

שיטות סטטיסטיות



תוכן העניינים

1.	המשתנה המקרי הרציף- התפלגויות כלליות (שימוש באינטגרלים).....	1
10.	התפלגויות רציפות מיוחדות- התפלגות מעריכית.....	10
13.	התפלגויות רציפות מיוחדות- התפלגות אחידה.....	13
16.	התפלגויות רציפות מיוחדות - התפלגות נורמלית.....	16
24.	טרנספורמציה על משתנה מקרי רציף.....	24
27.	נוסחת התוחלת השלמה.....	27
30.	נוסחת השונות השלמה (שונות של משתנה מותנה).....	30
32.	המשתנה המקרי הדו ממדי הרציף.....	32
40.	אמידה נקודתית (אומד חסר נטיה, קרטיון esm , אנ"מ ועוד).....	40
72.	בדיקת השערות כללית (סיכוי לטעויות ועוצמת מבחן).....	72
79.	הלמה של ניימן פירסון.....	79

שיטות סטטיסטיות

פרק 1 - המשתנה המקרי הרציף- התפלגויות כלליות (שימוש באינטגרלים)

תוכן העניינים

1. כללי 1

המשתנה המקרי הרציף – התפלגויות כלליות (שימוש באינטגרלים)

רקע:

בפרק זה נעסוק בהתפלגות של משתנים מקריים רציפים (גובה אדם אקראי, זמן תגובה וכו'). משתנים רציפים הם משתנים שבתחום מסוים מקבלים רצף אינסופי של ערכים אפשריים בניגוד למשתנים בדידים. נתאר את המשתנה המקרי הרציף על ידי פונקציה הנקראת פונקציית צפיפות. באופן כללי נסמן פונקציית צפיפות של משתנה רציף כלשהו ב- $f(x)$. השטח שמתחת לפונקציית הצפיפות נותן את ההסתברות. פונקציית צפיפות חייבת להיות לא-שלילית והשטח הכולל שמתחת לפונקציה יהיה תמיד 1.

הגדרות יסודיות:

יהא משתנה רציף X בעל פונקציית צפיפות $f(x)$.

פונקציית ההתפלגות מצטברת:

פונקציית ההתפלגות המצטברת מוגדרת באופן הבא: $F(t) = p(X \leq t) = \int_{-\infty}^t f(x) dx$.
כמו כן מתקיים: $p(X > t) = 1 - F(t)$ ו- $p(a < X < b) = F(b) - F(a)$.

תוחלת ושונות של משתנה רציף:

תוחלת של משתנה רציף תחושב באופן הבא: $E(X) = \int_{-\infty}^{\infty} X \cdot f(x) dx = \mu$.
שונות של משתנה רציף תחושב באופן הבא: $V(X) = \int_{-\infty}^{\infty} X^2 \cdot f(x) dx - \mu^2 = \sigma^2$.

תוחלת של פונקציה של X :

תוחלת של פונקציית משתנה רציף X , המסומנת : $g(x)$, תחושב באופן

$$\text{הבא : } E(g(x)) = \int_{-\infty}^{\infty} g(x) f(x) dx$$

אחוזונים :

האחוזון ה- p הוא ערך (נסמן אותו : x_p), שהסיכוי ליפול מתחתיו הוא p .

$$\text{כלומר : } p(X \leq x_p) = p$$

ריענון מתמטי :

נוסחאות לחישוב שטחים

$$\text{שטח משולש : גובה } (h) \text{ כפול הבסיס } (a) \text{ חלקי } 2 : S_{\text{triangle}} = \frac{h \cdot a}{2}$$

$$\text{שטח מלבן : אורך } (a) \text{ כפול רוחב } (b) : S_{\text{rectangle}} = a \cdot b$$

משוואת קו ישר :

משוואת ישר מפורשת תסומן : $y = mx + n$, כאשר m הוא שיפוע הישר ו- n היא נקודת החיתוך של הישר עם ציר ה- y .

$$\text{שיפוע ישר העובר דרך שתי נקודות : } (x_1, y_1), (x_2, y_2) \text{ הוא : } m = \frac{y_2 - y_1}{x_2 - x_1}$$

משוואת ישר שעובר דרך נקודה ספציפית (x_1, y_1) ושיפועו הוא m , תחושב באופן

$$\text{הבא : } y - y_1 = m(x - x_1)$$

אינטגרלים מידיים:

$$\int a dx = ax + c$$

$$\int x^n dx = \frac{x^{n+1}}{n+1} + c \quad n \neq -1$$

$$\int \frac{1}{x} dx = \ln |x| + c$$

$$\int e^x dx = e^x + c$$

$$\int k^x dx = \frac{k^x}{\ln k} + c$$

$$\int \cos x dx = \sin x + c$$

$$\int \sin x dx = -\cos x + c$$

$$\int \tan x dx = -\ln |\cos x| + c$$

$$\int \cot x dx = \ln |\sin x| + c$$

$$\int \frac{1}{\cos^2 x} dx = \tan x + c$$

$$\int \frac{1}{\sin^2 x} dx = -\cot x + c$$

$$\int \frac{1}{\cos x} dx = \ln \left| \frac{1}{\cos x} + \tan x \right| + c$$

$$\int \frac{1}{x^2 + a^2} dx = \frac{1}{a} \arctan \left(\frac{x}{a} \right) + c$$

$$\int \frac{1}{\sqrt{a^2 - x^2}} dx = \arcsin \left(\frac{x}{a} \right) + c$$

$$\int \frac{f'}{f} dx = \ln |f| + c$$

$$\int e^f \cdot f' dx = e^f + c$$

$$\int \sin f \cdot f' dx = -\cos(f) + c$$

$$\int \sqrt{f} \cdot f' dx = \frac{2}{3} f^{\frac{3}{2}} + c$$

$$\int (ax+b)^n dx = \frac{1}{a} \frac{(ax+b)^{n+1}}{n+1} + c \quad n \neq -1$$

$$\int \frac{1}{ax+b} dx = \frac{1}{a} \ln |ax+b| + c$$

$$\int e^{ax+b} dx = \frac{1}{a} e^{ax+b} + c$$

$$\int k^{ax+b} dx = \frac{1}{a} \frac{k^{ax+b}}{\ln k} + c$$

$$\int \cos(ax+b) dx = \frac{1}{a} \sin(ax+b) + c$$

$$\int \sin(ax+b) dx = -\frac{1}{a} \cos(ax+b) + c$$

$$\int \tan(ax+b) dx = -\frac{1}{a} \ln |\cos(ax+b)| + c$$

$$\int \cot(ax+b) dx = \frac{1}{a} \ln |\sin(ax+b)| + c$$

$$\int \frac{1}{\cos^2(ax+b)} dx = \frac{1}{a} \tan(ax+b) + c$$

$$\int \frac{1}{\sin^2(ax+b)} dx = -\frac{1}{a} \cot(ax+b) + c$$

$$\int \frac{1}{\sin x} dx = \ln \left| \frac{1}{\sin x} - \cot x \right| + c$$

$$\int \frac{1}{x^2 - a^2} dx = \frac{1}{2a} \ln \left| \frac{x-a}{x+a} \right| + c$$

$$\int \frac{1}{\sqrt{x^2 \pm a^2}} dx = \ln |x + \sqrt{x^2 \pm a^2}| + c$$

$$\int f \cdot f' dx = \frac{1}{2} f^2 + c$$

$$\int \cos f \cdot f' dx = \sin(f) + c$$

$$\int \frac{f'}{\sqrt{f}} dx = 2\sqrt{f} + c$$

$$\int u \cdot v' dx = u \cdot v - \int u' \cdot v dx$$

שאלות:

(1) X הינו משתנה רציף עם פונקציית צפיפות כמוצג בשרטוט:

א. מצאו את ערכו של c .

ב. בנו את פונקציית ההתפלגות המצטברת.

ג. חשבו את ההסתברויות הבאות:

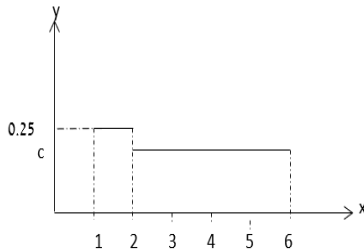
i. $P(x < 4)$

ii. $P(x > 1.5)$

iii. $P(1.5 < x < 5)$

iv. $P(5 < x < 10)$

v. מצאו את החציון של המשתנה.



(2) נתון משתנה מקרי רציף A שפונקציית הצפיפות שלו היא:

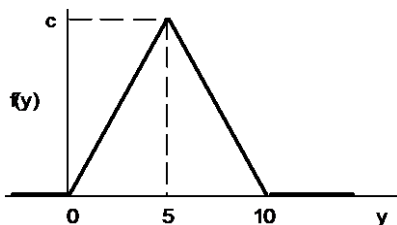
$$f(x) = \begin{cases} cx & 0 \leq x \leq b \\ 0 & \text{else} \end{cases}$$

וידוע ש- $P(0 < X < 1) = \frac{1}{4}$

א. מצאו במפורש את פונקציית הצפיפות של X .

ב. מצאו את החציון של X .

ג. מה הסיכוי ש- X קטן מ-0.5?



(3) נתונה פונקציית צפיפות של משתנה מקרי Y :

א. מצאו את c .

ב. מצאו את פונקציית ההתפלגות המצטברת של Y .

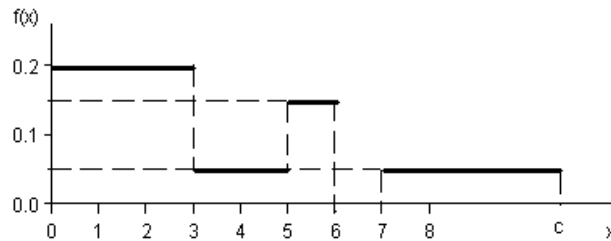
ג. חשבו את ההסתברויות הבאות:

$P(Y > 4)$, $P(7.5 \leq Y \leq 15.5)$, $P(Y \leq 3.0)$, $P(Y = 7.0)$

ד. מצאו את העשירון התחתון: $y_{0.1}$, הרבעון התחתון: $y_{0.25}$ והחציון של Y .

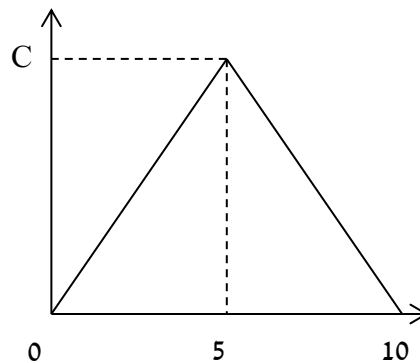
הסיקו מהו העשירון עליון: $y_{0.9}$.

(4) נתונה פונקציית צפיפות של משתנה מקרי X :



- א. מצאו ערך c שעבורו תתקבל פונקציית צפיפות.
- ב. מצאו את פונקציית ההתפלגות המצטברת.
- ג. חשבו את ההסתברויות הבאות :
 $P(1.0 < X \leq 5.0)$, $P(X \geq -2.0)$, $P(X \geq 4)$.

(5) נתונה פונקציית הצפיפות הבאה :



- א. מה ערכו של c ?
- ב. מצאו אינטרוול (תחום) סימטרי סביב הערך 5, שהסיכוי ליפול בו הינו 0.5.

(6) נתונה פונקציית צפיפות : $f(X) = \frac{2}{x}$, המוגדרת מ-1 עד K .

- א. מצאו את ערכו של K .
- ב. בנו את פונקציית ההתפלגות המצטברת.
- ג. חשבו את הסיכוי ש- X לפחות 1.5.
- ד. מצאו את העשירון התחתון של ההתפלגות.
- ה. מה התוחלת של X ?

(7) נתונה פונקציית צפיפות הבאה: $f(X) = AX^2(10 - X)$, $0 < X < 10$.

A הינו קבוע חיובי.

א. מצאו את A.

ב. חשב את: $P(x > 5 | x > 2)$.

ג. מה התוחלת ומהי השונות של X?

(8) פונקציית הצפיפות של משתנה מקרי רציף X:

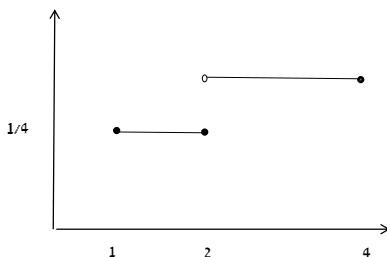
$$f(x) = 0.5 \cdot e^{2x}, \quad -\infty \leq X \leq \ln(c)$$

א. מצאו את ערכו של c.

ב. מצאו את פונקציית ההתפלגות המצטברת של ההתפלגות.

ג. חשב: $P(X > 0)$.

ד. מהו הרבעון העליון של ההתפלגות?



(9) נתונה פונקציית הצפיפות הבאה של משתנה מקרי X:

א. רשמו את נוסחת פונקציית הצפיפות.

ב. בנו את פונקציית ההתפלגות המצטברת.

ג. מצאו את החציון של ההתפלגות.

ד. חשבו את התוחלת והשונות של המשתנה.

ה. חשבו את: $E(X^3)$.

(10) במפעל מייצרים מוצר A. זמן תהליך הייצור של המוצר בשעות הוא בעל

$$f(x) = 6x(1-x), \quad 0 \leq x \leq 1$$

א. מה ההסתברות שזמן הייצור של מוצר A אקראי יהיה קטן מ-20 דקות?

ב. מה ההסתברות שזמן הייצור של מוצר A אקראי יהיה בדיוק חצי שעה?

ג. נבחרו חמישה מוצרים אקראיים מסוג A. מה תוחלת מספר המוצרים

שזמן הייצור שלהם יהיה גדול מ-20 דקות?

(11) זמן ההמתנה בדקות של לקוח בתור למכולת השכונתית מתפלג עם פונקציית

$$F(t) = 1 - e^{-0.2t}$$

א. שרטטו את פונקציית ההתפלגות המצטברת.

ב. מה הסיכוי שזמן ההמתנה יהיה לפחות רבע שעה?

ג. אם חיכיתי בתור כבר 10 דקות מה ההסתברות שאאלץ לחכות בסך הכול

פחות מרבע שעה?

ד. מהו הזמן ש-90% מהלקוחות מחכים מתחתיו?

(12) פונקציית הצפיפות של משתנה מקרי נתונה על ידי הנוסחה הבאה :

$$f(x) = \begin{cases} 0 & x < 4 \\ bx - 4b & 4 \leq x \leq 5 \\ b & 5 < x \leq 6 \\ 0 & x > 6 \end{cases}$$

- א. מצאו את b .
- ב. חשבו את התוחלת של X .
- ג. y הוא משתנה אינדיקטור המקבל את הערך 1 אם X קטן מ-5. מהי השונות של y ?

(13) נתונה פונקציית הצפיפות הבאה :

$$f(x) = \begin{cases} \frac{x^2}{4} & 1 \leq x \leq 2 \\ kx & 2 < x \leq 3 \end{cases}$$

- א. מצאו את ערכו של k .
- ב. מצאו את פונקציית ההתפלגות המצטברת.
- ג. חשבו $P(x > 2.5)$.

(14) להלן משתנה מקרי בעל פונקציית צפיפות הבאה : $f(x) = \frac{1}{b-a}$, $a \leq x \leq b$

- א. מצאו את פונקציית ההתפלגות המצטברת.
- ב. חשב את התוחלת והשונות של ההתפלגות.
- ג. מצאו את התוחלת של $\frac{1}{X}$.

תשובות סופיות:

$$F(t) = \begin{cases} 0 & t < 1 \\ (t-1)0.25 & 1 \leq t \leq 2 \\ 0.25 + (t-2) \cdot \frac{3}{16} & 2 < t \leq 6 \\ 1 & t > 6 \end{cases} \quad \text{ב.} \quad \text{א. } \frac{3}{16} \quad \text{ג. } \frac{5}{8} \quad \text{ד. } \frac{1}{3}$$

$$\text{א. } b=2, c=0.5 \quad \text{ב. } 1.41 \quad \text{ג. } 0.0625 \quad \text{ד. } \frac{1}{3}$$

$$F(t) = \begin{cases} 0 & t < 0 \\ 0.02t^2 & 0 \leq t \leq 5 \\ 1 - 0.02(t-10)^2 & 5 < t \leq 10 \\ 1 & t > 10 \end{cases} \quad \text{ב.} \quad \text{א. } 0.2 \quad \text{ג. } 0, 0.18, 0.125, 0.32$$

ד. עשירון תחתון: 2.24, רבעון תחתון: 3.54, החציון: 5, עשירון עליון: 7.76.

$$F(t) = \begin{cases} 0 & t < 0 \\ 0.2t & 0 < t \leq 3 \\ 0.6 + (t-3) \cdot 0.05 & 3 < t \leq 5 \\ 0.7 + (t-5) \cdot 0.15 & 5 < t \leq 6 \\ 0.85 & 6 < t \leq 7 \\ 0.85 + (t-7) \cdot 0.05 & 7 < t \leq 10 \\ 1 & t > 10 \end{cases} \quad \text{ב.} \quad \text{א. } 0.10 \quad \text{ג. } 0.5$$

$$\text{א. } c=0.2 \quad \text{ב. } 5 \pm 1.46$$

$$F(t) = \begin{cases} 0 & t < 1 \\ 2 \cdot \ln t & 1 \leq t \leq e^{\frac{1}{2}} \\ 1 & t > e^{\frac{1}{2}} \end{cases} \quad \text{ב.} \quad \text{א. } e^{\frac{1}{2}} \quad \text{ג. } 0.189$$

$$\text{ד. } 1.051 \quad \text{ה. } 1.297$$

$$\text{א. } 0.0012 \quad \text{ב. } 0.7067 \quad \text{ג. תוחלת: 6, שונות: 4}$$

$$(8) \quad \text{א. 2.} \quad \text{ב.} \quad F(t) = \begin{cases} \frac{1}{4}e^{2t} & t \leq \ln(2) \\ 1 & t > \ln(2) \end{cases} \quad \text{ג. 0.75} \quad \text{ד. 0.549}$$

$$(9) \quad \text{א. 2.} \quad \text{ב.} \quad F(t) = \begin{cases} 0 & t < 1 \\ (t-1)0.25 & 1 \leq t \leq 2 \\ 0.25 + (t-2) \cdot \frac{3}{8} & 2 < t \leq 4 \\ 1 & t > 4 \end{cases} \quad \text{ג. 0.75} \quad \text{ד. 0.549}$$

$$\text{ג. 2.} \quad \text{ד. תוחלת: 2.625, שונות: 0.6927} \quad \text{ה. 23.4375}$$

$$(10) \quad \text{א. 7/27} \quad \text{ב. 0} \quad \text{ג. 3.704}$$

$$(11) \quad \text{א. עיין סרטוט בוידאו} \quad \text{ב. 0.0498} \quad \text{ג. 0.6321} \quad \text{ד. 11.51}$$

$$(12) \quad \text{א. 2/3} \quad \text{ב. 5.22} \quad \text{ג. 2/9}$$

$$(13) \quad \text{א. 1/6} \quad \text{ב.} \quad F(t) = \begin{cases} 0 & t < 1 \\ \frac{t^3-1}{12} & 1 \leq t \leq 2 \\ \frac{7}{12} + \frac{t^2-4}{12} & 2 < t \leq 3 \\ 1 & t > 3 \end{cases} \quad \text{ג. 0.229}$$

$$(14) \quad \text{א.} \quad F(t) = \begin{cases} 0 & t < a \\ \frac{(t-b)}{b-a} & a \leq t \leq b \\ 1 & t > b \end{cases} \quad \text{ב. תוחלת: } E(X) = \frac{a+b}{2}, \text{ שונות: } V(X) = \frac{(b-a)^2}{12}$$

$$\text{ג.} \quad \frac{\ln\left(\frac{b}{a}\right)}{b-a}$$

שיטות סטטיסטיות

פרק 2 - התפלגויות רציפות מיוחדות- התפלגות מעריכית

תוכן העניינים

1. כללי..... 10

התפלגויות רציפות מיוחדות – התפלגות מעריכית:

רקע:

התפלגות זו היא התפלגות רציפה המאפיינת את הזמן עד להתרחשות מאורע מסוים. λ - הוא ממוצע מספר האירועים המתרחשים ביחידת זמן (אותו פרמטר מהתפלגות הפואסונית): $X \sim \exp(\lambda)$ כאשר $\lambda > 0$.
התפלגות זו צריכה להיות נתונה בתרגיל או שיאמר שמספר האירועים ביחידת זמן מתפלג פואסונית ואז הזמן עד להתרחשות המאורע הבא מתפלג מעריכית.

