

## Seminarul 7

**1. i)** Estimați parametrul necunoscut  $p \in (0, 1)$  pentru distribuția binomială a unei caracteristici cercetate:  $X \sim Bino(N, p)$ , unde  $N \in \mathbb{N}^*$  este cunoscut, cu metoda momentelor, respectiv metoda verosimilității maxime. Sunt estimatorii obținuți nedeplasați, respectiv consistenți?

**ii)** Într-o urnă sunt bile albe și negre. Proportia de bile albe  $p \in (0, 1)$  este necunoscută. În urma a  $n = 6$  serii a câte  $N = 5$  extrageri cu returnarea bilei extrase în urnă s-au obținut: 3, 4, 2, 0, 2, respectiv 1, bile albe. Estimați valoarea lui  $p$  cu metoda momentelor, respectiv metoda verosimilității maxime.

R: i) Fie  $X_1, \dots, X_n$  variabile de selecție și  $x_1, \dots, x_n$  date statistice pentru  $X$ .

Metoda momentelor:  $E(X) = Np = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i \implies \hat{p}(x_1, \dots, x_n) = \frac{1}{nN} \sum_{i=1}^n x_i$  valoarea estimată pentru parametrul necunoscut  $p$ .

Metoda verosimilității maxime:  $P(X = x) = C_N^x p^x (1-p)^{N-x}, x \in \{0, 1, \dots, N\}$

$$\implies L(x_1, \dots, x_n; p) = \prod_{i=1}^n P(X = x_i) = \prod_{i=1}^n C_N^{x_i} p^{x_i} (1-p)^{N-x_i} = \prod_{i=1}^n C_N^{x_i} \cdot p^{\sum_{i=1}^n x_i} (1-p)^{nN - \sum_{i=1}^n x_i}$$

$$\implies \ln L(x_1, \dots, x_n; p) = \sum_{i=1}^n \ln C_N^{x_i} + \sum_{i=1}^n x_i \ln p + (nN - \sum_{i=1}^n x_i) \ln(1-p)$$

$$\implies \frac{\partial \ln L}{\partial p}(x_1, \dots, x_n; p) = \frac{1}{p} \sum_{i=1}^n x_i - \frac{1}{1-p} (nN - \sum_{i=1}^n x_i).$$

$$\text{Deci, } \frac{\partial \ln L}{\partial p}(x_1, \dots, x_n; p) = 0 \implies p = \frac{1}{nN} \sum_{i=1}^n x_i;$$

$\frac{\partial^2 \ln L}{\partial p^2}(x_1, \dots, x_n; p) = -\frac{1}{p^2} \sum_{i=1}^n x_i - \frac{1}{(1-p)^2} \sum_{i=1}^n (N - x_i) < 0 \implies L(x_1, \dots, x_n; \cdot)$  ia valoarea maximă pentru  $p$  găsit mai sus. Valoarea estimată pentru parametrul necunoscut  $p$  este  $\hat{p}(x_1, \dots, x_n) = \frac{1}{nN} \sum_{i=1}^n x_i$ . Estimatorul pentru ambele metode este  $\hat{p}(X_1, \dots, X_n) = \frac{1}{nN} \sum_{i=1}^n X_i$ .

Deoarece  $E(\hat{p}(X_1, \dots, X_n)) = \frac{1}{N} E(X) = \frac{N \cdot p}{N} = p$ , estimatorul este nedeplasat.

LTNM implică  $\hat{p}(X_1, \dots, X_n) \xrightarrow{a.s.} \frac{1}{N} E(X) = p$  (am considerat șirul de variabile de selecție  $X_1, \dots, X_n, \dots$ ) deci estimatorul este consistent.

**ii)** Valoarea estimatorului este  $\hat{p}(3, 4, 2, 0, 2, 1) = \frac{12}{6 \cdot 5} = 40\%$ .

**2. i)** O caracteristică cercetată  $X$  are funcția de densitate

$$f_X(x) = \begin{cases} \lambda^2 x e^{-\lambda x}, & x > 0, \\ 0, & x \leq 0, \end{cases}$$

unde  $\lambda > 0$  este fixat. Estimați parametrul necunoscut  $\lambda$  cu metoda momentelor, respectiv metoda verosimilității maxime. Sunt estimatorii obținuți consistenți?

