目录

第一章 概率论的基本概念 2
第二章 随机变量及其分布 2
第三章 多为随机变量及其分布 4
第四章 随机变量的数字特征 4
第五章 大数定律和中心极限定理 5
第六章 样本及抽样分布 6
第七章 参数估计 7
第八章 假设检验 7
三大抽样分布 8
常用随机变量分布 9
正态总体均值、方差的置信区间 10
正态总体参数的假设检验 11

第一章 概率论的基本概念

1. 互斥(互不相容)：$AB=\emptyset$　　对立(互逆)：$\bar{A}=B$

完备(完全)事件组：$A_1,A_2,\dots,A_n$，满足$A_iA_j=\emptyset, i\neq j$，且$\bigcup_{i=1}^{n}A_i=\Omega$

2. 德摩根律：$\overline{A\cup B}=A\cap B$　　$\overline{A\cap B}=A\cup B$　　$\overline{\mathrm{A}-\mathrm{B}}=\overline{\mathrm{A}\bar{\mathrm{B}}}=\bar{\mathrm{A}}\cup\mathrm{B}$

3. $A\subset B, AB=A$

4. $P(A\cup B)=P(A)+P(B)-P(AB)$　　$P(A-B)=P(A)-P(AB)=P(A\bar{B})$

$P(A\cup B\cup C)=P(A)+P(B)+P(C)-P(AB)-P(BC)-P(AC)+P(ABC)$

$P(AB)=P(A)-P(A\bar{B})$

5. 古典型概率计算公式：$P(A)=\frac{k}{n}=\frac{\text{事件 A 中的基本事件数}}{\text{样本空间}S\text{中的基本事件总数}}$

6. 不放回抽取，连续取 n 次每次取 1 个⇔一次取 n 个

7. 条件概率：$P(B|A)=\frac{P(AB)}{P(A)}$　　乘法定理：$P(AB)=P(B|A)P(A)$

缩减样本空间解法　　$P(ABC)=P(C|AB)P(B|A)P(A)$

8. 全概率公式：离散：$P(A)=\sum_{i=1}^{n}P(AB_i)=\sum_{i=1}^{n}P(A|B_i)P(B_i)$

连续：$p_X(x)=\int_{-\infty}^{+\infty}p(x|y)p_Y(y)\,dy$　　$p_Y(y)$同理

9. 贝叶斯公式：离散：$P(B_i|A)=\frac{P(A|B_i)P(B_i)}{P(A)}=\frac{P(A|B_i)P(B_i)}{\sum_{j=1}^{n}P(A|B_j)P(B_j)}$

连续：$p(y|x)=\frac{p(x|y)p_Y(y)}{p_X(x)}=\frac{p(x|y)p_Y(y)}{\int_{-\infty}^{+\infty}p(x|y)p_Y(y)\,dy}$　　$p(x|y)$同理

10. A、B 独立：$P(AB)=P(A)P(B)$

定理：①一列独立事件中任一部分改为对立事件，所得事件列仍为相互独立

②事件 A、B、C，任取两个事件都独立，则

两两独立：$P(ABC)\neq P(A)P(B)P(C)$

相互独立：$P(ABC)=P(A)P(B)P(C)$

11.

第二章 随机变量及其分布

1. 离散型随机变量（概率质量函数 PMF）

a) **0-1 分布**：抛硬币，二选一

$P\{X=k\}=p^k(1-p)^{1-k}, k=0,1$　　$E(X)=p$　　$D(X)=p(1-p)$

b) **二项分布**：$X\sim B(n,p)$　　n 重伯努利，出现 k 次“是”

$P\{X=k\}=\binom{n}{k}p^k(1-p)^{n-k}, k=0,1,\dots,n$

$E(X)=np$　　$D(X)=np(1-p)$

c) **几何分布**：$X\sim Ge(P)$　　n 重伯努利，第 k 次**首次**出现”是”

$P\{X=k\}=p(1-p)^{k-1}, k=0,1,\dots,n$　　$E(X)=\frac{1}{p}$　　$D(X)=\frac{1-p}{p^2}$

无记忆性　　为负二项分布的特例 r=1

d) **负二项分布(帕斯卡分布)**：$X\sim Nb(r,p)$　　几何分布的和

$P\{X=k\}=C_{k-1}^{r-1}p^r(1-p)^{k-r}, k=r,r+1,\dots$　　$E(X)=\frac{r}{p}$　　$D(X)=\frac{r(1-p)}{p^2}$

X=第 k 次实验，正好发生 r 次”是”

e) **超几何分布**：$X\sim h(n,N,M)$　　不放回抽样的二项分布

$P\{X=k\}=\frac{C_M^kC_{N-M}^{n-k}}{C_N^n}$　　$E(X)=n\frac{M}{N}$　　$D(X)=n\frac{M}{N}(1-\frac{M}{N})(1-\frac{n-1}{N-1})$

N 件物品，有 M 件次品，抽 n 件（不放回）有 k 件次品概率

分子：k 件从不合格品中抽取，剩下的在合格品中抽取

分母：从 N 件中随便抽取 n 件

若 **N 巨大**，放不放回区别不大，近似为二项分布

f) **松柏分布**：$X\sim P(\lambda)$　　二项分布的极限，$p=\lambda/n$

$P(X=k)=\frac{\lambda^k}{k!}e^{-\lambda}$　　$E(X)=\lambda$　　$D(X)=\lambda$

条件：平稳性、独立性、普通性

意义：单位时间内随机事件发生的次数；例：汽车站台的候客人数

2. 概率密度函数**充要条件**①$f(x)>0$；②$\int_{-\infty}^{+\infty}f(x)\,dx=1$

3. 连续型随机变量（概率密度函数 PDF）

a) **均匀分布**：$X\sim U(a,b)$　　古典派的几何概型

$p(x)=\begin{cases}\frac{1}{b-a}, a<x<b\\ 0,\text{其他}\end{cases}$ $\quad F(x)=\begin{cases}0, x<a\\ \frac{x-a}{b-a}, a\le x\le b\\ 1, x>b\end{cases}$

