

STOCKHOLMS UNIVERSITET  
Statistiska institutionen  
Ellinor Fackle-Fornius

TENTAMEN I STATISTISK TEORI MED TILLÄMPNINGAR II  
2017-11-24

---

**Skrivtid:** 10.00-15.00

**Godkända hjälpmedel:** Miniräknare, språklexikon.

Tentamen består av fem uppgifter. För full poäng på en uppgift krävs tydliga, utförliga och väl motiverade lösningar.

Resultatet meddelas senast den 13 december.

---

OBS! Glöm inte att ange nödvändiga antaganden överallt

**Uppgift 1.** (20 poäng)

Avgör om vart och ett av följande påståenden är sanna eller falska och motivera ditt svar.

- i) När ett 95 %-igt konfidensintervall har beräknats är sannolikheten 95 % att intervallet innehåller det sanna men okända parametervärdet.
- ii) En lägre konfidensgrad ger ett bredare konfidensintervall (allt annat lika).
- iii) Signifikansnivån  $\alpha$  är sannolikheten att nollhypotesen är falsk.
- iv)  $p$ -värdet är alltid större än signifikansnivån.
- v) Vid ett test av  $H_0 : \mu = \mu_0$  mot alternativhypotesen  $H_a : \mu = \mu_a$  kommer en lägre signifikansnivå innebära att testets styrka ökar.

### Uppgift 2. (20 poäng)

Antalet bränder i Sverige under tidsperioden 1974-2003 visas i nedanstående tabell. Om intensiteten av bränder under tidsperioden är konstant borde observationerna vara slumpmässigt ordnade. Ett sätt att undersöka om det finns en trend i sekvensen av bränder är att testa om ordningen av positiva och negativa avvikelser från medelvärdet i sekvensen är slumpmässig. Testa detta med ett lämpligt icke-parametriskt test på signifikansnivån 0.01.

År	1974	1975	1976	1977	1978	1979	1980	1981	1982	1983
Antal	15 833	18 527	20 363	19 961	21 044	21 135	20 059	29 698	27 870	28 975
År	1984	1985	1986	1987	1988	1989	1990	1991	1992	1993
Antal	30 929	32 160	32 471	34 038	42 171	23 893	33 238	31 925	31 082	36 252
År	1994	1995	1996	1997	1998	1999	2000	2001	2002	2003
Antal	37 984	37 645	36 649	61 795	41 968	41 855	45 301	41 853	43 894	37 634

### Uppgift 3. (20 poäng)

En tillverkare av golfutrustning är intresserad av att undersöka om ett nytt material (material A) i skaften på golfklubbor ökar golfslagens längd jämfört med det traditionella materialet (material B). Handlaren väljer slumpmässigt ut 5 personer som får använda klubbor med skaftmaterial A och 5 personer som får använda klubbor med skaftmaterial B. Varje spelare får slå 10 slag vardera och följande genomsnittliga längder uppmättes.

Material A	177	195	188	179	182
Material B	187	192	198	181	206

- Testa med hjälp av ett lämpligt parameteriskt test om det går att påvisa någon skillnad mellan de två materialen när det gäller slaglängd. Använd signifikansnivån 5 %.
- Antag istället att tillverkaren hade valt 5 personer som var och en hade fått använda båda sorters klubbor (med skaftmaterial A och skaftmaterial B) och att tabellens kolumner beskriver de 5 personernas resultat. Testa med hjälp av ett lämpligt parameteriskt test om det går att påvisa någon skillnad mellan de två materialen när det gäller slaglängd. Använd signifikansnivån 5 %.
- Jämför de två sätten att lägga upp försöket i a)- och b)-uppgiften, vilket är att föredra?

**Uppgift 4.** (20 poäng)

Narkotikahalten i polisens beslag av narkotiskt material analyseras årligen. För att beskriva andelen narkotika av en viss typ i beslagen kan modellen

$$f(y) = \alpha y^{\alpha-1}, \quad 0 < y < 1,$$

användas. Här är  $y$  andelen narkotika och  $\alpha$  är en parameter. Denna modell är ett specialfall av en betafördelning där den ena parametern  $\beta = 1$ . I ett slumpmässigt urval av 7 beslag registrerades följande andelar:

0.354, 0.201, 0.959, 0.205, 0.172, 0.149, 0.561.

- a) Härled och beräkna maximum likelihood-skattningen av parametern  $\alpha$ .
- b) Härled och beräkna momentskattningen av parametern  $\alpha$ .

**Uppgift 5.** (20 poäng)

En voltmeter mäter spänningen i en elektrisk apparat. Mätningen antas vara likformigt fördelad i intervallet  $(\theta, \theta + 1)$ , där  $\theta$  är den sanna men okända spänningen i apparaten. Antag att  $Y_1, Y_2, \dots, Y_n$  är ett slumpmässigt urval av mätningar med voltmeter.

- a) Visa att  $\bar{Y}$  inte är en väntevärdesriktig estimator för  $\theta$ , d.v.s. har en bias. Hur stor är biasen?
- b) Bestäm MSE för  $\bar{Y}$  när  $\bar{Y}$  används som estimator för  $\theta$ .
- c) Bilda en funktion av  $\bar{Y}$  som är en väntevärdesriktig estimator för  $\theta$ .
- d) Är estimatoren i c)-uppgiften konsistent?

Statistiska institutionen



Stockholms  
universitet

# Rättningsblad

**Datum:** 24/11/17

**Sal:** Brunnsvikssalen

**Tenta:** Statistisk teori med tillämpningar

**Kurs:** Statistisk teori med tillämpningar II

**ANONYMKOD:**

STMT2-HCU-WCZ

Jag godkänner att min tenta får läggas ut anonymt på hemsidan som studentsvar.

