

# 概率论与数理统计

## 第七章

韩潇

[xhan011@ustc.edu.cn](mailto:xhan011@ustc.edu.cn)

# 第七章：区间估计

大纲：

- 基本概念
- 枢轴变量法
- 大样本方法
- 自助法置信区间
- 置信限

## 7.1 基本概念

**点估计的缺点：**无法估计它与真实参数之间的误差有多大→能否把未知参数估计在一个区间内.

例如：把一个大一新生的年龄估计在17-19岁之间, 中午食堂吃饭的费用在6-15元之间等等. 所以区间估计是一种常见的估计形式, 其优点是把可能的误差用醒目的形式标出来了, 即给出了参数的可能值, 从而为决策提供了充分的依据

## 7.1 基本概念

- 设 $X_1, \dots, X_n$ 是从总体 $F_\theta, \theta \in \Theta \subset \mathbb{R}$ 中抽取的一个简单随机样本, 所谓 $\theta$ 的区间估计, 就是寻找两个统计量  $\hat{\theta}_1(X_1, \dots, X_n) < \hat{\theta}_2(X_1, \dots, X_n)$ , 构造区间估计 $[\hat{\theta}_1, \hat{\theta}_2]$ , 在获得样本后, 把 $\theta$ 估计在区间 $[\hat{\theta}_1, \hat{\theta}_2]$ 中. 由于统计量是随机变量, 因此所构造的区间能否罩住参数 $\theta$ ? 这里有个概率问题, 我们希望:

➤可靠度要尽可能高, 即概率

$$P_\theta (\hat{\theta}_1(X_1, \dots, X_n) \leq \theta \leq \hat{\theta}_2(X_1, \dots, X_n)) \text{要尽可能大}$$


➤估计的精度要尽可能高, 即区间长度尽可能小.

## 7.1 基本概念

### 定义 7.1 置信区间和置信系数

设  $(X_1, \dots, X_n)$  是从总体中抽取的一个简单随机样本,  $\theta \in \Theta \subset \mathbb{R}$  为未知参数.  $\hat{\theta}_1(X_1, \dots, X_n) < \hat{\theta}_2(X_1, \dots, X_n)$  为两个统计量, 给定一个小的正数  $\alpha \in (0, 1)$ , 如果

$$\mathbb{P}_\theta(\hat{\theta}_1(X_1, \dots, X_n) \leq \theta \leq \hat{\theta}_2(X_1, \dots, X_n)) = 1 - \alpha, \quad \forall \theta \in \Theta, \quad (7.1)$$

则称区间  $[\hat{\theta}_1, \hat{\theta}_2]$  为参数  $\theta$  的置信区间 (Confidence interval) 估计, 置信系数为  $1 - \alpha$ . 

- 在实际中, 达到指定置信系数的置信区间可能有多个, 因此先寻找满足可靠性要求的区间, 然后再在满足要求的区间中寻找精度最高的区间
- 此外, 还要在最好的区间与计算方便性之间进行权衡

## 7.2 枢轴变量法

如何找到一个置信区间估计？直观上未知参数 $\theta$ 在优良的点估计附近，所以区间估计应该以这个优良的点估计为中心，向左和向右扩展一点

例：正态总体 $N(\mu, \sigma^2)$ ， $\sigma^2$ 已知，如何求 $\mu$ 的区间估计？由于 $\bar{X}$ 是 $\mu$ 的优良点估计(MVUE)，所以置信区间以 $\bar{X}$ 中心向两边延伸。注意到

$$\frac{\sqrt{n}(\bar{X}-\mu)}{\sigma} \sim N(0,1),$$

由正态密度的对称性，一个合理的置信区间应该有形式 $[\bar{X} - d, \bar{X} + d]$ ，其中 $d$ 是一个适当的常数，称为误差界限。换言之，在指定置信系数下，这种形式的置信区间长度最短。