$E(X)=\frac{a+b}{2}$ $\quad D(X)=\frac{(b-a)^2}{12}$

b) **正态分布**：$X\sim N(\mu,\sigma^2)$ 　二项分布的另一种极限

$p(x)=\frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}}e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}$ $\quad F(x)=\frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}}\int_{-\infty}^{x}e^{-\frac{(t-\mu)^2}{2\sigma^2}}dt=\Phi\left(\frac{x-\mu}{\sigma}\right)$

$E(X)=\mu$ $\quad D(X)=\sigma^2$

重要结论：①$aX+b\sim N(a\mu+b,a^2\sigma^2)$ 　②**标准化：令$Z=\frac{X-\mu}{\sigma}$，则$Z\sim N(0,1)$**

③$Z\sim N(0,1)$，$P(Z>z_\alpha)=\alpha, 0<\alpha<1$，$z_\alpha$称为上α分位点

④$P(\mu-\sigma<X<\mu+\sigma)\approx 68.26\%, P(\mu-3\sigma<X<\mu+3\sigma)\approx 99.72\%$

c) **标准正态分布**：$X\sim N(0,1)$ 　用 Z 表示

$p(x)=\varphi(x)=\frac{1}{\sqrt{2\pi}}e^{-\frac{x^2}{2}}$ $\quad F(X)=\Phi(x)=\frac{1}{\sqrt{2\pi}}\int_{-\infty}^{x}e^{-\frac{t^2}{2}}dt$

性质：$\Phi(-x)=1-\Phi(x)$，$\Phi(0)=0.5$，$\int_{-\infty}^{+\infty}\varphi(t)\,dt=1$

d) **指数分布**：$X\sim Exp(\lambda)$ 　泊松分布的间隔，连续的几何分布

$p(x)=\begin{cases}\lambda e^{-\lambda x}, x\ge 0\\ 0, x<0\end{cases}$ $\quad F(x)=\begin{cases}1-e^{-\lambda x}, x\ge 0\\ 0, x<0\end{cases}$

$E(X)=\frac{1}{\lambda}$ $\quad D(X)=\frac{1}{\lambda^2}$

泊松分布的三个条件+无记忆性 　~~指数函数取对数→对数正太分布~~

无记忆性：①$P\{X>t\}=\int_t^{+\infty}\lambda e^{-\lambda t}dt=e^{-\lambda t}, t>0$

②$P\{X>t+s|X>s\}=P\{X>t\}$

4. 伯努利分布$\xrightarrow{\text{+伯努利分布}}$二项分布$\xrightarrow{\text{+二项分布}}$二项分布$\xrightarrow{\text{n 很大}}$正态分布$\xrightarrow{\text{+正太分布}}$正态分布

5. (累积)分布函数 CDF：$F(x)=P(X\le x)$

离散：$F(x)=P(X\le x)=\Sigma_{a\le x}p(a)$

连续：$F(x)=P(X\le x)=\int_{-\infty}^{x}p(t)\,dt$ $\quad \frac{d}{dx}F(x)=p(x)$

$F(x)$为分布函数的**充分必要条件**：①$F(x)$单调非减；②$F(x)$右连续；

③$\lim_{x\to-\infty}F(x)=0$，$\lim_{x\to+\infty}F(x)=1$；

$P\{a<X\le b\}=P\{X\le b\}-P\{X\le a\}=F(b)-F(a)$

$P(X<a)=1-P(X\ge a)=F(a-0)$ ⇐“a-0”为 a 左极限，离散时有意义

$P(x=a)=P(X\le a)-P(X<a)=F(a)-F(a-0)$

6. 中心极限定理：正态分布是所有分布的最终归宿

7. 泊松过程：$P(X=k,t)=\frac{(\lambda t)^k}{k!}e^{-\lambda t}$ 　时间可变的泊松分布(t=1)

8. 唯二无记忆性的分布：几何分布、指数分布

9. 随机变量的函数分布： PDF 为$p_X(x)$的X，PDF 为$p_Y(y)$的$Y=g(X)$

$h(y)$是单调函数$y=g(x)$的反函数

a) 公式法：$\boldsymbol{p_Y(y)=\begin{cases}p_X[h(y)]\cdot|h'(y)|, a<y<b\\ 0,\text{其他}\end{cases}}$

其中 a,b 为函数$g(X)$在 X 可能取值区间上的值域

b) 定义法：①写出$p_X(x)$；

②$F_Y(y)=P\{Y\le y\}=P\{g(X)\le y\}=P\{X\le h(y)\}=F_X(h(y))$；

③$p_Y(y)=F_Y'(y)$

10. 常用公式：$\int_{-\infty}^{+\infty}e^{-t^2}dt=\sqrt{\pi}$ $\quad \sum_{k=0}^{\infty}\frac{1}{k!}=e$

第三章 多为随机变量及其分布

1. 离散： **联合**概率质量函数 JPMF

边缘概率质量函数 MPMF（边缘分布）：

$$p_{i\cdot}=P\{X=x_i\}=\sum_{j=1}^{\infty}P\{X=x_i,Y=y_i\}=\sum_{j=1}^{\infty}p_{ij}\,,i\in N$$ Y 同理