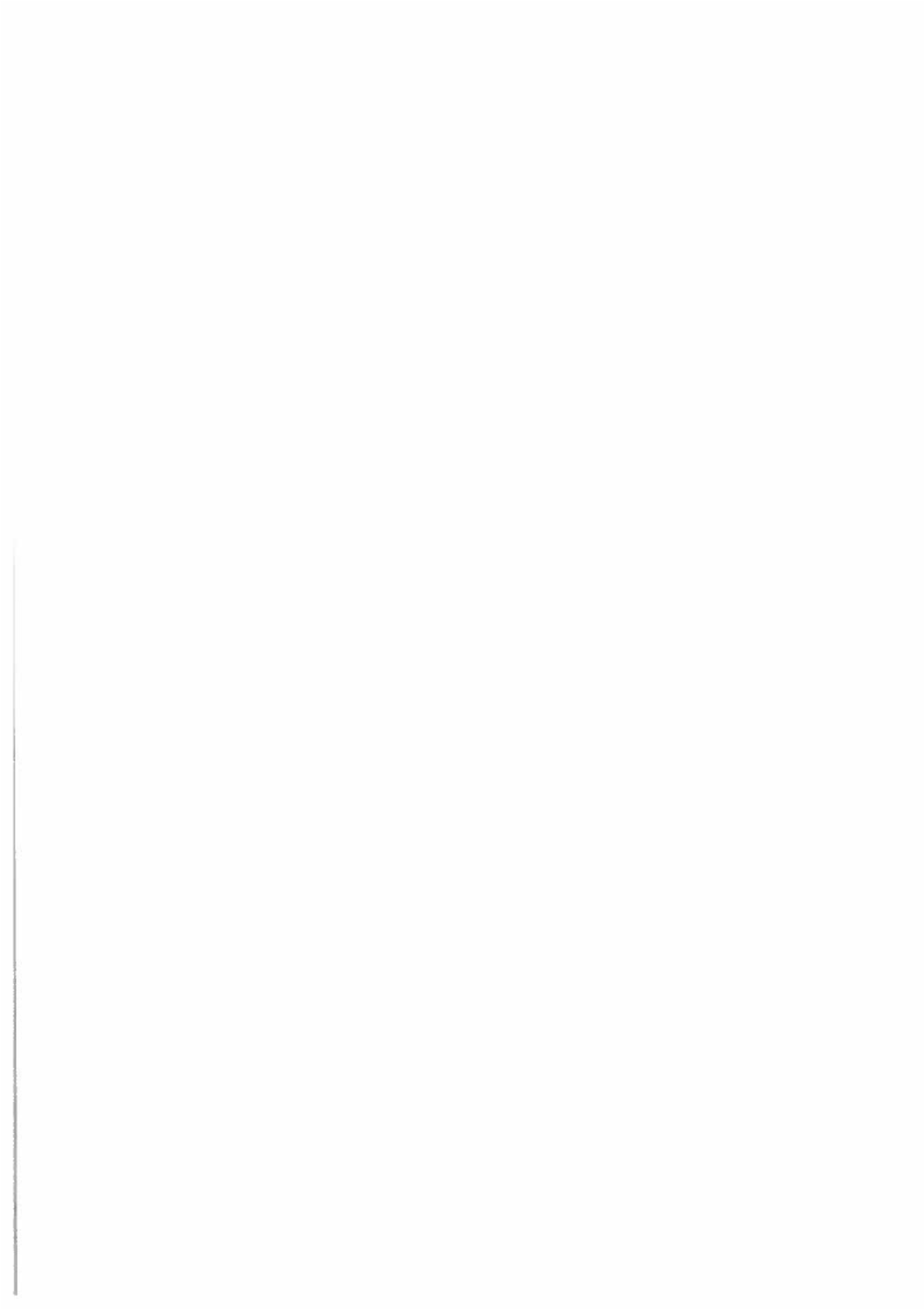
**OBS! SKRIV ÄVEN PÅ BAKSIDAN AV SKRIVBLADEN**