## 7.2 枢轴变量法

如果要求置信水平为  $1 - \alpha$ , 就要求

$$\begin{aligned}\mathbb{P}_\mu(\bar{X} - d \leq \mu \leq \bar{X} + d) &= 1 - \alpha \\ \Leftrightarrow \mathbb{P}_\mu\left(|\sqrt{n}(\bar{X} - \mu)/\sigma| \leq \frac{\sqrt{nd}}{\sigma}\right) &= 1 - \alpha \\ \Leftrightarrow \Phi\left(\frac{\sqrt{nd}}{\sigma}\right) &= 1 - \frac{\alpha}{2}.\end{aligned}$$

根据分布函数上  $\alpha$  分位点的定义, 记  $u_{\alpha/2}$  为方程

$$\Phi(x) = 1 - \alpha/2$$

的解. 则易得  $\frac{\sqrt{nd}}{\sigma} = u_{\alpha/2}$ .

## 7.2 枢轴变量法

所以  $\mu$  的置信系数为  $1 - \alpha$  的置信区间为

$$\left[ \bar{x} - \frac{\sigma}{\sqrt{n}} u_{\alpha/2}, \bar{x} + \frac{\sigma}{\sqrt{n}} u_{\alpha/2} \right] \equiv \bar{x} \pm \frac{\sigma}{\sqrt{n}} u_{\alpha/2}. \quad (7.3)$$

由此，我们可以总结出寻找区间估计的一种办法-“枢轴变量法”：  
假设我们感兴趣的是参数  $\theta$ ，

1. 找一个  $\theta$  的良好点估计  $T(X)$ ，一般为  $\theta$  的最大似然估计。
2. 构造一个函数  $S(T, \theta, U(X))$  称为枢轴变量，使得它的分布完全已知，注意枢轴变量仅是  $T, \theta, U$  的函数，不能包含其他未知参数。



## 7.2 枢轴变量法

3. 枢轴变量必须满足如下条件：对 $\forall a < b$ 不等式 $a \leq S(T, \theta, U) \leq b$ 能改写为等价形式 $A \leq \theta \leq B$ . 其中 $A, B$ 只能与 $T(\mathbf{X}), U(\mathbf{X}), a, b$ 有关, 与 $\theta$ 无关
4. 取分布 $F$ 的上 $\alpha/2$ 分位点 $w_{\alpha/2}$ 和上 $1 - \alpha/2$ 分位点  $w_{1-\alpha/2}$ , 由分位点定义, 有

$$P\left(w_{1-\frac{\alpha}{2}} \leq S(T, \theta, U) \leq w_{\frac{\alpha}{2}}\right) = 1 - \alpha,$$

根据第 3 步, 不等式  $w_{1-\frac{\alpha}{2}} \leq S(T, \theta, U) \leq w_{\frac{\alpha}{2}}$  可以改写为  $A \leq \theta \leq B$  的形式, 其中  $A, B$  是统计量. 由置信区间的定义, 就是  $\theta$  的置信系数为  $1 - \alpha$  的置信区间.

## 7.2 枢轴变量法

**例 7.2** 设  $\mathbf{x} = (x_1, \dots, x_n)$  是从正态总体  $N(\mu, \sigma^2)$  中抽取的一个样本, 参数  $\mu, \sigma^2$  未知, 求  $\mu$  的置信系数为  $1 - \alpha$  的置信区间.

**例 7.3** 设某小区的一号楼 1 单元 20 户居民每月煤气和水电的消费服从正态分布  $N(\mu, \sigma^2)$ , 本月的平均消费为 160 元, 样本标准差为 20 元, 求居民平均付款额  $\mu$  的置信系数为 95% 的置信区间.

上面两个例子可以看出, 在给定置信水平下, 标准差越大, 精度越低; 样本量越大, 精度越高, 与我们的常识吻合.