条件概率质量函数：$P\{X=x_i|Y=y_i\}=\frac{P(X=x_i,Y=y_i)}{P(Y=y_i)}$ Y 同理

2. 连续： **联合**概率密度函数 JPDF

边缘概率密度函数 MPDF（边缘密度）：$p_X(x)=\int_{-\infty}^{+\infty}p(x,y)\,dy$ Y 同理

条件概率密度函数：$p_{X|Y}(x|y)=\frac{p(x,y)}{p_Y(y)}$ X 为条件同理

3. 条件概率$\xrightarrow{\text{组成}}$条件分布

4. 联合累积分布函数 JCDF：$F(x,y)=P\big(\{X\le x\}\text{且}\{Y\le y\}\big)=P(X\le x,Y\le y)$

边缘累积分布函数 MCDF：$=F(x,+\infty)=\lim_{y\to+\infty}F(x,y)=P(X\le x)$

$F_Y(y)=F(+\infty,y)$ $\boldsymbol{F_X(x)F_Y(y)}$**也是分布函数**

条件累积分布函数：连续：$F_{X|Y}(x|y)=\int_{-\infty}^{x}\frac{p(u,y)}{p_Y(y)}du$ X 为条件同理

5. 相互**独立**： CDF：$F(x_1,x_2,\dots,x_n)=\prod_{i=1}^{n}F_i(x_i)$

PMF：$P(X=x_1,X=x_2,\dots,X=x_n)=\prod_{i=1}^{n}P(X=x_i)$

PDF：$p(x_1,x_2,\dots,x_n)=\prod_{i=1}^{n}p_i(x_i)$

离散：$p_{ij}=p_{i\cdot}p_{\cdot j}$ 连续：$p(x,y)=p_X(x)p_Y(y)$

6. **二维均匀分布**：$p(x,y)=\begin{cases}1/S\\0,\text{其他}\end{cases}$

二维正态分布：$(X,Y)\sim N(\mu_1,\mu_2;\sigma_1^2,\sigma_2^2;\rho)$ $X\sim N(\mu_1,\sigma_1^2)$ $Y\sim N(\mu_2,\sigma_2^2)$

$$p(x,y)=\frac{1}{2\pi\sigma_1\sigma_2\sqrt{1-\rho^2}}e^{-\frac{1}{2(1-\rho)^2}\left[\frac{(x-u_1)^2}{\sigma_1^2}-\frac{2\rho(x-\mu_1)(y-u_2)}{\sigma_1\sigma_2}+\frac{(y-u_2)^2}{\sigma_2^2}\right]}$$

性质：①X,Y相互独立$\Leftrightarrow\rho=0$；②$aX+bY\sim N(a\mu_1+b\mu_2,a\sigma_1^2+2ab\sigma_1\sigma_2\rho+b\sigma_2^2)$

7. $Z=(X,Y)$的分布：

a) X,Y离散：$P(X+Y=k)=\sum_{i=0}^{k}P(X=i)P(Y=k-i)$ 卷积公式

b) X,Y连续：$Z=Y+X$ $p_Z(z)=\int_{-\infty}^{+\infty}p(x,z-x)\,dx=\int_{-\infty}^{+\infty}p(z-y,y)\,dy$

$\overset{X,Y\text{相互独立}}{=}\int_{-\infty}^{+\infty}p_X(x)p_Y(z-x)\,dx=\int_{-\infty}^{+\infty}p_X(z-y)p_Y(y)\,dy$

$Z=\frac{Y}{X}$ $p_{Y/X}(z)=\int_{-\infty}^{+\infty}|x|P(x,xz)\,dx$ $|x|$意义：$\left|\frac{dy}{dz}\right|$

$Z=YX$ $p_{YX}(z)=\int_{-\infty}^{+\infty}\frac{1}{|x|}P\left(x,\frac{z}{x}\right)dx$

c) X离散，Y连续：$F_Z(z)=P\{Z\le z\}=\sum_i P\{X=x_i\}P\{g(x_i,Y)\le z|X=x_i\}$

8. $X_i\sim F_i(x)$ $Y=max(X_1,X_2,\dots,X_n)$ $F_Y(y)=\prod_{i=1}^{n}F_i(y)$

$Z=min(X_1,X_2,\dots,X_n)$ $F_Z(z)=1-\prod_{i=1}^{n}(1-F_i(z))$

第四章 随机变量的数字特征

1. **数学期望**（随机变量的一阶矩）

意义：①对不确定性的计量；②加权平均（重心）

a) 离散：$\mu=\mu_X=\boldsymbol{E(X)=\sum_{i=1}^{\infty}x_ip(x_i)}$ 前提：$\sum_{i=1}^{\infty}|x_i|p(x_i)<\infty$

b) 连续：$\boldsymbol{E(X)}=\int_{-\infty}^{\infty}xp(x)\,dx$

性质： ①$E[g(X)]=\sum_{i=1}^{\infty}g(x_i)p(x_i)=\int_{-\infty}^{\infty}g(x)p(x)\,dx$；

$E[g(X,Y)]=\sum_j\sum_i g(x_i,y_j)p(x_i,y_j)=\int_{-\infty}^{\infty}\int_{-\infty}^{\infty}g(x,y)p(x,y)\,dxdy$

②$\boldsymbol{E(c)=c}\to E\big(E(X)\big)=E(X)$ ③齐次性：$\boldsymbol{E(aX)=aE(X)}$

④可加性：$E(X\pm Y)=E(X)\pm E(Y)$

⑤施瓦茨不等式：$\boldsymbol{[E(XY)]^2\le E(X^2)E(Y^2)}$

⑥X,Y独立：$E(XY)=E(X)E(Y)$

2. A_i的示性变量（函数）：$X_i=\begin{cases}1,\text{事件}A_i\text{发生}\\0,\text{事件}A_i\text{没发生}\end{cases}$ **用于求 E(X)**

3. **方差**（二阶矩）：衡量集中程度

$$Var(X)=\sigma^2=\sigma_X^2=\boldsymbol{D(X)}=\boldsymbol{E\left[\left(X-E(X)\right)^2\right]}=\sum_{i=1}^{\infty}(x_i-\mu)^2p(x_i)$$

