Tóm tắt công thức Xác Suất - Thống Kê

I. Phần Xác Suất

1. Xác suất cổ điển

- Công thức cộng xác suất: P(A+B)=P(A)+P(B)-P(AB).
- $A_1, A_2,\ldots, A_n$ xung khắc từng đôi $\Leftrightarrow$ $P(A_1+A_2+\ldots+A_n)=P(A_1)+P(A_2)+\ldots+P(A_n)$.
- Ta có
  - A, B xung khắc $\Leftrightarrow$ P(A+B)=P(A)+P(B).
  - A, B, C xung khắc từng đôi $\Leftrightarrow$ P(A+B+C)=P(A)+P(B)+P(C).
  - $P(\bar{A}) = 1 - P(A)$.
- Công thức xác suất có điều kiện: $P(A/B) = \dfrac{P(AB)}{P(B)}$, $P(B/A) = \dfrac{P(AB)}{P(A)}$.
- Công thức nhân xác suất: P(AB)=P(A).P(B/A)=P(B).P(A/B).
- $A_1, A_2,\ldots, A_n$ độc lập với nhau $\Leftrightarrow$ $P(A_1.A_2.\ldots.A_n)=P(A_1).P(A_2).\ldots.P(A_n)$.
- Ta có
  - A, B độc lập $\Leftrightarrow$ P(AB)=P(A).P(B).
  - A, B, C độc lập với nhau $\Leftrightarrow$ P(A.B.C)=P(A).P(B).P(C).
- Công thức Bernoulli: $B(k;n;p) = C_n^k p^k q^{n-k}$, với p=P(A): xác suất để biến cố A xảy ra ở mỗi phép thử và q=1-p.
- Công thức xác suất đầy đủ - Công thức Bayes
  - Hệ biến cố gồm n phần tử $A_1, A_2,\ldots, A_n$ được gọi là một phép phân hoạch của Ω $\Leftrightarrow \begin{cases} A_i.A_j = \Phi, \forall i \neq j; i, j \in \overline{1,n} \\ A_1 + A_2 + \ldots + A_n = \Omega \end{cases}$
  - Công thức xác suất đầy đủ:

$$P(B) = \sum_{i=1}^{n} P(A_i).P(B/A_i) = P(A_1).P(B/A_1) + P(A_2).P(B/A_2) + \ldots + P(A_n).P(B/A_n)$$

  - Công thức Bayes:

$$P(A_i/B) = \frac{P(A_i).P(B/A_i)}{P(B)}$$

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

với $P(B) = P(A_1).P(B/A_1) + P(A_2).P(B/A_2) + \ldots + P(A_n).P(B/A_n)$

2. Biến ngẫu nhiên

a. Biến ngẫu nhiên rời rạc

- Luật phân phối xác suất

X	x_1	x_2	…	x_n
P	p_1	p_2	…	p_n

với $p_i = P(X = x_i), i = \overline{1,n}.$

Ta có:

$$\sum_{i=1}^{n} p_i = 1 \text{ và } P\{a \le f(X) \le b\} = \sum_{a \le f(x_i) \le b} p_i$$

Biến cố		Xác suất
$A + \Omega = \Omega$	$A.\Omega = A$	$P(A+B) = P(A) + P(B) - P(AB)$
$A + \emptyset = A$	$A.\emptyset = \emptyset$	$P(AB) = P(A)P(B\|A)$
$A + A = A$	$A.A = A$	$P(B\|A) = \dfrac{P(AB)}{P(A)}$
$A + \bar{A} = \Omega$	$A.\bar{A} = \emptyset$	$P(A) + P(\bar{A}) = 1$
$\overline{A+B} = \bar{A}.\bar{B}$	$\overline{A.B} = \bar{A} + \bar{B}$	$P(A) = P(AB) + P(A\bar{B})$

- Hàm phân phối xác suất

$$F_X(x) = P(X < x) = \sum_{x_i < x} p_i$$

- Mode

$$\text{ModX} = x_0 \Leftrightarrow p_0 = \max\{p_i : i = \overline{1,n}\}$$

- Median

$$\text{MedX} = x_e \Leftrightarrow \begin{cases} P(X < x_e) \le 0,5 \\ P(X > x_e) \le 0,5 \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} \sum\limits_{x_i < x_e} p_i \le 0,5 \\ \sum\limits_{x_i > x_e} p_i \le 0,5 \end{cases}$$

- Kỳ vọng

$$EX = \sum_{i=1}^{n} (x_i.p_i) = x_1.p_1 + x_2.p_2 + \ldots + x_n.p_n$$

$$E(\varphi(X)) = \sum_{i=1}^{n} (\varphi(x_i).p_i) = \varphi(x_1).p_1 + \varphi(x_2).p_2 + \ldots + \varphi(x_n).p_n$$

- Phương sai

$$VarX = E(X^2) - (EX)^2$$

với $E(X^2) = \sum_{i=1}^{n} (x_i^2.p_i) = x_1^2.p_1 + x_2^2.p_2 + \ldots + x_n^2.p_n$

b. Biến ngẫu nhiên liên tục.

- f(x) là hàm mật độ xác suất của X $\Rightarrow \int_{-\infty}^{+\infty} f(x)dx = 1$,

$$P\{a \le X \le b\} = \int_a^b f(x).dx$$

- Hàm phân phối xác suất

$$F_X(x) = P(X < x) = \int_{-\infty}^{x} f(t)dt$$

- Mode

$ModX = x_0 \Leftrightarrow$ Hàm mật độ xác suất f(x) của X đạt cực đại tại x_0.