Markera besvarade uppgifter med kryss

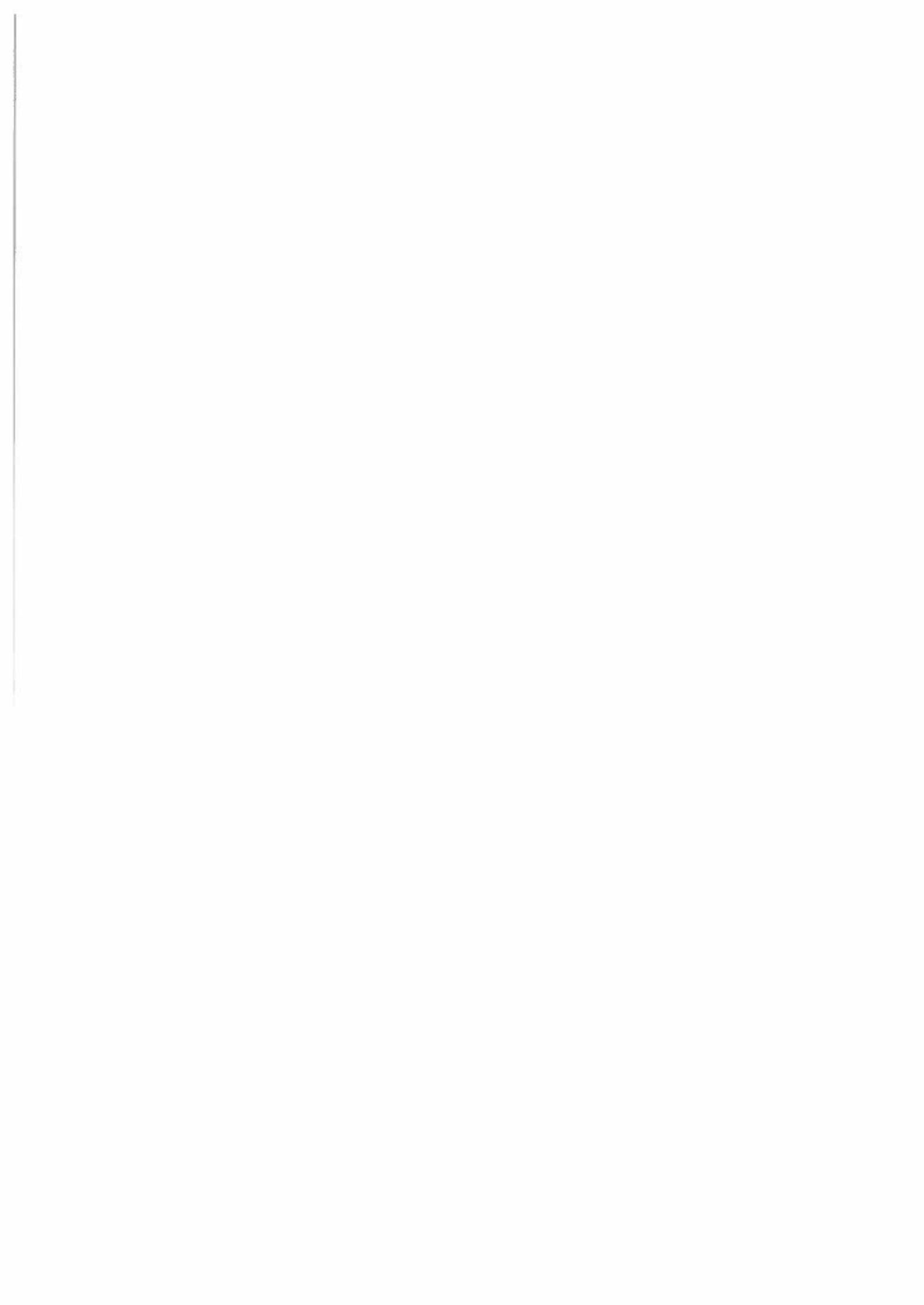
1	2	3	4	5	6	7	8	9	Antal inl. blad
X	X	X	X	X					5
Lär.ant. 15	20	16	18	3					

72 + 4 bonus

POÄNG 76	BETYG C	Lärarens sign. 
-------------	------------	--------------------







2. Jag använder här ett runs-test för att testa:  
 $H_0$ : Ordningen är slumpmässig  
 $H_1$ : Så är ej fallet.  
 Sign 0,01 ger  $RR = \{ |Z_{obs}| > 2,5758 \}$  då testet är dubbelsidigt.

För att räkna ut om varje är har ett antal bränder som är högre eller lägre än genomsnitt räknar jag ut  $\bar{y} = \frac{\sum y_i}{n}$  och jämför med vardera års obs värde.

$$\bar{y} = \frac{978202}{30} = 32606,73$$

Detta ger teckenföljden:

-----+--+-----+ + + + + + + + + + +

Teststatistika:  $Z = \frac{R - E(R)}{\sqrt{V(R)}}$   $R = 6$   
 $n_1 = 16$   
 $n_2 = 14$

$$E(R) = \frac{2n_1n_2}{n_1+n_2} + 1 = \frac{2 \cdot 16 \cdot 14}{16+14} + 1 = 15,933$$

