

Nachkass mit Lag 49 (74b, 75)

Kontinuierliche fassdelmungen

-4-

faktuelles

-4-

stochastische Variablen

Fassdelmungs Funktion $F(x) = P(X \leq x)$

$$F(x) = \begin{cases} \sum_{y \leq x} f(y) & \text{on } X \text{ diskret} \\ \int_{-\infty}^x f(y) dy & \text{on } X \text{ kontinuierlich} \end{cases}$$

$\sum_x H(x) f(x)$ on X diskret

$$E H(X) = \begin{cases} \sum_x H(x) f(x) & \text{on } X \text{ diskret} \\ \int_{-\infty}^{\infty} H(x) f(x) dx & \text{on } X \text{ kontinuierlich} \end{cases}$$

Gaussian (α, β) - Fassdelmungen

$$G_{\alpha, \beta}(x) = \exp(-\lambda x^2) \quad \lambda = 1/\beta$$

(Rechnen: Fassdelmungen $\exp(x)$)

$N(\mu, \sigma)$ - Fassdelmungen

Rule of thumb for N -observations:

low $\mu \pm 2\sigma$ means 95%

If used as check for outliers

Tillfästisgnet

Socio- och parallell skuldluren av
obesondera komponenter

Simulering av kontinuerliga
förändringar

$$x = F^{-1}(u) \text{ där } u \sim \text{Unif}(0,1)$$