tritt <b>nicht</b> ein
$A \cap B$	$A$ <b>und</b> $B$ treten ein
$A \cup B$	$A$ <b>oder</b> $B$ treten ein
$A \Delta B$	entweder $A$ <b>oder</b> $B$ tritt ein
$A \subseteq B$	$B$ tritt ein, falls $A$ eintritt
$A \cap B = \emptyset$	$A$ und $B$ nicht gleichzeitig

$\Omega = A_1 \cup A_2 \cup A_3$  mit  $\forall \omega \in \Omega$   
 $A_1, A_2, A_3$  paarw. disj. nur eines von  $A_1, A_2, A_3$  kann eintreten

Wir wählen nicht immer  $\mathcal{F} = \mathcal{P}(\Omega)$ , bspw. für mehrstufige Experimente ist dies nicht ideal (k. Filtern, Überabzählbarkeit)

### 1.4 Eigenschaften Wahrscheinlichkeitsmasse

**T 1.7**  $\mathbb{P}$  Wahrscheinlichkeitsmass auf  $(\Omega, \mathcal{F})$ ,  $A$  Ereignis:

- E1. Es gilt  $\mathbb{P}[\emptyset] = 0$
- E2. **Additivität**  $k \geq 1$ ,  $A_1, \dots, A_k$  paarw. disj. Ereignisse:  
 $\mathbb{P}[A_1 \cup \dots \cup A_k] = \mathbb{P}[A_1] + \dots + \mathbb{P}[A_k]$
- E3.  $\mathbb{P}[A^C] = 1 - \mathbb{P}[A]$
- E4.  $B$  Ereignis, dann  $\mathbb{P}[A \cup B] = \mathbb{P}[A] + \mathbb{P}[B] - \mathbb{P}[A \cap B]$

#### 1.4.1 Nützliche Ungleichungen

**T 1.8** (Monot.)  $A, B \in \mathcal{F}$ , dann  $A \subseteq B \Rightarrow \mathbb{P}[A] \leq \mathbb{P}[B]$

**T 1.9** (Union Bound) Für  $A_1, A_2, \dots$  (mögl. disj.) gilt:  
 $\mathbb{P}[\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i] \leq \sum_{i=1}^{\infty} \mathbb{P}[A_i]$ . Auch für endl. n.-leere Ereignisse

### 1.4.2 Anwendungen der Ungleichungen

Sie sind nützlich für schwer zu berechnende W.

**T 1.11**  $(A_n)$  mit  $A_n \subseteq A_{n+1}$  (mon. wachsend). Dann:  
 $\lim_{n \rightarrow \infty} \mathbb{P}[A_n] = \mathbb{P}[\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n]$

und für  $(B_n)$  mit  $B_n \supseteq B_{n+1}$  (mon. fallend) gilt:  
 $\lim_{n \rightarrow \infty} \mathbb{P}[B_n] = \mathbb{P}[\bigcap_{n=1}^{\infty} B_n]$

**B 1.12** Mit Monotonie:  $\mathbb{P}[A_n] \leq \mathbb{P}[A_{n+1}]$  und  $\mathbb{P}[B_n] \geq \mathbb{P}[B_{n+1}]$ . Grenzwerte oben wohldefiniert.

### 1.5 Bedingte Wahrscheinlichkeit

**D 1.13** Für  $(\Omega, \mathcal{F}, \mathbb{P})$  mit  $A, B \in \mathcal{P}(\Omega)$  mit  $\mathbb{P}[B] > 0$ :

$$\mathbb{P}[A|B] = \frac{\mathbb{P}[A \cap B]}{\mathbb{P}[B]} \quad (= \mathbb{P}[A] \text{ wenn } B \text{ eingetreten ist})$$

**B 1.14**  $\mathbb{P}[B|B] = 1$

**T 1.15**  $B \in \mathcal{P}(\Omega)$ , dann ist  $\mathbb{P}[\cdot|B]$  ein W-Mass auf  $\Omega$

**T 1.16** (Totale W.)  $\Omega = B_1 \cup \dots \cup B_n$  mit  $B_i$ s eine Partition von  $\Omega$ , mit  $B_i$  paarw. disj. und  $\mathbb{P}[B_i] > 0 \forall 1 \leq i \leq n$ . Dann:

$$\forall A \in \mathcal{F} \quad \mathbb{P}[A] = \sum_{i=1}^n \mathbb{P}[A|B_i] \cdot \mathbb{P}[B_i]$$