性质：①$\boldsymbol{D(X)=E(X^2)-E(X)^2}$；

②$\boldsymbol{D(aX+b)=a^2D(X)}$； b 的几何意义为平移量

③$D(c)=0\to D\big(D(x)\big)=D(x)$

④$D(X\pm Y)=D(X)+D(Y)\pm 2Cov(X,Y)$

⑤$D(X)=0\Leftrightarrow$存在常数 c 使得$P(X=c)=1$ $X=c$与$P(X=c)=1$不同

4. **标准差**：解决方差单位不一致 $\sigma=\sigma_x=\sqrt{Var(X)}$

5. 马尔可夫不等式：$P(X\ge a)\le\frac{E(X)}{a}$ 切比雪夫不等式：$P(|X-u|\ge k)\le\frac{\sigma^2}{k^2}$

6. 协方差：$Cov(X,Y)=E[(X-\mu_X)(Y-\mu_Y)]=\boldsymbol{E(XY)-E(X)E(Y)}\cancel{=Cov(Y,X)}$

$Cov(X,Y)>0$，**正相关**；<0，**负相关**；$=0$，**不相关** 不相关⇐独立

性质：①$Cov(aX,bY)=abCov(X,Y)$

②$Cov(X_1+X_2,Y)=Cov(X_1,Y)+Cov(X_2,Y)$

7. 相关系数：$\rho_{XY}=\frac{Cov(X,Y)}{\sigma_X\sigma_Y}$ 因为标准差有单位 $\rho_{XY}\in[-1,1]$

$\rho>0$，**正相关**； $\rho<0$，**负相关**；

$\rho=1$，**完全正相关**；$\rho=-1$，**完全负相关**；$\rho=0$，**（线性）不相关**；

$|\rho_{XY}|=1\Leftrightarrow$存在常数$a(\ne0),b$使得$P(Y=aX+b)=1$

8. 满足二维正态分布的 X,Y 独立 ⇔ $\rho=0$，即不相关

第五章 大数定律和中心极限定理

1. 概率收敛：记为$Y_n\xrightarrow{P}a$ $\lim\limits_{n\to\infty}P\{|Y_n-a|<\varepsilon\}=1$

2. 弱大数定律 统计存在的基础

a) 伯努利大数定律：记为$\frac{f_A}{n}\xrightarrow{P}p,n\to\infty$

$X_n\sim B(n,p)$ $\lim\limits_{n\to\infty}P\left\{\left|\frac{f_A}{n}-1\right|<\varepsilon\right\}=1$

b) 辛钦大数定律：记为$\bar{X}\xrightarrow{P}\mu,n\to\infty$

X_n具有相同的分布 $\lim\limits_{n\to\infty}P\{|X-E(\bar{X})|<\varepsilon\}=1$

c) 切比雪夫大数定律：记为$\bar{X}\xrightarrow{P}\mu,n\to\infty$

$\mathrm{Var}(X_i)\le c$ $\lim\limits_{n\to\infty}P\{|X-E(\bar{X})|<\varepsilon\}=1$

	分布	独立性	方差
伯努利大数定律	伯努利分布	独立	无要求
辛钦大数定律	同分布	独立	无要求
切比雪夫大数定律	无要求	不相关	同上界

~~3. 强大数定律：~~$\cancel{P\left(\lim\limits_{n\to\infty}|\bar{X}-\mu|<\varepsilon\right)=1}$ ~~约束条件比弱大数更强 考研不考~~

4. 中心极限定理 解释了为什么生活中正态分布处处可见

a) 棣莫弗-拉普拉斯定理 理解：伯努利分布的和的极限是正态分布

$$\lim_{n\to\infty}P\left(\frac{X-np}{\sqrt{np(1-p)}}\le x\right)=\Phi(x)=\frac{1}{\sqrt{2\pi}}\int_{-\infty}^{x}e^{-\frac{t^2}{2}}dt \qquad \mu=np,\sigma=\sqrt{np(1-p)}$$

b) 列维-林德伯格定理：

$$\lim_{n\to\infty}P\left(\frac{\sum_{i=1}^{n}X_i-n\mu}{\sqrt{n}\sigma}\le x\right)=\Phi(x) \qquad E\left(\sum_i X_i\right)=n\mu,D\left(\sum_i X_i\right)=n\sigma^2$$

第六章 样本及抽样分布

1. 统计量(样本数字特征)：　不含未知参数

a) 样本均值：$\bar{X}=\frac{1}{n}\sum_{i=1}^{n}X_i$

b) 样本方差：$S^2=\frac{1}{n-1}\sum_{i=1}^{n}(X_i-\bar{X})^2=\boldsymbol{\frac{1}{n-1}\left(\sum_{i=1}^{n}X_i^2-n\bar{X}^2\right)}$

样本标准差：$S=\sqrt{S^2}$

c) k(原点)阶矩：$E(X^k)$

k 阶中心矩：$E\{[X-E(X)]^k\}$

k+l 阶混合矩：$E(X^kY^l)$

k+l 阶混合中心矩$E\{[X-E(X)]^k[Y-E(Y)]^l\}$

性质：①$E(\bar{X})=E(X)=\mu$；②$D(\bar{X})=\frac{1}{n}D(X)$

③样本方差和方差的关系：$\boldsymbol{E(S^2)=\sigma^2}$

2. 抽样分布：统计量的分布

a) 卡方分布：记作$\chi^2\sim\chi^2(n)$　　$\chi^2=\sum_{i=1}^{n}X_i^2$　　n 越大，越接近正态分布

$$f(y)=\frac{1}{\Gamma\left(\frac{n}{2}\right)2^{\frac{n}{2}}}y^{\frac{n}{2}-1}e^{-\frac{y}{2}}(y>0)\qquad E(X)=n\qquad D(X)=2n$$