- Median

$$MedX = x_e \Leftrightarrow F_X(x_e) = \frac{1}{2} \Leftrightarrow \int_{-\infty}^{x_e} f(x)dx = \frac{1}{2}.$$

- Kỳ vọng

$$\text{EX} = \int_{-\infty}^{+\infty} x.f(x)dx.$$

$$E(\varphi(X)) = \int_{-\infty}^{+\infty} \varphi(x).f(x)dx$$

- Phương sai

$$VarX = E(X^2) - (EX)^2 \text{ với } EX^2 = \int_{-\infty}^{+\infty} x^2.f(x)dx.$$

c. Tính chất

- $E(C) = C, Var(C) = 0$, C là một hằng số.
- $E(kX) = kEX, Var(kX) = k^2 VarX$
- $E(aX + bY) = aEX + bEY$
- Nếu X, Y độc lập thì $E(XY) = EX.EY, Var(aX + bY) = a^2 VarX + b^2 VarY$
- $\sigma(X) = \sqrt{VarX}$: Độ lệch chuẩn của X, có cùng thứ nguyên với X và EX.

3. Luật phân phối xác suất

a. Phân phối Chuẩn $(X \sim N(\mu;\sigma^2))$

- $X(\Omega) = \mathbb{R}$, EX=ModX=MedX= μ, $VarX = \sigma^2$
- Hàm mđxs $f(x,\mu,\sigma) = \dfrac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}} \Rightarrow$ Với $\mu = 0, \sigma = 1$:

  $f(x) = \dfrac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{x^2}{2}}$ (Hàm Gauss)

- $P(a \le X \le b) = \varphi(\dfrac{b-\mu}{\sigma}) - \varphi(\dfrac{a-\mu}{\sigma})$ với $\varphi(x) = \displaystyle\int_0^x \dfrac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{t^2}{2}} dt$ (Hàm Laplace)
- Cách sử dụng máy tính bỏ túi để tính giá trị hàm Laplace, hàm phân phối xác suất của phân phối chuẩn chuẩn tắc

Tác vụ	**Máy CASIO 570MS**	**Máy CASIO 570ES**
Khởi động gói Thống kê	Mode…(tìm)…SD	Mode…(tìm)…STAT 1-Var
Tính $\varphi(x) = \int_0^x \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{t^2}{2}} dt$	Shift 3 2 x) =	Shift 1 7 2 x) =
$F(x) = \int_{-\infty}^x \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{t^2}{2}} dt$	Shift 3 1 x) =	Shift 1 7 1 x) =
Thoát khỏi gói Thống kê	Mode 1	Mode 1

Lưu ý: $F(x) = 0,5 + \varphi(x)$

b. Phân phối Poisson $(X \sim P(\lambda))$

- $X(\Omega) = \mathbb{N}$, $EX = VarX = \lambda$. ModX=k $\Leftrightarrow \lambda - 1 \le k \le \lambda$
- $P(X=k) = e^{-\lambda}\dfrac{\lambda^k}{k!}$, $k \in \mathbb{N}$

c. Phân phối Nhị thức $(X \sim B(n;p))$

- $X(\Omega)=\{0..n\}$, EX=np, VarX=npq, ModX=k $\Leftrightarrow (n+1)p-1 \le k \le (n+1)p$
- $P(\mathrm{X{=}k})=\mathrm{C}_n^k.p^k.q^{n-k}$, $\mathrm{q}=1-\mathrm{p}, 0 \le k \le n,\ k \in \mathbb{N}$
- Nếu $(n \ge 30; 0{,}1 < p < 0{,}9; np \ge 5, nq \ge 5)$ thì $X \sim B(n;p) \approx N(\mu;\sigma^2)$ với $\mu = n.p, \sigma = \sqrt{npq}$
  - $P(\mathrm{X{=}k}) \approx \dfrac{1}{\sigma} f(\dfrac{k-\mu}{\sigma}),\ 0 \le k \le n,\ k \in \mathbb{N}$
  - $P(\mathrm{a} \le \mathrm{X} < \mathrm{b}) \approx \varphi(\dfrac{b-\mu}{\sigma}) - \varphi(\dfrac{a-\mu}{\sigma})$
- Nếu $(n \ge 30,\ p \le 0{,}1, np < 5)$ thì $X \sim B(n;p) \approx P(\lambda)$ với $\lambda = np$
  - $P(\mathrm{X{=}k}) \approx \mathrm{e}^{-\lambda} \dfrac{\lambda^k}{k!},\ k \in \mathbb{N}$
- Nếu $(n \ge 30,\ p \ge 0{,}9, nq < 5)$

  $P(\mathrm{X{=}k}) \approx \mathrm{e}^{-\lambda} \dfrac{\lambda^{n-k}}{(n-k)!}, k \in \mathbb{R}$ với $\lambda = nq$

d. Phân phối Siêu bội $(X \sim H(N; N_A; n))$

- $X(\Omega) = \{\max\{0; n-(N-N_A)\}..\min\{\mathrm{n}; \mathrm{N}_A\}\}$
- EX=np, VarX=npq$\dfrac{N-n}{N-1}$ với $p = \dfrac{N_A}{N}$, q=1-p.
- $ModX = k \Leftrightarrow \dfrac{(N_A+1)(n+1)+2}{N+2} - 1 \le k \le \dfrac{(N_A+1)(n+1)+2}{N+2}$.
- $P(\mathrm{X{=}k}) = \dfrac{C_{N_A}^k C_{N-N_A}^{n-k}}{C_N^n},\ k \in X(\Omega)$
- Nếu $\dfrac{N}{n} > 20$ thì $X \sim H(N; N_A; n) \approx B(n;p)$ với $p = \dfrac{N_A}{N}$.