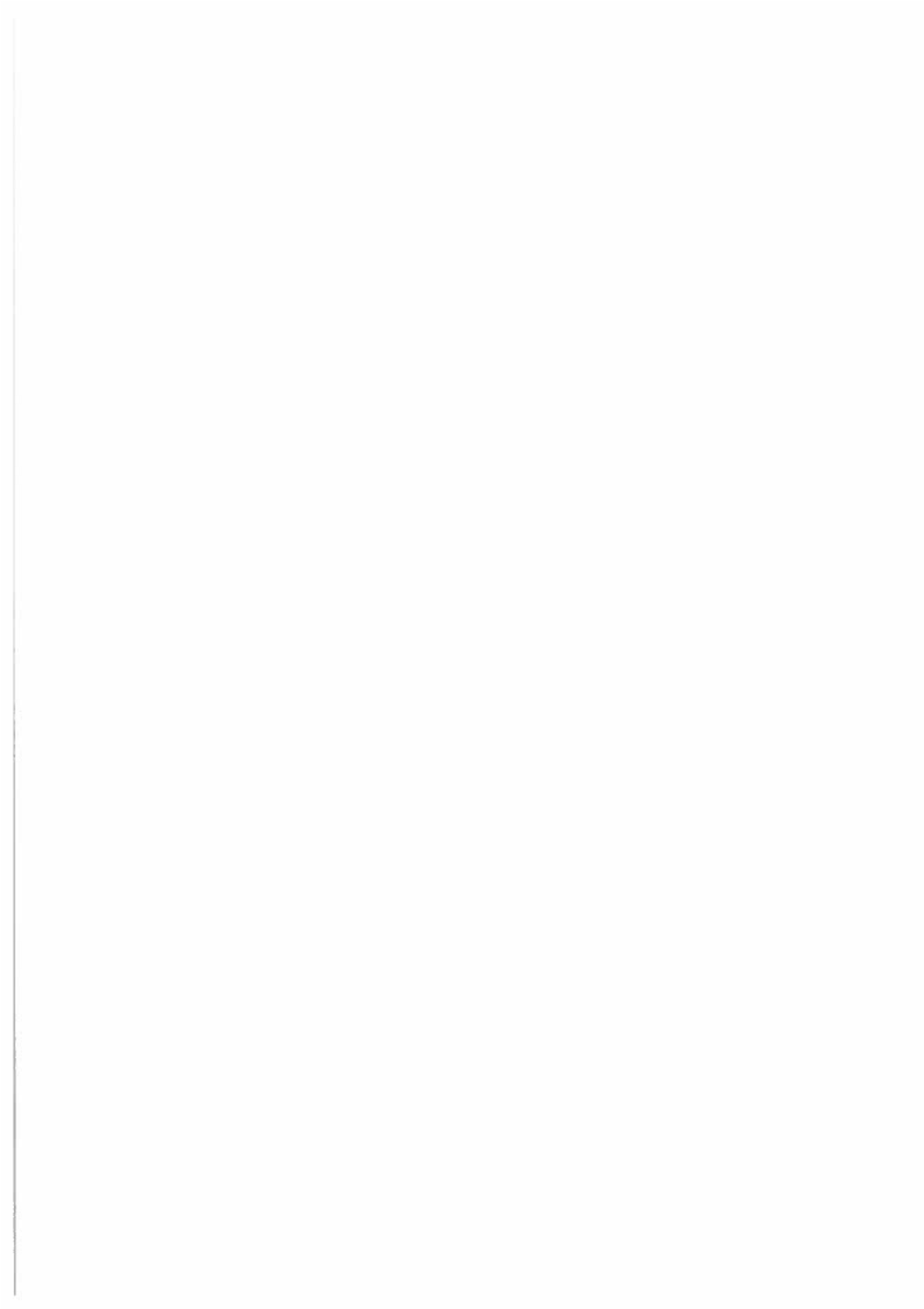
$$V(R) = \frac{2n_1n_2(2n_1n_2 - n_1 - n_2)}{(n_1+n_2)^2(n_1+n_2-1)} = \frac{2 \cdot 16 \cdot 14 (2 \cdot 16 \cdot 14 - 16 - 14)}{(16+14)^2(16+14-1)}$$

$$= \frac{187264}{26100} = 7,175$$

$$Z = \frac{6 - 15,933}{\sqrt{7,175}} = -3,576$$

Eftersom  $|Z_{obs}| > 2,5758$  så förkastar vi  $H_0$  på signifikansnivån 0,01, ordningen antas alltså icke slumpmässig.





3) a) På grund av slumpmässigt urval och icke-beroende både inom och mellan grupperna använder jag mig utav t-teststatistikern.

$$T = \frac{\bar{Y}_1 - \bar{Y}_2 - D_0}{S_p \sqrt{\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}}}$$

för att testa  $H_0: \mu_1 - \mu_2 = 0$   
 $H_a: \mu_1 - \mu_2 \neq 0$   
 $\alpha = 5\%$  dubbelstidigt ger  
 $\alpha_{0.025} = 1,96$

$$RR = \{ |t_{obs}| > 1,96 \}$$

$$\bar{Y}_1 = \frac{921}{5} = 184,2$$

$$\bar{Y}_2 = \frac{964}{5} = 192,8$$

$$S_1^2 = \frac{\sum Y_i^2 - n(\bar{Y})^2}{n-1} = \frac{169863 - 5 \cdot 33929,64}{4} = 53,7$$

$$S_2^2 = \frac{\sum Y_i^2 - n(\bar{Y})^2}{n-1} = \frac{186234 - 5 \cdot 37171,84}{4} = 93,7$$

$$S_p^2 = \frac{(n_1-1)S_1^2 + (n_2-1)S_2^2}{n_1+n_2-2} = \frac{4 \cdot 53,7 + 4 \cdot 93,7}{5+5-2} = 73,7$$

$$S_p = \sqrt{S_p^2} = 8,585$$

$$T = \frac{184,2 - 192,8 - 0}{8,585 \sqrt{\frac{1}{5} + \frac{1}{5}}} = \frac{-8,6}{5,4296} = -1,584$$

Svar: Eftersom  $|t_{obs}| < 1,96$  så förkastar vi inte  $H_0$ . Ingen skillnad har påvisats.



b) När vi nu har parvisa observationer använder vi oss av teststatistikan

$$T = \frac{\bar{D} - \mu_0}{S/\sqrt{n}} \quad \text{för att testa } H_0: \mu_0 = 0$$