伽马函数：$\Gamma(x)=\int_0^{\infty}\frac{t^{x-1}}{e^t}dt$

若 n 为正整数，$\Gamma(n)=(n-1)!$

性质：①可加性：$\chi_1^2+\chi_2^2\sim\chi^2(n_1+n_2)$；

②上α分位点：$P\{\chi^2>\chi_\alpha^2(n)\}=\int_{\chi_\alpha^2(n)}^{\infty}f(y)\,dy=\alpha$

b) t 分布：记作$T\sim t(n)$　　$T=\frac{X}{\sqrt{Y/n}},\begin{cases}X\sim N(0,1)\\Y\sim\chi^2(n)\end{cases}$　　n 越大，越接近正态分布

$$h(t)=\frac{\Gamma\left(\frac{n+1}{2}\right)}{\sqrt{n\pi}\Gamma\left(\frac{n}{2}\right)}\left(1+\frac{t^2}{n}\right)^{-\frac{n+1}{2}}\quad E(X)=0(n>1)\quad D(X)=\frac{n}{n-2}(n>2)$$

性质：①上α分位点：$P\{t>t_\alpha(n)\}=\int_{t_\alpha(n)}^{\infty}h(t)\,dt=\alpha$

②$h(t)$为偶函数；

③n 充分大时，$t(n)$分布近似于$N(0,1)$

c) F 分布：记作$F\sim F(n_1,n_2)$　　$F=\frac{X/n_1}{Y/n_2},\begin{cases}X\sim\chi^2(n_1)\\Y\sim\chi^2(n_2)\end{cases}$

$$p(x)=\frac{\Gamma\left(\frac{n_1+n_2}{2}\right)\left(\frac{n_1}{n}\right)^{n_1/2}}{\Gamma\left(\frac{n_1}{2}\right)\Gamma\left(\frac{n_2}{2}\right)}x^{\frac{n_1}{2}-1}\left(1+\frac{n_1}{n_2}x\right)^{-\frac{n_1+n_2}{2}}$$

$$E(X)=\frac{n_2}{n_2-2}(n_2>2)\qquad D(X)=\frac{2n_2^2(n_1+n_2-2)}{n_1(n_2-2)^2(n_2-4)}(n_2>4)$$

性质：①上α分位点：$P\{F>F_\alpha(n_1,n_2)\}=\int_{F_\alpha(n_1,n_2)}^{\infty}\psi(y)\,dy=\alpha$

②$F\sim F(n_1,n_2)$，则$\frac{1}{F}\sim F(n_2,n_1)$，$F_{1-\alpha}(n_1,n_2)=\frac{1}{F_\alpha(n_1,n_2)}$

d) 一个正态总体的抽样分布：总体$X\sim N(\mu,\sigma^2)$

i. 样本均值的分布(σ^2已知)：$\bar{X}\sim N\left(\mu,\frac{\sigma^2}{n}\right)$　或　$Z=\frac{\bar{X}-\mu}{\sigma/\sqrt{n}}\sim N(0,1)$

ii. 样本方差的分布(μ未知)：量化S^2逼近σ^2的靠谱程度

$\bar{X}$与S^2相互独立，且$\chi^2=\frac{(n-1)S^2}{\sigma^2}=\frac{\sum_{i=1}^{n}(X_i-\bar{X})^2}{\sigma^2}\sim\chi^2(n-1)$

iii. 样本均值的分布(σ^2未知)：$T=\frac{\bar{X}-\mu}{S/\sqrt{n}}\sim t(n-1)$　量化$\bar{X}$逼近μ的靠谱程度

iv. 样本方差的分布(μ已知)：$\chi^2=\frac{1}{\sigma^2}\sum_{i=1}^{n}(X_i-\mu)^2\sim\chi^2(n)$　　???

e) 两个正太总体的抽样分布：总体$X\sim N(\mu_1,\sigma_1^2)$和总体$X\sim N(\mu_2,\sigma_2^2)$

i. 样本均值的差(σ_1^2,σ_2^2已知)：

$$\bar{X}-\bar{Y}\sim N\left(\mu_1-\mu_2,\frac{\sigma_1^2}{n_1}+\frac{\sigma_2^2}{n_2}\right)\text{ 或 }Z=\frac{(\bar{X}-\bar{Y})-(\mu_1-\mu_2)}{\sqrt{\frac{\sigma_1^2}{n_1}+\frac{\sigma_2^2}{n_2}}}\sim N(0,1)$$

ii. 样本均值的差($\sigma_1^2=\sigma_2^2$=未知)：

$$T=\frac{(\bar{X}-\bar{Y})-(\mu_1-\mu_2)}{S_\omega\sqrt{\frac{1}{n_1}+\frac{1}{n_2}}}\sim t(n_1+n_2-2)\qquad S_\omega^2=\frac{(n_1-1)S_1^2+(n_2-1)S_2^2}{n_1+n_2-2}$$

iii. 样本方差的比例(μ_1,μ_2未知)：$F=\frac{S_1^2/\sigma_1^2}{S_2^2/\sigma_2^2}=\frac{S_1^2/S_2^2}{\sigma_1^2/\sigma_2^2}\sim F(n_1-1,n_2-1)$

第七章 参数估计

1. 参数估计意义：分布函数已知，部分参数未知
2. 点估计：部分参数θ，估计量$\hat{\theta}$

种类：①一致估计量：$\lim\limits_{n\to\infty} P(|\hat{\theta}-\theta|<\varepsilon)=1$　　$\hat{\theta}\xrightarrow{P}\theta$　　大样本容量