**T 1.17** (Bayes)  $B_i$  wie oben, dann  $\forall A$  mit  $\mathbb{P}[A] > 0$ :

$$\forall i = 1, \dots, n \quad \mathbb{P}[B_i|A] = \frac{\mathbb{P}[A|B_i] \mathbb{P}[B_i]}{\sum_{j=1}^n \mathbb{P}[A|B_j] \mathbb{P}[B_j]}$$

### 1.6 Unabhängigkeit

**D 1.18**  $A, B \in \mathcal{F}$  **unabh.** falls  $\mathbb{P}[A \cap B] = \mathbb{P}[A] \cdot \mathbb{P}[B]$

**B 1.19** Falls  $\mathbb{P}[A] \in \{0, 1\}$ :  $\forall B \in \mathcal{F} \quad \mathbb{P}[A \cap B] = \mathbb{P}[A] \mathbb{P}[B]$ . Falls  $A$  unabh. von sich selbst ( $\mathbb{P}[A \cap A] = \mathbb{P}[A]^2$ ), dann  $\mathbb{P}[A] \in \{0, 1\}$ . **Implik.:**  $A$  unabh. v.  $B \Leftrightarrow A$  unabh. v.  $B^C$

**T 1.20** Sei  $\mathbb{P}[A], \mathbb{P}[B] > 0$ . Dann ist equivalent:

- (i)  $\mathbb{P}[A \cap B] = \mathbb{P}[A] \cdot \mathbb{P}[B]$  ( $A$  und  $B$  unabhängig)
- (ii)  $\mathbb{P}[A|B] = \mathbb{P}[A]$  (Eintreten von  $B$  beeinflusst  $A$  nicht)
- (iii)  $\mathbb{P}[B|A] = \mathbb{P}[B]$  (Eintreten von  $A$  beeinflusst  $B$  nicht)

**D 1.21**  $I$  eine beliebige Menge.  $(A_i)_{i \in I}$  **unabhängig** falls:

$$\forall j \subseteq I \text{ endlich} \quad \mathbb{P}\left[\bigcap_{j \in J} A_j\right] = \prod_{j \in J} \mathbb{P}[A_j]$$

## 2 Zufallsvar., Verteilungsfunktionen

### 2.1 Abstrakte Definition

**D 2.1** (Zufallsvariable) kurz Z.V, ist  $\mathcal{X} : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ , sodass  $\forall a \in \mathbb{R}$  gilt:  $f = \{\omega \in \Omega \mid \mathcal{X}(\omega) \leq a\} \in \mathcal{F}$  (notwendige Bedingung für Wohldefiniertheit von  $\mathbb{P}[f]$ )

**Notation** Ohne  $\omega$ :  $\{X \leq a\} = \{\omega \in \Omega \mid X(\omega) \leq a\}$ , etc

### 2.2 Verteilungsfunktion

**D 2.2**  $F_{\mathcal{X}} : \mathbb{R} \rightarrow [0, 1]$ , def:  $\forall a \in \mathbb{R} \quad F_{\mathcal{X}}(a) = \mathbb{P}[\mathcal{X} \leq a]$

**T 2.3**  $a < b \in \mathbb{R}$ . Dann:  $\mathbb{P}[a < X \leq b] = F(b) - F(a)$

**T 2.4**  $\mathcal{X}$  Z.V. auf  $(\Omega, \mathcal{F}, \mathbb{P})$  und V.F.  $F = F_{\mathcal{X}}$ . Eig.:

- $F$  ist monoton wachsend
- $F$  ist rechtsseitig ( $F(a) = \lim_{h \downarrow 0} F(a+h) \forall a \in \mathbb{R}$ )
- $\lim_{a \rightarrow -\infty} F(a) = 0$  und  $\lim_{a \rightarrow \infty} F(a) = 1$

### 2.3 Unabhängigkeit

**D 2.5** Z.V.  $\mathcal{X}_1, \dots, \mathcal{X}_n$  sind **unabh.** falls  $\forall x_1, \dots, x_n \in \mathbb{R}$   
 $\mathbb{P}[\mathcal{X}_1 \leq x_1, \dots, \mathcal{X}_n \leq x_n] = \mathbb{P}[\mathcal{X}_1 \leq x_1] \cdots \mathbb{P}[\mathcal{X}_n \leq x_n]$