## 7.2 枢轴变量法

- 当样本量 $n$ 很大时, 由中心极限定理, 不论总体是什么分布, 只要二阶矩存在, 则 $\frac{\sqrt{n}(\bar{X}-\mu)}{\hat{\sigma}}$ 近似服从标准正态分布, 这里 $\hat{\sigma}$ 为总体标准差的相合估计.
- 关于总体均值 $\mu$ 的置信系数为 $1 - \alpha$ 的置信区间近似为

$$\mu \in \bar{x} \pm \frac{\hat{\sigma}}{\sqrt{n}} u_{\alpha/2}$$

总结: 总体均值 $\mu$ 的 $1 - \alpha$ 置信区间为 $\bar{x} \pm d$ , 其中

$$d = \begin{cases} \frac{\sigma}{\sqrt{n}} u_{\frac{\alpha}{2}}, & \text{总体为正态, } \sigma^2 \text{ 已知} \\ \frac{s}{\sqrt{n}} t_{n-1}(\frac{\alpha}{2}), & \text{总体为正态, } \sigma^2 \text{ 未知} \\ \frac{\hat{\sigma}}{\sqrt{n}} u_{\alpha/2}, & n > 30, \sigma^2 \text{ 未知} \end{cases}$$

## 7.2 枢轴变量法

**例 7.4** 假设国庆期间大学生的娱乐支出服从正态分布  $N(\mu, \sigma^2)$ . 如果希望以 90% 的置信水平将平均娱乐支出估计在 100 元以内 (即误差边界为 100 元), 试在下述情形下计算至少要调查多少位大学生? (1)  $\sigma = 200$  元; (2) 根据经验, 大学生娱乐支出在 100 元到 1700 元之间.

**例 7.5** 考虑均值方差都未知时正态总体中方差  $\sigma^2$  的置信区间估计.

## 7.2 枢轴变量法

**例 7.6** 设有两个独立正态总体, 分别服从  $N(\mu_1, \sigma_1^2)$  和  $N(\mu_2, \sigma_2^2)$ , 其中  $\sigma_1^2, \sigma_2^2$  都已知. 求均值差  $\mu_2 - \mu_1$  的置信系数为  $1 - \alpha$  的置信区间. 如果  $\sigma_1^2, \sigma_2^2$  都未知时如何给出置信区间?

➤ 设  $X, Y$  的样本数为  $m, n$ ,  $\bar{X} \sim N(\mu_1, \frac{\sigma_1^2}{m})$ ,  $\bar{Y} \sim N(\mu_2, \frac{\sigma_2^2}{n})$ , 则枢轴变量及其分布为

$$\frac{(\bar{Y} - \bar{X}) - (\mu_2 - \mu_1)}{\sqrt{\frac{\sigma_1^2}{m} + \frac{\sigma_2^2}{n}}} \sim N(0, 1),$$

因此  $\mu_2 - \mu_1$  的置信系数为  $1 - \alpha$  的置信区间为  $\mu_2 - \mu_1 \in \bar{y} - \bar{x} \pm \sqrt{\frac{\sigma_1^2}{m} + \frac{\sigma_2^2}{n}} u_{\alpha/2}$

➤ 方差未知时, 上面的方法不适用, 若样本量较大 ( $m, n > 30$ ), 则可以利用中心极限定理得到近似置信区间 (提示: 利用样本方差  $S_1^2, S_2^2$ )

➤ 若样本量不大, 且  $\sigma_1^2 = \sigma_2^2 = \sigma^2$ , 则有

$$(m + n - 2)S_T^2 = \frac{(m - 1)S_1^2 + (n - 1)S_2^2}{\sigma^2} \sim \chi_{m+n-2}^2$$

## 7.2 枢轴变量法

➤ 则  $\frac{(\bar{Y} - \bar{X}) - (\mu_2 - \mu_1)}{S_T \sqrt{\frac{1}{m} + \frac{1}{n}}} \sim t_{m+n-2}$

➤ 因此  $\mu_2 - \mu_1$  的置信系数为  $1 - \alpha$  的置信区间为

$$\mu_2 - \mu_1 \in \bar{y} - \bar{x} \pm s_T \sqrt{\frac{1}{m} + \frac{1}{n}} t_{m+n-2}(\alpha/2)$$

➤ 上述称为两个正态总体的均值差的区间估计.