פונקציית הצפיפות של ההתפלגות:

$$f(x) = \lambda e^{-\lambda x} \quad \text{לכל } x \geq 0.$$

$$F(t) = p(x \leq t) = 1 - e^{-\lambda t} \quad \text{פונקציית ההתפלגות המצטברת:}$$

$$E(x) = \frac{1}{\lambda} \quad \text{התוחלת:}$$

$$V(x) = \frac{1}{\lambda^2} \quad \text{השונות:}$$

$$P(X > a+b \mid X > a) = P(X > b) \quad \text{להתפלגות זו יש תכונת חוסר הזיכרון:}$$

דוגמה (פתרון בהקלטה):

אורך חיי סוללה מתפלג מעריכית עם תוחלת של 8 שעות.

א. מה ההסתברות שסוללה תחזיק מעמד פחות מ-9 שעות?

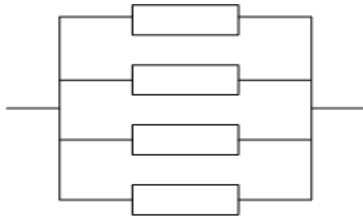
ב. מה סטיית התקן של אורך חיי הסוללה?

ג. אם סוללה כבר חייה מעל שעתיים, מה הסיכוי שהיא תחייה מעל 7 שעות בסך הכול?

שאלות:

- (1) הזמן שלוקח במערכת עד שתקלה מתרחשת מתפלג מעריכית עם תוחלת של 0.5 שעה.
- מה ההסתברות שהתקלה הבאה תתרחש תוך יותר מ-0.5 שעה?
 - מה ההסתברות שהתקלה הבאה תתרחש תוך פחות משעה?
 - מצא את הזמן החציוני להתרחשות תקלה במערכת.
- (2) הזמן שעובר בכביש מסוים עד להתרחשות תאונה מתפלג מעריכית עם תוחלת של 24 שעות.
- מהי סטיית התקן של הזמן עד להתרחשות תאונה?
 - מה ההסתברות שהתאונה הבאה תתרחש תוך פחות מיממה?
 - מהי ההסתברות שהתאונה הבאה תתרחש תוך לפחות יומיים?
- (3) משך הזמן X (בדקות) שסטודנטים עובדים רצוף על מחשב מתפלג מעריכית עם תוחלת של 30 דקות.
- מה הסיכוי שעבודת סטודנט על המחשב תארך פחות מרבע שעה?
 - מה הסיכוי שעבודת סטודנט על המחשב תארך בין רבע שעה לחצי שעה?
 - אם סטודנט עובד על המחשב כבר יותר מ-10 דקות, מה ההסתברות שמשך כל עבודתו יעלה על 30 דקות?
 - מהו הזמן שבסיכוי של 90% הסטודנט יעבוד פחות ממנו?
- (4) בממוצע מגיעים לחדר מיון 4 חולים בשעה בזרם פואסוני.
- שולה המזכירה הגיעה לחדר המיון. מה ההסתברות שזמן ההמתנה שלה לחולה הבא יהיה יותר מ-20 דקות?
 - אם שולה המתינה יותר מרבע שעה לחולה הבא. מה ההסתברות שתמתין בסך הכל יותר מחצי שעה?
 - מה ההסתברות שבין החולה הראשון לשני יש להמתין יותר מרבע שעה ובין החולה שני לשלישי יש להמתין פחות מרבע שעה?

(5) מערכת חשמלית כוללת 4 רכיבים אלקטרוניים זהים הפועלים במקביל כמתואר בשרטוט:



על מנת שהמערכת תפעל בצורה תקינה נדרש שלפחות אחד מהמרכיבים יהיה תקין. אורך החיים של כל רכיב מתפלג מעריכית עם ממוצע של 100 שעות.

א. מה ההסתברות שהמערכת תפעל בצורה תקינה במשך 100 שעות לפחות?

ב. מעוניינים להוסיף במקביל עוד רכיב למערכת. עלות הוספת רכיב היא K ₪.

כמו כן אם המערכת עבדה פחות מ-100 שעות נגרם הפסד של A ₪.

מה התנאי שבו יהיה כדאי להוסיף את הרכיב למערכת?

תשובות סופיות:

- | | | | | |
|-----|-------------|------------------|----------|----------|
| (1) | א. 0.368 | ב. 0.865 | ג. 0.347 | |
| (2) | א. 24 שעות. | ב. 0.632 | ג. 0.135 | |
| (3) | א. 0.393 | ב. 0.239 | ג. 0.513 | ד. 69.08 |
| (4) | א. 0.264 | ב. 0.368 | ג. 0.233 | |
| (5) | א. 0.8403 | ב. $K < 0.0588A$ | | |

שיטות סטטיסטיות

פרק 3 - התפלגויות רציפות מיוחדות-התפלגות אחידה

תוכן העניינים

1. כללי..... 13

התפלגויות רציפות מיוחדות – התפלגות אחידה:

רקע:

זו התפלגות שפונקציית הצפיפות שלה קבועה בין a לבין b .

$$X \sim U(a, b)$$

פונקציית הצפיפות:

$$f(x) = \frac{1}{b-a} \\ a \leq x \leq b$$

פונקציית ההתפלגות המצטברת:

$$F(t) = \frac{t-a}{b-a}$$

התוחלת :

$$E(X) = \frac{a+b}{2}$$

השונות:

$$V(x) = \frac{(b-a)^2}{12}$$

דוגמה (פתרון בהקלטה):

X - משתנה מקרי רציף המתפלג באופן אחיד בין 20 ל-40.

מה הסיכוי ש- X קטן מ-25?

מה התוחלת והשונות של X ?

$$a = 20, b = 40$$

$$X \sim U(20, 40)$$

$$א. \quad P(x < 25) = f(25) = \frac{25 - 20}{40 - 20} = 0.25$$

$$E(x) = \frac{20 + 40}{2} = 30$$

$$ב. \quad V(x) = \frac{(40 - 20)^2}{12} = 33\frac{1}{3}$$

שאלות:

- (1) משך (בדקות) הפסקה בשיעור, X , מתפלג: $U(13,16)$.
- מהי התוחלת ומהי סטיית התקן של משך ההפסקה?
 - מהי ההסתברות שהפסקה תמשך יותר מ-15 דקות?
 - מהי ההסתברות שמשך ההפסקה יסטה מהתוחלת בפחות מדקה?
- (2) רכבת מגיעה לתחנה בשעות היום כל עשר דקות. אדם הגיע לתחנה בזמן אקראי.
- הסבר כיצד מתפלג זמן ההמתנה לרכבת?
 - אם זמן ההמתנה לרכבת ארך יותר מ-5 דקות, מהי ההסתברות שבסך הכל האדם ימתין לרכבת פחות מ-8 דקות?
 - מה תוחלת מספר הימים שיעברו עד הפעם הראשונה שהאדם ימתין לרכבת יותר מ-9 דקות?
- (3) מכונה אוטומטית ממלאת גביעי גלידה. משקל הגלידה לגביע מתפלג אחיד בין 100-110 גרם (המשקל הוא של גלידה ללא הגביע).
- מה ההסתברות שמשקל הגלידה בגביע יהיה מעל 108 גרם?
 - נתון שהגלידה בגביע עם משקל נמוך מ-107 גרם. מה ההסתברות שמשקל הגלידה יהיה מעל 105 גרם?
 - מה העשירון העליון של משקל הגלידה בגביע?
 - עלות גביע גלידה היא 0.5 שקל. כל גרם של גלידה עולה 0.22 אגורות. מהי התוחלת ומהי סטיית התקן של עלות הגביע ביחד עם הגלידה?

תשובות סופיות:

- (1) א. תוחלת: 14.5, שונות: 0.866. ב. $\frac{1}{3}$. ג. $\frac{2}{3}$.
- (2) א. $X \sim U(0,10)$. ב. 0.6. ג. 10.
- (3) א. 0.2. ב. $\frac{2}{7}$. ג. 109.
- ד. תוחלת: 73.1 אגורות, סטיית תקן: 0.635 אגורות.

שיטות סטטיסטיות

פרק 4 - התפלגויות רציפות מיוחדות - התפלגות נורמלית

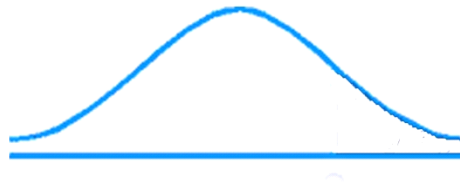
תוכן העניינים

1. כללי 16
2. התפלגות נורמלית (טבלת z כוללת ערכים שליליים) (ללא ספר)

התפלגויות רציפות מיוחדות – התפלגות נורמלית:

רקע:

התפלגות נורמלית הינה התפלגות של משתנה רציף. ישנם משתנים רציפים מסוימים שנהוג להתייחס אליהם כנורמליים כגון: זמן ייצור, משקל תינוק ביום היוולדו ועוד. פונקציית הצפיפות של ההתפלגות הנורמלית נראית כמו פעמון:



לעקומה זו קוראים גם עקומת גאוס ועקומה אחת נבדלת מהשנייה באמצעות הממוצע וסטיית התקן שלה.

אלה הם הפרמטרים שמאפיינים את ההתפלגות: $X \sim N(\mu, \sigma^2)$.

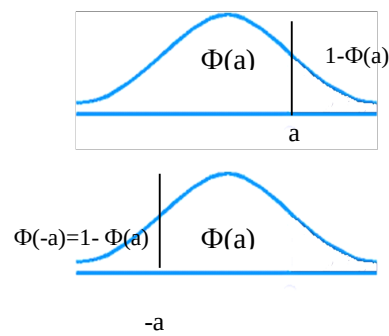
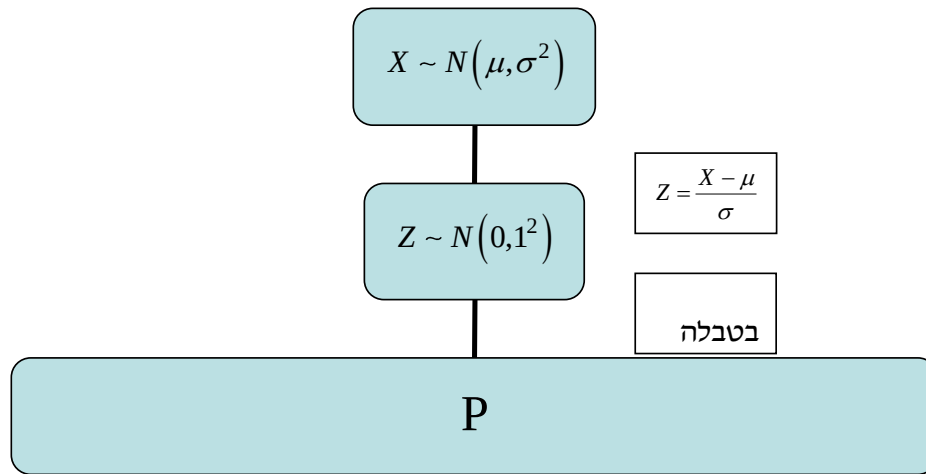
$$\text{נוסחת פונקציית הצפיפות: } f(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma^2}} e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}$$

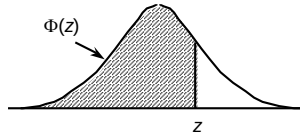
כדי לחשב הסתברויות בהתפלגות נורמלית יש לחשב את השטחים הרלוונטיים שמתחת לעקומה. כדי לחשב שטחים אלה נמיר כל התפלגות נורמלית להתפלגות נורמלית סטנדרטית על ידי תהליך הנקרא תקנון. התפלגות נורמלית סטנדרטית היא התפלגות נורמלית שהממוצע שלה הוא אפס וסטיית התקן היא אחת, והיא תסומן באות Z : $Z \sim N(0, 1^2)$.

$$\text{תהליך התקנון מבוצע על ידי הנוסחה הבאה: } Z = \frac{X - \mu}{\sigma}$$

אחרי תקנון מקבלים ערך הנקרא ציון תקן. ציון התקן משמעו בכמה סטיות תקן הערך סוטה מהממוצע.

לאחר חישוב ציון התקן של ערך מסוים נעזרים בטבלה של ההתפלגות הנורמלית הסטנדרטית לחישוב השטח הרצוי, ובאופן כללי נתאר את הסכמה הבאה:



טבלת ההתפלגות המצטברת הנורמלית סטנדרטית – ערכי $\Phi(z)$:


z	.00	.01	.02	.03	.04	.05	.06	.07	.08	.09
0.0	.5000	.5040	.5080	.5120	.5160	.5199	.5239	.5279	.5319	.5359
0.1	.5398	.5438	.5478	.5517	.5557	.5596	.5636	.5675	.5714	.5753
0.2	.5793	.5832	.5871	.5910	.5948	.5987	.6026	.6064	.6103	.6141
0.3	.6179	.6217	.6255	.6293	.6331	.6368	.6406	.6443	.6480	.6517
0.4	.6554	.6591	.6628	.6664	.6700	.6736	.6772	.6808	.6844	.6879
0.5	.6915	.6950	.6985	.7019	.7054	.7088	.7123	.7157	.7190	.7224
0.6	.7257	.7291	.7324	.7357	.7389	.7422	.7454	.7486	.7517	.7549
0.7	.7580	.7611	.7642	.7673	.7704	.7734	.7764	.7794	.7823	.7852
0.8	.7881	.7910	.7939	.7967	.7995	.8023	.8051	.8078	.8106	.8133
0.9	.8159	.8186	.8212	.8238	.8264	.8289	.8315	.8340	.8365	.8389
1.0	.8413	.8438	.8461	.8485	.8508	.8531	.8554	.8577	.8599	.8621
1.1	.8643	.8665	.8686	.8708	.8729	.8749	.8770	.8790	.8810	.8830
1.2	.8849	.8869	.8888	.8907	.8925	.8944	.8962	.8980	.8997	.9015
1.3	.9032	.9049	.9066	.9082	.9099	.9115	.9131	.9147	.9162	.9177
1.4	.9192	.9207	.9222	.9236	.9251	.9265	.9279	.9292	.9306	.9319
1.5	.9332	.9345	.9357	.9370	.9382	.9394	.9406	.9418	.9429	.9441
1.6	.9452	.9463	.9474	.9484	.9495	.9505	.9515	.9525	.9535	.9545
1.7	.9554	.9564	.9573	.9582	.9591	.9599	.9608	.9616	.9625	.9633
1.8	.9641	.9649	.9656	.9664	.9671	.9678	.9686	.9693	.9699	.9706
1.9	.9713	.9719	.9726	.9732	.9738	.9744	.9750	.9756	.9761	.9767
2.0	.9772	.9778	.9783	.9788	.9793	.9798	.9803	.9808	.9812	.9817
2.1	.9821	.9826	.9830	.9834	.9838	.9842	.9846	.9850	.9854	.9857
2.2	.9861	.9864	.9868	.9871	.9875	.9878	.9881	.9884	.9887	.9890
2.3	.9893	.9896	.9898	.9901	.9904	.9906	.9909	.9911	.9913	.9916
2.4	.9918	.9920	.9922	.9925	.9927	.9929	.9931	.9932	.9934	.9936
2.5	.9938	.9940	.9941	.9943	.9945	.9946	.9948	.9949	.9951	.9952
2.6	.9953	.9955	.9956	.9957	.9959	.9960	.9961	.9962	.9963	.9964
2.7	.9965	.9966	.9967	.9968	.9969	.9970	.9971	.9972	.9973	.9974
2.8	.9974	.9975	.9976	.9977	.9977	.9978	.9979	.9979	.9980	.9981
2.9	.9981	.9982	.9982	.9983	.9984	.9984	.9985	.9985	.9986	.9986
3.0	.9987	.9987	.9987	.9988	.9988	.9989	.9989	.9989	.9990	.9990
3.1	.9990	.9991	.9991	.9991	.9992	.9992	.9992	.9992	.9993	.9993
3.2	.9993	.9993	.9994	.9994	.9994	.9994	.9994	.9995	.9995	.9995
3.3	.9995	.9995	.9995	.9996	.9996	.9996	.9996	.9996	.9996	.9997
3.4	.9997	.9997	.9997	.9997	.9997	.9997	.9997	.9997	.9997	.9998

z	1.282	1.645	1.960	2.326	2.576	3.090	3.291	3.891	4.417
$\Phi(z)$	0.90	0.95	0.975	0.99	0.995	0.999	0.9995	0.99995	0.999995

דוגמה (הפתרון בהקלטה):

משקל חפיסות שוקולד המיוצרות בחברה מתפלג נורמלית עם ממוצע 100 גרם בסטיית תקן של 8 גרם.

- (1) מה אחוז חפיסות השוקולד ששוקלות מתחת ל-110 גרם?
- (2) מה אחוז חפיסות השוקולד ששוקלות מעל 110 גרם?
- (3) מה אחוז חפיסות השוקולד ששוקלות מתחת ל-92 גרם?
- (4) מהו המשקל ש-90% מהחפיסות בקו הייצור שוקלים פחות מהם?

שאלות:

(1) הגובה של אנשים באוכלוסייה מסוימת מתפלג נורמלית עם ממוצע של 170 ס"מ וסטית תקן של 10 ס"מ.

- א. מה אחוז האנשים שגובהם מתחת ל-182.4 ס"מ?
- ב. מה אחוז האנשים שגובהם מעל 190 ס"מ?
- ג. מה אחוז האנשים שגובהם בדיוק 173.6 ס"מ?
- ד. מה אחוז האנשים שגובהם מתחת ל-170 ס"מ?
- ה. מה אחוז האנשים שגובהם לכל היותר 170 ס"מ?

(2) נתון שהזמן שלוקח לתרופה מסוימת להשפיע מתפלג נורמלית עם ממוצע של 30 דקות ושונות של 9 דקות רבועות.

- א. מהי פרופורציית המקרים בהן התרופה תעזור אחרי יותר משעה?
- ב. מה אחוז מהמקרים שבהן התרופה תעזור בין 35 ל-37 דקות?
- ג. מה הסיכוי שהתרופה תעזור בדיוק תוך 36 דקות?
- ד. מה שיעור המקרים שבהן ההשפעה של התרופה תסטה מ-30 דקות בפחות מ-3 דקות?

(3) המשקל של אנשים באוכלוסייה מסוימת מתפלג נורמלית עם ממוצע של 60 ק"ג וסטיית תקן של 8 ק"ג.

- א. מה אחוז האנשים שמשקלם נמוך מ-55 ק"ג?
- ב. מהי פרופורציית האנשים באוכלוסייה שמשקלם לפחות 50 ק"ג?
- ג. מהי השכיחות היחסית של האנשים באוכלוסייה שמשקלם בין 60 ל-70 ק"ג?
- ד. לאיזה חלק מהאוכלוסייה משקל הסוטה מהמשקל הממוצע בלא יותר מ-4 ק"ג?
- ה. מה הסיכוי שאדם אקראי ישקול מתחת ל-140 ק"ג?

(4) משקל תינוקות ביום היוולדם מתפלג נורמלית עם ממוצע של 3300 גרם וסטיית תקן 400 גרם.

- א. מצאו את העשירון העליון.
- ב. מצאו את האחוזון ה-95.
- ג. מצאו את העשירון התחתון.