  $P(\mathrm{X{=}k}) \approx \mathrm{C}_n^k.p^k.q^{n-k},\ k \in X(\Omega), q = 1-p$.

Sơ đồ tóm tắt các dạng phân phối xác suất thông dụng:

Siêu bội: X~H(N;N_A;n)

$$P(X=k)=\frac{C_{N_A}^{k}.C_{N-N_A}^{n-k}}{C_N^n}$$

↓ *N>20n*, $p=\frac{N_A}{N}$, *q=1-p*

Nhị thức: X~B(n;p)

$$P(X=k)=C_n^k.p^k.q^{n-k}$$

→ *n≥30, np<5*, *p≤0,1*, $\lambda=np$

Poisson: X~P(λ)

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

↓ *n≥30*, $np\ge 5$, $nq\ge 5$

0,1<p<0,9

$$P(X=k)\approx\frac{1}{\sigma}f\left(\frac{k-\mu}{\sigma}\right)$$

$$P(a\le X<b)\approx\varphi\left(\frac{b-\mu}{\sigma}\right)-\varphi\left(\frac{a-\mu}{\sigma}\right)$$

với $\mu=np,\ \sigma=\sqrt{npq}$

Chuẩn: X~ $N(\mu;\sigma^2)$

$$f(x;\mu;\sigma)=\frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}}.e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}$$

→ $Y=\frac{X-\mu}{\sigma}$

Chuẩn chuẩn tắc: Y~ N(0;1)

$$f(y)=\frac{1}{\sqrt{2\pi}}.e^{-\frac{y^2}{2}}$$

II. Phần Thống Kê.

1. Lý thuyết mẫu.

a. Các công thức cơ bản.

Các giá trị đặc trưng	**Mẫu ngẫu nhiên**	**Mẫu cụ thể**
Giá trị trung bình	$\overline{X} = \dfrac{X_1 + ... + X_n}{n}$	$\overline{x} = \dfrac{x_1 + ... + x_n}{n}$
Phương sai không hiệu chỉnh	$\hat{S}_X^2 = \dfrac{(X_1 - \overline{X})^2 + ... + (X_n - \overline{X})^2}{n}$	$\hat{s}_x^2 = \dfrac{(x_1 - \overline{x})^2 + ... + (x_n - \overline{x})^2}{n}$
Phương sai hiệu chỉnh	$S_X^2 = \dfrac{(X_1 - \overline{X})^2 + ... + (X_n - \overline{X})^2}{n-1}$	$s_x^2 = \dfrac{(x_1 - \overline{x})^2 + ... + (x_n - \overline{x})^2}{n-1}$

b. Để dễ xử lý ta viết số liệu của mẫu cụ thể dưới dạng tần số như sau:

x_i	x_1	x_2	$\cdots$	x_k
n_i	n_1	n_2	$\cdots$	n_k

Khi đó

Các giá trị đặc trưng	**Mẫu cụ thể**
Giá trị trung bình	$\overline{x} = \dfrac{x_1 n_1 + ... + x_k n_k}{n}$
Phương sai không hiệu chỉnh	$\hat{s}_x^2 = \dfrac{(x_1 - \overline{x})^2 n_1 + ... + (x_k - \overline{x})^2 n_k}{n}$
Phương sai hiệu chỉnh	$s_x^2 = \dfrac{(x_1 - \overline{x})^2 n_1 + ... + (x_k - \overline{x})^2 n_k}{n-1}$

c. Cách sử dụng máy tính bỏ túi để tính các giá trị đặc trưng mẫu

- Nếu số liệu thống kê thu thập theo miền $[a;b)$ hay $(a;b]$ thì ta sử dụng giá trị đại diện cho miền đó là $\dfrac{a+b}{2}$ để tính toán.

Tác vụ	**Dòng CASIO MS**	**Dòng CASIO ES**
Bật chế độ nhập tần số	Không cần	Shift Mode ↓ 4 1
Khởi động gói Thống kê	Mode…(tìm)…SD	Mode…(tìm)…STAT 1-Var
Nhập số liệu	x_1 Shift , n_1 M+ $\vdots$ x_k Shift , n_k M+ Nếu $n_i = 1$ thì chỉ cần nhấn x_i M+	<table><tr><th>X</th><th>FREQ</th></tr><tr><td>x_1 = $\vdots$ x_k =</td><td>n_1 = $\vdots$ n_k =</td></tr></table>

Xóa màn hình hiển thị	AC	AC
Xác định: • Kích thước mẫu (n) • Giá trị trung bình ($\overline{x}$) • Độ lệch chuẩn không hiệu chỉnh ($\hat{s}_x$) • Độ lệch chuẩn hiệu chỉnh (s_x)	Shift 1 3 = Shift 2 1 = Shift 2 2 = Shift 2 3 =	Shift 1 5 1 = Shift 1 5 2 = Shift 1 5 3 = Shift 1 5 4 =
Thoát khỏi gói Thống kê	Mode 1	Mode 1

2. Ước lượng khoảng.

a) Khoảng tin cậy cho giá trị trung bình.