Dubbelsidighet ger åter igen  
sign  $\alpha = 5\%/2 \rightarrow 1,96$

$$RR = \{ |T_{\text{obs}}| > 1,96 \} \quad D_1 = 10 \quad D_2 = -3 \quad D_3 = 10 \quad D_4 = 2 \quad D_5 = 24$$

$$\bar{D} = \frac{39}{5} = 7,8$$

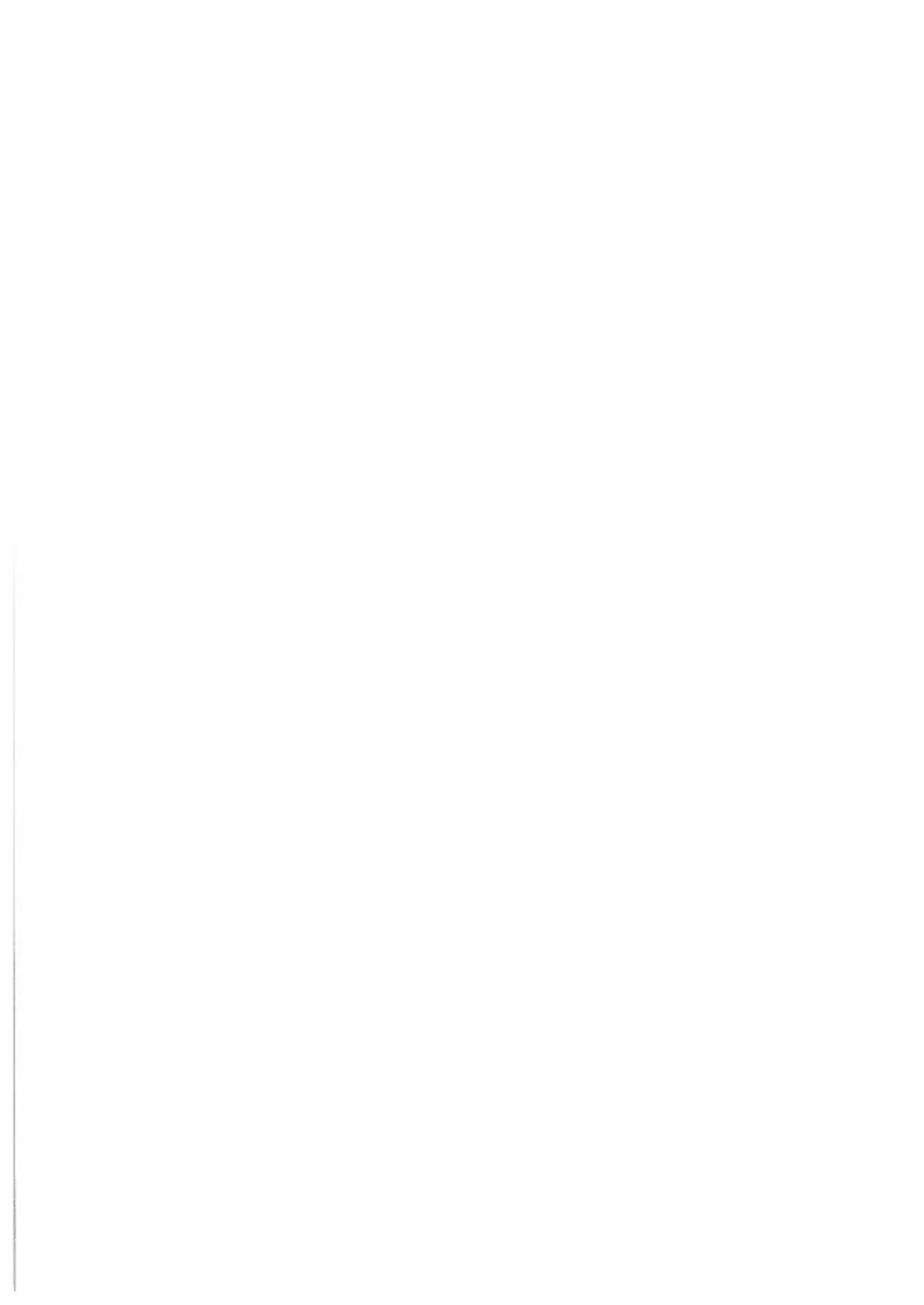
$$S^2 = \frac{\sum (D_i - \bar{D})^2}{4} = \frac{484,8 - 121,2}{4}$$

$$S = \sqrt{S^2} \approx 11$$

$$T = \frac{7,8 - 0}{11/\sqrt{5}} = 1,586$$

Svar: Vi förkastar inte heller här  $H_0$ .  
Vi kan inte utläsa denna data påvisa någon skillnad mellan materialen.

c) I dessa fall gav resultaten ingen skillnad. Generellt vill jag dock mena, framförallt om man inte har allt för stora urval, att metod 2 är bättre. När man låter varje försöksperson testa båda materialen eliminerar man risken för att urvalet har drastiskt olika skicklighetsnivåer. Om det i grupp ett råkar vara intresserade amatörer och grupp två endast innehåller proffs kommer resultaten gissningsvis bli missvisande. Detta då ett proffs gissningsvis står längre med ett dåligt material än vad en nybörjare gör med ett bra material.  
Alltså: Parvisa observationer är att föredra



4 a)  $f(y) = \alpha y^{\alpha-1}$  Pga oberoende ty s.k.  
 $L(y_1, y_2, \dots, y_n | \alpha) = \prod_{i=1}^n f(y_i | \alpha) = \prod_{i=1}^n \alpha y_i^{\alpha-1}$

$$L(\alpha) = \ln L(\alpha) = \ln\left(\prod_{i=1}^n \alpha y_i^{\alpha-1}\right) =$$

$$= \ln(\alpha^n \prod y_i^{\alpha-1}) =$$

$$= n \ln(\alpha) + (\alpha-1) \sum \ln(y_i) = n \ln(\alpha) - \alpha \sum \ln(y_i) + \sum \ln(y_i)$$

$$\frac{dL(\alpha)}{d\alpha} = \frac{n}{\alpha} + \sum \ln(y_i)$$

Sätt derivatan = 0 och lös ut  $\alpha$ :