- (5) ציוני מבחן אינטליגנציה מתפלגים נורמלית עם ממוצע 100 ושונות 225.
- א. מה העשירון העליון של הציונים במבחן האינטליגנציה?
 - ב. מה העשירון התחתון של ההתפלגות?
 - ג. מהו הציון ש-20% מהנבחנים מקבלים מעליו?
 - ד. מהו האחוזון ה-20?
 - ה. מהו הציון ש-5% מהנבחנים מקבלים מתחתיו?
- (6) נפח משקה בבקבוק מתפלג נורמלית עם סטיית תקן של 20 מ"ל, ונתון ש-33% מהבקבוקים בעלי נפח שעולה על 508.8 מ"ל.
- א. מה ממוצע נפח משקה בבקבוק?
 - ב. 5% מהבקבוקים המיוצרים עם הנפח הגבוה ביותר נשלחים לבדיקה, החל מאיזה נפח שולחים בקבוק לבדיקה?
 - ג. 1% מהבקבוקים עם הנפח הקטן ביותר נתרמים לצדקה, מהו הנפח המקסימלי לצדקה?
- (7) אורך חיים של מכשיר מתפלג נורמלית. ידוע שמחצית מהמכשירים חיים פחות מ-500 שעות, כמו כן ידוע ש-67% מהמכשירים חיים פחות מ-544 שעות.
- א. מהו ממוצע אורך חיי מכשיר?
 - ב. מהי סטית בתקן של אורך חיי מכשיר?
 - ג. מה הסיכוי שמכשיר אקראי יחיה פחות מ-460 שעות?
 - ד. מהו המאיון העליון של אורך חיי מכשיר?
 - ה. 1% מהמכשירים בעלי אורך החיים הקצר ביותר נשלח למעבדה לבדיקה מעמיקה. מהו אורך החיים המקסימלי לשליחת מכשיר למעבדה?
- (8) להלן שלוש התפלגויות נורמליות של שלוש קבוצות שונות ששורטטו באותה מערכת צירים. ההתפלגויות מוספרו כדי להבדיל ביניהן.
- א. לאיזו התפלגות הממוצע הגבוה ביותר?
 - ב. במה מבין המדדים הבאים התפלגות 1 ו-2 זהות?
 - i. בעשירון העליון.
 - ii. בממוצע.
 - iii. בשונות.
 - ג. לאיזו התפלגות סטיית התקן הקטנה ביותר?
 - i. 1.
 - ii. 2.
 - iii. 3.
 - iv. אין לדעת.



- (9)** הזמן שלוקח לאדם להגיע לעבודתו מתפלג נורמלית עם ממוצע של 40 דקות וסטית תקן של 5 דקות.
- א. מה ההסתברות שמשך הנסיעה של האדם לעבודתו יהיה לפחות שלושת רבעי השעה?
- ב. אדם יצא לעבודתו בשעה 08:10 מביתו. הוא צריך להגיע לעבודתו בשעה 09:00. מה הסיכוי שיאחר לעבודתו?
- ג. אם ידוע שזמן נסיעתו לעבודה היה יותר משלושת רבעי השעה. מה ההסתברות שזמן הנסיעה הכולל יהיה פחות מ-50 דקות?
- ד. מה הסיכוי שבשבוע (חמישה ימי עבודה) בדיוק פעם אחת יהיה זמן הנסיעה לפחות שלושת רבעי השעה?
- (10)** ההוצאה החודשית לבית אב בעיר "טרירה" מתפלגת נורמלית עם ממוצע של 2000 דולר וסטית תקן של 300 דולר. בחרו באקראי 5 בתי אב. ההסתברות שלפחות אחד מהם מוציא בחודש מעל ל- T דולר היא 0.98976.
- א. מה ערכו של T ?
- ב. מה הסיכוי שההוצאה החודשית של בית אב בעיר תהיה לפחות סטיית תקן אחת מעל T ?
- ג. מסתבר שנפלה טעות בנתונים, ויש להוסיף 100 דולר להוצאות החודשית של כל בתי האב בעיר. לאור זאת, מה ההסתברות שההוצאה החודשית של בית אב נמוכה מ-1800 דולר?
- (11)** אורך שיר אקראי המשודר ברדיו מתפלג נורמלית עם תוחלת של 3.5 דקות וסטית תקן של שלושים שניות.
- א. מה ההסתברות שאורך של שיר אקראי המנוגן ברדיו יהיה בין 3 ל-2.5 דקות?
- ב. מהו הטווח הבין רבעוני של אורך שיר המשודר ברדיו?
- ג. ביום מסוים מנוגנים 200 שירים ברדיו. כמה שירים מתוכם תצפה שיהיו באורך הנמוך מ-3.5 דקות?
- ד. בשעה מסוימת שודרו 8 שירים. מה ההסתברות שרבע מהם בדיוק היו ארוכים מ-4 דקות והיתר לא?

תשובות סופיות:

1	א. 89.25%	ב. 2.28%	ג. 0.	ד. 50%	ה. 50%
2	א. 0%	ב. 3.76%	ג. 0%	ד. 68.26%	
3	א. 26.43%	ב. 89.44%	ג. 39.44%	ד. 0.383	
	ה. 100%				
4	א. 3812.8	ב. 3958	ג. 2787.2		
5	א. 119.2	ב. 80.8	ג. 112.6	ד. 87.4	
6	א. 500	ב. 532.9	ג. 453.48		
7	א. 500	ב. 100	ג. 0.3446	ד. 733	
	ה. 267				
8	א. 3	ב. בממוצע.	ג. 1		
9	א. 0.1587	ב. 0.0228	ג. 0.8563	ד. 0.3975	
10	א. 1925	ב. 0.2266	ג. 0.1587		
11	א. 0.1359	ב. 0.675	ג. 100	ד. 0.25	

שיטות סטטיסטיות

פרק 5 - טרנספורמציה על משתנה מקרי רציף

תוכן העניינים

1. כללי 24

טרנספורמציה על משתנה מקרי רציף:

רקע:

מצב שבו ידועה לנו התפלגות של משתנה מקרי רציף כלשהו ואז יוצרים משתנה מקרי חדש שהוא פונקציה של המשתנה המקרי הידוע.

דוגמה (פתרון בהקלטה):

נתון משתנה מקרי רציף X המתפלג אחיד בין 0 ל-1.
מצאו את פונקציית ההתפלגות המצטברת של המשתנה Y ,
כאשר הקשר בין X ל- Y נתון על ידי הנוסחה: $Y = e^x$.

שאלות:

- (1) יהי W משתנה מקרי המתפלג מעריכית עם תוחלת השווה ל-1. הגדירו משתנה חדש: $Y = e^{-W}$.
 א. מצאו את פונקציית ההתפלגות המצטברת של Y .
 ב. זהו את Y כהתפלגות מיוחדת וקבע מהם הפרמטרים.
- (2) נתון: $X \sim U(0,1)$, ויוצרים דרך X משתנה חדש המוגדר להיות: $R = X^2$.
 מצאו את פונקציית הצפיפות של המשתנה החדש R .
- (3) ידוע ש- $X \sim \exp(\lambda)$. כמו כן, נתון הקשר הבא: $Y = \ln(X)$.
 הוכיחו שפונקציית הצפיפות של Y נתונה על ידי הנוסחה הבאה: $f(Y) = \lambda \cdot e^{-\lambda \cdot e^Y + 1}$.
- (4) ידוע ש- $X \sim \exp(\lambda=1)$. כמו כן, נתון הקשר הבא: $Y = 1 - 2 \cdot e^{-X}$.
 א. מצאו את פונקציית ההתפלגות המצטברת של Y .
 ב. זהו את ההתפלגות של Y .
- (5) אורך מקצוע של קובייה מתפלג אחיד בין 1 ל-2. מצאו את פונקציית הצפיפות של נפח הקובייה.
- (6) נתונה פונקציית ההתפלגות המצטברת הבאה: $F_X(t) = \theta^t - 1$, עבור התחום: $0 \leq t \leq 1$.
 א. מצאו את ערכו של הפרמטר θ .
 ב. מצאו את פונקציית הצפיפות של המשתנה X .
 ג. יהי $Y = 2^X - 1$.
 מצאו את פונקציית הצפיפות של Y וזהו את התפלגותו.

תשובות סופיות:

(1) ב. $Y \sim U(0,1)$.

(2) $f(R) = \frac{1}{2\sqrt{R}}$ כאשר $1 > R > 0$.

(3) שאלת הוכחה.

(4) ב. $Y \sim U(-1,1)$.

(5) $f(y) = \frac{1}{3}y^{-\frac{2}{3}}$ כאשר $1 < y < 8$.

(6) א. 2. ב. $Y \sim U(0,1)$.

שיטות סטטיסטיות

פרק 6 - נוסחת התוחלת השלמה

תוכן העניינים

1. כללי 27

נוסחת התוחלת השלמה:

רקע:

כאשר התפלגות של משתנה X תלויה במשתנה אחר Y , מתקיים: $E(X) = E[E(X/Y)]$.

עבור משתנה Y בדיד כלשהו: $E(X) = \sum_y E(X | Y = y) \cdot P(Y = y)$.

עבור משתנה Y רציף כלשהו: $E(X) = \int_{-\infty}^{\infty} E(X | Y = y) \cdot f(y) dy$.

דוגמה (הפתרון בהקלטה):

מרצה מלמד שתי כיתות. הוא מעוניין לבדוק 5 מחברות בחינה.

בכיתה מספר 1: 10 בנים ו-20 בנות.

בכיתה מספר 2: 15 בנים ו-15 בנות.

המרצה בוחר כיתה באופן מקרי וממנה בוחר 5 מחברות בחינה באקראי.

יהי X מספר מחברות הבחינה של בנים שנבחרו.

יש לחשב את $E(X)$.

שאלות:

(1) בכד 2 כדורים ירוקים, 4 כדורים כחולים ו-4 אדומים. שולפים כדור באקראי. אם הכדור ירוק מטיילים קובייה עד אשר מתקבלת התוצאה 1. אם הכדור כחול מטיילים קובייה עד אשר מתקבלת התוצאה 5. אם הכדור אדום מטיילים קובייה עד אשר מתקבלת תוצאה זוגית. חשבו את תוחלת מספר הפעמים שהקובייה הוטלה.

(2) מטיילים n מטבעות ומוציאים מהמשחק את כל המטבעות שהראו ראש. כעת מטיילים את כל המטבעות שנותרו. בטאו באמצעות n את תוחלת מספר הראשים שהתקבלו בסבב השני של ההטלות.

(3) בהגרלה מבצעים את התהליך הבא: בסיכוי 0.25 מגרילים מספר ממכונה A בסיכוי 0.75 מגרילים מספר ממכונה B. במכונה A המספר המוגרל מתפלג פואסונית עם תוחלת 6. במכונה B המספר המוגרל מתפלג פואסונית עם תוחלת 2. אם הוגרל המספר 0 זוכים ב-15 ₪. אחרת זוכים ב-50 ₪. חשבו את תוחלת סכום הזכיה.

(4) נתון ש- $Y/X \sim U(0, X)$, כאשר פונקציית הצפיפות של X

$$f(x) = \begin{cases} 0.1 & 2 \leq x \leq 6 \\ 0.2 & 6 < x \leq 9 \\ 0 & \text{אחרת} \end{cases} \quad \text{הינה:}$$

חשבו את $E(Y)$.

(5) בתכנית הריאליטי "המרוץ למיליון" מגיעים לנקודה שבה שלוש אפשרויות בפני המתמודדים: נקודה A - שבה חוזרים אחרי 1 שעות לנקודת המוצא. נקודה B - שבה חוזרים אחרי 2 שעות לנקודת המוצא ונקודה C - המובילה תוך 2 שעות לנקודת הסיום. המתמודדים בוחרים בכל פעם את הנקודה באופן מקרי. נסמן ב- X את זמן ההגעה לנקודת הסיום. חשבו את $E(Y)$.

תשובות סופיות:

(1) 4.4.

(2) $\frac{n}{4}$.

(3) 46.4.

(4) 3.05.

(5) .5

שיטות סטטיסטיות

פרק 7 - נוסחת השונות השלמה (שונות של משתנה מותנה)

תוכן העניינים

1. נוסחת השונות השלמה (שונות של משתנה מותנה) 30

נוסחת השונות השלמה (המותנית):

רקע:

כאשר התפלגות של משתנה X תלויה במשתנה אחר Y , מתקיים: $E(X) = E[E(X|Y)]$.
 כמו כן, מתקיים לגבי השונות: $\text{Var}(X) = \text{Var}(E[X|Y]) + E[\text{Var}(X|Y)]$.

דוגמה (הפתרון בהקלטה):

מרצה מלמד שתי כיתות. הוא מעוניין לבדוק 5 מחברות בחינה.
 בכיתה מספר 1: 10 בנים ו-20 בנות.
 בכיתה מספר 2: 15 בנים ו-15 בנות.
 המרצה בוחר כיתה באופן מקרי וממנה בוחר 5 מחברות בחינה באקראי.
 יהי X מספר מחברות הבחינה של בנים שנבחרו.
 יש לחשב את $V(X)$.

שאלות:

- (1) בכד 2 כדורים ירוקים, 4 כדורים כחולים ו-4 אדומים. שולפים כדור באקראי. אם הכדור ירוק מטיילים קובייה עד אשר מתקבלת התוצאה 1.
אם הכדור כחול מטיילים קובייה עד אשר מתקבלת התוצאה 5.
אם הכדור אדום מטיילים קובייה עד אשר מתקבלת תוצאה זוגית.
חשבו את התוחלת והשונות של מספר הפעמים שהקובייה הוטלה.

- (2) נטיל קובייה: $Y+4$ פעמים. נתון ש- $Y \sim P(4)$.
נגדיר את X כמספר הפעמים שהתקבלה התוצאה 2.
א. מצאו את התוחלת של X .
ב. מצאו את השונות של X .

- (3) נתון ש- $Y|X \sim U(0, X)$, כאשר פונקציית הצפיפות של X

$$f(x) = \begin{cases} 0.1 & 2 \leq x \leq 6 \\ 0.2 & 6 < x \leq 9 \\ 0 & \text{אחרת} \end{cases} \quad \text{הינה:}$$

חשבו את $V(Y)$.

תשובות סופיות:

- (1) תוחלת: 4.4, שונות: 22.64.
(2) תוחלת: $\frac{4}{3}$, שונות: $\frac{11}{9}$.
(3) 4.4

שיטות סטטיסטיות

פרק 8 - המשתנה המקרי הדו ממדי הרציף

תוכן העניינים

1. משתנה דו ממדי רציף 32

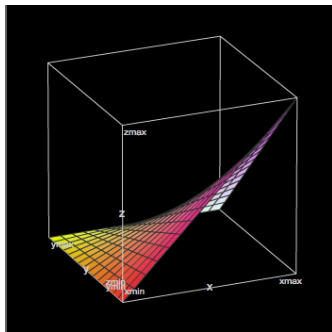
משתנה מקרי דו ממדי רציף:

רקע:

יהיו X ו- Y משתנים מקריים רציפים המוגדרים בתחום R מסוים. פונקציית הצפיפות המשותפת שלהם תסומן על ידי $f(x, y)$. פונקציית צפיפות משותפת צריכה לקיים את שני התנאים הבאים:

$$(1) \quad f(x, y) \geq 0 \quad \text{לכל } (x, y) \in R$$

$$(2) \quad \iint_R f(x, y) dx dy = 1$$



דוגמה (פתרון בהקלטה):

$$f(x, y) = \begin{cases} 4x(1-y) & 0 \leq x, y \leq 1 \\ 0 & \text{else} \end{cases} : \text{נתונה הפונקציה}$$

הראו שפונקציה זו יכולה להיות פונקציית צפיפות משותפת.

פונקציית צפיפות שולית:

$$f(x) = \int_{-\infty}^{\infty} f(x, y) dy : \text{פונקציית הצפיפות השולית של } X \text{ תתקבל באופן הבא}$$

$$f(y) = \int_{-\infty}^{\infty} f(x, y) dx : \text{פונקציית הצפיפות השולית של } Y \text{ תתקבל באופן הבא}$$

דוגמה (פתרון בהקלטה):

$$f(x, y) = \begin{cases} 4x(1-y) & 0 \leq x, y \leq 1 \\ 0 & \text{else} \end{cases} : \text{מצאו לפונקציית הצפיפות}$$

את פונקציית הצפיפות השולית של X , וחשבו את $E(X)$ דרכה.

אי-תלות בין משתנים רציפים:

X ו- Y יהיו משתנים מקרים בלתי תלויים, אם עבור כל X ו- Y בתחום ההגדרה R מתקיים ש:

$$f(x, y) = f(x) \cdot f(y)$$

דוגמה (פתרון בהקלטה):

האם X ו- Y , המתפלגים לפי פונקציית הצפיפות המשותפת:

$$f(x, y) = \begin{cases} 4x(1-y) & 0 \leq x, y \leq 1 \\ 0 & \text{else} \end{cases}$$

הם משתנים בלתי תלויים?

חישוב הסתברויות עבור משתנה מקרי רציף דו ממדי:

הנפח הכלוא מתחת למשטח $f(x, y)$ בתחום מסוים ייתן את ההסתברות ש- X

$$\text{ו-} Y \text{ יהיו בתחום הזה: } P[(x, y) \in A] = \iint_A f(x, y) dx dy$$

דוגמה (פתרון בהקלטה):

$$f(x, y) = \begin{cases} 4x(1-y) & 0 \leq x, y \leq 1 \\ 0 & \text{else} \end{cases} \quad \text{משתנים מתפלגים לפי פונקציית הצפיפות:}$$

$$P(X < 0.5 \cap Y < 0.5) \quad \text{חשבו את הסיכוי:}$$

פונקציית התפלגות מצטברת משותפת:

פונקציית התפלגות מצטברת משותפת הינה פונקציה של שני משתנים רציפים המחזירה את הסיכוי שהמשתנים יהיו קטנים מערכים מסוימים:

$$F(s, t) = P(X \leq s \cap Y \leq t) = \int_{-\infty}^t \int_{-\infty}^s f(x, y) dx dy$$

דוגמה (פתרון בהקלטה):

$$f(x, y) = \begin{cases} 4x(1-y) & 0 \leq x, y \leq 1 \\ 0 & \text{else} \end{cases} \quad \text{משתנים מתפלגים לפי פונקציית הצפיפות:}$$

מצאו את פונקציית ההתפלגות המצטברת המשותפת

$$\text{ועל פיה חשבו את הסיכוי: } P(X < 0.5 \cap Y < 0.5)$$

פונקציית צפיפות מותנית:

אם ל- X ול- Y ישנה פונקציית צפיפות משותפת $f(x, y)$, אז מגדירים את פונקציית הצפיפות המותנית של X , בהינתן ש- $Y = y$ לכל ערכי y

$$\text{המקיימים: } f(y) > 0 \text{ על ידי: } f(x|y) = \frac{f(x, y)}{f(y)}$$

באופן דומה, פונקציית הצפיפות המותנית של Y בהינתן ש- $X = x$ לכל ערכי x

$$\text{המקיימים: } f(x) > 0 \text{ על ידי: } f(y|x) = \frac{f(x, y)}{f(x)}$$

דוגמה (פתרון בהקלטה):

$$f(x, y) = \begin{cases} 4x(1-y) & 0 \leq x, y \leq 1 \\ 0 & \text{else} \end{cases} \quad \text{משתנים מתפלגים לפי פונקציית הצפיפות:}$$

$$\text{מצאו את: } f(x|y)$$

תוחלת מותנית:

ל- X ול- Y ישנה פונקציית צפיפות משותפת $f(x, y)$.

$$\text{התוחלת של } X \text{ בהינתן ש- } Y = y \text{ תהיה: } E(X|Y=y) = \int_{-\infty}^{\infty} x \cdot f(x|y) dx$$

ובאופן דומה, התוחלת של Y בהינתן ש- $X = x$ תהיה:

$$E(Y|X=x) = \int_{-\infty}^{\infty} y \cdot f(y|x) dy$$

דוגמה (פתרון בהקלטה):

$$f(x, y) = \begin{cases} 4x(1-y) & 0 \leq x, y \leq 1 \\ 0 & \text{else} \end{cases} \quad \text{משתנים מתפלגים לפי פונקציית הצפיפות:}$$

$$\text{מצאו את: } E(X|Y)$$

שאלות:

- (1) נתונה פונקציית הצפיפות הבאה: $f(x, y) = x + y$, המוגדרת בתחום שבו: $0 \leq x \leq 1$ וגם: $0 \leq y \leq 1$. הוכיחו שמדובר בפונקציית צפיפות.
- (2) נתונה פונקציית הצפיפות הבאה: $f(x, y) = Ax(x - y)$, המוגדרת בתחום שבו: $0 \leq x \leq 2$ וגם: $-x \leq y \leq x$. מצאו את ערכו של הפרמטר A .
- (3) נתונה פונקציית הצפיפות הבאה: $f(x, y) = \frac{(x \cdot y)^3 + x \cdot y}{C}$, המוגדרת בתחום שבו: $0 \leq x \leq 1$ וגם: $0 \leq y \leq 1$.
 א. מצאו את ערכו של C .
 ב. מצאו את $f(y)$.
 ג. האם X ו- Y הינם משתנים בלתי תלויים?
- (4) משתנה מקרי דו ממדי מתפלג לפי פונקציית הצפיפות הבאה: $f(x, y) = \frac{1}{800}$, המוגדרת בתחום שבו: $60 \leq x \leq y$ וגם: $60 \leq y \leq 100$.
 א. הראו שפונקציה זו מקיימת את התנאים של פונקציית צפיפות.
 ב. מצאו את פונקציית הצפיפות השולית של Y .
 ג. חשבו את $E(X)$, $V(X)$.
 ד. האם X ו- Y הם משתנים בלתי תלויים?
 ה. חשבו את מקדם המתאם בין X ל- Y .
 ו. חשבו את הסיכוי: $P(Y > X + 10)$.
- (5) משתנה מקרי דו ממדי מתפלג לפי פונקציית הצפיפות הבאה:
 $f(x, y) = \lambda\mu \cdot e^{-(\lambda x + \mu y)}$, המוגדרת בתחום שבו: $x, y > 0$.
 א. מצאו את פונקציית הצפיפות של X ואת פונקציית הצפיפות של Y .
 ב. האם X ו- Y הם משתנים תלויים?
 ג. מהו מקדם המתאם בין X ל- Y ?
 ד. חשבו את הסיכוי: $P(Y > X)$.