**ii)** Durata culorii roșii (în minute)  $X$  a unui anumit semafor are funcția de densitate  $f_X$  dată mai sus, cu parametrul  $\lambda > 0$  necunoscut. Un taximetrist (curios din fire) a observat următoarele durate (în minute) ale culorii roșii pentru acest semafor:  $1, \frac{3}{2}, 3, 2, 3, \frac{5}{2}, 1, 2$ . Aplicați metoda momentelor, respectiv metoda verosimilității maxime, pentru a estima valoarea lui  $\lambda$ , folosind datele furnizate de taximetrist.

R: i) Fie  $X_1, \dots, X_n$  variabile de selecție și  $x_1, \dots, x_n$  date statistice pentru  $X$ .

Metoda momentelor:  $E(X) = \int_0^\infty \lambda^2 x^2 e^{-\lambda x} dx = \frac{2}{\lambda} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i \implies \hat{\lambda}(x_1, \dots, x_n) = \frac{2n}{\sum_{i=1}^n x_i}$ .

Metoda verosimilității maxime:  $f_X(x) = \lambda^2 x e^{-\lambda x}, x > 0 \implies L(x_1, \dots, x_n; \lambda) = \prod_{i=1}^n \lambda^2 x_i e^{-\lambda x_i} \implies \ln L(x_1, \dots, x_n; \lambda) = 2n \ln \lambda + \sum_{i=1}^n \ln x_i - \lambda \sum_{i=1}^n x_i$ .  $\frac{\partial \ln L}{\partial \lambda}(x_1, \dots, x_n; \lambda) = \frac{2n}{\lambda} - \sum_{i=1}^n x_i = 0 \implies \lambda = \frac{2n}{\sum_{i=1}^n x_i}$ ;  $\frac{\partial^2 \ln L}{\partial \lambda^2}(x_1, \dots, x_n; \lambda) = -\frac{2n}{\lambda^2} < 0 \implies$  valoarea estimatorului este  $\hat{\lambda}(x_1, \dots, x_n) = \frac{2n}{\sum_{i=1}^n x_i}$ . Estimatorul pentru ambele metode este  $\hat{\lambda}(X_1, \dots, X_n) = \frac{2n}{\sum_{i=1}^n X_i}$ .

LTNM  $\implies \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i \xrightarrow{a.s.} E(X) = \frac{2}{\lambda}$  (unde considerăm șirul de variabile de selecție  $X_1, \dots, X_n, \dots$ )  $\implies \hat{\lambda}(X_1, \dots, X_n) = \frac{2}{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i} \xrightarrow{a.s.} \frac{2}{\frac{2}{\lambda}} = \lambda \implies$  estimatorul este consistent.

**ii)** Valoarea estimată este  $\hat{\lambda}(1, \frac{3}{2}, 3, 2, 3, \frac{5}{2}, 1, 2) = 1$ .

Pentru rezolvarea următoarelor probleme de statistică, folosiți următoarele valori numerice calculate în Python:

```
[1]: from scipy.stats import norm, t, chi2
```

```
[2]: round(norm.ppf([0.025,0.05,0.95,0.975]),decimals=2)
```

```
[2]: array([-1.96, -1.64, 1.64, 1.96])
```

```
[3]: round(t.ppf([0.025,0.05,0.95,0.975],4),decimals=2),  
round(t.ppf([0.025,0.05,0.95,0.975],99),decimals=2)
```

```
[3]: (array([-2.78, -2.13, 2.13, 2.78]),  
array([-1.98, -1.66, 1.66, 1.98]))
```

```
[4]: round(chi2.ppf([0.025,0.05,0.95,0.975],2),decimals=2),  
round(chi2.ppf([0.025,0.05,0.95,0.975],4),decimals=2)
```

```
[4]: (array([0.05, 0.1, 5.99, 7.38]),  
array([0.48, 0.71, 9.49, 11.14]))
```

**3.** Considerăm următoarele date statistice pentru masa corporală a persoanelor dintr-o anumită populație: 71 kg; 68 kg; 77 kg; 69 kg; 65 kg. Presupunem că masa corporală este o caracteristică ce urmează distribuția normală.

