

گزیده‌ی مسائل آمار و احتمال مهندسی

نیمسال اول سال تحصیلی ۹۷-۹۸
(سری دوم - پرآورد و آزمون فرضی)

دکتر امیر نادری

دانشکده‌ی علوم ریاضی، دانشگاه صنعتی اصفهان

۱. فرض کنید X_1, X_2, \dots, X_n یک نمونه‌ی تصادفی از توزیعی با تابع احتمال $p_\theta(x)$ یا تابع چگالی احتمال $f_\theta(x)$ تعریف شده در زیر باشد. برآورد کننده‌های درستنمایی ماکسیمم و گشتاوری θ را در هر یک از حالات زیر بیابید.

(الف) $p_\theta(x) = \frac{\theta^x e^{-\theta}}{x!}, \quad x = 0, 1, 2, \dots, \theta > 0$

(ب) $f_\theta(x) = \theta x^{\theta-1}, \quad 0 < x < 1, \theta > 0$

(ج) $f_\theta(x) = e^{-(x-\theta)}, \quad \theta \leq x < \infty, -\infty < \theta < \infty$

۲. یک مشاهده از متغیر تصادفی گسسته‌ی X با تابع احتمال $p_\theta(x)$ تعریف شده در زیر در دست است که $\theta \in \{1, 2, 3\}$. برآورد درستنمایی ماکسیمم θ را به دست آورید.

x	0	1	2	3	4
$p_1(x)$	$\frac{1}{3}$	$\frac{1}{3}$	0	$\frac{1}{6}$	$\frac{1}{6}$
$p_2(x)$	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{4}$	0
$p_3(x)$	0	0	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{4}$

۳. فرض کنید X_1, X_2, \dots, X_n یک نمونه‌ی تصادفی از توزیع دوجمله‌ای با پارامترهای m و θ باشد. برآورد کننده‌های درستنمایی ماکسیمم و گشتاوری θ را بیابید و ناریب بودن آن‌ها را بررسی کنید.

۴. فرض کنید X_1, X_2, \dots, X_n یک نمونه‌ی تصادفی از توزیعی با تابع چگالی احتمال زیر باشد:

$$f_\theta(x) = \begin{cases} \frac{1}{\theta} x^{\frac{1-\theta}{\theta}}, & 0 < x < 1, \theta > 0 \\ 0, & \text{سایر نقاط} \end{cases}$$

برآورد کننده‌های درستنمایی ماکسیمم و گشتاوری θ را بیابید.

۵. فرض کنید X_1, X_2, \dots, X_n یک نمونه‌ی تصادفی از تابع توزیع زیر باشد:

$$F_\theta(x) = \begin{cases} 1 - \left(\frac{1}{x}\right)^\theta, & x \geq 1, \theta > 0 \\ 0, & x < 1 \end{cases}$$

برآورد کننده‌ی درستنمایی ماکسیمم θ را بیابید.

۶. فرض کنید X_1, X_2, \dots, X_n یک نمونه تصادفی از توزیعی با تابع چگالی احتمال زیر باشد:

$$f_{\theta}(x) = \begin{cases} \theta(1+x)^{-(1+\theta)}, & x > 0, \theta > 0 \\ 0, & \text{سایر نقاط} \end{cases}$$

برآورد کننده‌های درست‌نمایی ماکسیم $\frac{1}{\theta}$ و $\ln \theta$ را به دست آورید.

۷. هرگاه یک نمونه تصادفی اندازه‌ی ۱۵ از توزیع $N(\mu, \sigma^2)$ مقادیر زیر را به دست دهد، برآوردهای درست‌نمایی ماکسیم $\mu = \theta_1$ و $\sigma^2 = \theta_2$ را به دست آورید.

۳۱٫۵	۳۶٫۹	۳۳٫۸	۳۰٫۱	۳۳٫۹
۳۵٫۲	۲۹٫۶	۳۴٫۴	۳۰٫۵	۳۴٫۲
۳۱٫۶	۳۶٫۷	۳۵٫۸	۳۴٫۵	۳۲٫۷

۸. فرض کنید X_1, X_2, \dots, X_n یک نمونه تصادفی از توزیع $N(\mu, 80)$ باشد. هرگاه $\bar{x} = 81.2$ ، یک بازه‌ی اطمینان ۹۵ درصد برای μ بیابید.