(6) Y הינו משתנה מקרי אחיד רציף המתפלג בקטע: $[2, 4]$.

בנוסף, נתון ש- X הינו משתנה מקרי רציף המקיים: $0 \leq x \leq y$, $f(x|y) = \frac{2x}{y^2}$.
מצאו את השונות המשותפת של X ו- Y .

(7) נתונים שני משתנים מקרים רציפים X ו- Y . פונקציות הצפיפות

$$f(x, y) = \begin{cases} x & 0 < y < 1 \\ 0 & \text{else} \end{cases} \quad 1 - y \leq x \leq 1 + y$$

המשותפות שלהם היא:

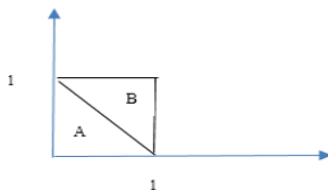
- מצאו את $f(x)$.
- מצאו את $f(y|x)$.
- מצאו את $E(Y|X)$.

(8) יהיו X ו- Y משתנים רציפים המתפלגים אחיד בתוך משולש שקדקודיו: $(-1, 2)$, $(-1, 0)$, $(0, 1)$.

- רשמו את פונקציית הצפיפות המשותפת.
- מצאו את פונקציית הצפיפות השולית של X ו- Y .
- חשבו את התוחלת של X ו- Y .
- האם X ו- Y משתנים בלתי מתואמים?
- האם X ו- Y משתנים בלתי תלויים?

(9) פונקציית צפיפות משותפת מקבלת ערך אחיד באופן הבא:

הצפיפות על פני משולש A הינה 1.5 והצפיפות על פני משולש B היא 0.5.
האם פונקציית הצפיפות המשותפת היא לגיטימית?



- מצאו את $f(x)$.
- מצאו את $f(x|y)$.

(10) נתונה פונקציית הצפיפות המשותפת: $f(x, y) = cx$. פונקציה זו מוגדרת

בתחום שבו: $0 \leq x \leq 1$ וכן: $0 \leq y \leq x^2$.

- מצאו את הקבוע C .
- חשבו את ההסתברות ש- $6Y < 1 - X$.

11 נתונים X ו- Y שני משתנים מקריים רציפים כך ש: $Y \sim U(0,1)$

ו- $X|Y=y \sim U(0, \sqrt{y})$. חשבו את: $E(Y|X=0.5)$.

12 נתונה פונקציית הצפיפות: $f(x,y) = 2e^{-x} \cdot e^{-2y}$ בתחום שבו: $x, y \geq 0$.

חשבו את הסיכוי: $P(X < Y)$.

13 נתונה פונקציית הצפיפות המשותפת: $f(x,y) = \frac{e^{-y} \cdot e^{-\frac{x}{y}}}{y}$, המוגדרת לרביע

הראשון. חשבו את: $P(X > 1|Y=2)$.

14 יוסי וערן עובדים באותו המשרד. הם מגיעים לעבודה בכל יום בין 8:00 ל-9:00.

נניח שזמן ההגעה של כל אחד מתפלג אחיד ובאופן בלתי תלוי זה בזה.

מה הסיכוי שיוסי יצטרך לחכות לערן יותר מ-10 דקות?

15 נתונים שני משתנים מקרים רציפים: $X \sim N(Y,1)$ ו- $Y \sim U(0,2)$.

א. מצאו את פונקציית הצפיפות המשותפת של X ו- Y .

ב. מצאו את $E(X^2|Y)$.

ג. מצאו את $E(X)$.

16 פונקציית הצפיפות המשותפת של X ו- Y היא: $f(x,y)=1$.

פונקציה זו מוגדרת בתחומי: $0 \leq x, y \leq 1$.

הוכיחו ש: $E(|X-Y|^n) = \frac{2}{(n+1)(n+2)}$.

17 $X \sim \exp(1)$ וכן: $Y \sim \exp(1)$, הינם משתנים מקרים בלתי תלויים.

נגדיר את: $Z = \frac{X}{X+Y}$.

הוכיחו: $Z \sim U(0,1)$.

תשובות סופיות:

(1) שאלת הוכחה.

(2) $A = \frac{1}{8}$

(3) א. $\frac{5}{16}$ ב. $f(y) = 0.8y^3 + 1.6y$ ג. תלויים.

(4) א. שאלת הוכחה. ב. $f(y) = \frac{y-60}{800}$ ג. $E(X) = 73\frac{1}{3}$, $V(X) = 88\frac{8}{9}$

ד. לא. ה. 0.5 ו. 0.5625

(5) א. $f(y) = \mu e^{-\mu y}$, $f(x) = \lambda e^{-\lambda x}$ ב. לא.

ג. 0. ד. $\frac{\lambda}{\lambda + \mu}$

(6) $\frac{2}{9}$

(7) א. $f(x) = \begin{cases} x^2 & 0 \leq x < 1 \\ 2x - x^2 & 1 \leq x \leq 2 \\ 0 & \text{else} \end{cases}$

$$E(y|x) = \begin{cases} 1 - \frac{x}{2} & 0 \leq x < 1 \\ \frac{x}{2} & 1 \leq x \leq 2 \\ 0 & \text{else} \end{cases} \quad \text{ג.}$$

$$f(y|x) = \begin{cases} \frac{1}{x} & 0 \leq x < 1 \quad 1-x < y < 1 \\ \frac{1}{2-x} & 1 \leq x \leq 2 \quad x-1 < y < 1 \\ 0 & \text{else} \end{cases} \quad \text{ב.}$$

(8) א. $f(x, y) = \begin{cases} 1 & 1+x < y < 1-x-1 < x < 0 \\ 0 & \text{else} \end{cases}$

$$f(y) = \begin{cases} y & 0 \leq y < 1 \\ 2-y & 1 \leq y \leq 2 \\ 0 & \text{else} \end{cases}, \quad f(x) = \begin{cases} -2x & -1 < x < 0 \\ 0 & \text{else} \end{cases} \quad \text{ב.}$$

ג. $E(X) = -\frac{2}{3}$, $E(Y) = 1$ ד. כן.

ה. לא.

(9) א. כן. ב. $f(x) = \begin{cases} 1.5 - x & 1 < x < 0 \\ 0 & \text{else} \end{cases}$

ג. $f(x|y) = \begin{cases} \frac{1.5}{1.5-y} & 0 \leq x < 1-y \\ \frac{0.5}{1.5-y} & 1-y \leq x \leq 1 \\ 0 & \text{else} \end{cases}$

(10) א. 4. ב. 0.0947.

(11) $\frac{7}{12}$

(12) $\frac{1}{3}$

(13) $e^{-\frac{1}{2}}$

(14) $\frac{25}{72}$

(15) א. $f(x, y) = \begin{cases} \frac{1}{2\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{(x-y)^2}{2}} & 0 < y < 2 \\ 0 & \text{else} \end{cases}$ ב. $y^2 + 1$

ג. 1.

(16) שאלת הוכחה.

(17) שאלת הוכחה.

שיטות סטטיסטיות

פרק 9 - אמידה נקודתית (אומד חסר נטיה, קרטיון mse , אנ"מ ועוד)

תוכן העניינים

40	1. אומד חסר הטייה
47	2. אומד נראות מקסימלית
55	3. MSE
58	4. אומד עקיב
60	5. אומד חסר הטיה בעל שונות מינימלית
62	6. אומד נראות מקסימלית לשני פרמטרים (דו ממדי)
67	7. שאלות מסכמות

אומד חסר הטייה:

רקע:

$\hat{\theta}$ יהיה אומד חסר הטיה ל- θ , אם התוחלת של $\hat{\theta}$ תהיה שווה ל- θ : $E(\hat{\theta}) = \theta$.

דוגמה (פתרון בהקלטה):

המשתנה X הוא בעל פונקציית ההסתברות הבאה:

3	2	1	X
4θ	$1 - 60\theta$	2θ	הסתברות

מעוניינים לאמוד את θ על סמך שתי תצפיות מההתפלגות: X_1 ו- X_2 .

א. הראו שהאומד: $T_1 = \frac{2X_1 + X_2}{2}$, הוא אומד מוטה ל- θ .

הטיה של אומד היא: $E(\hat{\theta}) - \theta$. כמובן שלאומד חסר הטיה אין הטיה.

ב. מהי ההטיה של האומד T_1 ?

ג. תקנו את T_1 , כך שיהיה אומד חסר הטיה.

אם יש שני אומדים חסרי הטיה עדיף זה עם השונות היותר קטנה.

ד. מוצא האומד הבא: $T_3 = 1.5X_1 - X_2 - 1$.

האם הוא עדיף על האומד שהצעת בסעיף ג'?

אם $\hat{\theta}$ אומד חסר הטיה ל- θ , אז $g(\hat{\theta})$ יהיה אומד חסר הטיה עבור $g(\theta)$, רק אם g תהיה לינארית.

ה. מצאו אומד חסר הטיה ל: $P(X = 3)$.

אומד חסר הטיה לשונות האוכלוסייה σ^2 : $S^2 = \frac{\sum (x_i - \bar{x})^2}{n-1} = \frac{\sum x_i^2 - n\bar{x}^2}{n-1}$.

ו. מצאו אומד חסר הטיה לשונות של X .

תזכורות חשובות:

אם: $Y = aX + b$, אזי: $E(Y) = aE(X) + b$, $V(Y) = a^2 \cdot V(X)$, $\sigma_Y = |a| \sigma_X$.

אם: $X_1, X_2, \dots, X_n$ משתנים מקריים, אזי:

$$E(T) = E(X_1 + X_2 + \dots + X_n) = E(X_1) + E(X_2) + \dots + E(X_n)$$

אם: $X_1, X_2, \dots, X_n$ משתנים מקריים בלתי תלויים בזוגות, אזי:

$$V(T) = V(X_1 + X_2 + \dots + X_n) = V(X_1) + V(X_2) + \dots + V(X_n)$$

שאלות:

- (1) הציון במבחן מסוים של תלמידי כתה ח' הנו משתנה מקרי בעל תוחלת μ וסטיית תקן 10. כדי לאמוד את התוחלת μ , נלקח מדגם של 5 ציונים: $X_1, \dots, X_5$. שלושה חוקרים הציעו אומדים לתוחלת על סמך מדגם זה:

$$T_1 = \frac{X_1 + \dots + X_5}{5} \quad \text{חוקר א' הציע:}$$

$$T_2 = \frac{2X_1 - X_3 + X_4}{2} \quad \text{חוקר ב' הציע:}$$

$$T_3 = \frac{2X_1 + X_3}{2} \quad \text{חוקר ג' הציע:}$$

- איזה מן האומדים הוא חסר הטיה?
- הציעו תיקון לאומד המוטה כך שיהיה חסר הטיה.
- במדגם התקבלו הציונים הבאים: 100, 82, 58, 78, 65. חשבו את האומדנים המתקבלים עבור האומדים חסרי ההטיה.
- איזה מבין שני האומדים חסרי ההטיה עדיף? נמקו.

- (2) כדי לאמוד את המשקל הממוצע של הנשים בארה"ב, נבחר מדגם של $2n$ נשים. נסמן את שונות הגובה ב- σ^2 . הוצעו שני אומדים לממוצע המשקל על סמך מדגם

$$T_1 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i, \quad T_2 = \frac{1}{2n} \sum_{i=1}^{2n} X_i \quad \text{זה:}$$

- בדקו לגבי כל אומד אם הוא בלתי מוטה.
- איזה אומד עדיף? נמקו.

- (3) $X \sim B(n, p)$. כלומר, X הינו משתנה מקרי המתפלג בינומית עם פרמטר P (סיכוי להצלחה בניסיון בודד) במדגם בגודל n .

- פתחו אומד חסר הטיה ל- P .
- מהו אומד חסר הטיה לסיכוי לכישלון בניסיון בודד?
- מהו אומד חסר הטיה ל- $E(X)$?
- מצאו אומד חסר הטיה ל- $E(X^2)$.

(4) בתיק מניות שתי מניות. מספר המניות שיעלו ביום מסוים הוא משתנה מקרי התלוי בפרמטר לא ידוע: θ , $0 \leq \theta \leq 2$.

פונקציית ההסתברות של X - מספר המניות שיעלו ביום מסוים:

$$P(X=0) = 1 - \frac{\theta}{2}, \quad P(X=1) = \frac{\theta}{3}, \quad P(X=2) = \frac{\theta}{6}$$

א. מצאו אומד בלתי מוטה ל- θ , שמתבסס על מספר המניות שיעלו ביום מסוים.

ב. מצאו אומד בלתי מוטה ל- θ , שמתבסס על מספר המניות שעלו ביום,

במשך שלושה ימים - X_1, X_2, X_3 (לכל אחד מהם אותה התפלגות כנ"ל והם בלתי תלויים).

(5) בקרב המטפלות בת"א, מספר התינוקות שבטיפולן הוא משתנה מקרי בעל התפלגות התלויה בפרמטר θ באופן הבא:

הסיכוי שמטפלת תטפל בתינוק אחד בלבד הוא 3θ ,

הסיכוי שמטפלת תטפל ב-2 תינוקות הוא $1 - 4\theta$,

הסיכוי שמטפלת תטפל ב-3 תינוקות הוא θ .

במדגם מיקרי של 4 מטפלות מת"א, נמצא כי שתיים מהם מטפלות בתינוק אחד בלבד, אחת מהן בשנים ואחת השלושה תינוקות.

א. מצאו אומד חסר הטיה לפרמטר θ על סמך תצפית בודדת.

ב. מצאו אומד חסר הטיה לפרמטר θ על סמך 4 תצפיות.

ג. מהו האומדן לפרמטר θ על סמך תוצאות המדגם.

ד. מצאו אומד חסר הטיה לסיכוי שלמטפלת בת"א תטפל בתינוק בודד אחד.

ה. מצאו אומדים חסרי הטיה לתוחלת ולשונות של מספר התינוקות בטיפול אצל מטפלת מת"א. חשבו אומדנים.

(6) קבעו אילו מהטענות הבאות נכונות:

א. אם T הוא אומד בלתי מוטה עבור פרמטר θ , אז $5T$ אומד בלתי מוטה

עבור הפרמטר 5θ .

ב. אם T הוא אומד בלתי מוטה עבור פרמטר θ , אז T^2 אומד בלתי מוטה

עבור הפרמטר θ^2 .

- (7) במפעל שתי מכונות המייצרות מוצרים. במכונה הראשונה ההסתברות שמכשיר תקין היא p , ובמכונה השנייה ההסתברות שמכשיר תקין היא $2p$. דוגמים 20 מכשירים מהייצור של כל מכונה. נסמן ב- X את מספר המכשירים התקינים שיוצרו על ידי המכונה הראשונה, וב- Y את מספר המכשירים התקינים שיוצרו על ידי המכונה השנייה. איזה מבין האומדים הבאים אינו אומד חסר הטיה ל- p ?

א. $\frac{X}{20}$.

ב. $\frac{Y}{20}$.

ג. $\frac{X+Y}{60}$.

ד. $\frac{2X+Y}{80}$.

- (8) יהיו T_1 ו- T_2 אומדים חסרי הטיה ובלתי תלויים לפרמטר θ .
 א. מצאו אומד חסר הטיה ל- θ^2 , המתבסס על T_1 ו- T_2 .
 ב. מצאו אומד חסר הטיה ל- $\theta(1-\theta)$, המתבסס על T_1 ו- T_2 .

- (9) נתון ש- X הינו משתנה מקרי עם תוחלת μ ושונות σ^2 . נדגמו n תצפיות בלתי תלויים מאותה אוכלוסיה.

א. הראו ש- $\sum_{i=1}^n p_i x_i$ אומד חסר הטיה ל- μ , כאשר: $\sum_{i=1}^n p_i = 1$.

ב. נתבונן במכפלת שתי התצפיות הראשונות: $X_1 \cdot X_2$.

הראו שהוא אומד חסרי הטיה ל- μ^2 .

- (10) $X_i \sim N(\mu, 1)$, כאשר: $i = 1, 2, \dots, n$. נתון שהתצפיות הינן בלתי תלויות זו בזו. מצאו אומד חסר הטיה ל- μ^2 .

(11) נתונות n תצפיות בלתי תלויות מתוך התפלגות בעלת הצפיפות הבאה :

$$f(x) = \begin{cases} \frac{1+\beta x}{2} & -1 < x < 1 \\ 0 & \text{else} \end{cases}$$

- א. הראו כי האומד $3\bar{X}$ הנו אומד בלתי מוטה ל- β .
 ב. מצאו את השונות של האומד מהסעיף הקודם.

(12) $X_1, X_2, \dots, X_n$ הינם משתנים מקריים רציפים בלתי תלויים בעלי פונקציית

$$f(x) = \begin{cases} X \cdot A & 0 \leq x \leq \theta \\ 0 & \text{אחרת} \end{cases} \quad \text{הצפיפות הבאה :}$$

- א. בטאו את ערכו של A באמצעות θ , כדי שפונקציית הצפיפות תהיה לגיטימית.
 ב. מצאו אומד חסר הטיה ל- θ , על סמך n התצפיות.

תשובות סופיות:

$$(1) \quad \text{א. } T_1 \text{ ו- } T_2. \quad \text{ב. } \frac{2}{3}T_3. \quad \text{ג. } T_1 = 76.6, T_2 = 110. \quad \text{ד. } T_1.$$

$$(2) \quad \text{א. ראו בוידאו.} \quad \text{ב. } T_2.$$

$$(3) \quad \text{א. } \frac{x}{n}. \quad \text{ב. } 1 - \frac{x}{n}. \quad \text{ג. } X. \quad \text{ד. } \theta.$$

$$(4) \quad \text{א. } \frac{3x}{2}. \quad \text{ב. } \frac{3\bar{x}}{2}.$$

$$(5) \quad \text{א. } 1 - \frac{x}{2}. \quad \text{ב. } 1 - \frac{1}{2}\bar{x}. \quad \text{ג. } 0.125. \quad \text{ד. } 3\left(1 - \frac{1}{2}\bar{x}\right).$$

$$\text{ה. לשונות } 0.917.$$

$$(6) \quad \text{א. נכון.} \quad \text{ב. לא נכון.}$$

$$(7) \quad \text{ב'.$$

$$(8) \quad \text{א. } T_1 \cdot T_2. \quad \text{ב. } T_1 - T_1 \cdot T_2.$$

$$(9) \quad \text{א. שאלת הוכחה.} \quad \text{ב. שאלת הוכחה.}$$

$$(10) \quad \bar{X}^2 - \frac{1}{n}.$$

$$(11) \quad \text{א. שאלת הוכחה.} \quad \text{ב. } V(3\bar{X}) = \frac{3 - \beta^2}{n}.$$

$$(12) \quad \text{א. } A = \frac{2}{\theta^2}. \quad \text{ב. } \theta = \frac{3 - \bar{X}}{2}.$$

אומד נראות מקסימלית:

רקע:

להלן נלמד את שיטת הנראות המקסימלית למציאת אומדים.