<u>Trường hợp 1</u>. (σ đã biết)

- Ước lượng đối xứng.

$$\varphi(z_{\frac{\alpha}{2}}) = \frac{1-\alpha}{2} \to z_{\frac{\alpha}{2}} \Rightarrow \varepsilon = z_{\frac{\alpha}{2}}.\frac{\sigma}{\sqrt{n}} \Rightarrow (\overline{x}-\varepsilon\,;\overline{x}+\varepsilon)$$

- Ước lượng chệch trái.

$$\varphi(z_{\alpha}) = 0,5-\alpha \to z_{\alpha} \Rightarrow \varepsilon = z_{\alpha}.\frac{\sigma}{\sqrt{n}} \Rightarrow (-\infty;\overline{x}+\varepsilon)$$

- Ước lượng chệch phải.

$$\varphi(z_{\alpha}) = 0,5-\alpha \to z_{\alpha} \Rightarrow \varepsilon = z_{\alpha}.\frac{\sigma}{\sqrt{n}} \Rightarrow (\overline{x}-\varepsilon;+\infty)$$

<u>Trường hợp 2</u>. (σ chưa biết, $n \geq 30$)

- Ước lượng đối xứng.

$$\varphi(z_{\frac{\alpha}{2}}) = \frac{1-\alpha}{2} \to z_{\frac{\alpha}{2}} \Rightarrow \varepsilon = z_{\frac{\alpha}{2}}.\frac{s}{\sqrt{n}} \Rightarrow (\overline{x}-\varepsilon\,;\overline{x}+\varepsilon)$$

- Ước lượng chệch trái.

$$\varphi(z_{\alpha}) = 0,5-\alpha \to z_{\alpha} \Rightarrow \varepsilon = z_{\alpha}.\frac{s}{\sqrt{n}} \Rightarrow (-\infty;\overline{x}+\varepsilon)$$

- Ước lượng chệch phải.

$$\varphi(z_{\alpha}) = 0,5-\alpha \to z_{\alpha} \Rightarrow \varepsilon = z_{\alpha}.\frac{s}{\sqrt{n}} \Rightarrow (\overline{x}-\varepsilon;+\infty)$$

<u>Trường hợp 3</u>. (σ chưa biết, n<30)

- Ước lượng đối xứng.

$$1-\alpha \to \frac{\alpha}{2} \to t_{(n-1;\frac{\alpha}{2})} \Rightarrow \varepsilon = t_{(n-1;\frac{\alpha}{2})}.\frac{s}{\sqrt{n}} \Rightarrow (\overline{x}-\varepsilon\,;\overline{x}+\varepsilon)$$

- Ước lượng chệch trái.

$$1-\alpha \to \alpha \to t_{(n-1;\alpha)} \Rightarrow \varepsilon = t_{(n-1;\alpha)}.\frac{s}{\sqrt{n}} \Rightarrow (-\infty\,;\overline{x}+\varepsilon)$$

- Ước lượng chệch phải.

$$1-\alpha \to \alpha \to t_{(n-1;\alpha)} \Rightarrow \varepsilon = t_{(n-1;\alpha)}.\frac{s}{\sqrt{n}} \Rightarrow (\overline{x}-\varepsilon\,;+\infty)$$

b) Khoảng tin cậy cho tỉ lệ.

- Ước lượng đối xứng.

$$\varphi(z_{\frac{\alpha}{2}}) = \frac{1-\alpha}{2} \to z_{\frac{\alpha}{2}} \Rightarrow \varepsilon = z_{\frac{\alpha}{2}}.\frac{\sqrt{f(1-f)}}{\sqrt{n}} \Rightarrow (f-\varepsilon\,;\,f+\varepsilon)$$

- Ước lượng chệch trái.

$$\varphi(z_{\alpha}) = 0,5-\alpha \to z_{\alpha} \Rightarrow \varepsilon = z_{\alpha}.\frac{\sqrt{f(1-f)}}{\sqrt{n}} \Rightarrow (0;\,f+\varepsilon)$$

- Ước lượng chệch phải.

$$\varphi(z_{\alpha}) = 0,5-\alpha \to z_{\alpha} \Rightarrow \varepsilon = z_{\alpha}.\frac{\sqrt{f(1-f)}}{\sqrt{n}} \Rightarrow (\,f-\varepsilon;1)$$

c) Khoảng tin cậy cho phương sai.

Trường hợp 1. (μ chưa biết)

- Nếu đề bài chưa cho s mà cho mẫu cụ thể thì phải xác định s (bằng máy tính).

- Ước lượng không chệch.

$$1-\alpha \to \frac{\alpha}{2} \to \chi_2 = \chi^2_{(n-1;\frac{\alpha}{2})},\ 1-\alpha \to 1-\frac{\alpha}{2} \to \chi_1 = \chi^2_{(n-1;1-\frac{\alpha}{2})}$$

$$\Rightarrow (\frac{(n-1)s^2}{\chi_2};\frac{(n-1)s^2}{\chi_1})$$

- Ước lượng chệch trái.

$$1-\alpha \to \chi_1 = \chi^2_{(n-1;1-\alpha)} \Rightarrow (0;\frac{(n-1)s^2}{\chi_1})$$

- Ước lượng chệch phải.

$$1-\alpha \to \alpha \to \chi_2 = \chi^2_{(n-1;\alpha)} \Rightarrow (\frac{(n-1)s^2}{\chi_2};+\infty)$$

Trường hợp 2. (μ đã biết)

- Tính $(n-1)s^2 = \sum_{i=1}^{k} n_i.(x_i-\mu)^2$

- Ước lượng không chệch.

$$1-\alpha \to \frac{\alpha}{2} \to \chi_2 = \chi^2_{(n;\frac{\alpha}{2})},\ 1-\alpha \to 1-\frac{\alpha}{2} \to \chi_1 = \chi^2_{(n;1-\frac{\alpha}{2})}$$

$$\Rightarrow (\frac{(n-1)s^2}{\chi_2};\frac{(n-1)s^2}{\chi_1})$$

- Ước lượng chệch trái.

