



Blatt 10

Aufgabe 10.1

- a) Plotten Sie die zweidimensionalen (verallgemeinerten) Gaussdichten

$$f(x, y) = \frac{1}{2\pi\sigma_x\sigma_y\sqrt{1-\rho^2}} e^{\left\{-\frac{1}{2(1-\rho^2)}\left[\frac{(x-\mu_x)^2}{\sigma_x^2} + \frac{(y-\mu_y)^2}{\sigma_y^2} - 2\rho\frac{(x-\mu_x)(y-\mu_y)}{\sigma_x\sigma_y}\right]\right\}}$$

für die Werte von μ_x , μ_y , σ_x , σ_y und ρ aus der folgenden Tabelle:

| μ_x | μ_y | σ_x | σ_y | ρ |
|---------|---------|------------|---------------|--------|
| 0 | 0 | 1 | 1 | 0 |
| 3 | 0 | 1 | 1 | 0 |
| 0 | -5 | 1 | 1 | 0 |
| 3 | -5 | 1 | 1 | 0 |
| 0 | 0 | 4 | 1 | 0 |
| 0 | 0 | 1 | $\frac{1}{9}$ | 0 |
| 0 | 0 | 4 | $\frac{1}{9}$ | 0 |
| 0 | 0 | 4 | 1 | 0.2 |
| 0 | 0 | 4 | 1 | 0.4 |
| 0 | 0 | 4 | 1 | 0.6 |
| 0 | 0 | 4 | 1 | 0.8 |
| 0 | 0 | 4 | 1 | 1.0 |
| 0 | 0 | 4 | $\frac{1}{9}$ | 0.4 |

Welchen Einfluss haben die einzelnen Parameter jeweils auf die Dichte?

- b) Berechnen Sie die beiden Randdichten $f_X(x)$ und $f_Y(y)$ einer zweidimensionalen Gaussdichte

$$f(x, y) = \frac{1}{2\pi\sigma_x\sigma_y\sqrt{1-\rho^2}} e^{\left\{-\frac{1}{2(1-\rho^2)}\left[\frac{(x-\mu_x)^2}{\sigma_x^2} + \frac{(y-\mu_y)^2}{\sigma_y^2} - 2\rho\frac{(x-\mu_x)(y-\mu_y)}{\sigma_x\sigma_y}\right]\right\}}$$

- c) Berechnen Sie die bedingten Dichten $f_{X|Y}(x|y)$ und $f_{Y|X}(y|x)$ von $f(x, y)$.
- d) Plotten Sie $f_X(x)$ und $f_{X|Y}(x|y)$ für $x \in [-10, 10]$ und $y \in \{-2, 0, 2, 4, 6\}$. Hier und in den folgenden beiden Beispielen sei $\mu_x = \mu_y = 0$, $\sigma_x = 1$, $\sigma_y = 2$ und $\rho = 0.75$.

e) Plotten Sie $f_Y(y)$ und $f_{Y|X}(y|x)$ für $y \in [-10, 10]$ und $x \in \{-2, 0, 2, 4, 6\}$.

f) Plotten Sie $f(x, y)$ für $(x, y) \in [-10, 10] \times [-10, 10]$.

Aufgabe 10.2 Wir modellieren Sequenzen der Länge L über einem festen Alphabet der Größe D mit einem inhomogenen Markov Modell 1-ter Ordnung. Als Daten stehen uns N Sequenzen der Länge L zur Verfügung, die – wie üblich – als paarweise unabhängige Realisierung dieser iMM(1) angenommen werden. Als a priori Verteilung der Parameter des iMM(1) nehmen wir statistisch unabhängige Dirichlet-Verteilungen an.

Geben Sie die explizit die ML-, MAP- und MP-Schätzwerte der Parameter des iMM(1) an.

Aufgabe 10.3 Wir betrachten N Sequenzen über einem festen Alphabet, die nun aber unterschiedliche Längen L_n haben.

Geben Sie für folgende Modelle für Sequenzen der Länge $L, L > 5$, jeweils die ML-Schätzer an:

(a) ein homogenes Markov Modell 5-ter Ordnung

(b) ein “periodisches” inhomogenes Markov Modell 5-ter Ordnung

(also ein iMM(5), für das gilt:

$$P_l(X_l | X_{l-5}, \dots, X_{l-1}) = P_k(X_k | X_{k-5}, \dots, X_{k-1}), \text{ falls } k = l \% 5$$