۹. فرض کنید X_1, X_2, \dots, X_n یک نمونه تصادفی از توزیع $N(\mu, 9)$ باشد. n را به نحوی بیابید که به طور تقریبی، $P(\bar{X} - 1 < \mu < \bar{X} + 1) = 0.9$.

۱۰. فرض کنید X_1, X_2, \dots, X_{17} یک نمونه تصادفی از توزیع $N(\mu, \sigma^2)$ باشد به طوری که $\bar{x} = 4.7$ و $s^2 = 6.12$. یک بازه‌ی اطمینان ۹۰ درصد برای μ بیابید.

۱۱. فرض کنید X_1, X_2, \dots, X_9 یک نمونه تصادفی از توزیع $N(\mu, \sigma^2)$ باشد. اگر σ معلوم باشد، طول یک بازه‌ی اطمینان ۹۵ درصد را برای μ بیابید هرگاه این بازه براساس $\frac{\sqrt{9}(\bar{X} - \mu)}{\sigma}$ بنا نهاده شده باشد.

۱۲. دو نمونه تصادفی مستقل، هریک با اندازه‌ی ۱۰ و به ترتیب دارای توزیع‌های $N(\mu_1, \sigma^2)$ و $N(\mu_2, \sigma^2)$ ، مقادیر $\bar{x} = 4.8$ ، $s_1^2 = 9.6$ ، $\bar{y} = 5.6$ و $s_2^2 = 8.76$ را به دست می‌دهند. یک بازه‌ی اطمینان ۹۵ درصد برای $\mu_1 - \mu_2$ بیابید.

۱۳. فرض کنید \bar{X} و \bar{Y} میانگین‌های دو نمونه تصادفی مستقل، هریک با اندازه‌ی n و به ترتیب دارای توزیع‌های $N(\mu_1, \sigma^2)$ و $N(\mu_2, \sigma^2)$ باشند که در آن σ^2 معلوم است. n را به نحوی بیابید که $P\left(\bar{X} - \bar{Y} - \frac{\sigma}{5} < \mu_1 - \mu_2 < \bar{X} - \bar{Y} + \frac{\sigma}{5}\right) = 0.9$

۱۴. فرض کنید $8.6, 7.9, 8.3, 6.4, 8.4, 7.2, 9.8, 7.8, 7.5$ مقادیر مشاهده شده‌ی یک نمونه تصادفی اندازه‌ی ۹ از توزیع $N(8, \sigma^2)$ باشد. یک بازه‌ی اطمینان ۹۰ درصد برای σ^2 بیابید.

۱۵. یک نمونه تصادفی اندازه‌ی ۱۵ از توزیع $N(\mu, \sigma^2)$ ، به ترتیب مقادیر $\bar{x} = 3.2$ و $s^2 = 4.54$ را به دست می‌دهد. یک بازه‌ی اطمینان ۹۰ درصد برای σ^2 بیابید.

۱۶. فرض کنید S_1^2 و S_2^2 به ترتیب واریانس‌های نمونه‌های تصادفی مستقل با اندازه‌ی n از توزیع $N(\mu_1, \sigma^2)$ و با اندازه‌ی m از توزیع $N(\mu_2, \sigma^2)$ باشند. از این‌که $\frac{(n-1)S_1^2 + (m-1)S_2^2}{\sigma^2}$ دارای توزیع χ^2 با $n+m-2$ درجه‌ی آزادی است استفاده نمایید و یک بازه‌ی اطمینان برای σ^2 بیابید.

۱۷. فرض کنید دو نمونه‌ی تصادفی مستقل با اندازه‌ی $n = 16$ از توزیع $N(\mu_1, \sigma_1^2)$ و با اندازه‌ی $m = 10$ از توزیع $N(\mu_2, \sigma_2^2)$ مقادیر $\bar{x} = 3/6$ ، $s_1^2 = 4/42$ ، $\bar{y} = 13/6$ و $s_2^2 = 8/07$ را به دست دهند. هرگاه μ_1 و μ_2 مجهول باشند، یک بازه‌ی اطمینان ۹۰ درصد برای $\frac{\sigma_1^2}{\sigma_2^2}$ بیابید.