נניח ש- X משתנה מקרי בדיד עם פונקציית הסתברות $P(x, \theta)$, כאשר θ הפרמטר הבלתי ידוע.

יהיו: $X_1, X_2, \dots, X_n$ תוצאות מדגם מקרי בגודל n הנלקח מאוכלוסייה זו.

נבנה את פונקציית ההסתברות המשותפת (פונקציית הדגימה).

אם אנו יודעים את תוצאות המדגם, ולא את הפרמטר, קוראים לפונקציית הנראות שהיא פונקציה של הפרמטר.

נגדיר את פונקציית הנראות:

$$L(\theta) = P(x_1, \theta) \cdot P(x_2, \theta) \cdot \dots \cdot P(x_n, \theta) = \prod_{i=1}^n P(x_i, \theta)$$

פונקציית הנראות היא ההסתברות לקבל את התצפית הראשונה (כפונקציה של θ), כפול ההסתברות לקבל את התצפית השנייה, וכולי. כלומר, המשמעות של פונקציית הנראות היא ההסתברות לקבל את המדגם שהתקבל, כפונקציה של הפרמטר המבוקש θ .

אם מדובר במשתנה רציף, נכפיל את פונקציות הצפיפות ולא את פונקציות ההסתברות:

$$L(\theta) = f(x_1, \theta) \cdot f(x_2, \theta) \cdot \dots \cdot f(x_n, \theta) = \prod_{i=1}^n f(x_i, \theta)$$

דוגמה (פתרון בהקלטה):

הסיכוי של שחקן כדורסל לקלוע לסל הוא p (לא ידוע). השחקן זורק כדורים לסל עד שהוא קולע בפעם הראשונה. נניח כי הזריקות בלתי תלויות זו בזו. הכדור נכנס לסל לראשונה בניסיון השלישי. השחקן חוזר על התהליך שוב, והפעם הכדור נכנס לסל בניסיון החמישי. מצאו את פונקציית הנראות של p .

אומד נראות מקסימלית עבור θ הוא האומד $\hat{\theta}$, שממקסם את פונקציית הנראות $L(\theta)$. כלומר, אנו מחפשים את האומד שיגרום לכך שהמדגם המקרי שקיבלנו יהיה כמה שיותר סביר.

שלבים למציאת אומד נראות מקסימלית:

- לוקחים את פונקציית ההסתברות המשותפת של המדגם (או צפיפות משותפת אם המשתנה רציף).
- מציבים את תוצאות המדגם ומקבלים את פונקציית הנראות (פונקציה של הפרמטר הנחקר).
- מוצאים מקסימום לפונקציית הנראות (לעיתים כדאי להוסיף $\ln$ כדי להקל על המלאכה).

המשך דוגמה:

חשבו את אומדן הנראות המקסימלית עבור p .

משפט: אם $\hat{\theta}$ הוא אומד נראות מקסימלית עבור θ , אזי $g(\hat{\theta})$ הוא אומד נראות מקסימלית עבור $g(\hat{\theta})$, בהנחה והפונקציה היא חד-חד ערכית (אינווריאנטיות).

המשך דוגמה:

מצאו אומדן נראות מקסימלית לסיכוי של שחקן הכדורסל לקלוע לסל פעמיים ברצף.

שאלות:

- (1) הסיכוי של שחקן לנצח במשחק הוא p (לא ידוע).
 השחקן משחק במשחק עד אשר הוא מנצח בפעם הראשונה.
 נתון שהשחקן ניצח לראשונה רק במשחק השני.
 א. חשבו את פונקציית הנראות של p , וציירו גרף שלה.
 ב. מצאו אומדן נראות מקסימלית עבור p .
 ג. מצאו אומדן נראות מקסימלית ל- p , אם ביום אחד הוא נאלץ לשחק 4 פעמים וביום אחר הוא נאלץ לשחק 5 פעמים, עד אשר ניצח.
- (2) מספר הלקוחות שנכנסים לחנות מסוימת, מתפלג פואסונית עם תוחלת של λ לקוחות ביום.
 א. מצאו אומדן נראות מקסימלית ל- λ , על סמך מספר הלקוחות שנכנסים ביום מסוים.
 ב. מצאו אומדן נראות מקסימלית ל- λ , על סמך מספר הלקוחות שנכנסים ב- n ימים מסוימים.
- (3) הזמן שלוקח לאדם לחכות בתור מתפלג מעריכית עם פרמטר λ .
 דגמו 4 אנשים מקריים שחיכו בתור ומדדו את זמני ההמתנה שלהם.
 התוצאות שהתקבלו בדקות הן: 3, 5, 7 ו-3.
 א. פתחו אומדן נראות מקסימלית לפרמטר זה על סמך n תצפיות כלשהן.
 ב. מהו האומדן לפרמטר?
- (4) משך זמן הכנת שיעורי הבית (בשעות) של בני נוער, ביום אחד, מתפלג אחיד: $U(0, q)$.
 כדי לאמוד את θ , נשאלו ביום מסוים מספר בני נוער כמה שעות הם הכינו שיעורי-בית באותו יום.
 א. אלעד הכין ביום מסוים שיעורי בית במשך שעה שלמה. חשבו את פונקציית הנראות של θ המתבססת על תצפית זו, וציירו את הגרף שלה.
 ב. מצאו אומדן נראות מקסימלית ל- θ על סמך התצפית.
 ג. משכי הכנת שיעורי בית (שעות) של 3 בני נוער היו 1.5, 3, 1.
 ד. מצאו אומדן נראות מקסימלית ל- θ על סמך המדגם הזה.
 ד. מצאו באופן כללי אומדן נראות מקסימלית ל- θ , על סמך מדגם של n בני נוער – $X_1, \dots, X_n$.

(5) הגובה של אוכלוסייה מסוימת מתפלג נורמלית עם תוחלת ידועה של 170 ס"מ ושונות σ^2 לא ידועה.

א. מצאו אומד נראות מקסימלית עבור השונות על סמך מדגם $X_1, \dots, X_n$ מתצפיות מהאוכלוסייה.

ב. נדגמו 5 אנשים בלתי תלויים בעלי הגבהים: 170, 182, 165, 174, 174. מהו האומדן לשונות הגבהים באוכלוסייה?

(6) פתחו אומד נראות מקסימלית לפרמטר p בהתפלגות הבינומית, על סמך מדגם בגודל n , בו X הוא מספר ההצלחות במדגם.

$$(7) \quad X \text{ הוא משתנה מקרי בעל פונקציית הצפיפות: } f(x) = \begin{cases} 2\theta x e^{-\theta x^2} & x > 0 \\ 0 & x \leq 0 \end{cases}$$

א. מצאו אומד נראות מקסימלית ל- θ על סמך n תצפיות בלתי תלויות: $X_1, \dots, X_n$.

ב. מצאו אומד נראות מקסימלית ל- θ^2 .

(8) בכד א' 10 כדורים שחורים ו-10 לבנים ובכד ב' 5 כדורים שחורים ו-15 לבנים. דוגמים באקראי כדור, בלי לדעת מאיזה כד.

א. מצא אומד נראות מקסימלית לכד שממנו הוצא הכדור על סמך הצבע של הכדור.

ב. מהו האומדן אם הצבע הוא שחור?

(9) הזמן שלוקח ליוסי לפתור תשבץ מתפלג מעריכית עם תוחלת לא ידועה. נתנו ליוסי לפתור חמישה תשבצים ובממוצע לקח לו 32 דקות לפתור אותם.

א. מה אומדן הנראות המקסימלית לתוחלת זמן הפתרון של תשבץ על ידי יוסי (אין חובה לפתח).

ב. מה אומדן הנראות המקסימלית לסיכוי שייקח לו לפחות חצי שעה לפתור את התשבץ הבא?

- 10) מספר הלקוחות הממתינים בתור במוקד טלפוני הוא משתנה מקרי X , בעל התפלגות התלויה בפרמטר θ , באופן הבא:

X	0	1	2
$P(X)$	$4\theta^2$	$4\theta - 8\theta^2$	$1 - 4\theta + 4\theta^2$

בחמישה זמנים שונים שנבחרו באקראי נמצאו: 0, 0, 1, 0, 0 לקוחות ממתינים בתור.

- א. מצאו אומדן בשיטת הנראות המקסימלית עבור הפרמטר θ , על-סמך המדגם הנתון.
 ב. מצאו אומדן בשיטת הנראות המקסימלית לסיכוי שלא יהיו לקוחות בתור.

- 11) אדם מחזיק בידו שני מטבעות: מטבע הוגן ומטבע שאינו הוגן – שהסיכוי לקבל בו תוצאה של עץ הוא 0.2. האדם מטיל את אחד המטבעות פעמיים ומודיע לך כמה פעמים הוא קיבל עץ. אתה צריך לנחש איזה מטבע הוא הטיל: את ההוגן או את זה שאינו הוגן.

- א. מצא אומדן בשיטת הנראות המקסימלית לסוג המטבע שהוטל.
 ב. מהו האומדן אם האדם קיבל פעמיים עץ?

- 12) מעוניינים לאמוד את אחוז המובטלים באוכלוסייה. דוגמים 50 אנשים אקראיים ומתקבל ש-4 מהם מובטלים.
 א. מצא אומדן נראות מקסימלית לשיעור המובטלים באוכלוסייה.
 ב. מצא אומדן לשיעור העובדים באוכלוסייה.
 ג. מצא אומדן ליחס בין שיעור העובדים לשיעור המובטלים באוכלוסייה.

- 13) במשחק מחשב שלוש רמות משחק:
 ברמה 1 הסיכוי של יוסי לסיים את המשחק הוא 0.9.
 ברמה 2 הסיכוי של יוסי לסיים את המשחק הוא 0.7.
 ברמה 3 הסיכוי של יוסי לסיים את המשחק הוא 0.4.
 יוסי בחר ברמה מסוימת, אך אינו יודע באיזו רמה הוא בחר.
 הוא משחק במשחק ברמה שבחר פעמיים.
 א. הציעו א.נ.מ. לרמה של המשחק שיוסי שיחק, על סמך מספר הפעמים שסיים את המשחק.
 ב. אם יוסי סיים את שני המשחקים, מה יהיה האומדן לרמה?
 ג. מהו א.נ.מ. לסיכוי, שמתוך שני משחקים הוא יצליח בדיוק משחק אחד?

(14) $X_1, X_2, \dots, X_n$ מתפלגים אחיד בקטע: $[-\theta, \theta]$.

מצא אומד נראות מקסימלית לפרמטר θ .

(15) $X_1, X_2, \dots, X_n$ מתפלגים בדיד לפי פונקציית ההסתברות הבאה:

$$P(X = k) = \frac{\binom{2}{k} \cdot P^k \cdot (1-P)^{2-k}}{1 - (1-P)^2} \quad K = 1, 2$$

הוכח שא.נ.מ ל- P , הינו: $2 - \frac{2}{X}$.

(16) במכשיר חשמלי יש 2 סוללות שפועלות באופן ב"ת זו בזו, והוא מפסיק לפעול ברגע שאחת הסוללות מפסיקה לעבוד. הסיכוי של סוללה לתפקד לפחות חודש הוא P . כאשר המכשיר מפסיק לפעול מחליפים את שתי הסוללות שלו. בתחילת הניסוי נלקחו 80 מכשירים כאלה עם סוללות חדשות ולאחר חודש נמצא ש-30 מהם עדיין פועלים.

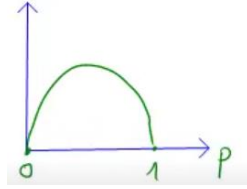
- מצא אומדן נראות מקסימלית עבור P .
- רשמו את האומד שבו השתמשותם בחלק א' באופן כללי, עבור מדגם של n מכשירים שמתוכם נמצאו Y מכשירים שעדיין פועלים לאחר חודש אחד.
- בהנחה שאורך החיים (בחודשים) של סוללה בודדת הוא מעריכי, עם פי צפיפות: $f(t) = \theta e^{-\theta t}$ עבור $t > 0$. מצא א.נ.מ. עבור θ , המבוסס על Y . מהו האומדן המתאים מן המדגם הנתון?

(17) חיוג אוטומטי של מכשיר טלפון משדר אות אחת לשתי דקות. אם לאחר 20 דקות (10 אותות חיוג) המספר שאליו מטלפנים עדיין תפוס, החיוג האוטומטי נפסק.

- רשמו את פונקציית ההסתברות של המשתנה X – מספר הפעמים שהחייגן האוטומטי מחייג למספר הטלפון המבוקש, אם ההסתברות לקבלת צליל "פנוי" בשידור אחד של אות חיוג הוא P .
- מתוך 12 ניסיונות חיוג אוטומטי למשרד הרישוי בזמנים שונים במשך 5 ימים, התקבלו התוצאות הבאות: בשני ניסיונות הופסק החיוג האוטומטי ובשאר הניסיונות שבהם הצליח המטלפן להשיג את המספר המבוקש, מספר החיוגים האוטומטיים עד לקבל צליל "פנוי" היו: 1, 6, 2, 7, 3, 8, 2, 1, 5. מצאו אומדן נראות מקסימלית עבור P , על סמך התוצאות שהתקבלו.

תשובות סופיות:

להלן גרף:



$$(1) \quad L(p) = (1-p) \cdot p \quad \text{א.}$$

$$\text{ב. } 0.5 \quad \text{ג. } \frac{2}{9}$$

$$(2) \quad X \quad \text{א.} \quad \bar{X} \quad \text{ב.}$$

$$(3) \quad \frac{1}{\bar{X}} \quad \text{א.} \quad \frac{2}{9} \quad \text{ב.}$$

$$(4) \quad \text{א. } 1 \quad \text{ב. } 1 \quad \text{ג. } 3 \quad \text{ד. } \hat{\theta} = \max\{X_1, \dots, X_n\}$$

$$(5) \quad \frac{\sum_{i=1}^n (x_i - 170)^2}{n} \quad \text{א.} \quad \text{ב. } 40.2$$

$$(6) \quad \frac{x}{n}$$

$$(7) \quad \frac{n}{\sum X_i^2} \quad \text{א.} \quad \left(\frac{n}{\sum X_i^2} \right)^2 \quad \text{ב.}$$

$$(8) \quad \text{א. ראה סרטון.} \quad \text{ב. כד א'.$$

$$(9) \quad \text{א. } 32 \quad \text{ב. } 0.3916$$

$$(10) \quad \text{א. } 0.45 \quad \text{ב. } 0.81$$

$$(11) \quad \text{א. ראה סרטון.} \quad \text{ב. הוגן.}$$

$$(12) \quad \text{א. } 0.08 \quad \text{ב. } 0.92 \quad \text{ג. } 11.5$$

$$(13) \quad \hat{\theta} = \begin{cases} 3 & X = 0,1 \\ 1 & X = 2 \end{cases} \quad \text{א.} \quad \hat{p} = \begin{cases} 2 \cdot 0.4 \cdot 0.6 & X = 0,1 \\ 2 \cdot 0.9 \cdot 0.1 & X = 2 \end{cases} \quad \text{ג.} \quad \text{ב. } 1$$

$$(14) \quad \max |X_i|$$

$$(15) \quad \text{שאלת הוכחה.}$$

$$(16) \quad \text{א. } 0.6124 \quad \text{ב. } \hat{p} = \sqrt{\frac{y}{n}} \quad \text{ג. } 0.49$$

$$(17) \quad \text{א.} \quad P(x) = \begin{cases} (1-p)^{x-1} p & 1 \leq x \leq 9 \\ (1-p)^9 & x = 10 \end{cases} \quad \text{ב. } 0.1818$$

נספח:**התפלגויות רציפות**

ההתפלגות	פונקציית הצפיפות	פונקציית ההתפלגות המצטברת	תוחלת	שונות	הערות	אנ"מ
$X \sim U(a, b)$	$f(x) = \frac{1}{b-a}$ $a \leq x \leq b$	$\frac{t-a}{b-a}$	$\frac{a+b}{2}$	$\frac{(b-a)^2}{12}$		$b = \max(X_i)$ $a = \min(X_i)$
$X \sim \exp(\lambda)$	$f(x) = \lambda e^{-\lambda x}$	$1 - e^{-\lambda t}$	$\frac{1}{\lambda}$	$\frac{1}{\lambda^2}$	הזמן עד להתרחשות מאורע מסוים. λ - הוא ממוצע האירועים ביחידת זמן.	$\hat{\lambda} = \frac{1}{\bar{X}}$
$X \sim N(\mu, \sigma^2)$	$f(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma^2}} e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}$	$\Phi(t)$	μ	σ^2		$\hat{\mu} = \bar{X}$ $\hat{\sigma}^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2$ $Z = \frac{X - \mu}{\sigma}$

התפלגויות בדידות

ההתפלגות	פונקציית ההסתברות $P(X=k)$	תוחלת	שונות	הערות	אנ"מ
בינומית $B(n, p)$ $0 \leq p \leq 1$	$\binom{n}{k} p^k (1-p)^{n-k}$ $k = 0, 1, \dots, n$	np	$np(1-p)$	(1)	$\hat{p} = \frac{Y}{n}$
גיאומטרית $G(p)$ $0 < p \leq 1$	$(1-p)^{k-1} p$ $k = 1, 2, \dots, \infty$	$\frac{1}{p}$	$\frac{1-p}{p^2}$	(2)	$\hat{p} = \frac{1}{\bar{X}}$
אחידה $U(a, b)$	$\frac{1}{b-a+1}$ $K = a, \dots, b$	$\frac{a+b}{2}$	$\frac{(b-a+1)^2 - 1}{12}$	(3)	$b = \max(X_i)$ $a = \min(X_i)$
פואסונית $P(\lambda)$ $\lambda > 0$	$\frac{e^{-\lambda} \lambda^k}{k!}$ $k = 0, 1, \dots, \infty$	λ	λ	(4)	$\hat{\lambda} = \bar{X}$

(1) מספר ההצלחות ב- n ניסויי ברנולי ב"ת. p - ההסתברות להצלחה.(2) מספר הניסויים עד להצלחה הראשונה בסדרת ניסויי ברנולי ב"ת, p - ההסתברות להצלחה.(3) בחירה אקראית של מספר בין a ו- b .(4) מספר אירועים ביחידת זמן, λ - קצב האירועים.

קריטריון MSE – תוחלת ריבוע הטעות:

רקע:

הקריטריון הנפוץ ביותר כדי לבדוק את טיב האומד הוא קריטריון MSE :
Mean Squared Error – תוחלת ריבוע טעות האמידה.

$$MSE(\hat{\theta}) = E(\hat{\theta} - \theta)^2 = V(\hat{\theta}) + (E(\hat{\theta}) - \theta)^2$$

כאשר: $V(\hat{\theta})$ – הינה שונות האומד.

$E(\hat{\theta}) - \theta$ – הינה ההטיה של האומד.

אם T_1 ו- T_2 הינם אומדים לפרמטר θ , האומד העדיף יהיה זה עם MSE קטן יותר.
כלומר, אם: $MSE(T_1) > MSE(T_2)$, אז T_2 עדיף על T_1 .

דוגמה (הפתרון בהקלטה):

נתון משתנה X המתפלג אחיד רציף באופן הבא: $X \sim U(3, \theta)$.

מוצעים שני אומדים לפרמטר θ על סמך תצפית בודדת: $T_1 = 2X - 3$ ו- $T_2 = \frac{3X - 3}{2}$.

איזה אומד עדיף לאמידת הפרמטר θ ?