**B 2.6** Alternativ: ZVs unabhängig, falls  $\forall I_1 \subseteq \mathbb{R}, \dots, I_n \subseteq \mathbb{R}$  Intervalle  $\{\mathcal{X}_1 \in I_1\}, \dots, \{\mathcal{X}_n \in I_n\}$  unabhängig

#### 2.3.1 Gruppierung

**T 2.7**  $n$  ZV  $\mathcal{X}_i$  und  $1 \leq i_1 < \dots < i_k \leq n$  sind indizes und  $\phi_1, \dots, \phi_k$  Abbildungen. Dann sind unabhängig:  
 $Y_1 = \phi_1(\mathcal{X}_{i_1}, \dots, \mathcal{X}_{i_1}), \dots, Y_k = \phi_k(\mathcal{X}_{i_{k-1}+1}, \dots, \mathcal{X}_{i_k})$

#### 2.3.2 Unabhängig identisch verteilte ZV

**D 2.8** Eine Folge von ZV ist **(1)** unabh. falls  $X_i$  unabh. sind und **(2)** uiv, falls unabh. und die ZV dieselbe Verteilungsf. haben, also:  $\forall i, j \quad F_{\mathcal{X}_i} = F_{\mathcal{X}_j}$

### 2.4 Transformation von Zufallsvariablen

Da ZV Funk.  $\Omega \rightarrow \mathbb{R}$  sind, mit komposition neue ZV aus and. ZV, bspw:  $Z_1 = \exp(\mathcal{X}_1)$  oder  $Z_2 = \mathcal{X}_1 + \mathcal{X}_2$

### 2.5 Konstruktion von Zufallsvariablen

**D 2.9** (Bernoulli ZV) mit param.  $p \in [0, 1]$  falls  $\mathbb{P}[\mathcal{X} = 0] = 1 - p$  und  $\mathbb{P}[\mathcal{X} = 1] = p$ . Not.:  $\mathcal{X} \sim \text{Ber}(p)$

**T 2.10** ( $\exists$ -T v. Kolmogorov)  $\exists$  W-Raum und n. endl. uiv Folge von  $\mathcal{X}_i \sim \text{Ber}(\frac{1}{2})$

**D 2.11** ZV  $U$  heisst **gleichverteilt auf**  $[0, 1]$ , falls

$$F_U(x) = \begin{cases} 0 & x < 0 \\ x & 0 \leq x \leq 1. \text{ Wir schreiben } U \sim \mathcal{U}([0, 1]) \\ 1 & x > 1 \end{cases}$$

**T 2.12**  $\mathcal{X}_i$  wie oben, da  $\mathcal{X}_i(\omega) \in \{0, 1\}$  konvergiert  $\mathcal{Y}(\omega) = \sum_{n=1}^{\infty} 2^{-n} \mathcal{X}_n(\omega)$  absolut, mit  $\mathcal{Y}(\omega) \in [0, 1]$ .  $\mathcal{Y} \sim \mathcal{U}([0, 1])$

**D 2.13** (Pseudoinverse) von  $F$  ist  $F^{-1} : (0, 1) \rightarrow \mathbb{R}$ . Def:  $\forall \alpha \in (0, 1) \quad F^{-1}(\alpha) = \inf\{x \in \mathbb{R} \mid F(x) \geq \alpha\}$

**T 2.14** (Inversionsmethode)  $F$  erfüllt eig. v. T2.4,  $U \sim \mathcal{U}(\dots)$ , dann hat ZV  $X = F^{-1}(U)$  die Verteilungsf.  $F_X = F$

**B 2.15**  $X$  wohldefiniert mit  $X(\omega) = F^{-1}(U(\omega))$  falls  $U(\omega) \in (0, 1)$  und  $X(\omega) = 0$  sonst.

**T 2.16**  $F_1, \dots$  Folge von Funk. mit eig. v. T2.4. Dann  $\exists$  W-Raum und Folge von unabhängigen ZV  $X_i$ , sodass:

- $\forall i \quad X_i$  has  $F_i$  (also  $\forall x \quad \mathbb{P}[X_i \leq x] = F_i(x)$ )
- $X_1, X_2, \dots$  sind unabhängig.

## 3 Diskrete und stetige ZV

### 3.1 Stetigkeit der Verteilungsfunktion

**T 3.1** (W. Punkt) Für Z.V  $\mathcal{X}$  und V.F  $F_{\mathcal{X}}$  gilt  $\forall a \in \mathbb{R}$   
 $\mathbb{P}[\mathcal{X} = a] = F(a) - F(a-)$  mit  $F(a-) := \lim_{h \downarrow 0} F(a-h)$ .