۱۸. فرض کنید X یک متغیر تصادفی با تابع چگالی احتمال $f_\theta(x) = \begin{cases} \frac{1}{\theta}, & 0 < x < \theta \\ 0, & \text{سایر نقاط} \end{cases}$ باشد. هرگاه برای

آزمون فرض ساده‌ی $H_0: \theta = 1$ مقابل فرض ساده‌ی $H_1: \theta = 2$ ، از ناحیه‌ی بحرانی $C = \{x : x > 0/99\}$ استفاده کنیم، احتمال خطای نوع اول و احتمال خطای نوع دوم را بیابید.

۱۹. هرگاه X_1, X_2, \dots, X_n یک نمونه‌ی تصادفی از توزیع $N(\mu, \sigma^2)$ باشد، آنگاه $\sum_{i=1}^n \frac{(X_i - \mu)^2}{\sigma^2}$ دارای توزیع χ_n^2 است. از این توزیع استفاده کنید و به سؤالات زیر پاسخ دهید.

الف) فرض کنید X_1, X_2, \dots, X_{25} یک نمونه‌ی تصادفی از توزیع $N(0, \sigma^2)$ ، $\sigma^2 > 0$ باشد. هرگاه $C = \{(x_1, \dots, x_{25}) : \sum_{i=1}^{25} x_i^2 \geq c\}$ یک ناحیه‌ی بحرانی برای آزمون فرض ساده‌ی $H_0: \sigma^2 = 1$ مقابل فرض مرکب $H_1: \sigma^2 > 1$ باشد، مقدار c را طوری بیابید که اندازه‌ی ناحیه‌ی بحرانی برابر $0/05$ باشد.
ب) هرگاه $\mu = \mu_0$ ، یک بازه‌ی اطمینان $100(1 - \alpha)$ درصد برای σ^2 بیابید.

۲۰. فرض کنید X_1, X_2, \dots, X_{25} یک نمونه‌ی تصادفی از توزیع $N(\theta, 100)$ باشد. برای آزمون فرض ساده‌ی $H_0: \theta = 80$ مقابل فرض مرکب $H_1: \theta > 80$ ، از ناحیه‌ی بحرانی $C = \{(x_1, \dots, x_{25}) : \bar{x} > 83\}$ استفاده می‌کنیم.

الف) احتمال خطای نوع اول (اندازه‌ی ناحیه‌ی بحرانی) را بیابید.

ب) احتمال خطای نوع دوم را به ازای $\theta = 85$ و نیز $\theta = 87$ بیابید.

۲۱. آزمون میانگین (نمونه‌ی تصادفی از توزیع $N(\mu, \sigma^2)$ با واریانس معلوم)

فرض کنید X_1, X_2, \dots, X_n یک نمونه‌ی تصادفی از توزیع $N(\mu, \sigma_0^2)$ ، σ_0^2 معلوم، باشد. برای آزمون فرض ساده‌ی $H_0: \mu = \mu_0$ مقابل فرض مرکب $H_1: \mu > \mu_0$ ، ناحیه‌ی بحرانی متشکل از مجموعه‌ی نقاط (x_1, \dots, x_n) است که برای آن‌ها $\bar{x} > \mu_0 + z_\alpha \frac{\sigma_0}{\sqrt{n}}$ ؛ برای آزمون فرض ساده‌ی $H_0: \mu = \mu_0$ مقابل فرض مرکب $H_1: \mu < \mu_0$ ، ناحیه‌ی بحرانی متشکل از مجموعه‌ی نقاط (x_1, \dots, x_n) است که برای آن‌ها $\bar{x} < \mu_0 - z_\alpha \frac{\sigma_0}{\sqrt{n}}$ و برای آزمون فرض ساده‌ی $H_0: \mu = \mu_0$ مقابل فرض مرکب $H_1: \mu \neq \mu_0$ ، ناحیه‌ی بحرانی متشکل از مجموعه‌ی نقاط (x_1, \dots, x_n) است که برای آن‌ها $|\bar{x} - \mu_0| > z_{\alpha/2} \frac{\sigma_0}{\sqrt{n}}$ است که تابع توزیع نرمال استاندارد در آن برابر $1 - \alpha$ است.