## 7.2 枢轴变量法

- 考虑两个正态总体方差比的区间估计，假设总体  $X \sim N(\mu_1, \sigma_1^2)$ ,  $Y \sim N(\mu_2, \sigma_2^2)$ , 样本分别为  $(x_1, \dots, x_m)$ ,  $(y_1, \dots, y_n)$ , 均值未知, 做方差比值  $\sigma_1^2/\sigma_2^2$  的区间估计
- 由F分布的定义，我们有  $\frac{s_1^2/\sigma_1^2}{s_2^2/\sigma_2^2} \sim F_{m-1, n-1}$ , 为枢轴变量，因此置信系数为  $1 - \alpha$  的置信区间为

$$\frac{\sigma_1^2}{\sigma_2^2} \in \left[ \left( \frac{s_1^2}{s_2^2} \right) F_{n-1, m-1} \left( 1 - \frac{\alpha}{2} \right), \left( \frac{s_1^2}{s_2^2} \right) F_{n-1, m-1} \left( \frac{\alpha}{2} \right) \right]$$

## 7.3 大样本方法

- 构造置信区间的关键是要知道枢轴变量的分布. 大样本方法就是利用极限定理, 特别是中心极限定理, 来建立枢轴变量  $S(T(X), \theta, U(X))$ , 使得  $S(T(X), \theta, U(X))$  的分布与  $\theta$  无关
- 如何构造比例  $p$  的置信区间?



## 7.3.1 比例p的区间估计

设事件A在每次试验中发生的概率为p，作n次独立试验，以 $Y_n$ 记事件A发生的次数，求p的 $1 - \alpha$ 置信区间。

事实上，当n充分大时，由中心极限定理，近似有  $\frac{Y_n - np}{\sqrt{np(1-p)}} \sim N(0,1)$ ，因此

$\frac{Y_n - np}{\sqrt{np(1-p)}}$  可以作为构造p的置信区间估计的枢轴变量。由中心极限定理，得

$$P(-u_{\alpha/2} \leq \frac{Y_n - np}{\sqrt{np(1-p)}} \leq u_{\alpha/2}) \approx 1 - \alpha$$

解不等式  $-u_{\alpha/2} \leq \frac{Y_n - np}{\sqrt{np(1-p)}} \leq u_{\alpha/2}$ ，令  $\hat{p} = y_n/n$ ，我们有(得分区间)

$$p \in \frac{\hat{p} + u_{\alpha/2}^2/(2n)}{1 + u_{\alpha/2}^2/n} \pm u_{\alpha/2} \frac{\sqrt{\hat{p}(1 - \hat{p})/n + u_{\alpha/2}^2/(4n^2)}}{1 + u_{\alpha/2}^2/n}, \quad (7.7)$$

令  $\hat{q} = 1 - \hat{p}$ ，若要求  
区间宽度为w，则  
样本量应该满足：

$$n = \frac{u_{\alpha/2}^2 \left[ 2\hat{p}\hat{q} - w^2 + \sqrt{(2\hat{p}\hat{q})^2 + (1 - 4\hat{p}\hat{q})w^2} \right]}{w^2}$$

**例 7.7** 网络钓鱼 (phishing) 是一种是通过欺骗性垃圾邮件或者网页, 意图引诱人们给出敏感信息 (如密码, 银行卡号等) 的一种违法攻击方式. 2016 年发表的研究论文\* 描述了一项试验, 向 320 名参与者展示一些网页, 并要求他们识别哪些是合法的, 哪些是钓鱼欺诈性的. 在研究的一个阶段, 有 157 名参与者将一个钓鱼网站误认为是安全的. 记  $p$  为参与试验人数中错误识别钓鱼网站的比例, 求  $p$  的 95% 置信区间.