**a)** Știind că varianța/dispersia masei corporale este 20, determinați un interval de încredere bilateral cu nivelul de încredere 95% pentru media masei corporale, apoi testați, cu probabilitatea de risc 5%, ipoteza că media masei corporale este 75 kg.

**b)** Știind că varianța/dispersia masei corporale este necunoscută, determinați un interval de încredere bilateral cu nivelul de încredere 95% pentru media masei corporale, apoi testați, cu probabilitatea de risc 5%, ipoteza că media masei corporale este 75 kg.

**c)** Determinați un interval de încredere bilateral cu nivelul de încredere 95% pentru varianța masei corporale, apoi testați, cu probabilitatea de risc 5%, ipoteza că abaterea standard a masei corporale este 10 kg.

R:  $n = 5$ ,  $\bar{x}_n = \frac{71+68+77+69+65}{5} = 70$ ,  $\alpha = 5\% = 0,05$ . Fie  $\mu$  media masei corporale.

a)  $z_{1-\frac{\alpha}{2}} = \text{norm.ppf}(0.975) \approx 1,96$ ,  $\sigma = \sqrt{20} = 2\sqrt{5}$ .

Valoarea intervalului de încredere este:  $(\bar{x}_n - z_{1-\frac{\alpha}{2}} \cdot \frac{\sigma}{\sqrt{n}}, \bar{x}_n + z_{1-\frac{\alpha}{2}} \cdot \frac{\sigma}{\sqrt{n}}) \approx (70 - 1,96 \cdot 2, 70 + 1,96 \cdot 2) = (66,08, 73,92)$ . Deoarece 75 nu aparține intervalului, respingem  $H_0 : \mu = 75$  și acceptăm  $H_1 : \mu \neq 75$ .

b)  $t_{1-\frac{\alpha}{2}} = \text{t.ppf}(0.975, 4) \approx 2,78$ ,  $s_n = \left( \frac{1}{n-1} \sum_{k=1}^n (x_k - \bar{x}_n)^2 \right)^{\frac{1}{2}} = \sqrt{\frac{1^2 + (-2)^2 + 7^2 + (-1)^2 + (-5)^2}{4}} = 2\sqrt{5}$ .

Valoarea intervalului de încredere este:  $(\bar{x}_n - t_{1-\frac{\alpha}{2}} \cdot \frac{s_n}{\sqrt{n}}, \bar{x}_n + t_{1-\frac{\alpha}{2}} \cdot \frac{s_n}{\sqrt{n}}) \approx (70 - 2,78 \cdot 2, 70 + 2,78 \cdot 2) = (64,44, 75,56)$ . Deoarece 75 aparține intervalului, acceptăm  $H_0 : \mu = 75$  și respingem  $H_1 : \mu \neq 75$ .

c)  $c_{\frac{\alpha}{2}} = \text{chi2.ppf}(0.025, 4) \approx 0,48$ ,  $c_{1-\frac{\alpha}{2}} = \text{chi2.ppf}(0.975, 4) \approx 11,14$ .

Valoarea intervalului de încredere este:  $\left( \frac{(n-1)s_n^2}{c_{1-\frac{\alpha}{2}}}, \frac{(n-1)s_n^2}{c_{\frac{\alpha}{2}}} \right) \approx \left( \frac{80}{11,14}, \frac{80}{0,48} \right) \approx (7,18, 166,67)$ . Deoarece  $100 \in \left( \frac{80}{11,14}, \frac{80}{0,48} \right) \Leftrightarrow 48 < 80 < 111,4$ , acceptăm  $H_0 : \sigma = 10$  și respingem  $H_1 : \sigma \neq 10$ .

**4.** Într-un sondaj de opinie, suntem interesați de proporția  $p$  a persoanelor dintr-un anumit oraș care ar vota candidatul  $A$  împotriva candidatului  $B$ . 576 din participanții la sondaj au declarat că ar vota candidatul  $A$ , iar 324 din participanți au declarat că ar vota cu candidatul  $B$ .

a) Determinați un interval de încredere bilateral cu nivelul de încredere 95% pentru  $p$ .

b) Testați cu probabilitatea de risc 5% ipoteza că  $p = 0,6$ .