هرگاه $n = 16$ ، $\sigma_0^2 = 100$ و $\bar{x} = 113/5$ ، فرض ساده‌ی $H_0: \mu = 110$ را مقابل فرض مرکب $H_1: \mu > 110$ ، با اندازه‌ی ناحیه‌ی بحرانی $\alpha = 0/05$ و نیز با اندازه‌ی ناحیه‌ی بحرانی $\alpha = 0/1$ بیازمایید.

۲۲. آزمون میانگین (نمونه‌ی تصادفی از توزیع $N(\mu, \sigma^2)$ با واریانس مجهول)

فرض کنید X_1, X_2, \dots, X_n یک نمونه‌ی تصادفی از توزیع $N(\mu, \sigma^2)$ مجهول، باشد. برای آزمون فرض ساده‌ی $H_0: \mu = \mu_0$ مقابل فرض مرکب $H_1: \mu > \mu_0$ ، ناحیه‌ی بحرانی متشکل از مجموعه‌ی نقاط (x_1, \dots, x_n) است که برای آن‌ها $\bar{x} > \mu_0 + t_{\alpha}(n-1) \frac{s}{\sqrt{n}}$ ؛ برای آزمون فرض ساده‌ی $H_0: \mu = \mu_0$ مقابل فرض مرکب $H_1: \mu < \mu_0$ ، ناحیه‌ی بحرانی متشکل از مجموعه‌ی نقاط (x_1, \dots, x_n) است که برای آن‌ها $\bar{x} < \mu_0 - t_{\alpha}(n-1) \frac{s}{\sqrt{n}}$ و برای آزمون فرض ساده‌ی $H_0: \mu = \mu_0$ مقابل فرض مرکب $H_1: \mu \neq \mu_0$ ، ناحیه‌ی بحرانی متشکل از مجموعه‌ی نقاط (x_1, \dots, x_n) است که برای آن‌ها $|\bar{x} - \mu_0| > t_{\frac{\alpha}{2}}(n-1) \frac{s}{\sqrt{n}}$ و $t_x(r)$ عددی است که تابع توزیع t با r درجه‌ی آزادی در آن برابر $1 - \alpha$ است.

هرگاه $n = 16$ ، $s = 0.4$ و $\bar{x} = 10.4$ ، فرض ساده‌ی $H_0: \mu = 10.1$ را مقابل فرض مرکب $H_1: \mu > 10.1$ با اندازه‌ی ناحیه‌ی بحرانی $\alpha = 0.05$ بیازمایید.

۲۳. آزمون نسبت یا آزمون احتمال موفقیت (نمونه‌ی تصادفی از توزیع برنولی با احتمال موفقیت p)

فرض کنید X_1, X_2, \dots, X_n یک نمونه‌ی تصادفی از توزیع برنولی با احتمال موفقیت p باشد و $\hat{p} = \frac{\sum_{i=1}^n x_i}{n}$ و $\hat{q} = 1 - \hat{p}$. برای آزمون فرض ساده‌ی $H_0: p = p_0$ مقابل فرض مرکب $H_1: p > p_0$ ، ناحیه‌ی بحرانی متشکل از مجموعه‌ی نقاط (x_1, \dots, x_n) است که برای آن‌ها $\hat{p} > p_0 + z_{\alpha} \sqrt{\frac{\hat{p}\hat{q}}{n}}$ ؛ برای آزمون فرض ساده‌ی $H_0: p = p_0$ مقابل فرض مرکب $H_1: p < p_0$ ، ناحیه‌ی بحرانی متشکل از مجموعه‌ی نقاط (x_1, \dots, x_n) است که برای آن‌ها $\hat{p} < p_0 - z_{\alpha} \sqrt{\frac{\hat{p}\hat{q}}{n}}$ و برای آزمون فرض ساده‌ی $H_0: p = p_0$ مقابل فرض مرکب $H_1: p \neq p_0$ ، ناحیه‌ی بحرانی متشکل از مجموعه‌ی نقاط (x_1, \dots, x_n) است که برای آن‌ها $|\hat{p} - p_0| > z_{\frac{\alpha}{2}} \sqrt{\frac{\hat{p}\hat{q}}{n}}$ و z_x عددی است که تابع توزیع نرمال استاندارد در آن برابر $1 - \alpha$ است.