$\rightarrow F$  in  $a$  n. stetig, dann "Sprunghöhe"

$$F(a) - F(a-) = \mathbb{P}[\mathcal{X} = a]$$

$\rightarrow F$  stetig in  $a$ , dann  $\mathbb{P}[\mathcal{X} = a] = 0$

### 3.2 Fast sichere Ereignisse

**D 3.2**  $A \in \mathcal{F}$  tritt **fast sicher** (f.s.) ein, falls  $\mathbb{P}[A] = 1$ .

**B 3.3** Für allg. Mengen:  $A$  f.s., falls  $\exists A' \subseteq A \mid \mathbb{P}[A'] = 1$

### 3.3 Diskrete Zufallsvariablen

**D 3.4** Z.V.  $\mathcal{X}$  ist **diskret**, falls endl. oder abzählb. Menge  $W \subseteq \mathbb{R}$  existiert, s.d.  $\mathbb{P}[\mathcal{X} \in W] = 1$  (Werte v.  $\mathcal{X}$  f.s. in  $W$ )

**B 3.5** Falls der Grundraum  $\Omega$  endlich oder abzählbar ist, dann ist jede Z.V.  $\mathcal{X}$  diskret.

**D 3.6** (Verteilung) Für Z.V.  $\mathcal{X}$  mit  $W$  endl. oder abzählb.  $(p(x))_{x \in W} \stackrel{\text{def}}{\iff} \forall x \in W \quad p(x) := \mathbb{P}[\mathcal{X} = x]$

**T 3.7**  $(p(x))_{x \in W} = \sum_{x \in W} p(x) = 1$

**B 3.8**  $\forall (p(x))_{x \in W} \exists$  eine Z.V. mit dieser Verteilung. Können desh. schreiben: "Sei  $\mathcal{X}$  disk. Z.V. mit Verteilung  $(p(x))_{x \in W}$ "

#### 3.3.1 Zusammenhang Verteilung, Verteilungsfunktion

**T 3.9**  $\mathcal{X}$  disk. Z.V. wie oben, dann ist Verteilungsfunktion:  $\forall x \in \mathbb{R} \quad F_{\mathcal{X}}(x) = \sum_{y \in W, y \leq x} p(y)$ . **Umgekehrt:**  $p(x)$  ist die "Sprunghöhe" im Punkt  $x \in W$ ,  $W$  pos. Sprünge in  $F_{\mathcal{X}}$

## 3.4 Verteilungen

### 3.4.1 Bernoulli-Verteilung

**D 3.10**  $\mathcal{X} \sim \text{Ber}(p)$ :  $\mathbb{P}[\mathcal{X} = 0] = 1 - p$  und  $\mathbb{P}[\mathcal{X} = 1] = p$

### 3.4.2 Binomialverteilung

**D 3.11**  $\mathcal{X} \sim \text{Bin}(n, p)$ , falls  $\forall k \in \{0, \dots, n\} \quad \mathbb{P}[\mathcal{X} = k] = \binom{n}{k} p^k (1-p)^{n-k}$

**B 3.12**  $\sum_{k=0}^n p(k) = \sum_{k=0}^n \mathbb{P}[\mathcal{X} = k] = (p + 1 - p)^n = 1$

**T 3.13**  $X_i \sim \text{Ber}(p_i)$  unabh:  $(S_n := \sum_{i=0}^n X_i) \sim \text{Ber}(n, p)$

**B 3.14**  $\text{Bin}(1, p)$  ist  $\text{Ber}(p)$  verteilt. Für  $X, Y \sim \text{Bin}(n_i, p)$  mit  $X, Y$  unabhängig dann ist  $X + Y \sim \text{Bin}(n_1 + n_2, p)$

### 3.4.3 Geometrische Verteilung

Warten auf den ersten Erfolg (in  $\infty$  Folge von Bernoulli-Experimenten)

**D 3.15**  $\mathcal{X} \sim \text{Geom}(p)$  mit  $W = \mathbb{N} \setminus \{0\}$  falls  $\forall k \in W \quad \mathbb{P}[\mathcal{X} = k] = (1-p)^{k-1} \cdot p$