②无偏估计量：$E(\hat{\theta})=\theta$　　小样本容量

③更有效估计量：$D(\hat{\theta}_1)<D(\hat{\theta}_2)$，$\hat{\theta}_1$更有效

计算方法：

a) 矩估计法：

理论基础：样本 k 阶矩$A_k=\frac{1}{n}\sum_{i=1}^{n}X_i^k$，随机变量 k 阶矩$E(X^k)=\mu_k$

$$\lim_{n\to\infty} P(|A_k-\mu_k|<\varepsilon)=1，即A_k\xrightarrow{P}\mu_k, n\to\infty$$

步骤：列出一阶矩到 k 阶矩的方程。（考研最多两个方程）

b) 最大似然估计法：可能性最大的就是事实

i. 似然函数：离散：$L(\theta)=L(x_1,x_2,\dots,x_n;\theta)=\prod_{i=1}^{n}p(x_i;\theta),\theta\in\Theta$

连续：$L(\theta)=L(x_1,x_2,\dots,x_n;\theta)=\prod_{i=1}^{n}f(x_i;\theta),\theta\in\Theta$

ii. 最大似然函数：$L(x_1,x_2,\dots,x_n;\hat{\theta})=\max\limits_{\theta\in\Theta}L(x_1,x_2,\dots,x_n;\theta)$

最大似然估计值：$\hat{\theta}(x_1,x_2,\dots,x_n)$；　最大似然估计量：$\hat{\theta}(X_1,X_2,\dots,X_n)$

iii. 对数似然方程：$\frac{d}{d\theta}\ln L(\theta)=0$　　**解法之一**

3. 区间估计：置信水平$1-\alpha$

a) 单个总体$N(\mu,\sigma^2)$

i. μ的置信区间

①σ^2已知：$\left(\bar{X}\pm\frac{\sigma}{\sqrt{n}}z_{\alpha/2}\right)$　　②σ^2未知：$\left(\bar{X}\pm\frac{S}{\sqrt{n}}t_{\alpha/2}(n-1)\right)$

ii. σ^2的置信区间　　σ的置信区间同理

①μ已知：$\left(\frac{\sum_{i=1}^{n}(X_i-\mu)^2}{\chi^2_{\alpha/2}(n)},\frac{\sum_{i=1}^{n}(X_i-\mu)^2}{\chi^2_{1-\alpha/2}(n)}\right)$　　②μ未知：$\left(\frac{(n-1)S^2}{\chi^2_{\alpha/2}(n-1)},\frac{(n-1)S^2}{\chi^2_{1-\alpha/2}(n-1)}\right)$

b) 两个总体$N(\mu_1,\sigma_1^2)$和$N(\mu_2,\sigma_2^2)$

i. $\mu_1-\mu_2$的置信区间

①σ_1^2,σ_2^2已知：$\left(\bar{X}-\bar{Y}\pm z_{\alpha/2}\sqrt{\frac{\sigma_1^2}{n_1}+\frac{\sigma_2^2}{n_2}}\right)$

②$\sigma_1^2=\sigma_2^2=$未知：$\left(\bar{X}-\bar{Y}\pm t_{\frac{\alpha}{2}}(n_1+n_2-2)S_\omega\sqrt{\frac{1}{n_1}+\frac{1}{n_2}}\right)$

$$S_\omega^2=\frac{(n_1-1)S_1^2+(n_2-1)S_2^2}{n_1+n_2-2}$$

ii. σ_1^2/σ_2^2的置信区间　　μ_1,μ_2未知

$$\left(\frac{S_1^2}{S_2^2}\cdot\frac{1}{F_{\alpha/2}(n_1-1,n_2-1)},\frac{S_1^2}{S_2^2}\cdot\frac{1}{F_{1-\alpha/2}(n_1-1,n_2-1)}\right)$$

第八章 假设检验

1. 第一类错误：H_0是对的，但我们拒绝了它（弃真）

第二类错误：H_0　错　，　　接受　　（纳伪）

2. 显著性检测：只控制第一类错误

步骤：①提出H_0；　②给出显著性水平α；

③确定检验统计量及拒绝域形式；　④求出拒绝域W

3.

三大抽样分布

	统计量		概率密度函数	$E(X)$	$D(X)$
卡方分布	$\chi^2=\sum_{i=1}^{n} X_i^2$	$\chi^2\sim\chi^2(n)$	$\frac{1}{\Gamma\left(\frac{n}{2}\right)2^{\frac{n}{2}}}y^{\frac{n}{2}-1}e^{-\frac{y}{2}}(x>0)$	n	$2n$
t 分布	$T=\frac{X}{\sqrt{Y/n}},\begin{cases}X\sim N(0,1)\\Y\sim\chi^2(n)\end{cases}$	$T\sim t(n)$	$\frac{\Gamma\left(\frac{n+1}{2}\right)}{\sqrt{n\pi}\Gamma\left(\frac{n}{2}\right)}\left(1+\frac{t^2}{n}\right)^{-\frac{n+1}{2}}$	$0(n>1)$	$\frac{n}{n-2}(n>2)$
F 分布	$F=\frac{X/n_1}{Y/n_2},\begin{cases}X\sim\chi^2(n_1)\\Y\sim\chi^2(n_2)\end{cases}$	$F\sim F(n_1,n_2)$	$\frac{\Gamma\left(\frac{n_1+n_2}{2}\right)\left(\frac{n_1}{n}\right)^{n_1/2}}{\Gamma\left(\frac{n_1}{2}\right)\Gamma\left(\frac{n_2}{2}\right)}x^{\frac{n_1}{2}-1}\left(1+\frac{n_1}{n_2}x\right)^{-\frac{n_1+n_2}{2}}$	$\frac{n_2}{n_2-2}(n_2>2)$	$\frac{2n_2^2(n_1+n_2-2)}{n_1(n_2-2)^2(n_2-4)}(n_2>4)$