R:  $n = 576 + 324 = 900$ ,  $\bar{x}_n = \frac{576}{900} = 0,64$ ,  $\alpha = 5\% = 0,05$ ,  $z_{1-\frac{\alpha}{2}} = \text{norm.ppf}(0.975) \approx 1,96$ .

a) Valoarea intervalului de încredere este:  $(\bar{x}_n - z_{1-\frac{\alpha}{2}} \sqrt{\frac{\bar{x}_n(1-\bar{x}_n)}{n}}, \bar{x}_n + z_{1+\frac{\alpha}{2}} \sqrt{\frac{\bar{x}_n(1-\bar{x}_n)}{n}}) \approx (0,64 - 1,96 \sqrt{\frac{0,64 \cdot 0,36}{900}}, 0,64 + 1,96 \sqrt{\frac{0,64 \cdot 0,36}{900}}) = (0,64 - 1,96 \cdot \frac{0,8 \cdot 0,6}{30}, 0,64 + 1,96 \cdot \frac{0,8 \cdot 0,6}{30}) \approx (0,61, 0,67)$ .

b) Aplicăm testul pentru proporție.  $p_0 = 0.6$ ,  $np_0(1-p_0) \geq 10$ ,  $z = \frac{\bar{x}_n - p_0}{\sqrt{\frac{p_0(1-p_0)}{n}}} = \frac{0,04}{\sqrt{\frac{0,24}{900}}} = \sqrt{6} \approx 2,45 \implies |z| \geq z_{1-\frac{\alpha}{2}} \implies$  se respinge  $H_0 : p = 0.6$ , adică se acceptă  $H_1 : p \neq 0.6$ .

**5.** Un provider de internet își asigură clienții că viteza conexiunii la internet este în medie 250 Mbps între orele 20:00 și 22:00. Pe de altă parte, providerul susține că în acest interval orar conexiunea nu este stabilă, având o abatere standard de 40 Mbps. În urma unei selecții de 100 de clienți s-a constatat că valoarea mediei de selecție este 242 Mbps pentru viteza conexiunii între orele specificate.

i) Să se construiască un interval de încredere unilateral stâng cu nivelul de încredere 95% pentru media vitezei conexiunii.

ii) Să se testeze, cu nivelul de semnificație 5%, dacă media vitezei este cea pretinsă de provider.

R:  $n = 100$ ,  $\bar{x}_{100} = 242$ ,  $\sigma = 40$ ,  $\alpha = 0,05$ .

i)  $z_\alpha = \text{norm.ppf}(0.05) \approx -1,64$ . Valoarea intervalului de încredere unilateral este  $(-\infty, \bar{x}_{100} - \frac{\sigma}{\sqrt{n}} \cdot z_\alpha) \approx (-\infty, 242 + \frac{40}{10} \cdot 1,64) = (-\infty, 248,56)$ . Deoarece viteza conexiunii nu poate fi negativă, avem intervalul  $[0, 248,56)$ .

ii)  $H_0 : \mu = 250$ ,  $H_1 : \mu \neq 250$ . Aplicăm testul pentru medie, când varianța este cunoscută:  $z_{1-\frac{\alpha}{2}} = \text{norm.ppf}(0.975) \approx 1,96$ ,  $z = \frac{\bar{x}_{100} - 250}{\frac{\sigma}{\sqrt{100}}} = \frac{242 - 250}{\frac{40}{10}} = -2$ ,  $|z| \geq z_{1-\frac{\alpha}{2}} \implies$  se respinge  $H_0$ , adică se acceptă că media vitezei conexiunii la internet nu este cea pretinsă de provider.

**6.** O companie dorește înlocuirea unui sistem de frânare pentru un anumit tip de mașină cu unul nou, care să reducă semnificativ distanța de frânare. Media distanței de frânare pentru vechiul sistem este mai mare sau egală decât 50 m, pentru o viteză de 80 km/h pe ploaie. În urma testării a 100 de mașini cu noul sistem de frânare instalat, pentru o viteză de 80 km/h pe ploaie, s-a constatat că valoarea mediei de selecție este 49 m și că valoarea abaterii standard de selecție este 1 m pentru distanța de frânare a acestui eșantion.

i) Să se construiască un interval de încredere unilateral drept cu nivelul de încredere 95% pentru media distanței de frânare a noului sistem.

ii) Să se testeze cu probabilitatea de risc 5% dacă noul sistem de frânare este diferit de cel vechi.