**B 3.16**  $\mathbb{P}[\mathcal{X} = 1] = p$ , da wir Konvention  $a^0 = 1$  verwenden.

**B 3.17**  $\sum_{k=0}^{\infty} p(k) = p \cdot \sum_{k=0}^{\infty} (1-p)^{k-1} = p \cdot \frac{1}{p} = 1$

**T 3.18**  $X_i \sim \text{Ber}(p)$  für  $i \in \mathbb{N}$ .

Dann  $(T := \min\{n \geq 1 \mid X_n = 1\}) \sim \text{Geom}(p)$

**B 3.19**  $T = \infty$  ist möglich,  $\mathbb{P}[T = \infty] = 0$

**T 3.20**  $T \sim \text{Geom}(p)$ , dann

$\forall n \geq 0 \quad \forall k \geq 1 \quad \mathbb{P}[T \geq n+k \mid T > n] = \mathbb{P}[T \geq k]$

### 3.4.4 Negativbinomiale Verteilung

Warten auf den  $r$ -ten Erfolg (in  $\infty$  Folge von Bernoulli-Experimenten)

**D 3.21**  $\mathcal{X} \sim \text{NBin}(r, p)$ , falls

$\forall k \in \{r, r+1, \dots\} \quad \mathbb{P}[\mathcal{X} = k] = \binom{k-1}{r-1} p^r (1-p)^{k-r}$

**T 3.22**  $\mathcal{X}_i \sim \text{Ber}(p)$ , dann

$T_r := \inf\{n \geq 1 \mid \sum_{i=1}^n \mathcal{X}_i = r\} \sim \text{NBin}(r, p)$

**B 3.23**  $\mathcal{X} := \sum_{i=1}^r \mathcal{X}_i \sim \text{NBin}(r, p)$  für  $\mathcal{X}_i \sim \text{Geom}(p)$

### 3.4.5 Hypergeometrische Verteilung

$r$  Elemente vom Typ I,  $n-r$  El. vom Typ II,  $m$  davon gezogen, ohne Zurücklegen

**D 3.24**  $\mathcal{X} \sim \text{H}(n, r, m)$ , falls

$\forall k \in \{0, \dots, \min(m, r)\} \quad \mathbb{P}[\mathcal{X} = k] = \frac{\binom{r}{k} \binom{n-r}{m-k}}{\binom{n}{m}}$

### 3.4.6 Poisson-Verteilung

**D 3.25**  $\mathcal{X} \sim \text{Poisson}(\lambda)$  mit  $\lambda > 0 \in \mathbb{R}$ , falls

$\forall k \in \mathbb{N} \quad \mathbb{P}[\mathcal{X} = k] = \frac{\lambda^k}{k!} e^{-\lambda}$

**T 3.26** Für  $n \in \mathbb{N}$  Z.V.  $\mathcal{X}_i \sim \text{Bin}(n, \frac{\lambda}{n})$  und  $\mathcal{N} \sim \text{Poisson}(\lambda)$ :

$\forall k \in \mathbb{N} \quad \lim_{n \rightarrow \infty} \mathbb{P}[\mathcal{X}_i = k] = \mathbb{P}[\mathcal{N} = k]$

### 3.5 Stetige Zufallsvariablen

**D 3.27** (Stetig verteilte Z.V)  $\mathcal{X}$  stetig, falls  $\exists f_{\mathcal{X}} : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}_+$ , s.d. V.F.  $F_{\mathcal{X}}(x) = \int_{-\infty}^x f_{\mathcal{X}}(t) dt$ .  $f_{\mathcal{X}}$  ist Dichte (pdf) von  $\mathcal{X}$

**T 3.28** Sei  $F_{\mathcal{X}}$  st. stückw. diff. auf Partition  $-\infty = x_0 < x_1 \dots < x_n = \infty$ . Dann  $\mathcal{X}$  stetig, mit  $a_k$  beliebig und

$$f_{\mathcal{X}} = \begin{cases} F'_{\mathcal{X}}(x) & \exists k \in \{0, 1, \dots, n-1\} \\ a_k & x \in \{x_1, \dots, x_{n-1}\} \end{cases}$$

**B 3.29**  $f_{\mathcal{X}}$  fast analog zu Gew.F  $p_{\mathcal{X}}$ . Also:  $(\Sigma, p_{\mathcal{X}}) \mapsto (f, f_{\mathcal{X}})$  vom diskreten zu stetigen Fall

### 3.6 Stetige Verteilungen

**D 3.30** (Gleichverteilung)  $\mathcal{X} \sim \mathcal{U}([a, b])$ , falls  $f_{\mathcal{X}} = \begin{cases} \frac{1}{b-a} & x \in [a, b] \\ 0 & \text{sonst} \end{cases}$