**解** 显然  $p$  的点估计为  $\hat{p} = 157/320 = .491$ , 根据(7.7)知  $p$  的一个近似 95% 置信区间为

$$\begin{aligned} & \frac{(.491) + (1.96)^2/2(320)}{1 + (1.96)^2/320} \pm 1.96 \frac{\sqrt{(.491)(.509)/320 + (1.96)^2/4(320)^2}}{1 + (1.96)^2/320} \\ & = .491 \pm .054 = (.437, .545). \end{aligned}$$

因此, 在 95% 置信水平下, 我们得出在试验设置下有 43.7% 到 54.5% 之间的参与者不能识别该钓鱼网站. □

## 7.3.2 一般总体均值 $\mu$ 的置信区间

设 $(X_1, X_2, \dots, X_n)$ 是从总体 $X$ 中抽取的一个简单随机样本,  $E(X) = \mu$ 为感兴趣的参数, 同时, 总体的分布未知, 如何构造 $\mu$ 的置信区间?

若 $E(X^2) < \infty$ , 根据大数定律, 样本标准差 $S$ 是 $\sigma$ 的一个相合估计. 再由中心极限定理, 近似有

$$\frac{\sqrt{n}(\bar{X} - \mu)}{S} \sim N(0,1)$$

因此  $\frac{\sqrt{n}(\bar{X} - \mu)}{S}$  可以作为 $\mu$ 近似的枢轴变量, 不难得到 $\mu$ 的置信水平近似为 $1 - \alpha$ 置信区间为

$$\mu \in \bar{x} \pm \frac{S}{\sqrt{n}} u_{\alpha/2}$$

## 7.3.2 一般总体均值 $\mu$ 的置信区间

**例 7.9** 设  $x_1, \dots, x_n$  是从 Poisson 总体  $P(\lambda)$  中抽取的一个简单随机样本, 求  $\lambda$  的区间估计.

**例 7.10** 设  $x_1, \dots, x_n$  是从指数总体  $Exp(\lambda)$  中抽取的一个简单随机样本, 求均值  $\theta = \lambda^{-1}$  的  $1 - \alpha$  置信区间.

## 7.4 自助法置信区间

如果总体分布不是正态分布且样本量比较小，如何构建总体均值的置信区间？

自助法(Bootstrap method)-仅仅通过使用已有的样本数据而不对总体的分布做任何假设，给出置信区间

- 将手头的样本当成总体-因为样本在某种意义上反映了总体的信息

## 7.4 自助法置信区间

### 标准自助法步骤:

假设我们在当前样本观测值  $x_1, x_2, \dots, x_n$  下想得到统计量  $\hat{\theta}$  的自助分布, 则

- (1) 从  $x_1, x_2, \dots, x_n$  中有放回地抽取一组样本量同样为  $n$  的样本, 记为  $x_1^*, x_2^*, \dots, x_n^*$ , 称为一个自助样本.
- (2) 基于自助样本  $x_1^*, x_2^*, \dots, x_n^*$  计算统计量  $\hat{\theta}$  的值, 称为  $\hat{\theta}$  的一个自助版本.
- (3) 重复上述 (1)-(2) 步足够多次, 比如  $B$  次, 得到  $B$  个自助版本  $\hat{\theta}_1^*, \hat{\theta}_2^*, \dots, \hat{\theta}_B^*$ , 它们被用来近似统计量  $\hat{\theta}$  的自助分布. 也就是说视自助版本为  $\hat{\theta}$  的同分布复制.

## 7.4 自助法置信区间

构造置信区间的关键： $\hat{\theta} - \theta$ 可以由 $\hat{\theta}^* - \hat{\theta}$ 来近似

### 定义 7.2 基本自助置信区间

设感兴趣参数  $\theta$  的点估计为  $\hat{\theta}$ , 记其  $B$  个自助版本统计量  $\hat{\theta}_1^*, \hat{\theta}_2^*, \dots, \hat{\theta}_B^*$  的  $\alpha/2$  和  $1 - \alpha/2$  样本分位数分别为  $\hat{\theta}_{[(B+1)\alpha/2]}^*$  和  $\hat{\theta}_{[(B+1)(1-\alpha/2)]}^*$ , 则称

$$\left[ 2\hat{\theta} - \hat{\theta}_{[(B+1)(1-\alpha/2)]}^*, 2\hat{\theta} - \hat{\theta}_{[(B+1)\alpha/2]}^* \right]$$

为  $\theta$  的  $1 - \alpha$  基本自助置信区间 (The Basic Bootstrap Confidence Interval).