R:  $n = 100$ ,  $\bar{x}_n = 49$ ,  $s_n = 1$ ,  $\alpha = 0,05$ .

i)  $t_{1-\alpha} = \text{t.ppf}(0.95, 99) \approx 1,66$ . Valoarea intervalului de încredere unilateral este  $(\bar{x}_{100} - \frac{s_n}{\sqrt{n}} \cdot t_{1-\alpha}, \infty) \approx (49 - 1,66, \infty) = (47,34, \infty)$ .

ii)  $H_0 : \mu = 50$ ,  $H_1 : \mu \neq 50$ . Aplicăm testul pentru medie, când varianța este necunoscută:  $t_{1-\frac{\alpha}{2}} = \text{t.ppf}(0.975, 99) \approx 1,98$ ,  $t = \frac{\bar{x}_{100} - 50}{\frac{s_n}{\sqrt{n}}} = \frac{49 - 50}{\frac{1}{10}} = -10$ ,  $|t| \geq t_{1-\frac{\alpha}{2}} \implies$  se respinge  $H_0$ , adică se acceptă că sistemul nou este diferit de cel vechi.

7. Un sondaj de opinie are în vedere studiul a două caracteristici:  $F$ , genul de film preferat, și  $M$ , genul de muzică preferat. S-au obținut următoarele date statistice:

Film \ Muzică	Rock	Pop
Acțiune	25	45
Comedie	26	39
Dramă	39	26

Testați, cu nivelul de semnificație 5%, dacă  $F$  și  $M$  sunt independente.

R: Aplicăm testul pentru independența a două caracteristici discrete.

$$r = 3, s = 2, n_{1.} = 70, n_{2.} = 65, n_{3.} = 65, n_{.1} = 90, n_{.2} = 110, n = 200,$$

$$x = \frac{\left(25 - \frac{70 \cdot 90}{200}\right)^2}{\frac{70 \cdot 90}{200}} + \frac{\left(45 - \frac{70 \cdot 110}{200}\right)^2}{\frac{70 \cdot 110}{200}} + \frac{\left(26 - \frac{65 \cdot 90}{200}\right)^2}{\frac{65 \cdot 90}{200}} + \frac{\left(39 - \frac{65 \cdot 110}{200}\right)^2}{\frac{65 \cdot 110}{200}} + \frac{\left(39 - \frac{65 \cdot 90}{200}\right)^2}{\frac{65 \cdot 90}{200}} + \frac{\left(26 - \frac{65 \cdot 110}{200}\right)^2}{\frac{65 \cdot 110}{200}} \approx 6,12,$$

$c_{1-\alpha} = \text{chi2.ppf}(1 - \alpha, (r - 1)(s - 1)) = \text{chi2.ppf}(0.95, 2) \approx 6 \implies x \geq c_{1-\alpha} \implies$  se respinge  $H_0$  : “ $F$  și  $M$  sunt independente” și se acceptă  $H_1$  : “ $F$  și  $M$  sunt dependente”.

8. Într-o urnă sunt 100 de bile. Fiecare bilă este colorată cu una din culorile: roșu, albastru, verde. În urma extragerii a 120 bile, cu returnare, s-au obținut 34 de bile roșii, 55 de bile albastre și 31 de bile verzi. Folosind un test statistic cu nivelul de semnificație 5%, se poate afirma că în urnă sunt 25 de bile roșii, 50 de bile albastre și 25 de bile verzi?

R: Aplicăm testul  $\chi^2$  de concordanță.

$$n = 34 + 55 + 31 = 120, p_r = \frac{25}{100}, p_a = \frac{50}{100}, p_v = \frac{25}{100}, v = \frac{(34 - 120 \cdot 0,25)^2}{120 \cdot 0,25} + \frac{(55 - 120 \cdot 0,5)^2}{120 \cdot 0,5} + \frac{(31 - 120 \cdot 0,25)^2}{120 \cdot 0,25} \approx 1,48,$$

$c_{1-\alpha} = \text{chi2.ppf}(0.95, 2) \approx 6. v < c_{1-\alpha} \implies$  se acceptă  $H_0$  :  $p_r = \frac{25}{100}, p_a = \frac{50}{100}, p_v = \frac{25}{100}$ .