  $1-\alpha \rightarrow \chi_1 = \chi^2_{(n;1-\alpha)} \Rightarrow (0;\frac{(n-1)s^2}{\chi_1})$

- Ước lượng chệch phải.

  $1-\alpha \rightarrow \alpha \rightarrow \chi_2 = \chi^2_{(n;\alpha)} \Rightarrow (\frac{(n-1)s^2}{\chi_2};+\infty)$

3. Kiểm định tham số.
   a) Kiểm định giá trị trung bình.

Trường hợp 1. (σ đã biết)

- $H_o: \mu = \mu_o, H_1: \mu \neq \mu_o$

  $\varphi(z_{\frac{\alpha}{2}}) = \frac{1-\alpha}{2} \rightarrow z_{\frac{\alpha}{2}}, z = \frac{\overline{x}-\mu_o}{\sigma}.\sqrt{n}$

  - Nếu $|z| > z_{\frac{\alpha}{2}}$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.

  - Nếu $|z| \leq z_{\frac{\alpha}{2}}$: Chấp nhận H_o.

- $H_o: \mu = \mu_o, H_1: \mu < \mu_o$

  $\varphi(z_{\alpha}) = 0,5-\alpha \rightarrow z_{\alpha}, z = \frac{\overline{x}-\mu_o}{\sigma}.\sqrt{n}$

  - Nếu $z < -z_{\alpha}$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
  - Nếu $z \geq -z_{\alpha}$: Chấp nhận H_o.

- $H_o: \mu = \mu_o, H_1: \mu > \mu_o$

  $\varphi(z_{\alpha}) = 0,5-\alpha \rightarrow z_{\alpha}, z = \frac{\overline{x}-\mu_o}{\sigma}.\sqrt{n}$

  - Nếu $z > z_{\alpha}$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
  - Nếu $z \leq z_{\alpha}$: Chấp nhận H_o.

Trường hợp 2. (σ chưa biết, $n \geq 30$)

- $H_o: \mu = \mu_o, H_1: \mu \neq \mu_o$

  $\varphi(z_{\frac{\alpha}{2}}) = \frac{1-\alpha}{2} \rightarrow z_{\frac{\alpha}{2}}, z = \frac{\overline{x}-\mu_o}{s}.\sqrt{n}$

  - Nếu $|z| > z_{\frac{\alpha}{2}}$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.

  - Nếu $|z| \leq z_{\frac{\alpha}{2}}$: Chấp nhận H_o.

- $H_o: \mu = \mu_o, H_1: \mu < \mu_o$

  $\varphi(z_{\alpha}) = 0,5-\alpha \rightarrow z_{\alpha}, z = \frac{\overline{x}-\mu_o}{s}.\sqrt{n}$

- Nếu $z < -z_\alpha$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
- Nếu $z \geq -z_\alpha$: Chấp nhận H_o.

• $H_o : \mu = \mu_o, H_1 : \mu > \mu_o$

$\varphi(z_\alpha) = 0,5 - \alpha \to z_\alpha,\ z = \dfrac{\overline{x} - \mu_o}{s}.\sqrt{n}$

- Nếu $z > z_\alpha$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
- Nếu $z \leq z_\alpha$: Chấp nhận H_o.

Trường hợp 3. (σ chưa biết, n<30)

• $H_o : \mu = \mu_o, H_1 : \mu \neq \mu_o$

$\alpha \to \dfrac{\alpha}{2} \to t_{(n-1;\frac{\alpha}{2})},\ t = \dfrac{\overline{x} - \mu_o}{s}.\sqrt{n}$

- Nếu $|t| > t_{(n-1;\frac{\alpha}{2})}$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
- Nếu $|t| \leq t_{(n-1;\frac{\alpha}{2})}$: Chấp nhận H_o.

• $H_o : \mu = \mu_o, H_1 : \mu < \mu_o$

$\alpha \to t_{(n-1;\alpha)},\ t = \dfrac{\overline{x} - \mu_o}{s}.\sqrt{n}$

- Nếu $t < -t_{(n-1;\alpha)}$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
- Nếu $t \geq -t_{(n-1;\alpha)}$: Chấp nhận H_o.

• $H_o : \mu = \mu_o, H_1 : \mu > \mu_o$

$\alpha \to t_{(n-1;\alpha)},\ t = \dfrac{\overline{x} - \mu_o}{s}.\sqrt{n}$

- Nếu $t > t_{(n-1;\alpha)}$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
- Nếu $t \leq t_{(n-1;\alpha)}$: Chấp nhận H_o.

b) Kiểm định tỉ lệ.

• $H_o : p = p_o, H_1 : p \neq p_o$

$\varphi(z_{\frac{\alpha}{2}}) = \dfrac{1-\alpha}{2} \to z_{\frac{\alpha}{2}},\ f = \dfrac{k}{n},\ z = \dfrac{f - p_o}{\sqrt{p_o(1-p_o)}}.\sqrt{n}$

- Nếu $|z| > z_{\frac{\alpha}{2}}$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
- Nếu $|z| \leq z_{\frac{\alpha}{2}}$: Chấp nhận H_o.