هرگاه $n = 400$ و نصف مقادیر مشاهده شده موفقیت باشد، فرض ساده‌ی $H_0: p = 0.43$ را مقابل فرض مرکب $H_1: p \neq 0.43$ با اندازه‌ی ناحیه‌ی بحرانی $\alpha = 0.1$ بیازمایید.

۲۴. آزمون واریانس (نمونه‌ی تصادفی از توزیع $N(\mu, \sigma^2)$ با میانگین مجهول)

فرض کنید X_1, X_2, \dots, X_n یک نمونه‌ی تصادفی از توزیع $N(\mu, \sigma^2)$ مجهول، باشد. برای آزمون فرض ساده‌ی $H_0: \sigma^2 = \sigma_0^2$ مقابل فرض مرکب $H_1: \sigma^2 > \sigma_0^2$ ، ناحیه‌ی بحرانی متشکل از مجموعه‌ی نقاط (x_1, \dots, x_n) است که برای آن‌ها $s^2 > \chi_{\alpha}^2(n-1) \frac{\sigma_0^2}{n-1}$ ؛ برای آزمون فرض ساده‌ی $H_0: \sigma^2 = \sigma_0^2$ مقابل فرض مرکب $H_1: \sigma^2 < \sigma_0^2$ ، ناحیه‌ی بحرانی متشکل از مجموعه‌ی نقاط (x_1, \dots, x_n) است که برای آن‌ها $s^2 < \chi_{1-\alpha}^2(n-1) \frac{\sigma_0^2}{n-1}$ و برای آزمون فرض ساده‌ی $H_0: \sigma^2 = \sigma_0^2$ مقابل فرض مرکب $H_1: \sigma^2 \neq \sigma_0^2$ ، ناحیه‌ی بحرانی متشکل از مجموعه‌ی نقاط (x_1, \dots, x_n) است که برای آن‌ها $s^2 > \chi_{\frac{\alpha}{2}}^2(n-1) \frac{\sigma_0^2}{n-1}$ یا $s^2 < \chi_{1-\frac{\alpha}{2}}^2(n-1) \frac{\sigma_0^2}{n-1}$ و χ_x^2 عددی است که تابع توزیع کای دو با $n-1$ درجه‌ی آزادی در آن برابر $1 - \alpha$ است.

هرگاه $n = 13$ و $s^2 = 9.88$ ، فرض ساده‌ی $H_0: \sigma^2 = 25$ را مقابل فرض مرکب $H_1: \sigma^2 < 25$ با اندازه‌ی ناحیه‌ی بحرانی $\alpha = 0.05$ بیازمایید.

۲۵. فرض کنید X و Y به ترتیب، نشان‌دهنده‌ی وزن‌ها (بر حسب گرم) نوعی از پرندگان نر و ماده آبی، مستقل و دارای توزیع‌های $N(\mu_X, \sigma_X^2)$ و $N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$ باشند. نیز فرض کنید نمونه‌های تصادفی مستقل با اندازه‌ی $n = 16$

از توزیع $N(\mu_X, \sigma_X^2)$ و با اندازه‌ی $m = 13$ از توزیع $N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$ مقادیر $\bar{x} = 347/4$ ، $s_X^2 = 1356/75$ ، $\bar{y} = 415/16$ و $s_Y^2 = 692/21$ را به دست دهند.

(الف) فرض $H_0: \sigma_X^2 = \sigma_Y^2$ را مقابل فرض $H_1: \sigma_X^2 \neq \sigma_Y^2$ با $\alpha = 0/1$ بیازمایید.