$$n \sum \ln(y_i) = -\frac{n}{\alpha} \quad \alpha n \sum \ln(y_i) = -n$$

$$\alpha = \frac{-n}{n \sum \ln(y_i)} = \hat{\alpha}_{ML}$$

$$\sum \ln(y_i) = -8,512$$

$$\hat{\alpha}_{ML} = \frac{-n}{n - 8,512} = \frac{-7}{7 - 8,512} = 0,117$$

Följande

12

$$b) \left. \begin{aligned} \mu_i' &= \frac{\sum y_i}{n} = \bar{y} \\ m_i' &= \frac{\alpha}{\alpha+1} \end{aligned} \right\} \bar{y} = \frac{\alpha}{\alpha+1}$$

$$\bar{y} = \frac{\alpha}{\alpha+1} \rightarrow (\alpha+1) \bar{y} = \alpha \rightarrow \alpha \bar{y} + \bar{y} = \alpha \rightarrow$$

$$\rightarrow \bar{y} = \alpha - \alpha \bar{y} \rightarrow \bar{y} = \alpha(1 - \bar{y}) \rightarrow \frac{\bar{y}}{1 - \bar{y}} = \alpha$$

$$\bar{y} = \frac{\sum y_i}{n} = 0,372$$

$$\hat{\alpha}_{inom} = \frac{0,372}{0,628} = 0,59$$

5

18



5

$$a) E(\bar{y}) = \frac{\theta_1 + \theta_2}{2} = \frac{2\theta + 1}{2} = \theta + 1 \quad \checkmark$$

$$\bar{y} = \frac{\sum y_i}{n}$$

$$\theta + 1 = \frac{\sum y_i}{n} \rightarrow \theta = \frac{\sum y_i}{n} - 1 \quad \checkmark$$

Svar: Biasen är -1

$$b) \text{MSE för } \bar{y} = V(\bar{y}) = \frac{1}{n^2} \sum y_i + 1$$

c) En MVR estimator för  $\theta$  ges av  $\int_{\theta}^{\theta+1} y f(y) dy$

$$\int_{\theta}^{\theta+1} \bar{y} \left( \frac{1}{2\theta+1} \right) dy = \left[ \bar{y}^{-1} \left( \frac{1}{2\theta+1} \right) \right]_{\theta}^{\theta+1} = \theta^{-1} \left( \frac{1}{2\theta+1} \right) =$$

$$= \frac{1}{2\theta^2 + 1}$$

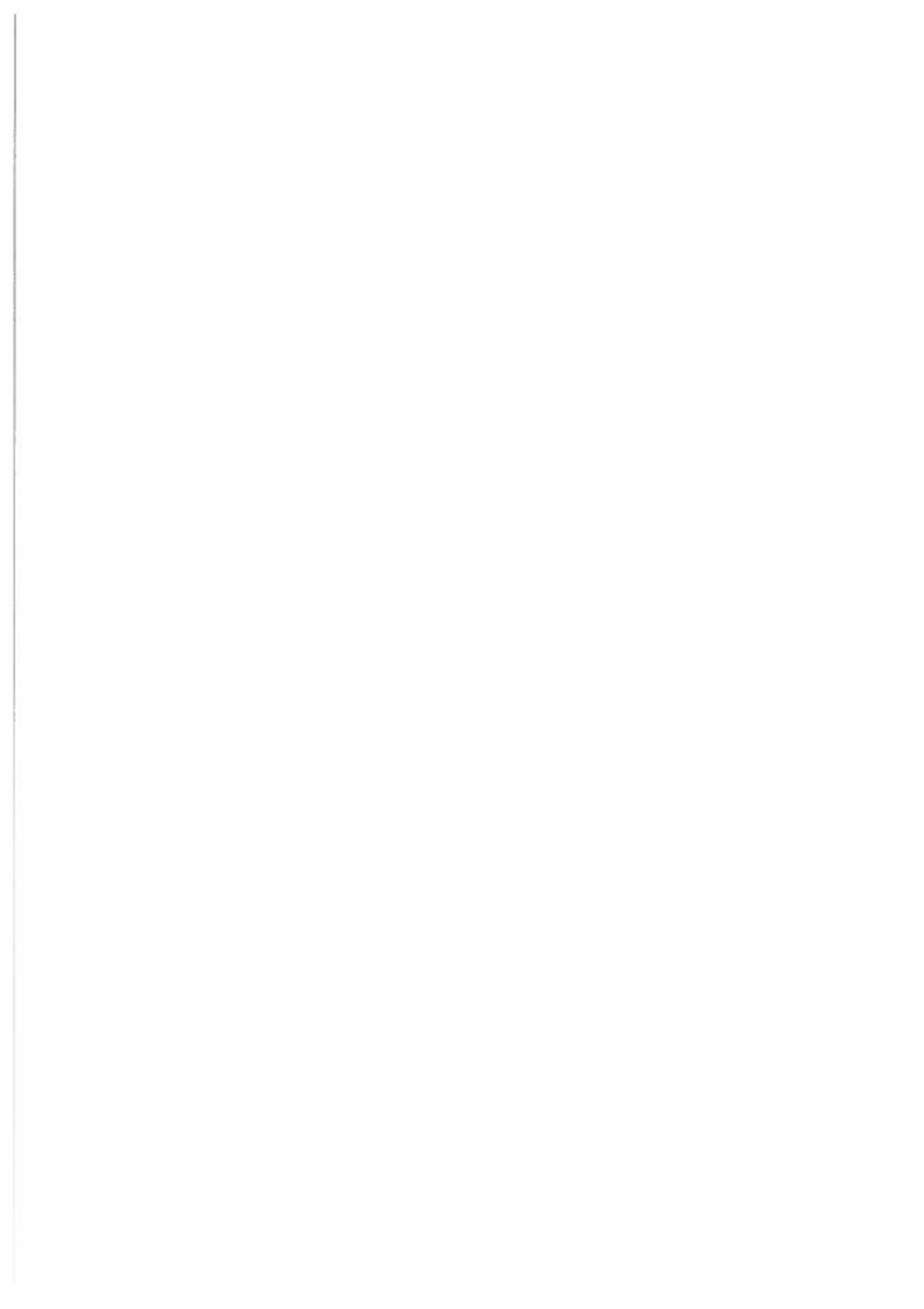
d) En estimator är konsistent om dess varians går mot noll när  $n$  går mot oändligheten

Denna estimator är konsistent.