## 7.4 自助法置信区间

若 $\hat{\theta}$ 是 $\theta$ 的(渐进)无偏估计, 标准差 $se(\hat{\theta})$ 可以得到, 且枢轴变量

$$T = \frac{\hat{\theta} - \theta}{se(\hat{\theta})}$$

的(渐进)分布已知, 则可以用 $T$ 来构造 $\theta$ 的置信区间.

未知时, 自助t置信区间法:

1. 使用 $\hat{\theta}$ 的自助版本 $\hat{\theta}_1^*, \hat{\theta}_2^*, \dots, \hat{\theta}_B^*$ 的样本标准差估计 $se(\hat{\theta})$ :

$$\widehat{se}_B(\hat{\theta}) = \sqrt{\frac{1}{B-1} \sum_{b=1}^B (\hat{\theta}_b^* - \bar{\hat{\theta}}^*)^2}, \quad \bar{\hat{\theta}}^* = \sum_{b=1}^B \hat{\theta}_b^* / B$$

2. 构建一个“ $T$ 类型”的变量

$$T^* = \frac{\hat{\theta} - \theta}{\widehat{se}_B(\hat{\theta})}$$

3. 再使用自助法计算出 $T^*$ 的样本分位数 $t_{\alpha/2}^*$ 和 $t_{1-\alpha/2}^*$ , 从而得到自助t置信区间



## 7.4 自助法置信区间

### 定义 7.3 自助 $t$ 置信区间

称

$$[\hat{\theta} - t_{1-\alpha/2}^* \hat{se}_B(\hat{\theta}), \hat{\theta} - t_{\alpha/2}^* \hat{se}_B(\hat{\theta})]$$

为  $\theta$  的  $1 - \alpha$  自助  $t$  置信区间 (The Bootstrap  $t$  Confidence Interval).



记样本值为  $x = (x_1, \dots, x_n)$ , 则自助  $t$  置信区间的算法如下

1. 由样本观测值得到  $\hat{\theta}$ .
2. 对每个再抽样,  $b = 1, \dots, B$ :
  - (a). 从  $x$  中有放回的抽样得到第  $b$  个再抽样样本  $x^{(b)} = (x_1^{(b)}, \dots, x_n^{(b)})$ .
  - (b). 由第  $b$  个再抽样样本计算  $\hat{\theta}_b^*$ .
  - (c). 计算  $\hat{\theta}_b^*$  的标准差估计  $\hat{se}_R(\hat{\theta}_b^*)$ . (即对每个再抽样样本  $x^{(b)}$ , 生成  $R$  个自助版本为  $\tilde{\theta}^*$ , 使用自助法估计标准差):

$$\hat{se}_R(\hat{\theta}_b^*) = \sqrt{\frac{1}{R-1} \sum_{k=1}^R (\tilde{\theta}_k^* - \overline{\tilde{\theta}^*})^2}, \quad (7.17)$$

其中  $\overline{\tilde{\theta}^*} = \sum_b \tilde{\theta}_b^* / R$ . 注意此步嵌套使用了自助法.