常用随机变量分布

		$P\{X=k\}/p(x)$	$F(x)$	$E(X)$	$D(X)$	
0-1 分布		$p^k(1-p)^{1-k}$		p	$p(1-p)$	抛硬币，二选一
二项分布	$X\sim B(n,p)$	$\binom{n}{k}p^k(1-p)^{n-k}$		np	$np(1-p)$	n 重伯努利，出现 k 次“是”
松柏分布	$X\sim P(\lambda)$	$\frac{\lambda^k}{k!}e^{-\lambda}$		λ	λ	二项分布的**极限**，$p=\frac{\lambda}{n}$
几何分布	$X\sim Ge(P)$	$p(1-p)^{k-1}$		$\frac{1}{p}$	$\frac{1-p}{p^2}$	n 重伯努利，第 k 次**首次**出现“是”
负二项分布	$X\sim Nb(r,p)$	$C_{k-1}^{r-1}p^r(1-p)^{k-r}$		$\frac{r}{p}$	$\frac{r(1-p)}{p^2}$	几何分布的**和** X=第 k 次实验，正好发生 r 次“是”
超几何分布	$X\sim h(n,N,M)$	$\frac{C_M^k C_{N-M}^{n-k}}{C_N^n}$		$n\frac{M}{N}$	$n\frac{M}{N}(1-\frac{M}{N})(1-\frac{n-1}{N-1})$	**不放回**抽样的二项分布
均匀分布	$X\sim U(a,b)$	$\begin{cases}\frac{1}{b-a},a<x<b\\ 0,\text{其他}\end{cases}$	$\begin{cases}0,x<a\\ \frac{x-a}{b-a},a\le x\le b\\ 1,x>b\end{cases}$	$\frac{a+b}{2}$	$\frac{(b-a)^2}{12}$	古典派的几何概型
正态分布	$X\sim N(\mu,\sigma^2)$	$\frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}}e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}$	$\Phi\left(\frac{x-\mu}{\sigma}\right)$ $\frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}}\int_{-\infty}^{x}e^{-\frac{(t-\mu)^2}{2\sigma^2}}dt$	μ	σ^2	二项分布的另一种极限
标准正态分布	$X\sim N(0,1)$	$\frac{1}{\sqrt{2\pi}}e^{-\frac{x^2}{2}}$	$\frac{1}{\sqrt{2\pi}}\int_{-\infty}^{x}e^{-\frac{t^2}{2}}dt$	0	1	
指数分布	$X\sim Exp(\lambda)$	$\begin{cases}\lambda e^{-\lambda x},x\ge 0\\ 0,x<0\end{cases}$	$\begin{cases}1-e^{-\lambda x},x\ge 0\\ 0,x<0\end{cases}$	$\frac{1}{\lambda}$	$\frac{1}{\lambda^2}$	泊松分布的间隔，连续的几何分布
二维均匀分布		$p(x,y)=\begin{cases}1/S\\ 0,\text{其他}\end{cases}$				
二维正态分布	$(X,Y)\sim N(\mu_1,\mu_2;\sigma_1^2,\sigma_2^2;\rho)$	$p(x,y)=\frac{1}{2\pi\sigma_1\sigma_2\sqrt{1-\rho^2}}e^{-\frac{1}{2(1-\rho)^2}\left[\frac{(x-u_1)^2}{\sigma_1^2}-\frac{2\rho(x-\mu_1)(y-u_2)}{\sigma_1\sigma_2}+\frac{(y-u_2)^2}{\sigma_2^2}\right]}$				

正态总体均值、方差的置信区间

	待估参数	其他参数	枢轴量的分布	置信区间
一个正态总体	μ	σ^2已知	$Z=\dfrac{\bar{X}-\mu}{\sigma/\sqrt{n}}\sim N(0,1)$	$\left(\bar{X}\pm\dfrac{\sigma}{\sqrt{n}}z_{\alpha/2}\right)$
		σ^2未知	$T=\dfrac{\bar{X}-\mu}{S/\sqrt{n}}\sim t(n-1)$	$\left(\bar{X}\pm\dfrac{S}{\sqrt{n}}t_{\alpha/2}(n-1)\right)$
	σ^2	~~μ已知~~	$\cancel{\chi^2=\dfrac{1}{\sigma^2}\sum_{i=1}^{n}(X_i-\mu)^2\sim\chi^2(n)}$	$\cancel{\left(\dfrac{\sum_{i=1}^{n}(X_i-\mu)^2}{\chi^2_{\alpha/2}(n)},\dfrac{\sum_{i=1}^{n}(X_i-\mu)^2}{\chi^2_{1-\alpha/2}(n)}\right)}$
		μ未知	$\chi^2=\dfrac{(n-1)S^2}{\sigma^2}=\sim\chi^2(n-1)$	$\left(\dfrac{(n-1)S^2}{\chi^2_{\alpha/2}(n-1)},\dfrac{(n-1)S^2}{\chi^2_{1-\alpha/2}(n-1)}\right)$
两个正态总体	$\mu_1-\mu_2$	σ_1^2,σ_2^2已知	$Z=\dfrac{(\bar{X}-\bar{Y})-(\mu_1-\mu_2)}{\sqrt{\dfrac{\sigma_1^2}{n_1}+\dfrac{\sigma_2^2}{n_2}}}\sim N(0,1)$	$\left(\bar{X}-\bar{Y}\pm z_{\alpha/2}\sqrt{\dfrac{\sigma_1^2}{n_1}+\dfrac{\sigma_2^2}{n_2}}\right)$
		$\sigma_1^2=\sigma_2^2=$未知	$T=\dfrac{(\bar{X}-\bar{Y})-(\mu_1-\mu_2)}{S_\omega\sqrt{\dfrac{1}{n_1}+\dfrac{1}{n_2}}}\sim t(n_1+n_2-2)$ $S_\omega^2=\dfrac{(n_1-1)S_1^2+(n_2-1)S_2^2}{n_1+n_2-2}$	$\left(\bar{X}-\bar{Y}\pm t_{\frac{\alpha}{2}}(n_1+n_2-2)S_\omega\sqrt{\dfrac{1}{n_1}+\dfrac{1}{n_2}}\right)$
	σ_1^2/σ_2^2	μ_1,μ_2未知	$F=\dfrac{S_1^2/S_2^2}{\sigma_1^2/\sigma_2^2}\sim F(n_1-1,n_2-1)$	$\left(\dfrac{S_1^2}{S_2^2}\cdot\dfrac{1}{F_{\alpha/2}(n_1-1,n_2-1)},\dfrac{S_1^2}{S_2^2}\cdot\dfrac{1}{F_{1-\alpha/2}(n_1-1,n_2-1)}\right)$