3

3





$k_1$  eller  $k_2$  (eller  
 det mer det  
 konstant) med slh 0 eller 1.

ii) FALSKT. Generellt fås ett k.i. för  $\theta$  som

$$\hat{\theta} \pm \text{kvantil} \cdot \sigma_{\hat{\theta}}$$

där kvantilen bestäms av fördelningen för  $\hat{\theta}$ ,  
 en lägre konfidensgrad gör att kvantilens  
 värde minskar (t.ex. är  $z_{0.05} \approx 1.65 < z_{0.025} \approx 1.96$ )  
 vilket ger ett smalare k.i.

iii) FALSKT.  $\alpha = P(\hat{\theta} \in RR \mid \theta = \theta_0)$  dvs slh  
 att testvariabeln hamnar i förkastelsområdet  
 givet att nollhypotesen är sann och säger  
 inget om slh att en hypotes är sann eller falsk  
 ( $\theta$  är konstant)



det

det

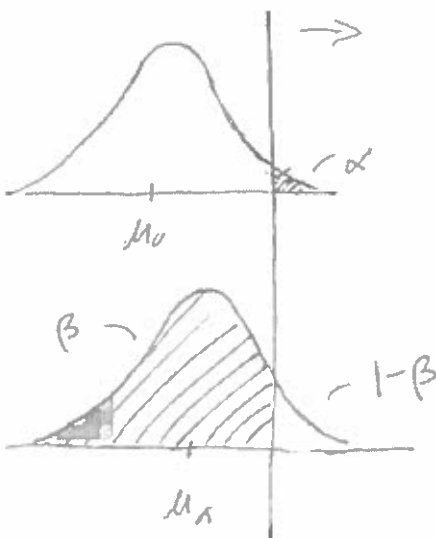
det

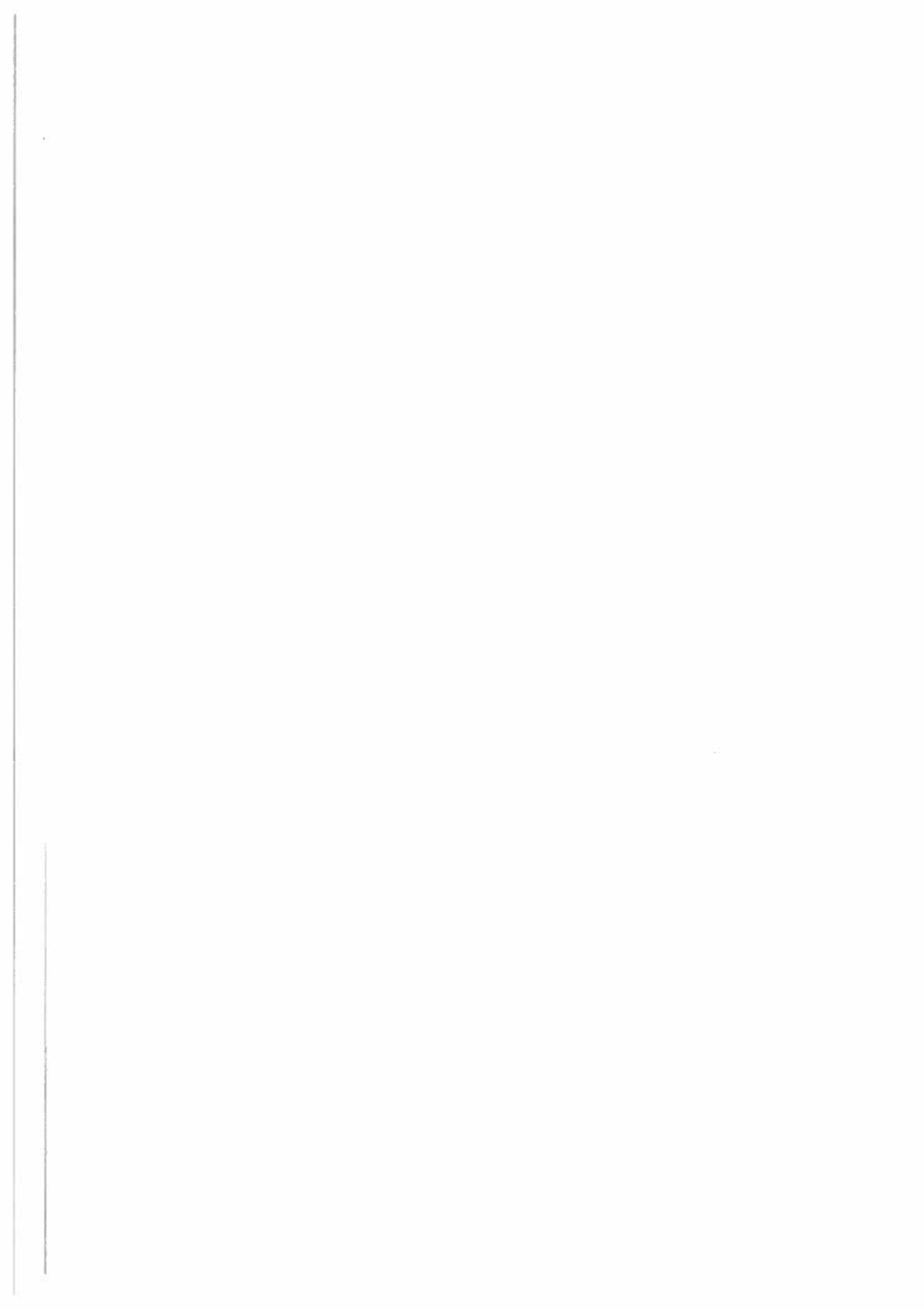
rejektas  $H_0$ .