שאלות:

(1) מעוניינים לאמוד את התוחלת של התפלגות מסוימת. מוצעים שני אומדים אפשריים ממוצע של שתי תצפיות וממוצע של שלוש תצפיות. לפי קריטריון תוחלת ריבוע הטעות (MSE), איזה אומד עדיף? הסבירו.

(2) בעיר מסוימת בשוויץ בכל θ דקות רכבת מגיעה לתחנה מסוימת. דוד מגיע לתחנה בזמן אקראי ומודד את זמן ההמתנה לרכבת - X .
 א. הצע אומד חסר הטיה ל- θ , על סמך X .
 ב. סטטיסטיקאי הציע לאמוד את θ על סמך האומד: $1.5X$. האם האומד הנ"ל מוטה?
 ג. איזה אומד מבין האומדים בסעיפים א' ו-ב' עדיף?

(3) חוקר מעוניין לאמוד את הסיכוי לחלות במחלת השפעת בחורף (להלן: הפרמטר P). הוא דוגם חמישה אנשים בריאים, ומתבונן בסטטיסטי X - מספר האנשים שחלו בשפעת בחורף. הוא מתלבט בין שני אומדים: $T_1 = \frac{X}{5}$ ו- $T_2 = \frac{X+1}{7}$.
 א. מי מבין האומדים הללו הוא חסר הטיה?
 ב. מי מבין האומדים עדיף אם $P = 0.5$?
 ג. מי מבין האומדים עדיף אם $P = 0.1$?

(4) מספר השריפות המתרחשות בארץ בחודש אוקטובר מתפלג פואסונית עם תוחלת λ . נלקח מדגם של 10 חודשי אוקטובר. להלן שני אומדים אפשריים:

$$\hat{\lambda}_1 = \frac{\sum_{i=1}^{10} X_i}{10} \text{ ו- } \hat{\lambda}_2 = \frac{2 \cdot \sum_{i=1}^5 X_i + 2 \cdot \sum_{i=6}^{10} X_i}{10}$$

כאשר: X_i = מספר השריפות בחודש אוקטובר ה- i .
 איזה מהאומדים עדיף, לצורך אמידת הפרמטר λ ?

(5) הוכח ש: $E(\hat{\theta} - \theta)^2 = V(\hat{\theta}) + (E(\hat{\theta}) - \theta)^2$

תשובות סופיות:

- (1) שלוש תצפיות.
- (2) א. $2x$. ב. אומד מוטה. ג. סעיף ב.
- (3) א. T_1 . ב. T_2 . ג. T_1 .
- (4) $\hat{\lambda}_1$.
- (5) שאלת הוכחה.

אומד עקיב:

רקע:

יהי $\hat{\theta}_n$ אומד לפרמטר θ , המתבסס על n תצפיות.

אומד זה יקרא אומד עקיב, אם יתקיים ש: $\hat{\theta}_n \xrightarrow{n \rightarrow \infty} \theta$.

אם $\hat{\theta}_n$ אומד חסר הטיה לפרמטר θ ומתקיים ש: $\lim_{n \rightarrow \infty} V(\hat{\theta}_n) = 0$,

אזי $\hat{\theta}_n$ אומד עקיב ל- θ .

דוגמה (פתרון בהקלטה):

הסבר מדוע $\bar{X}$ אומד עקיב ל- μ .

אם $\hat{\theta}_n$ אומד נראות מקסימלית לפרמטר θ , מתקיים ש: $\hat{\theta}_n \xrightarrow{n \rightarrow \infty} \theta$.

כלומר, $\hat{\theta}_n$ אומד עקיב ל- θ .

דוגמה (פתרון בהקלטה):

הסבר מדוע בהתפלגות גיאומטרית $\frac{1}{X}$, אומד עקיב לפרמטר P .

שאלות:

(1) נתון כי: $X_i \sim U(0, \theta)$, כאשר: $i = 1, 2, \dots, n$.

$2\bar{X}$ מוצע להיות האומד ל- θ .

א. הראה שאומד זה הוא חסר הטיה.

ב. הסבר מדוע האומד הינו עקיב.

(2) נתון ש- $X \sim B(n, p)$. כמו כן, נתון ש: $\hat{p} = \frac{X}{n}$ הינו אומד ל- p .

הוכח שאומד זה הינו אומד עקיב ל- p .

(3) אורך חיי נורה מתפלג מעריכית עם קצב λ לשנה.

נגדיר את: $W_1, W_2, \dots, W_n$ כסדרת זמנים (בשנים) של n נורות בלתי תלויות.

א. מהו אומד הנראות המקסימלי עבור λ ? האם האומד עקיב?

ב. מצא אומד עקיב לסיכוי שנורה כלשהי תישרף תוך פחות משנתיים.

(4) נפח החלב בקרטון חלב מתפלג נורמלית עם תוחלת μ ושונות σ^2 .

מצא אומד עקיב לפרמטר σ^2 , המתבסס על n תצפיות בלתי תלויות.

תשובות סופיות:

(1) א. שאלת הוכחה. ב. ראה סרטון.

(2) שאלת הוכחה.

(3) א. $\frac{1}{\bar{W}}$. ב. $1 - e^{-\frac{2}{\bar{W}}}$.

(4) $\frac{\sum_i (X_i - \bar{X})^2}{n}$.

אומד חסר הטיה בעל שונות מינימלית:

אומד חסר הטיה יעיל ביותר – MVUE (Minimum-variance unbiased estimator).

רקע:

T יהיה MVUE, אם מתקיים ש- T אומד חסר הטיה ל- θ , ובנוסף מתקיים ש:
 $V(T) \leq V(\hat{\theta})$ לכל חסר הטיה אחר.

דוגמה (פתרון בהקלטה):

לרשת חנויות ישנם שני סניפים. מספר הלקוחות הנכנסים לכל סניף ביום מתפלג פואסונית עם קצב של λ בסניף A וקצב של 2λ בסניף B. נדגמו n ימים מכל סניף, ונבדק בכל יום:

X_i - מספר הלקוחות שנכנסו לסניף A ביום i .

Y_j - מספר הלקוחות שנכנסו לסניף B ביום j .

על מנת לאמוד את λ , מוצע האומד: $\alpha \bar{X} + \beta \bar{Y}$.

א. מה התנאי, שצריך להתקיים על α ו- β , כדי שהאומד יהיה חסר הטיה?

ב. מה צריכים להיות α ו- β כדי שהאומד יהיה גם בעל שונות מינימלית?

שאלות:

- (1) T_1 ו- T_2 הינם אומדים חסרי הטיה ובלתי תלויים לפרמטר θ .
 כמו כן, נגדיר: $T = aT_1 + bT_2$.
 א. מה צריך להיות התנאי על a ו- b , כדי ש- T יהיה אומד חסר הטיה?
 ב. σ_1^2 ו- σ_2^2 הם השונות של T_1 ו- T_2 , בהתאמה.
 מצאו a ו- b , כך ש- T יהיה אומד חסר הטיה ל- θ , ובעל שונות מינימלית.
- (2) במפעל 3 מכונות המייצרות את אותו חלק.
 תוחלת הקוטר של החלקים המיוצרים בכל מכונה זהה.
 השונות של כל מכונה שונות, ומקיימות: $\sigma_2^2 = 2\sigma_1^2$, $\sigma_3^2 = 3\sigma_1^2$.
 הוחלט לדגום n חלקים מכל מכונה, ולחשב את ממוצע הקוטר המתקבל.
 $\bar{X}_i$ - יהיה הממוצע המתקבל במכונה i .
 יהי: $W = \sum_{i=1}^3 a_i \bar{X}_i$ האומד לתוחלת קוטר החלקים המיוצרים על ידי מכונה כלשהי.
 א. מה התנאי שצריך להתקיים על המשקלים a_i , כדי שהאומד המוצע יהיה בלתי-מוטה?
 ב. נניח ש- $a_1 = a_2$.
 מה במקרה זה המשקלים המביאים את האומד להיות MVUE?

תשובות סופיות:

- (1) א. $a + b = 1$.
 ב. $a = \frac{\sigma_2^2}{\sigma_1^2 + \sigma_2^2}$, $b = \frac{\sigma_1^2}{\sigma_1^2 + \sigma_2^2}$.
- (2) א. $\sum_{i=1}^3 a_i = 1$.
 ב. $a_1 = a_2 = 0.4$, $a_3 = 0.2$.

אומד נראות מקסימלית דו-ממדי (לשני פרמטרים):

רקע:

בהינתן פונקציית הסתברות למשתנה בדיד או פונקציית צפיפות למשתנה רציף, אשר תלויות בשני פרמטרים שאינם ידועים, נרצה למצוא אומד נראות מקסימלית דו-ממדי. כלומר, אומד נראות מקסימלית לשני הפרמטרים שאינם ידועים.

דוגמה:

בעוגייה המיוצרת על ידי חברת "עוגית" יש סוכריות כחולות וצהובות. מספר הסוכריות הכחולות בעוגייה של החברה מתפלג פואסונית עם תוחלת α ומספר הסוכריות הצהובות מתפלג פואסונית עם תוחלת $\alpha + \beta$. אין תלות בין מספר הסוכריות הכחולות למספר הסוכריות הצהובות בכל עוגייה, וכמו כן אין תלות בין מספר הסוכריות בעוגייה אחת למספרן בעוגייה אחרת. דגמו באקראי 4 עוגיות וספרו את מספר הסוכריות הכחולות ומספר הסוכריות הצהובות בכל אחת מהן. להלן התוצאות שהתקבלו:

# עוגייה	מספר הסוכריות הכחולות	מספר הסוכריות הצהובות
1	15	20
2	17	24
3	15	26
4	17	22

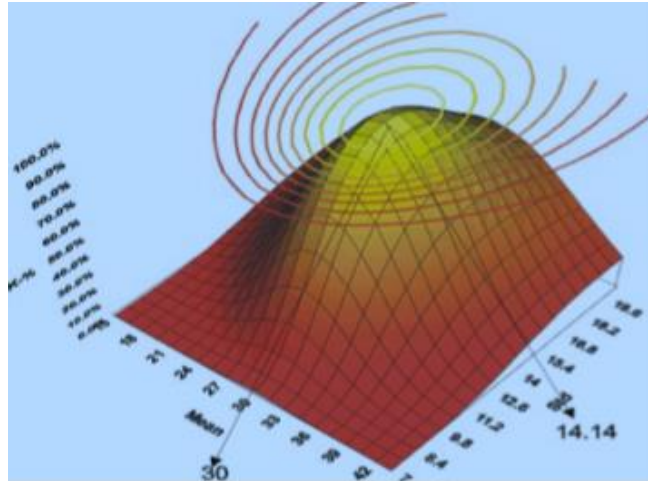
- מה הם הפרמטרים שאינם ידועים?

בדומה למציאת אומד נראות מקסימלית לפרמטר אחד, גם במקרה זה נרצה לבנות פונקציית הסתברות משותפת, כשמדובר במשתנה מקרי בדיד, או פונקציית צפיפות משותפת, כשמדובר במשתנה מקרי רציף. אחרי שנציב את תוצאות המדגם בפונקציה, נקבל את פונקציית הנראות.

בהמשך לדוגמה:

- בנו את פונקציית ההסתברות המשותפת.
- הציבו את תוצאות המדגם ומצאו את פונקציית הנראות.

אומד הנראות המקסימלית (אנ"מ) יהיה שני הערכים של הפרמטרים הלא ידועים המביאים את פונקציית הנראות לקבל ערך מקסימלי. בשרטוט שלפניכם דוגמה לפונקציית נראות לשני פרמטרים לא ידועים שהתקבלה בבעיה כלשהי:



כדי למצוא את נקודת המקסימום, יש להיזכר כיצד מוצאים נקודת מקסימום מקומית לפונקציה בשני משתנים:

שלב א - נתונה $f(x, y)$ שיש לה קיצון מקומי. נפתור את מערכת המשוואה הבאה: $f_x = 0, f_y = 0$. נקבל נקודה (x_0, y_0) החשודה כקיצון מקומי.

שלב ב - $f(x, y)$ היא בעלת נגזרות חלקיות רציפות מסדר שני סביב הנקודה החשודה (x_0, y_0) .

$$\Delta = f_{xx}(x_0, y_0) f_{yy}(x_0, y_0) - f_{xy}^2(x_0, y_0) \text{ נסמן:}$$

(א) אם: $\Delta > 0$ ו- $f_{xx}(x_0, y_0) > 0$ או: $f_{yy}(x_0, y_0) > 0$, אז ל- f יש מינימום מקומי ב- (x_0, y_0) .

(ב) אם: $\Delta > 0$ ו- $f_{xx}(x_0, y_0) < 0$ או $f_{yy}(x_0, y_0) < 0$, אז ל- f יש מקסימום מקומי ב- (x_0, y_0) .

(ג) אם: $\Delta < 0$, אז ל- f יש נקודת אוכף ב- (x_0, y_0) .

(ד) אם: $\Delta = 0$, מבחן זה אינו מספק מידע על (x_0, y_0) .

הערה: אם לפונקציה בשני משתנים יש מקסימום מקומי יחיד בתחום מסוים, אז בתחום זה המקסימום המקומי יהיה המקסימום המוחלט. אם לפונקציה בשני משתנים אין מקסימום מקומי בתחום מסוים, המקסימום המוחלט יהיה בקצוות של הפונקציה.

בהמשך לדוגמה:

- מצאו אומדן נראות מקסימלית לפרמטרים α ו- β על סמך תוצאות המדגם.

שאלות:

- (1) זמן ההמתנה לקו אוטובוס 33 מתפלג מעריכית עם פרמטר λ .
 זמן ההמתנה לקו אוטובוס 44 מתפלג מעריכית עם פרמטר $\beta - \lambda$.
 זמן ההמתנה לקו אוטובוס 33 אינו תלוי בזמן ההמתנה לקו אוטובוס 44.
 יוסי המתין 8 דקות לקו אוטובוס 33. לקו אוטובוס 44 הוא המתין 3 דקות.
 מצאו אומדן נראות מקסימלית לפרמטרים β ו- λ .

- (2) בהגרלה אפשר לזכות ב-20, 50 או 100 ש, לפי פונקציית ההסתברות הבאה:

100	50	20	X
$1 - p - q$	Q	p	$P(X)$

כדי לאמוד את הפרמטרים p ו- q , השתתפו בהגרלה 6 פעמים וקיבלו את התוצאות הבאות:

6	5	4	3	2	1	i
50	100	20	20	50	20	X_i

מצאו אנ"מ דו-ממדי לפרמטרים p ו- q .

- (3) נתון ש- $X_i \sim N(\mu, \sigma^2)$, כאשר: $i = 1, 2, \dots, n$. שני הפרמטרים μ ו- σ^2 , אינם ידועים.
 מצאו אומד נראות מקסימלית לשני הפרמטרים הלא ידועים, על סמך מדגם מקרי בגודל n .

- (4) נתונה אוכלוסייה בעלת התפלגות אחידה עם הפרמטרים α ו- β .
 שאינם ידועים. מצאו אנ"מ דו-ממדי לשני הפרמטרים על סמך מדגם מקרי של n תצפיות מהאוכלוסייה.

(5) במודל רגרסיה ליניארית פשוטה מגדירים את הקשר: $Y_i = \beta \cdot X_i + \alpha + \varepsilon_i$,

כאשר X_i הוא משתנה בלתי תלוי ו- Y_i הוא משתנה שתלוי בו.

כמו כן, נתון ש- $\varepsilon_i \sim N(0, \sigma^2)$.

הרעיון במודל הוא שלכל X_i ידוע, אפשר לקבל התפלגות של Y_i .

א. בטאו את התוחלת של Y_1 עבור X_1 ידוע באמצעות הפרמטרים: α, β ו- σ^2 .

ב. מהי ההתפלגות של Y_1 עבור X_1 ידוע?

ג. מבצעים מדגם בגודל n , שבו מקבלים זוגות בלתי תלויים (X_i, Y_i)

לכל: $i = 1, 2, \dots, n$. בנו את פונקציית הנראות.

ד. מצאו אומד נראות מקסימלית לפרמטרים α ו- β , בהנחה שהפרמטר σ^2 ידוע.

(6) במודל רגרסיה ליניארית פשוטה, ללא חותך, מגדירים את הקשר: $Y_i = \beta \cdot X_i + \varepsilon_i$,

כאשר X_i הוא משתנה בלתי תלוי ו- Y_i הוא משתנה שתלוי בו.

כמו כן, נתון ש- $\varepsilon_i \sim N(0, \sigma^2)$.

הרעיון במודל הוא, שלכל X_i ידוע אפשר לקבל התפלגות של Y_i .

א. בטאו את התוחלת של Y_1 עבור X_1 ידוע באמצעות X_1 והפרמטרים β ו- σ^2 .

ב. מהי ההתפלגות של Y_1 עבור X_1 ידוע?

ג. מבצעים מדגם מקרי בגודל n , שבו מקבלים זוגות בלתי תלויים (X_i, Y_i)

לכל: $i = 1, 2, \dots, n$.

בנו את פונקציית הנראות.

ד. מצאו אומד נראות מקסימלית לפרמטרים β ו- σ^2 .

תשובות סופיות:

$$\hat{\lambda} = \frac{1}{8}, \hat{\beta} = \frac{11}{24} \quad (1)$$

$$\hat{p} = \frac{1}{2}, \hat{q} = \frac{1}{3} \quad (2)$$

$$S^2 = \sum_{i=1}^n \frac{(X_i - \bar{X})^2}{n}, \hat{\mu} = \bar{X} \quad (3)$$

$$\hat{\alpha} = X_{\min}, \hat{\beta} = X_{\max} \quad (4)$$

$$Y_1 | X = X_1 \sim N(\beta X_1 + \alpha, \sigma^2) \quad \text{ב.} \quad E(Y_1) = \beta \cdot X_1 + \alpha \quad \text{א.} \quad (5)$$

$$L(\alpha, \beta) = \left(\frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma^2}} \right)^n \cdot e^{-\frac{(Y_1\beta X_1 - \alpha)^2 + (Y_2\beta X_2 - \alpha)^2 + \dots}{2\sigma^2}} \quad \text{ג.}$$

$$\hat{\alpha} = \bar{Y} - \hat{\beta} \cdot \bar{X}, \hat{\beta} = \frac{\text{cov}(x, y)}{S_x^2} \quad \text{ד.}$$

$$Y_1 \sim N(\beta X_1, \sigma^2) \quad \text{ב.} \quad E(Y_1) = \beta \cdot X_1 \quad \text{א.} \quad (6)$$

$$L(\beta, \sigma^2) = \left(2\pi\sigma^2 \right)^{-\frac{1}{2}n} \cdot e^{-\frac{(Y_1 - \beta X_1)^2 + (Y_2 - \beta X_2)^2 + \dots}{2\sigma^2}} \quad \text{ג.}$$

$$\hat{\sigma}^2 = \sum_{i=1}^n \frac{(Y_i - \hat{\beta} X_i)^2}{n}, \hat{\beta} = \frac{\sum_{i=1}^n X_i Y_i}{\sum_{i=1}^n X_i^2} \quad \text{ד.}$$

שאלות מסכמות:

שאלות:

- (1) במפעל מייצרים מוצרים בשלוש מכונות שונות ובלתי תלויות. במכונה הראשונה הסיכוי שמוצר יהיה תקין הוא P , במכונה השנייה ההסתברות שמוצר יהיה תקין הוא P^2 ובמכונה השלישית הסיכוי הוא $2P$. דוגמים 20 מוצרים מכל מכונה. נסמן ב- X את מספר המוצרים התקינים שיוצרו במכונה הראשונה, ב- Y את מספר המוצרים התקינים שיוצרו במכונה השנייה וב- Z את מספר המוצרים התקינים שיוצרו במכונה השלישית.
- א. מהם הערכים האפשריים של הפרמטר P ?
- ב. מצאו אומד בלתי מוטה עבור הפרמטר P , על סמך X ו- Z .
- ג. אם התקבל ש- $Y = 3$, $X = 6$, מהו אומדן נראות מקסימלית ל- P ?
- (2) מספר תאונות הדרכים בקטע כביש א' מתפלג פואסונית עם קצב של λ תאונות בחודש, ומספר תאונות הדרכים בקטע כביש ב' מתפלג פואסונית עם קצב של 2λ תאונות בחודש. הוחלט לספור את כמות התאונות בחודש בכל אחד מקטעי הכביש. נסמן ב- X את מספר התאונות בחודש בקטע א' וב- Y בקטע ב'.
- א. מצאו אומד נראות מקסימלית לפרמטר λ , על סמך X ו- Y .
- ב. מצאו אומד נראות מקסימלית, לסיכוי שבקטע כביש א' תהיה לפחות תאונה אחת בחודש.
- ג. האם האומד שמצאת בסעיף א' הוא חסר הטיה ל- λ ?
- (3) זמן הייצור של מוצר מסוים בתהליך ייצור מתפלג נורמאלי, עם תוחלת ושונות שאינן ידועות.
- א. הציעו אומדים חסרי הטיה לתוחלת והשונות של זמן הייצור של המוצר.
- ב. הציעו אומדי נראות מקסימלית לתוחלת ולשונות של זמן הייצור של המוצר.
- ג. הציעו אומד נראות מקסימלית לריבוע התוחלת של זמן הייצור.
- ד. האם האומד מהסעיף הקודם הוא גם חסר הטיה?