正态总体参数的假设检验

检验参数	其他参数	H_0	H_1	检验统计量的分布	拒绝域
μ	σ^2已知	$\mu=\mu_0$ $\mu\le\mu_0$ $\mu\ge\mu_0$	$\mu\ne\mu_0$ $\mu>\mu_0$ $\mu<\mu_0$	$Z=\dfrac{\bar{X}-\mu_0}{\sigma/\sqrt{n}}\sim N(0,1)$	$\|U\|\ge u_{\alpha/2}$ $U\ge u_\alpha$ $U\le u_\alpha$
	σ^2未知			$T=\dfrac{\bar{X}-\mu_0}{S/\sqrt{n}}\sim t(n-1)$	$\|T\|\ge t_{\alpha/2}(n-1)$ $T\ge t_\alpha(n-1)$ $T\le t_\alpha(n-1)$
σ^2	~~μ已知~~	$\sigma^2=\sigma_0^2$ $\sigma^2\le\sigma_0^2$ $\sigma^2\ge\sigma_0^2$	$\sigma^2\ne\sigma_0^2$ $\sigma^2>\sigma_0^2$ $\sigma^2<\sigma_0^2$	~~$\chi^2=\dfrac{1}{\sigma^2}\sum_{i=1}^{n}(X_i-\mu)^2\sim\chi^2(n)$~~	$\chi^2\le\chi^2_{1-\alpha/2}(n)$ or $\chi^2\ge\chi^2_{\alpha/2}(n)$ $\chi^2\ge\chi^2_\alpha(n)$ $\chi^2\le\chi^2_{1-\alpha}(n)$
	μ未知			$\chi^2=\dfrac{(n-1)S^2}{\sigma^2}=\sim\chi^2(n-1)$	$\chi^2\le\chi^2_{1-\alpha/2}(n-1)$ or $\chi^2\ge\chi^2_{\alpha/2}(n-1)$ $\chi^2\ge\chi^2_\alpha(n-1)$ $\chi^2\le\chi^2_{1-\alpha}(n-1)$
$\mu_1-\mu_2$	σ_1^2,σ_2^2已知	$\mu_1-\mu_2=\mu_0$ $\mu_1-\mu_2\le\mu_0$ $\mu_1-\mu_2\ge\mu_0$	$\mu_1-\mu_2\ne\mu_0$ $\mu_1-\mu_2>\mu_0$ $\mu_1-\mu_2<\mu_0$	$Z=\dfrac{(\bar{X}-\bar{Y})-\mu_0}{\sqrt{\dfrac{\sigma_1^2}{n_1}+\dfrac{\sigma_2^2}{n_2}}}\sim N(0,1)$	$\|U\|\ge u_{\alpha/2}$ $U\ge u_\alpha$ $U\le u_\alpha$
	$\sigma_1^2=\sigma_2^2=$未知			$T=\dfrac{(\bar{X}-\bar{Y})-\mu_0}{S_\omega\sqrt{\dfrac{1}{n_1}+\dfrac{1}{n_2}}}\sim t(n_1+n_2-2)$	$\|T\|\ge t_{\alpha/2}(n_1+n_2-2)$ $T\ge t_\alpha(n_1+n_2-2)$ $T\le t_\alpha(n_1+n_2-2)$
σ_1^2/σ_2^2	μ_1,μ_2已知	$\sigma_1^2=\sigma_2^2$ $\sigma_1^2\le\sigma_2^2$ $\sigma_1^2\ge\sigma_2^2$	$\sigma_1^2\ne\sigma_2^2$ $\sigma_1^2>\sigma_2^2$ $\sigma_1^2<\sigma_2^2$	$F=\dfrac{X/n_1}{Y/n_2}\sim F(n_1,n_2),\begin{cases}X\sim\chi^2(n_1)\\Y\sim\chi^2(n_2)\end{cases}$	$F\le F_{1-\alpha/2}(n_1,n_2)$ *or* $F\le F_{\alpha/2}(n_1,n_2)$ $F\le F_\alpha(n_1,n_2)$ $F\le F_{1-\alpha}(n_1,n_2)$
	μ_1,μ_2未知			$F=S_1^2/S_2^2\sim F(n_1-1,n_2-1)$	$F\le F_{1-\frac{\alpha}{2}}(n_1-1,n_2-1)$ *or* $F\le F_{\frac{\alpha}{2}}(n_1-1,n_2-1)$ $F\le F_\alpha(n_1-1,n_2-1)$ $F\le F_{1-\alpha}(n_1-1,n_2-1)$