• $H_o : p = p_o, H_1 : p < p_o$

$\varphi(z_\alpha) = 0,5 - \alpha \to z_\alpha,\ f = \dfrac{k}{n},\ z = \dfrac{f - p_o}{\sqrt{p_o(1-p_o)}}.\sqrt{n}$

- Nếu $z < -z_{\alpha}$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
- Nếu $z \geq -z_{\alpha}$: Chấp nhận H_o.

- $H_o : p = p_o, H_1 : p > p_o$

$$\varphi(z_{\alpha}) = 0,5 - \alpha \to z_{\alpha},\ f = \frac{k}{n}, z = \frac{f - p_o}{\sqrt{p_o(1-p_o)}}.\sqrt{n}$$

- Nếu $z > z_{\alpha}$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
- Nếu $z \leq z_{\alpha}$: Chấp nhận H_o.

c) Kiểm định phương sai.

Trường hợp 1. (μ chưa biết)

- Nếu đề chưa cho s mà cho mẫu cụ thể thì phải sử dụng máy tính để xác định s.

- $H_o : \sigma^2 = \sigma_o^2, H_1 : \sigma^2 \neq \sigma_o^2$

$$\alpha \to 1 - \frac{\alpha}{2} \to \chi_1^2 = \chi^2_{(n-1;1-\frac{\alpha}{2})},\ \alpha \to \frac{\alpha}{2} \to \chi_2^2 = \chi^2_{(n-1;\frac{\alpha}{2})},\ \chi^2 = \frac{(n-1)s^2}{\sigma_o^2}$$

- Nếu $\left[\begin{array}{l}\chi^2 > \chi_2^2 \\ \chi^2 < \chi_1^2\end{array}\right.$: Bác bỏ H_0, chấp nhận H_1.
- Nếu $\chi_1^2 \leq \chi^2 \leq \chi_2^2$: Chấp nhận H_o.

- $H_o : \sigma^2 = \sigma_o^2, H_1 : \sigma^2 < \sigma_o^2$

$$\alpha \to 1 - \alpha \to \chi_1^2 = \chi^2_{(n-1;1-\alpha)},\ \chi^2 = \frac{(n-1)s^2}{\sigma_o^2}$$

- Nếu $\chi^2 < \chi_1^2$: Bác bỏ H_0, chấp nhận H_1.
- Nếu $\chi^2 \geq \chi_1^2$: Chấp nhận H_o.

- $H_o : \sigma^2 = \sigma_o^2, H_1 : \sigma^2 > \sigma_o^2$

$$\alpha \to \chi_2^2 = \chi^2_{(n-1;\alpha)},\ \chi^2 = \frac{(n-1)s^2}{\sigma_o^2}$$

- Nếu $\chi^2 > \chi_2^2$: Bác bỏ H_0, chấp nhận H_1.
- Nếu $\chi^2 \leq \chi_2^2$: Chấp nhận H_o.

4. Kiểm định so sánh tham số.

a) Kiểm định so sánh giá trị trung bình.

Trường hợp 1. (σ_1, σ_2 đã biết)

- $H_o : \mu_1 = \mu_2, H_1 : \mu_1 \neq \mu_2$

$$\varphi(z_{\frac{\alpha}{2}}) = \frac{1-\alpha}{2} \to z_{\frac{\alpha}{2}}, z = \frac{\overline{x}_1 - \overline{x}_2}{\sqrt{\frac{\sigma_1^2}{n_1} + \frac{\sigma_2^2}{n_2}}}$$

- Nếu $z > z_{\frac{\alpha}{2}}$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
- Nếu $|z| \le z_{\frac{\alpha}{2}}$: Chấp nhận H_o.

- $H_o : \mu_1 = \mu_2, H_1 : \mu_1 < \mu_2$

$$\varphi(z_\alpha) = 0,5 - \alpha \to z_\alpha, z = \frac{\overline{x}_1 - \overline{x}_2}{\sqrt{\frac{\sigma_1^2}{n_1} + \frac{\sigma_2^2}{n_2}}}$$

- Nếu $z < -z_\alpha$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
- Nếu $z \ge -z_\alpha$: Chấp nhận H_o.

- $H_o : \mu_1 = \mu_2, H_1 : \mu_1 > \mu_2$

$$\varphi(z_\alpha) = 0,5 - \alpha \to z_\alpha, z = \frac{\overline{x}_1 - \overline{x}_2}{\sqrt{\frac{\sigma_1^2}{n_1} + \frac{\sigma_2^2}{n_2}}}$$

- Nếu $z > z_\alpha$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
- Nếu $z \le z_\alpha$: Chấp nhận H_o.

<u>Trường hợp 2</u>. (σ_1, σ_2 chưa biết, $n_1, n_2 \ge 30$)

- $H_o : \mu_1 = \mu_2, H_1 : \mu_1 \ne \mu_2$

$$\varphi(z_{\frac{\alpha}{2}}) = \frac{1-\alpha}{2} \to z_{\frac{\alpha}{2}}, z = \frac{\overline{x}_1 - \overline{x}_2}{\sqrt{\frac{s_1^2}{n_1} + \frac{s_2^2}{n_2}}}$$

- Nếu $|z| > z_{\frac{\alpha}{2}}$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
- Nếu $|z| \le z_{\frac{\alpha}{2}}$: Chấp nhận H_o.