- (4) בקזינו משחק, ובו 4 תאים ממוספרים מ-1 עד 4. מפעיל המשחק שם כסף באחד מארבעת התאים והאדם המשתתף צריך לנחש באיזה תא הכסף מוחבא. מפעיל הקזינו מודיע שהסיכוי להחביא את הכסף בכל אחד משלושת התאים הראשונים שווה, אך לא בהכרח שווה לסיכוי להחביא אותו בתא הרביעי. יש לאמוד את הסיכוי להחביא את הכסף בתא הראשון: P . א. מצא את תחום ההגדרה של הפרמטר P . יעל שיחק את המשחק 3 פעמים וקיבלה שפעם אחת הכסף הוחבא בתא מספר 1 ובפעמים האחרות בתא מספר 2. ב. מצאו אומדן ל- P על סמך התוצאות הללו בשיטת הנראות המקסימלית. ג. מצאו אומד חסר הטיה ל- P . מהו האומדן לפי התוצאות של יעל? ד. מצאו אומדן חסר הטיה ונראות מקסימלית לסיכוי שהכסף יוחבא בתא מספר 4 על סמך התוצאות של יעל.

- (5) יהי: $X_1, X_2, \dots, X_n$ מדגם מקרי מתוך ההתפלגות הבאה:

$$f(x) = \begin{cases} \frac{\theta}{\lambda} \left(\frac{x}{\lambda}\right)^{\theta-1} & 0 < x < \lambda, \theta > 0 \\ 0 & \text{else} \end{cases}$$

- א. מצא אחי"ה ל- λ (כאשר θ קבוע ידוע).
 ב. מצא אני"מ ל- θ (כאשר λ קבוע ידוע).
 ג. מצא אני"מ ל- λ (כאשר θ קבוע ידוע).

- (6) X - משך זמן הפרסומות בערוץ 2 מתפלג אחיד רציף בתחום $(0, \theta)$.
 Y - משך זמן הפרסומות בערוץ 10 מתפלג אחיד רציף בתחום $(0, 2\theta)$.
 א. מצא אומד חסר הטיה ל- θ , המשתמש במשך זמן אקראי של פרסומת בודדת בערוץ 2 ופרסומת בודדת בערוץ 10.
 ב. מוצע האומד: $T_2 = X + 0.5Y$. האם האומד הנ"ל הוא חסר הטיה?
 ג. איזה אומד יותר עדיף זה של סעיף א או זה של סעיף ב?
 ד. מצא אומד נראות מקסימלית ל- θ על סמך X ו- Y .

- (7) נדגמו 2 תצפיות, X_1, X_2 , בלתי תלויות מהתפלגויות אחידות רציפות התלויות בפרמטר θ . ידוע כי: $X_1 \sim U(0, \theta)$, $X_2 \sim U(0, a\theta)$ (כאשר a קבוע ידוע וחיובי).
 א. מצא אני"מ ל- θ , על סמך 2 התצפיות הנ"ל.
 ב. חשב את תוחלת ושונות האני"מ מסעיף א'. האם האני"מ מוטה?
 ג. מצא אחי"ה ל- θ על סמך סכומן של 2 התצפיות הנ"ל. מהי שונותו?

תשובות סופיות:

$$(1) \quad \text{א. } 0 \leq P \leq 0.5 \quad \text{ב. } \hat{p} = \frac{x+z}{60} \quad \text{ג. } 0.345$$

$$(2) \quad \text{א. } \frac{x+y}{3} \quad \text{ב. } 1 - e^{-\frac{x+y}{3}} \quad \text{ג. כן.}$$

(3) א. מאחר ולא התבקשתם לפתח, הרי שהאומד זהה לנוסחה הכללית (ראו נספח).
ב. כנ"ל. ג. כנ"ל (ראו הפרק על אומד נראות מקסמילי). ד. לא.

$$(4) \quad \text{א. } 0 \leq P \leq \frac{1}{3} \quad \text{ב. } \frac{1}{3} \quad \text{ג. } 0.389 \quad \text{ד. } -0.167$$

$$(5) \quad \text{א. אח"ה יהיה: } \hat{\lambda} = \frac{\theta+1}{\theta} \bar{x} \quad \text{ב. } \hat{\theta} = \frac{n}{n \ln \lambda - \sum_{i=1}^n \ln x_i}$$

$$\text{ג. } \hat{\lambda} = X_{\max}$$

$$(6) \quad \text{א. } T_1 = (x+y) \frac{2}{3} \quad \text{ב. כן.} \quad \text{ג. ב'.} \quad \text{ד. } \hat{\theta} = \max \left\{ x, \frac{1}{2} y \right\}$$

$$(7) \quad \text{א. } \hat{\theta} = \max \left(X_1, \frac{X_2}{a} \right) \quad \text{ב. } E(\hat{\theta}) = \frac{2}{3} \theta, \quad V(\hat{\theta}) = \frac{1}{18} \theta^2$$

$$\text{ג. } \tilde{\theta} = \left(\frac{2}{1+a} \right) (X_1 + X_2)$$

נספח: אומדי נראות מקסימלית ואומדים חסרי הטיה בהתפלגויות השונות:

מודל בינומי

נתון מדגם של משתנה בינומי: $X \sim B(n, p)$.

א.נ.מ עבור p הוא: $\hat{p} = \frac{X}{n}$, והוא גם א.ח.ה.

מודל אחיד (בדיד)

נתון מדגם: $X_1, X_2, \dots, X_n$ של משתנים אחידים: $X_i \sim U(1, N)$ בלתי-תלויים בזוגות.

א.נ.מ עבור N הוא: $\hat{N} = \max\{X_1, \dots, X_n\}$, ואינו א.ח.ה.

מודל פואסוני

נתון מדגם: $X_1, X_2, \dots, X_n$ של משתנים פואסוניים: $X_i \sim P(\lambda)$ בלתי-תלויים בזוגות.

א.נ.מ עבור λ הוא: $\hat{\lambda} = \bar{X}$ וגם א.ח.ה.

מודל גיאומטרי

נתון מדגם: $X_1, X_2, \dots, X_n$ של משתנים גיאומטריים: $X_i \sim G(p)$ בלתי-תלויים בזוגות.

א.נ.מ עבור p הוא $\hat{p} = \frac{1}{\bar{X}}$, אינו א.ח.ה. א.נ.מ עבור התוחלת $\frac{1}{p}$, הוא $\bar{X}$ והינו א.ח.ה.

מודל נורמלי

נתון מדגם: $X_1, X_2, \dots, X_n$ של משתנים נורמליים: $X_i \sim N(\mu, \sigma^2)$ בלתי-תלויים בזוגות.

א.נ.מ עבור μ הוא: $\hat{\mu} = \bar{X}$.

כאשר μ ידוע, א.נ.מ עבור σ^2 הוא: $\hat{\sigma}^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (X_i - \mu)^2$ (אומד חסר-הטיה).

כאשר μ לא-ידוע, א.נ.מ עבור σ^2 הוא: $\hat{\sigma}^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2$ (אומד מוטה!!!).

אומד חסר-הטיה עבור σ^2 :

כאשר μ ידוע: $\hat{\sigma}^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (X_i - \mu)^2$.

כאשר μ לא-ידוע: $S^2 = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2$.

מודל מעריכי

נתון מדגם: $X_1, X_2, \dots, X_n$ של משתנים מעריכיים: $X_i \sim \exp(\theta)$ בלתי-תלויים בזוגות.

א.נ.מ עבור θ הוא: $\hat{\theta} = \frac{1}{\bar{X}}$ - מהווה אומד מוטה, וא.נ.מ עבור התוחלת $\frac{1}{\theta}$ הוא $\bar{X}$.
א.ח.ה.

מודל אחיד (רציף)

נתון מדגם: $X_1, X_2, \dots, X_n$ של משתנים אחידים: $X_i \sim U(0, \theta)$ בלתי-תלויים בזוגות.

א.נ.מ עבור θ הוא: $\hat{\theta} = \max\{X_1, \dots, X_n\}$ אינו א.ח.ה.

בכל התפלגות:

א.ח.ה עבור μ הוא: $\hat{\mu} = \bar{X}$.

אומד חסר-הטיה עבור σ^2 :

$$\hat{\sigma}^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (X_i - \mu)^2 \quad \text{כאשר } \mu \text{ ידוע:}$$

$$S^2 = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2 \quad \text{כאשר } \mu \text{ לא-ידוע:}$$

שיטות סטטיסטיות

פרק 10 - בדיקת השערות כללית (סיכוי לטעויות ועוצמת מבחן)

תוכן העניינים

1. בדיקת השערות כללית (סיכוי לטעויות ועוצמת מבחן) 72

בדיקת השערות כללית (סיכוי לטעויות ועוצמת מבחן):

רקע:

תהליך של בדיקת השערות הוא תהליך מאד נפוץ בעולם הסטטיסטיקה. בתהליך זה ישנן שתי השערות שנבדקות:

1. השערת האפס: המסומנות ב- H_0 .

2. השערה אלטרנטיבית (השערת המחקר): המסומנת ב- H_1 .

בדרך כלל השערת האפס מסמנת את אשר היה מקובל עד עכשיו, את השגרה הנורמה ואילו ההשערה האלטרנטיבית את החדשנות בעצם ההשערה האלטרנטיבית מדברת על הסיבה שהמחקר נעשה.

דוגמה:

ישנה תרופה קיימת למחלה A אשר גורמת ל-10% מהמשתמשים בה לתופעות לוואי. חברת תרופות טוענת שפיתחה תרופה שיעילה באותה מידה, אך מקטינה את הסיכוי לתופעות הלוואי. לכן יש לבצע מחקר שעל סמך תוצאותיו ננסה להכריע איזה השערה נקבל:

H_0 : התרופה החדשה הנה קונבנציונאלית וגורמת ל-10% תופעות לוואי.

H_1 : התרופה החדשה מקטינה את אחוז הסובלים מתופעות לוואי מתחת ל-10%.

בתהליך של בדיקת השערות יוצרים כלל שנקרא כלל הכרעה. הכלל יוצר אזורים:

1. אזור דחייה: דחייה של השערת האפס כלומר קבלה של האלטרנטיבה.

2. אזור קבלה: קבלה של השערת האפס ודחייה של האלטרנטיבה.

כלל ההכרעה מתבסס על איזשהו סטטיסטי. בתהליך יש ללכת לתוצאות המדגם ולבדוק האם התוצאות נופלות באזור הדחייה או הקבלה וכך להגיע למסקנה. המסקנה היא בעירבון מוגבל כיוון שהיא תלויה בכלל ההכרעה ובתוצאות המדגם. אם נשנה את כלל ההכרעה אז אנחנו יכולים לקבל מסקנה אחרת, אם נבצע מדגם חדש אז אנחנו עלולים לקבל תוצאה אחרת.

לכן יתכנו טעויות במסקנות שלנו :

מציאות	הכרעה		
		H_0	H_1
	H_0	אין טעות	טעות מסוג 1
	H_1	טעות מסוג 2	אין טעות

הגדרת הטעויות:

טעות מסוג ראשון : להכריע לדחות את H_0 למרות שבמציאות H_0 נכונה.

טעות מסוג שני : להכריע לקבל את H_0 למרות שבמציאות H_1 נכונה.

הגדרת הסתברויות:

הסיכוי לבצע טעות מסוג 1 (רמת מובהקות) :

$$\alpha = P(H_0 \text{ לדחות את } H_0 \mid H_0 \text{ נכונה}) = P_{H_0}(H_0 \text{ לדחות})$$

הסיכוי לבצע טעות מסוג 2 :

$$\beta = P(H_0 \text{ לקבל את } H_1 \mid H_1 \text{ נכונה}) = P_{H_1}(H_0 \text{ לקבל})$$

רמת בטחון :

$$(\alpha - 1) = P(H_0 \text{ לקבל את } H_0 \mid H_0 \text{ נכונה}) = P_{H_0}(H_0 \text{ לקבל})$$

עוצמה :

$$(\beta - 1) = \pi = P(H_1 \text{ לדחות את } H_0 \mid H_1 \text{ נכונה}) = P_{H_1}(H_0 \text{ לדחות})$$

דוגמה (פתרון בהקלטה):

בכד יש 10 כדורים. יתכן ש-5 מהם לבנים והיתר שחורים (כד א' – השערת האפס) או ש-7 מהם לבנים והיתר שחורים (כד ב' – השערה אלטרנטיבית). כדי להחליט איזה מהכדים ברשותנו, הוחלט להוציא כדור ולהשתמש בכלל ההחלטה הבא : אם הכדור שהוצא הוא לבן שזהו כד ב' H_1 .

א. חשבו את רמת המובהקות ואת רמת הביטחון של המבחן המוצע.

ב. חשבו את הסיכוי לטעות מסוג שני והעוצמה של המבחן המוצע.

שאלות:

- (1) אדם חשוד בביצוע פשע. מהן הטעויות האפשריות בהכרעת הדין?
- (2) ילד קנה שקית סוכריות אטומה שבה ציפה ל-10 סוכריות תות ו-5 לימון. ישנה שקית אחרת אותה הוא לא רצה בה 6 סוכריות תות ו-9 לימון. הוא החליט להוציא באקראי סוכרייה, אם היא תהיה לימון הוא יחזיר את השקית לחנות. מה הסיכויים לכל סוג של טעות בהכרעתו?
- (3) יהי X מספר שלם הנבחר באקראי מבין המספרים השלמים. הסיכוי ש- X יקבל ערך כלשהו נתון על ידי הנוסחה: $p(X=k) = \frac{1}{n}$ עבור: $k=1,2,\dots,n$. נתונות ההשערות הבאות לגבי התפלגות של X : $H_0: n=4$, $H_1: n=6$. כמו כן נתון כלל ההכרעה הבא: נדחה את השערת האפס אם: $X > 3$. חשבו את הסיכוי לטעות מסוג ראשון וטעות מסוג שני ואת העוצמה?
- (4) איכות של מוצר מסווגת ל-4 רמות איכות: מצוין, טוב, בינוני וירוד. להלן התפלגות טיב המוצר בשני מפעלים:
- | מפעל / איכות | מצוין | טוב | בינוני | ירוד |
|--------------|-------|-----|--------|------|
| "היוצר" | 0.6 | 0.2 | 0.2 | 0 |
| "שמשון" | 0.1 | 0.2 | 0.3 | 0.4 |
- בוחרים ממשלוח מוצר באקראי, אך לא יודעים מאיזה מפעל המשלוח הגיע. על סמך בדיקת האיכות מנסים להכריע האם מדובר במפעל "היוצר" (השערת האפס) או במפעל "שמשון" (השערה אלטרנטיבית).
- א. להלן כלל החלטה: אם מדובר במוצר שטיבו "טוב" נכריע שהמוצר בא ממפעל "שמשון", מהן ההסתברויות לסוגי הטעויות השונים?
- ב. להלן כלל החלטה: אם מדובר במוצר שטיבו "בינוני" או גרוע מכך נכריע שהמוצר בא ממפעל "שמשון", מהן ההסתברויות לסוגי הטעויות השונים?
- ג. איזה כלל החלטה עדיף? נמקו!
- (5) במטרה לבדוק האם מטבע תקין הטילו אותו 8 פעמים. הוחלט שאם מספר העצים יהיה בין 1 ל-7 כולל יוחלט שהמטבע תקין, אחרת נחליט שהמטבע מזויף.
- א. רשמו את השערות המחקר.
- ב. מה ההסתברות לטעות מסוג ראשון?
- ג. מהי עצמת המבחן אם במציאות אכן המטבע אינו תקין כי הסיכוי לעץ בו הוא 20%.

(6) להלן השערות:

$H_0: X \sim t(5)$ - התפלגות T עם חמש דרגות חופש.

$H_1: X \sim Z$ - התפלגות נורמלית.

כלל החלטה: נדחה את השערת האפס אם X גדול מ-2.015.

א. מהי רמת המובהקות של כלל ההחלטה?

ב. מהי העוצמה של כלל ההחלטה?

(7)

במפעל מסוים נפלטים לאוויר חומרים רעילים. במצב שיגרה העוצמה הממוצעת של החומר הרעיל אמורה להיות 6,000 יחידות עם סטיית תקן 900. במצב חירום העוצמה הממוצעת היא 7,000 עם סטיית תקן 900. במפעל מערכת התראה נתמכת על ידי 9 חיישנים. אם ממוצע העוצמה של החומר הרעיל לפי תשעת החיישנים עולה על 6,600 יחידות מופעלת מערכת ההתראה. נתון שעוצמת הזיהום מתפלגת נורמלית.

א. מה הסיכוי להתראת שווא? (באיזה סוג טעות מדובר)?

ב. מה הסיכוי שבמצב חירום מערכת ההתראה לא תפעל? (באיזה סוג טעות מדובר)?

ג. מה ההסתברות שאם המצב הוא מצב חירום מערכת ההתראה תפעל? (איך קוראים להסתברות זו)?

ד. בסעיפים הבאים נשנה בכל סעיף נתון מסוים. כל סעיף עומד בפני עצמו, כיצד השינוי ישנה את הסיכוי לטעות מסוג ראשון ושני?

i. המפעל יקנה עוד 4 חיישנים.

ii. מצב חירום מוגדר כעת בתוחלת של 7,500 יחידות.

iii. מערכת ההתראה תופעל אם ממוצע של תשעת החיישנים יהיה מעל 6,700.

(8)

במטרה לבדוק האם במקום עבודה מסוים פרופורציית הבנים נמוכה מפרופורציית הבנות נדגמו באקראי 10 עובדים. הוחלט שאם מספר הבנים במדגם יהיה לכל היותר 2 תתקבל הטענה שפרופורציית הבנים נמוכה מפרופורציית הבנות.

א. מה רמת המובהקות של כלל ההכרעה הנ"ל?

ב. מהי העוצמה בהנחה ובחברה 30% בנים?