- (d). 计算第  $b$  个重复下的“ $t$ ”统计量:  $t^{(b)} = (\hat{\theta}_b^* - \hat{\theta}) / \hat{se}_R(\hat{\theta}_b^*)$
3. 重复样本  $t^{(1)}, \dots, t^{(B)}$  的分布作为推断分布. 找出样本分位数  $t_{\alpha/2}^*$  和  $t_{1-\alpha/2}^*$ .
4. 计算  $\hat{se}_B(\hat{\theta})$ , 即自助版本  $\{\hat{\theta}_b^*\}$  的样本标准差.
5. 计算置信界  $[\hat{\theta} - t_{1-\alpha/2}^* \hat{se}_B(\hat{\theta}), \hat{\theta} - t_{\alpha/2}^* \hat{se}_B(\hat{\theta})]$

## 7.5 置信限

在实际问题中，有时候我们只对参数 $\theta$ 一侧的界限感兴趣：

- 空气颗粒物的上限不超过某个值( $\theta \leq \bar{\theta}$ )
- 对于小区推出的某项惠民措施，我们仅关心支持该措施业主的百分率下限( $\theta \geq \underline{\theta}$ )

## 7.5 置信限

### 定义7.4

设 $(X_1, X_2, \dots, X_n)$ 是从总体 $F(x, \theta)$ 中抽取的一个简单随机样本,  $\bar{\theta} = \bar{\theta}(X_1, X_2, \dots, X_n)$ ,  $\underline{\theta} = \underline{\theta}(X_1, X_2, \dots, X_n)$ 为两个统计量.

1. 若对 $\theta$ 的一切可取的值, 有

$$P(\bar{\theta}(X_1, X_2, \dots, X_n) \geq \theta) = 1 - \alpha \quad (7.18)$$

则称 $\bar{\theta}$ 为 $\theta$ 的一个置信系数为 $1 - \alpha$ 的置信上限;

2. 若对 $\theta$ 的一切可取的值, 有

$$P(\underline{\theta}(X_1, X_2, \dots, X_n) \leq \theta) = 1 - \alpha \quad (7.19)$$

则称 $\underline{\theta}$ 为 $\theta$ 的一个置信系数为 $1 - \alpha$ 的置信下限;

## 7.5 置信限

➤ 置信上限和置信下限是一种特殊的置信区间，其一端为 $\infty$ 或 $-\infty$ ，因此前面求区间估计的方法，可以平移到此处。

➤ 求正态分布总体 $N(\mu, \sigma^2)$ 的均值 $\mu$ 的置信上限，当 $\sigma^2$ 已知时， $\sqrt{n}(\bar{X} - \mu)/\sigma$ 是枢轴变量，分布为标准正态，故

$$P\left(\frac{\sqrt{n}(\bar{X} - \mu)}{\sigma} \geq -u_\alpha\right) = 1 - \alpha \Rightarrow P\left(\bar{X} + \frac{\sigma}{\sqrt{n}}u_\alpha \geq \mu\right) = 1 - \alpha$$

参考(7.18)，我们有 $\bar{x} + \frac{\sigma}{\sqrt{n}}u_\alpha$ 是 $\mu$ 的 $1 - \alpha$ 的置信上限

➤ 同理， $\mu$ 的 $1 - \alpha$ 的置信下限为 $\bar{x} - \frac{\sigma}{\sqrt{n}}u_\alpha$ 。

➤  $\sigma^2$ 未知时， $\mu$ 的 $1 - \alpha$ 的置信上限和置信下限分别为 $\bar{x} + \frac{s}{\sqrt{n}}t_{n-1}(\alpha)$ 和 $\bar{x} - \frac{s}{\sqrt{n}}t_{n-1}(\alpha)$

➤ 正态总体中 $\sigma^2$ 的 $1 - \alpha$ 的置信上限和置信下限分别为 $(n - 1)s^2 / \chi_{n-1}^2(1 - \alpha)$ 和 $(n - 1)s^2 / \chi_{n-1}^2(\alpha)$

## 7.5 置信限

**例 7.13** 设某地区 12 个测量点测得某时刻空气质量指数 (Air Quality Index, AQI)( $\mu g/m^3$ ) 为

29, 37, 47, 57, 53, 60, 54, 51, 46, 44, 33, 32.

设空气质量指数服从正态分布, 求该时刻某地区空气质量指数的 90% 的置信上限. 能否说该时刻某地区的空气为优? (空气质量指数在  $50\mu g/m^3$  以下为优)



*Thank  
you!*