- $H_o : \mu_1 = \mu_2, H_1 : \mu_1 < \mu_2$

$$\varphi(z_\alpha) = 0,5 - \alpha \to z_\alpha, z = \frac{\overline{x}_1 - \overline{x}_2}{\sqrt{\frac{s_1^2}{n_1} + \frac{s_2^2}{n_2}}}$$

- Nếu $z < -z_\alpha$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
- Nếu $z \ge -z_\alpha$: Chấp nhận H_o.

- $H_o : \mu_1 = \mu_2, H_1 : \mu_1 > \mu_2$

$$\varphi(z_\alpha) = 0,5 - \alpha \to z_\alpha, z = \frac{\overline{x}_1 - \overline{x}_2}{\sqrt{\frac{s_1^2}{n_1} + \frac{s_2^2}{n_2}}}$$

- Nếu $z > z_\alpha$: Bác bỏ H$_o$, chấp nhận H$_1$.
- Nếu $z \le z_\alpha$: Chấp nhận H$_o$.

<u>Trường hợp 3</u>. ($\sigma_1 = \sigma_2$ chưa biết, $n_1, n_2 < 30$)

- $H_o : \mu_1 = \mu_2, H_1 : \mu_1 \ne \mu_2$

$$\alpha \to \frac{\alpha}{2} \to t_{(n_1+n_2-2;\frac{\alpha}{2})}, t = \frac{\overline{x}_1 - \overline{x}_2}{\sqrt{s^2(\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2})}}, \text{ với } s^2 = \frac{(n_1-1).s_1^2 + (n_2-1).s_2^2}{n_1+n_2-2}$$

- Nếu $|t| > t_{(n_1+n_2-2;\frac{\alpha}{2})}$: Bác bỏ H$_o$, chấp nhận H$_1$.
- Nếu $|t| \le t_{(n_1+n_2-2;\frac{\alpha}{2})}$: Chấp nhận H$_o$.

- $H_o : \mu_1 = \mu_2, H_1 : \mu_1 < \mu_2$

$$\alpha \to t_{(n_1+n_2-2;\alpha)}, t = \frac{\overline{x}_1 - \overline{x}_2}{\sqrt{s^2(\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2})}}, \text{ với } s^2 = \frac{(n_1-1).s_1^2 + (n_2-1).s_2^2}{n_1+n_2-2}$$

- Nếu $t < -t_{(n_1+n_2-2;\frac{\alpha}{2})}$: Bác bỏ H$_o$, chấp nhận H$_1$.
- Nếu $t \ge -t_{(n_1+n_2-2;\frac{\alpha}{2})}$: Chấp nhận H$_o$.

- $H_o : \mu_1 = \mu_2, H_1 : \mu_1 > \mu_2$

$$\alpha \to t_{(n_1+n_2-2;\alpha)}, t = \frac{\overline{x}_1 - \overline{x}_2}{\sqrt{s^2(\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2})}}, \text{ với } s^2 = \frac{(n_1-1).s_1^2 + (n_2-1).s_2^2}{n_1+n_2-2}$$

- Nếu $t > t_{(n_1+n_2-2;\frac{\alpha}{2})}$: Bác bỏ H$_o$, chấp nhận H$_1$.
- Nếu $t \le t_{(n_1+n_2-2;\frac{\alpha}{2})}$: Chấp nhận H$_o$.

b) Kiểm định so sánh tỉ lệ.

$$f_1 = \frac{k_1}{n_1}, f_2 = \frac{k_2}{n_2}, f = \frac{k_1+k_2}{n_1+n_2}$$

- $H_o : p_1 = p_2, H_1 : p_1 \ne p_2$

$$\varphi(z_{\frac{\alpha}{2}}) = \frac{1-\alpha}{2} \to z_{\frac{\alpha}{2}}, \ z = \frac{f_1 - f_2}{\sqrt{f(1-f).(\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2})}}$$

- Nếu $|z| > z_{\frac{\alpha}{2}}$: Bác bỏ H$_o$, chấp nhận H$_1$.
- Nếu $|z| \le z_{\frac{\alpha}{2}}$: Chấp nhận H$_o$.

- $H_o: p_1 = p_2, H_1: p_1 < p_2$

  $\varphi(z_\alpha) = 0,5 - \alpha \rightarrow z_\alpha, z = \dfrac{f_1 - f_2}{\sqrt{f(1-f).(\dfrac{1}{n_1} + \dfrac{1}{n_2})}}$

  - Nếu $z < -z_\alpha$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.

  - Nếu $z \geq -z_\alpha$: Chấp nhận H_o.

- $H_o: p_1 = p_2, H_1: p_1 > p_2$

  $\varphi(z_\alpha) = 0,5 - \alpha \rightarrow z_\alpha, z = \dfrac{f_1 - f_2}{\sqrt{f(1-f).(\dfrac{1}{n_1} + \dfrac{1}{n_2})}}$

  - Nếu $z > z_\alpha$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.

  - Nếu $z \leq z_\alpha$: Chấp nhận H_o.

c. Kiểm định so sánh phương sai.

- μ_1, μ_2 chưa biết nên tính s_1 và s_2 từ mẫu (sử dụng máy tính) nếu đề bài chưa cho.