- (9)** זמן ההשפעה של משכך הכאבים "אופטלנוס" מתפלג נורמאלי עם תוחלת של 40 דקות וסטיית תקן של 12 דקות. חברת התרופות המייצרת את התרופה מנסה לשפר את התרופה כך שתוחלת הזמן עד להשפעה תתקצר. לצורך כך, דגמו 25 מטופלים שיקבלו את התרופה "אופטלנוס פורטה", ממוצע זמן התגובה של המטופלים היה 34.5 דקות. חברת התרופות החליטה מראש שאם ממוצע הזמן עד להשפעה יהיה נמוך מ-35 דקות, היא תמשיך בתהליך שיווק "אופטלנוס פורטה".
- א. מהי רמת המובהקות של המבחן המוצע?
- ב. על סמך תוצאות המדגם, מהי המסקנה ומהי הטעות האפשרית במסקנה?
- ג. מהי עצמת המבחן המוצע אם במציאות התרופה "אופטלנוס פורטה" מפחיתה את התוחלת לכדי 32 דקות?
- ד. כיצד תשתנה התשובה לסעיף ג' אם החברה הייתה מחליטה שהיא תמשיך בתהליך שיווק התרופה החדשה כאשר ממוצע המדגם יהיה נמוך מ-36 דקות?
- (10)** ציוני פסיכומטרי מתפלגים נורמלית עם סטיית תקן 120. מכון טוען שלימודים אצלו מעלים את ממוצע הציונים ביותר מ-30 נקודות. נלקחו 20 שלמדו במכון ו-20 שניגשו לבחינה בלמידה עצמית. הוחלט במשרד פרסום לקבל את טענת המכון רק אם במדגם ממוצע הציונים של אלה שלמדו במכון יהיה גבוהה בלפחות 50 נקודות מאלה שלא היו.
- א. מהי רמת המובהקות של המחקר?
- ב. מה הסיכוי לעשות טעות מסוג שני II בהנחה שהמכון מעלה את ממוצע הציונים ב-60 נקודות?
- ג. כיצד התשובות לסעיף א ו ב' היו משתנות אם מסתבר שסטיית התקן בציוני הפסיכומטרי הינה 100. הסבירו ללא חישוב.
- (11)** קו ייצור נחשב תקין אם יש בו לכל היותר 4% פגומים, ונחשב שאינו תקין אחרת. מנהל האיכות דוגם בכל יום מקו הייצור 500 מוצרים. אם במדגם יהיה לפחות 30 מוצרים פגומים יפסיקו באותו היום את קו הייצור.
- א. מה ההסתברות להפסיק את קו הייצור כשהוא תקין. איך קוראים להסתברות זאת?
- ב. מה ההסתברות להמשיך ביום מסוים את קו הייצור למרות שאינו תקין כי היו 8% פגומים בקו הייצור. איך קוראים להסתברות זאת?
- (12)** מעוניינים לבדוק האם בפקולטה מסוימת ישנה העדפה לגברים. הוחלט לדגום 200 מתקבלים ועל סמך מספר הבנים לקבוע אם טענת המחקר מתקבלת. חוקר א' קבע רמת מובהקות של 5% וחוקר ב' החליט לקבל את טענת המחקר אם במדגם יהיו לפחות 120 בנים. למי מבין החוקרים רמת מובהקות גדולה יותר?

13 מספר המכוניות הנכנסות לחניון "עזרים" מתפלג פואסונית. בשנה שעברה המכוניות נכנסו לחניון בקצב של 2 מכוניות לדקה. בעקבות תלונות על עומס יתר בכניסה לחניון מעוניין מנהל החניון לבדוק האם קצב כניסת המכוניות לחניון גדל השנה. מנהל החניון החליט לספור את מספר המכוניות שיכנסו לחניון בדקה אקראית. אם מספר המכוניות שיספרו יהיה לפחות 4 יפתח מנהל החניון שער נוסף לחניון.

א. רשמו את השערות מנהל החניון ואת כלל ההחלטה שלו. האם כלל ההכרעה הגיוני?

ב. מהי רמת המובהקות של כלל ההכרעה?

ג. מהי העוצמה של כלל ההחלטה, אם כיום קצב כניסת המכוניות לחניון גדל ל-4 מכוניות בדקה?

14 עודד עובד במפעל שבו מתחילים לעבוד בשעה 8:00. עודד בדרך כלל מאחר לעבודה והמנהל החליט לרשום את שעת הגעתו. המנהל טוען שמשך האיחור של עודד (בדקות), X , הוא משתנה אחיד $U(0, 60)$. עודד טוען שהוא לא מגיע באיחור כה גדול, אלא שהתפלגות X היא בעלת התפלגות מעריכית עם תוחלת איחור של 20 דקות.

לבדיקת טענת המנהל (H_0) כנגד טענת עודד (H_1), המבוסס על משך האיחור של חגי ביום אחד. מוצאים שני ככלי הכרעה:

כלל 1: דחה את השערת האפס אם משך האיחור יהיה לפחות 40 דקות.

כלל 2: דחה את השערת האפס אם משך האיחור יהיה לכל היותר 20 דקות.

חשבו את הסיכוי לטעות מסוג ראשון ושני לכל אחת מכללי ההכרעה. מי עדיף?

תשובות סופיות:

- (1) ראה סרטון וידאו.
- (2) $\beta = \frac{2}{5}$, $\alpha = \frac{1}{3}$
- (3) $\beta = 0.5$, $\alpha = 0.25$
- (4) א. $\beta = 0.8$, $\alpha = 0.2$ ב. $\beta = 0.3$, $\alpha = 0.2$ ג. כלל ב'.
- (5) א. השערות: H_0 - מטבע תקין. ב. 0.00781250 ג. 0.1678 H_1 - מטבע לא תקין.
- (6) א. 0.05 ב. 0.022
- (7) א. 0.0228 ב. 0.0918 ג. 0.9082 ד. i. α, β יקטנו. ii. α לא משתנה, β קטנה. iii. α קטנה, β גדלה.
- (8) א. 0.055 ב. 0.383
- (9) א. 0.0188 ב. טעות מסוג I. ג. 0.8944 ד. העוצמה תגדל.
- (10) א. 0.2981 ב. 0.3974 ג. קטן.
- (11) א. 0.0113 ב. 0.0495
- (12) חוקר א'.
- (13) א. ראה סרטון וידאו. ב. 0.1428 ג. 0.566
- (14) להלן טבלת טעויות, ממנה ניתן להסיק שכלל 2 עדיף.

β	α	כלל
0.865	$\frac{1}{3}$	1
0.368	$\frac{1}{3}$	2

שיטות סטטיסטיות

פרק 11 - הלמה של ניימן פירסון

תוכן העניינים

1. כללי 79

הלמה של ניימן פירסון:

רקע:

שיטה זו עוזרת לנו לבנות מבחנים בעלי עוצמה מקסימאלית עבור α נתונה. הלמה של ניימן פירסון אומרת שמבחן בעל עוצמה מקסימלית מתקבל כאשר אזור הדחיה שלו כולל את התוצאות שעבורן יחס הנראות הוא הגבוה ביותר.

נגדיר את יחס הנראות: $x_1, x_2, \dots, x_n$ - תוצאות הניסוי.

ההשערות: $H_0: x_i \sim p_0$, $H_1: x_i \sim p_1$.

$$\lambda(x_1, x_2, \dots, x_n) = \frac{p_{H1}(x_1, x_2, \dots, x_n)}{p_{H0}(x_1, x_2, \dots, x_n)}$$

המשמעות של יחס הנראות היא פי כמה H_1 יותר סבירה מ- H_0 .

עבור משתנים שמתפלגים בדיד:

שלב א: עבור כל תוצאות המדגם האפשריים מחשבים את הסיכויים בהנחת השערת האפס ובהנחת ההשערה האלטרנטיבית.

שלב ב: מחלקים את הסיכויים באופן הבא: $\lambda(x_1, x_2, \dots, x_n) = \frac{p_{H1}(x_1, x_2, \dots, x_n)}{p_{H0}(x_1, x_2, \dots, x_n)}$.

ומקבלים את יחס הנראות.

שלב ג: מסדרים את תוצאות הניסוי על פי סדר יורד מהתוצאה שמניבה את ערך יחס הנראות הגבוה ביותר עד התוצאה שמניבה את ערך יחס הנראות הנמוך ביותר.

שלב ד: מכניסים את התוצאה שמניבה את יחס הנראות הגבוה ביותר לאזור הדחיה ובודקים תחת השערת האפס מהי רמת המובהקות המתקבלת. צוברים את התוצאות לפי העיקרון שהוצג עד שרמת המובהקות לא תעלה על ה- α הרצויה.

דוגמה (הפתרון בהקלטה):

איכות של מוצר מסווגת ל-4 רמות איכות: מצוין, טוב, בינוני וירוד.
להלן התפלגות טיב המוצר בשני מפעלים:

מפעל / איכות	מצוין	טוב	בינוני	ירוד
"היוצר"	0.6	0.15	0.25	0
"שמשון"	0.1	0.2	0.3	0.4

בוחרים ממשלוח מוצר באקראי, אך לא יודעים מאיזה מפעל המשלוח הגיע. על סמך בדיקת האיכות מנסים להכריע האם מדובר במפעל "היוצר" (השערת האפס) או במפעל "שמשון" (השערה אלטרנטיבית). צרו כלל הכרעה לפי הלמה של ניימן פירסון ברמת מובהקות שלא תעלה על 20%.

עבור משתנים שמתפלגים רציף:

שלב א: בונים את פונקציית הצפיפות המשותפת בהנחת השערת האפס ובהנחת ההשערה האלטרנטיבית.

$$\lambda(x_1, x_2, \dots, x_n) = \frac{f_{H1}(x_1, x_2, \dots, x_n)}{f_{H0}(x_1, x_2, \dots, x_n)} : \text{שלב ב: מחלקים את שלב א באופן הבא}$$

ומקבלים את פונקציית יחס הנראות.

שלב ג: מזהים את האזור עבורו יחס הנראות הוא הגבוה ביותר.

שלב ד: לפי ההתפלגות של השערת האפס מוצאים את הערכים הקריטיים באזור שנקבע בסעיף הקודם כך שרמת המובהקות תהיה α שנקבעה מראש.

דוגמה (פתרון בהקלטה):

$$X \sim \exp(\lambda) : \text{נתון}$$

$$H_0: \lambda = 1, H_1: \lambda = 2 : \text{ההשערות הן}$$

מצאו מבחן בעל עוצמה מקסימלית ברמת מובהקות של 5% על סמך תצפית בודדת.

שאלות:

- (1) איכות של מוצר מסווגת ל-5 רמות איכות: מצוין, טוב, בינוני, ירוד ופסול. להלן התפלגות טיב המוצר בשני מפעלים:

מפעל / איכות	מצוין	טוב	בינוני	ירוד	פסול
"היוצר"	0.4	0.2	0.1	0.1	0.2
"שמשון"	0.1	0.2	0.3	0.4	0

בוחרים משלוח מוצר באקראי, אך לא יודעים מאיזה מפעל המשלוח הגיע. על סמך בדיקת האיכות מנסים להכריע האם מדובר במפעל "היוצר" (השערת האפס) או במפעל "שמשון" (השערה אלטרנטיבית).

- א. חשבו את יחס הנראות עבור כל תוצאות המדגם האפשריים.
 ב. צרו כלל הכרעה לפי הלמה של ניימן פירסון ברמת מובהקות שלא תעלה על 25%.

ג. מהי עוצמת המבחן שיצרת בסעיף הקודם?

- (2) מטבע הוטל 3 פעמים ומתבוננים במספר הפעמים שהתקבלה התוצאה ראש. נסמן ב- p את הסיכוי בהטלה בודדת לקבל את התוצאה ראש.

ההשערות הן: $H_0: p = 0.5$, $H_1: p = 0.25$.

מצאו מבחן ברמת מובהקות שלא תעלה על 30% עם עוצמה מקסימלית. מהי העוצמה?

- (3) בכד א' 7 כדורים לבנים ו-8 שחורים. בכד ב' 8 כדורים לבנים ו-7 שחורים. אדם בוחר כד וממנו מוציא באקראי 4 כדורים ללא החזרה. הוא מתבונן במספר הכדורים הלבנים שהוצאו ומודיע לך את המספר המתקבל. יש לבנות כלל הכרעה על סמך המספר המתקבל שיכריע האם מדובר בהוצאה מכד א' (השערת האפס) או מכד ב' (השערה אלטרנטיבית).
 א. בנו כלל הכרעה בעל עוצמה מקסימלית ברמת מובהקות שלא תעלה על 10%.
 ב. מהי רמת המובהקות של כלל ההכרעה שבנית בסעיף הקודם?
 ג. מה הסיכוי לטעות מסוג שני של כלל ההכרעה שבנית?

- (4) בצרור מפתחות 5 מפתחות שרק אחד פותח את הדלת. על סמך מספר הניסיונות לפתיחת הדלת יש להחליט האם הניסיונות נעשו ללא החזרה (השערת האפס) או עם החזרה (השערה אלטרנטיבית) של המפתחות לצרור. מצאו מבחן לפי הלמה של ניימן פירסון ברמת מובהקות שלא עולה על 0.25.

(5) מספר תאונות הדרכים בכביש 4 מתפלג פואסונית עם קצב של תאונה ביממה. לאחרונה התעורר החשד שתוחלת מספר התאונות בכביש עלתה לקצב של שתי תאונות ביממה. דגמו 4 ימים אקראיים וקיבלו את מספר התאונות הבאות ליממה: 3, 3, 0, 1.

- א. נסחו את הבעיה ובנו מבחן MP עם: $\alpha \leq 0.1$.
- ב. מהי מסקנתך ומהי הטעות האפשרית במסקנה?
- ג. מה הסיכוי להכריע שכיום קצב תאונות הדרכים בכביש מספר 4 עלה לשתי תאונות ביממה שאכן כך הדבר באמת? פתרו על סמך המבחן של סעיף א'.

(6) התפלגות זמן ההמתנה לקופה בסופרמרקט מתפלג מעריכית. בעל הסופרמרקט טוען שתוחלת זמן ההמתנה היא 5 דקות אך הלקוחות חושדים שהתוחלת גבוהה יותר ושווה ל-10 דקות.

- א. רשמו את השערות המחקר וחשבו את פונקציית יחס הנראות על סמך זמן המתנה של לקוח אקראי לקופה.
- ב. מה כיוון אזור הדחייה של השערת האפס?
- ג. מצאו את אזור הדחייה עבור רמת מובהקות של 5%.
- ד. בהמשך לסעיף הקודם, מה הסיכוי להכריע לטובת בעל הסופרמרקט בטעות?

(7) יהי X תצפית בודדת מפונקציית הצפיפות הבאה, כאשר θ פרמטר חיובי:

$$f_{\theta}(x) = \begin{cases} 2\theta x + 1 - \theta & 0 \leq x \leq 1 \\ 0 & \text{otherwise} \end{cases} \quad \frac{n!}{r!(n-r)!}$$

ההשערות הן: $H_0: \theta = 0$, $H_1: \theta = 1$.

- א. הוכיחו שמבחן MP (עוצמה מקסימלית) עם רמת מובהקות α יהיה: $C = \{X > 1 - \alpha\}$.

- ב. הוכיחו שהעוצמה של המבחן שנמצאה היא: $2\alpha - \alpha^2$.
- ג. מצאו את כלל ההכרעה והעוצמה עבור: $\alpha = 0.05$.

(8) מחשב חניון "אתרים" רושם את זמן כניסת כל מכונית לחניון. ישנו חשד שעקב תקלה המחשב מבצע את הרישום לכל מכונית שניה. נסמן ב- X את הזמן בדקות בין רישום לרישום.

אם הרישום הוא תקין, ההתפלגות היא מעריכית: $f_0(x) = \lambda \cdot e^{-\lambda x}$.

אם הרישום הוא לפי החשד, פונקציית הצפיפות היא: $f_1(x) = \lambda^2 \cdot x \cdot e^{-\lambda x}$.
כאשר מדובר באותו פרמטר λ .

א. רשמו את ההשערות.

ב. מצאו מבחן בעל עוצמה מקסימלית כדי לבדוק את ההשערות.

ג. פתרו עבור רמת מובהקות של 5% ו- $\lambda = 1$.

ד. רשמו את איזו הדחייה עבור שתי תצפיות אקראיות של X .

(9) יהי $X_1, \dots, X_n$ מדגם מקרי מהתפלגות בעלת פונקציית הצפיפות הבאה, כאשר θ

$$f_\theta(x) = \begin{cases} \theta e^{1-\theta x} & x \geq \frac{1}{\theta} \\ 0 & \text{otherwise} \end{cases} \quad \text{פרמטר חיובי}$$

א. מצאו מבחן בעל עוצמה מקסימלית לבדיקת ההשערות: $H_0: \theta = 1$

כנגד: $H_1: \theta = 2$, על סמך תצפית בודדת (ברמת מובהקות 5%).

ב. מהי עוצמת המבחן שמצאת?

ג. כעת נשנה את הערך תחת האלטרנטיבה ל-3 במקום 2.

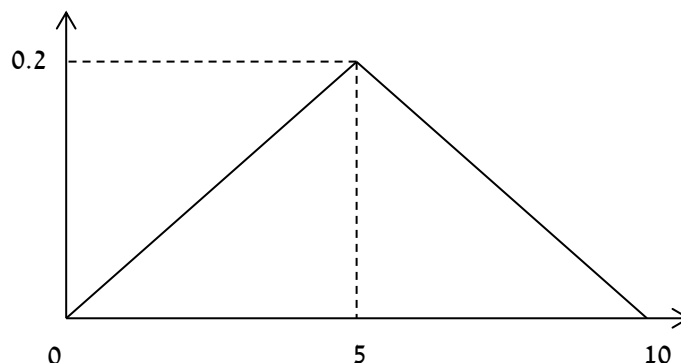
בחרו בתשובה הנכונה ונמקו:

i. אפשר לומר ללא חישוב נוסף שהעוצמה תגדל.

ii. אפשר לומר ללא חישוב נוסף שהעוצמה תקטן.

iii. יש לחשב כדי להחליט.

(10) נתונה פונקציית הצפיפות הבאה שנשמנה ב- $f_1(x)$:



$$f_0(x) = \begin{cases} 0.1 & 0 \leq x \leq 10 \\ 0 & \text{else} \end{cases} \quad \text{כמו כן נתון ש:}$$

- א. עבור השערות: $H_0: f = f_0$ כנגד: $H_1: f = f_1$, מצאו את צורת אזור הדחיה של מבחן בעל עוצמה מקסימלית, על סמך תצפית בודדת.
- ב. בהינתן: $\alpha = 0.05$, מצאו את כלל הכרעה מתאים בעל עוצמה מקסימלית.

(11) X הוא משתנה רציף המוגדר בין 0 ל-20.

$$\text{להלן השערות מחקר: } H_1: f(X) = \frac{e^{-\frac{x}{4}}}{4(1-e^{-5})} \quad , \quad H_0: X \sim U(0,20)$$

יש לבנות מבחן בעל עוצמה מקסימלית ברמת מובהקות של 10% על סמך הממוצע 100 תצפיות אקראיות.

תשובות סופיות:

(1) א. להלן טבלה: ב. ראה סרטון. ג. 0.7.

המפעל	ירוד	בינוני	טוב	מצוין	פסול
H_0	0.1	0.1	0.2	0.4	0.2
H_1	0.4	0.3	0.2	0.1	0
$\gamma(x)$	4	3	1	0.25	0

(2) $C = \{X = 0\}$, עוצמה $\frac{27}{64}$.

(3) א. $C = \{X = 4\}$. ב. 0.0256. ג. 0.9487.

(4) $C = \{X = 1 \text{ or } X \geq 6\}$.

(5) א. נדחה את השערת האפס אם מספר התאונות הכולל ב-4 הימים יהיה לפחות 8 תאונות. ב. נקבל את השערת האפס (טעות מסוג שני). ג. 0.5471.

(6) א. H_0 : התוחלת של זמן ההמתנה 5 דקות.

H_1 : התוחלת של זמן המתנה 10 דקות.

פונקציית יחס הנראות: $0.5e^{0.1x}$.

ב. $c = \{x \geq k\}$. ג. $c = \{x \geq 14.98\}$. ד. 0.776.

(7) א. שאלת הוכחה. ב. שאלת הוכחה. ג. $c = \{x > 0.95\}$, 0.0975.

(8) א. השערת האפס: שומר הלילה רושם כל מבקר אשר ניכנס לבניין. ההשערה האלטרנטיבית: שומר הלילה מדלג ברישום על מבקר, רושם אחד כן ואחד לא.

ב. אזור הדחייה יהיה היכן שיחס הנראות הינו גבוה לכן הוא יהיה מאינסוף ועד ערך k מסוים.

ג. נדחה את השערת האפס אם: $x > 2.996$. ד. $x_1 \cdot x_2 > k$.

(9) א. נדחה את H_0 עבור: $\frac{1}{2} \leq x \leq 1.0513$. ב. חישוב עוצמת המבחן: 0.668.

ג. i. אפשר לומר ללא חישוב נוסף שהעוצמה תגדל.

(10) א. $c = \{|x - 5| \leq a\}$. ב. $c = \{4.75 \leq x \leq 5.25\}$.

(11) כלל ההכרעה הוא נדחה את השערת האפס אם: $\bar{D} \leq 9.26$.