(ب) فرض $H_0: \mu_X = \mu_Y$ را مقابل فرض $H_1: \mu_X < \mu_Y$ با $\alpha = 0/01$ بیازمایید.

۲۶. فرض کنید X و Y به ترتیب دارای توزیع‌های $N(\mu_X, \sigma_X^2)$ و $N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$ باشند. دو نمونه‌ی تصادفی مستقل، یکی از X با اندازه‌ی $n = 9$ ، مقادیر $\bar{x} = 84/34$ و $s_X^2 = 13/90$ و دیگری از Y با اندازه‌ی $m = 16$ ، مقادیر $\bar{y} = 50/29$ و $s_Y^2 = 12/48$ را به دست می‌دهند. آیا فرض $H_0: \sigma_X^2 = \sigma_Y^2$ مقابل فرض $H_1: \sigma_X^2 > \sigma_Y^2$ با $\alpha = 0/05$ رد می‌شود؟

۲۷. فرض کنید X و Y نشان‌دهنده‌ی زمان‌های مورد نیاز جهت رسیدن دانه‌های گیاه گواردیولا، از خانواده‌های به ترتیب باریک‌برگ از توزیع $N(\mu_X, \sigma_X^2)$ و پهن‌برگ از توزیع $N(\mu_Y, \sigma_Y^2)$ باشند. هرگاه دو نمونه‌ی تصادفی مستقل، یکی از X با اندازه‌ی $n = 13$ ، مقادیر $\bar{x} = 18/97$ و $s_X^2 = 4/08$ و دیگری از Y با اندازه‌ی $m = 9$ ، مقادیر $\bar{y} = 23/20$ و $s_Y^2 = 9/88$ را به دست دهند، فرض $H_0: \sigma_X^2 = \sigma_Y^2$ مقابل فرض $H_1: \sigma_X^2 < \sigma_Y^2$ با $\alpha = 0/05$ بیازمایید.

۲۸. دو نمونه‌ی تصادفی مستقل با اندازه‌های یکسان $n = 81$ ، یکی از توزیع $N(\mu_X, \sigma^2)$ و دیگری از توزیع $N(\mu_Y, \sigma^2)$ به ترتیب مقادیر $\bar{x} = 182$ ، $\bar{y} = 173$ و انحراف معیارهای یکسان $s = 24$ را به دست می‌دهند. فرض $H_0: \mu_X = \mu_Y$ را مقابل فرض $H_1: \mu_X \neq \mu_Y$ با $\alpha = 0/05$ بیازمایید.

۲۹. فرض کنید X و Y مستقل و به ترتیب دارای توزیع‌های $N(\mu_X, \sigma^2)$ و $N(\mu_Y, \sigma^2)$ باشند. فرض $H_0: \mu_X = \mu_Y$ را مقابل فرض $H_1: \mu_X > \mu_Y$ می‌آزماییم. بر اساس $n = 10$ مشاهده از X و $m = 10$ مشاهده از Y ، (الف) یک ناحیه‌ی بحرانی با اندازه‌ی $\alpha = 0/05$ تعریف کنید.

(ب) هرگاه $\bar{x} = 79/8$ ، $s_X^2 = 271/2$ ، $\bar{y} = 74/3$ و $s_Y^2 = 258/7$ ، نتیجه‌ی آزمون فرض چه خواهد بود؟

۳۰. فرض کنید در یک نظرسنجی، p_1 و p_2 به ترتیب نشان‌دهنده‌ی نسبت آرای موافق در حوزه‌های رأی‌گیری شماره‌های ۱ و ۲ باشند. آیا با اطلاعات داده شده در جدول زیر، فرض $H_0: p_1 = p_2$ مقابل فرض $H_1: p_1 > p_2$ با $\alpha = 0/1$ رد می‌شود؟

	تعداد آرای موافق	تعداد آرای مخالف
حوزه‌ی شماره ۱	۲۰۰	۱۸۰
حوزه‌ی شماره ۲	۲۲۰	۲۶۵