  - $H_o: \sigma_1{}^2 = \sigma_2^2, H_1: \sigma_1{}^2 \neq \sigma_2^2$
    - $f = \dfrac{s_1^2}{s_2^2}$, $f_1 = f(n_1 - 1; n_2 - 1; 1 - \dfrac{\alpha}{2})$, $f_2 = f(n_1 - 1; n_2 - 1; \dfrac{\alpha}{2})$
    - Nếu $\left[\begin{array}{l} f < f_1 \\ f > f_2 \end{array}\right.$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
    - Nếu $f_1 \leq f \leq f_2$: Chấp nhận H_o.
  - $H_o: \sigma_1{}^2 = \sigma_2^2, H_1: \sigma_1{}^2 < \sigma_2^2$
    - $f = \dfrac{s_1^2}{s_2^2}$, $f_1 = f(n_1 - 1; n_2 - 1; 1 - \alpha)$
    - Nếu $f < f_1$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
    - Nếu $f_1 \leq f$: Chấp nhận H_o.
  - $H_o: \sigma_1{}^2 = \sigma_2^2, H_1: \sigma_1{}^2 > \sigma_2^2$
    - $f = \dfrac{s_1^2}{s_2^2}$, $f_2 = f(n_1 - 1; n_2 - 1; \alpha)$
    - Nếu $f > f_2$: Bác bỏ H_o, chấp nhận H_1.
    - Nếu $f \leq f_2$: Chấp nhận H_o.

5. Hệ số tương quan mẫu và phương trình hồi quy tuyến tính mẫu.

a. Hệ số tương quan mẫu: $r = \dfrac{n\sum_{i=1}^{n} x_i y_i - \sum_{i=1}^{n} x_i \sum_{i=1}^{n} y_i}{\sqrt{n\sum_{i=1}^{n} x_i^2 - (\sum_{i=1}^{n} x_i)^2}\sqrt{n\sum_{i=1}^{n} y_i^2 - (\sum_{i=1}^{n} y_i)^2}}$

Phương trình hồi quy tuyến tính mẫu: $\overline{y_x} = A + Bx$ với

$$B = \frac{n\sum_{i=1}^{n} x_i y_i - \sum_{i=1}^{n} x_i \sum_{i=1}^{n} y_i}{n\sum_{i=1}^{n} x_i^2 - (\sum_{i=1}^{n} x_i)^2} \text{ và } A = \frac{\sum_{i=1}^{n} y_i - B.\sum_{i=1}^{n} x_i}{n}.$$

b. Trong trường hợp sử dụng bảng tần số:

x_i	x_1	x_2	$\cdots$	x_k
y_i	y_1	y_2	$\cdots$	y_k
n_i	n_1	n_2	$\cdots$	n_k

Ta tính theo công thức thu gọn như sau:

Hệ số tương quan mẫu: $r = \dfrac{n\sum_{i=1}^{k} n_i x_i y_i - \sum_{i=1}^{k} n_i x_i \sum_{i=1}^{k} n_i y_i}{\sqrt{n\sum_{i=1}^{k} n_i x_i^2 - (\sum_{i=1}^{k} n_i x_i)^2}\sqrt{n\sum_{i=1}^{k} n_i y_i^2 - (\sum_{i=1}^{k} n_i y_i)^2}}$

Phương trình hồi quy tuyến tính mẫu: $\overline{y_x} = A + Bx$ với

$$B = \frac{n\sum_{i=1}^{k} n_i x_i y_i - \sum_{i=1}^{k} n_i x_i \sum_{i=1}^{k} n_i y_i}{n\sum_{i=1}^{k} n_i x_i^2 - (\sum_{i=1}^{k} n_i x_i)^2} \text{ và } A = \frac{\sum_{i=1}^{k} n_i y_i - B.\sum_{i=1}^{k} n_i x_i}{n}.$$

c. Sử dụng máy tính bỏ túi để tính hệ số tương quan mẫu và phương trình hồi quy tuyến tính mẫu:

<table>
<tr><th>Tác vụ</th><th>Dòng CASIO MS</th><th>Dòng CASIO ES</th></tr>
<tr><td>Bật chế độ nhập tần số</td><td>Không cần</td><td>Shift Mode ↓ 4 1</td></tr>
<tr><td>Khởi động gói Hồi quy tuyến tính</td><td>Mode…(tìm)…REG Lin</td><td>Mode…(tìm)…STAT A+BX</td></tr>
<tr><td>Nhập số liệu</td><td>x_1 , y_1 Shift , n_1 M+
⋮
x_k , y_k Shift , n_k M+

$n_i = 1$ thì chỉ cần nhấn
x_i , y_i M+</td><td><table><tr><th>X</th><th>Y</th><th>FREQ</th></tr><tr><td>x_1 =
⋮
x_k =</td><td>y_1 =
⋮
y_k =</td><td>n_1 =
⋮
n_k =</td></tr></table></td></tr>
<tr><td>Xóa màn hình hiển thị</td><td>AC</td><td>AC</td></tr>
<tr><td>Xác định:
• Hệ số tương quan mẫu (r)
• Hệ số hằng: A
• Hệ số ẩn (x): B</td><td>Shift 2 ⟶⟶ 3 =

Shift 2 ⟶⟶ 1 =
Shift 2 ⟶⟶ 2 =</td><td>Shift 1 7 3 =

Shift 1 7 1 =
Shift 1 7 2 =</td></tr>
<tr><td>Thoát khỏi gói Hồi quy</td><td>Mode 1</td><td>Mode 1</td></tr>
</table>

Lưu ý: Máy ES nếu đã kích hoạt chế độ nhập tần số ở phần Lý thuyết mẫu rồi thì không cần kích hoạt nữa.

……………………………………….