v) FALSKT.

$$\begin{cases} H_0: \mu = \mu_0 \\ H_a: \mu = \mu_a \end{cases}$$

För att få lägre signifikansnivå måste det kritiska värdet (som bestäms RR) ändras vilket medför att slh för typ II-fel ( $\beta$ ) ökar, vilket gör att styrkan ( $1-\beta$ ) minskar.





U

medelvärdet är raka-stumpmässig

Testvariabel :  $R$  = antal runs i sekvensen

Medelvärdet av antal bränder under perioden:

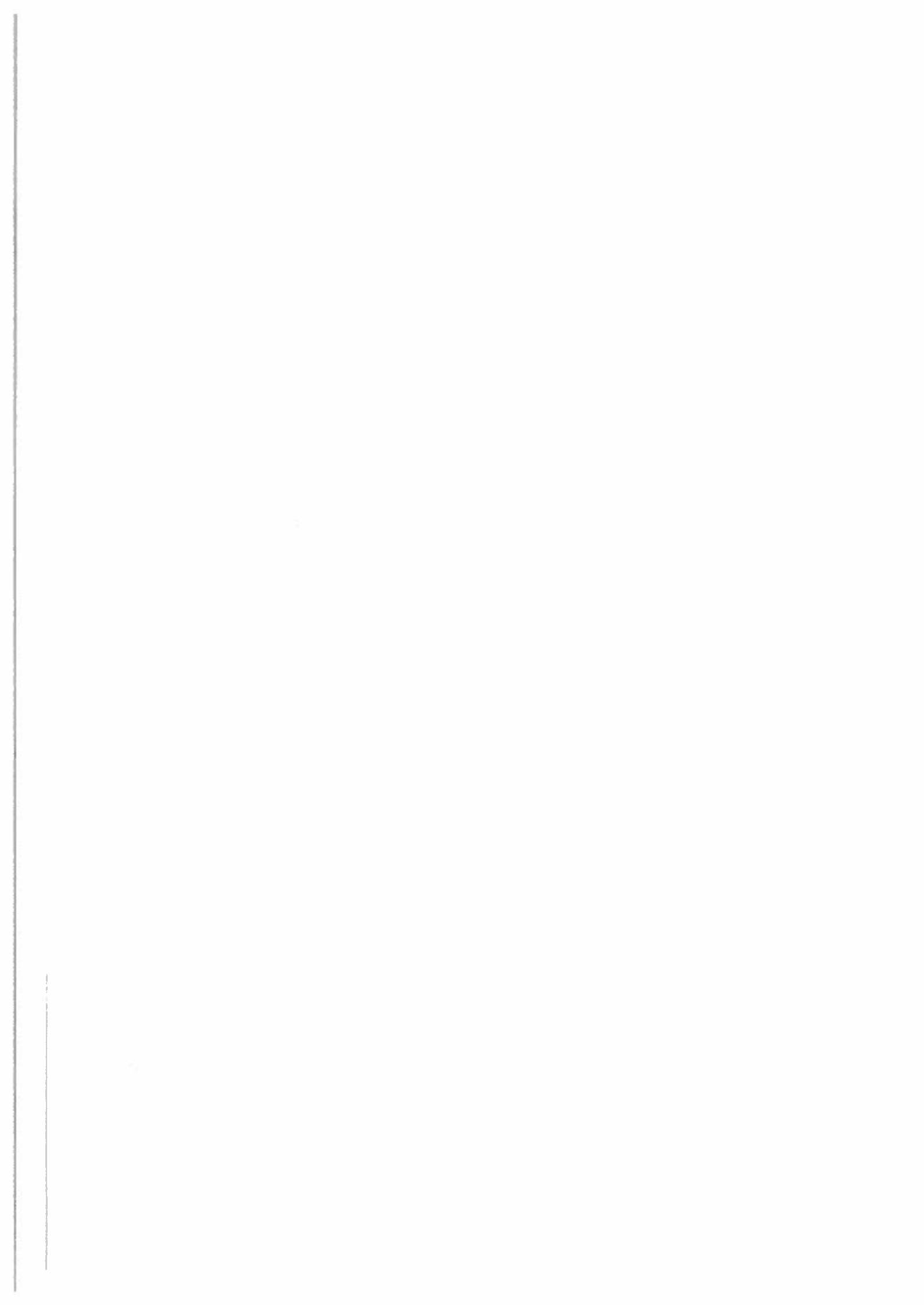
$$\frac{15833 + 18527 + \dots + 37634}{30} = 32607$$

vilket ger följande sekvens av pos. & neg. avvikelser:

-----	}	$n_1 = 16$ st "-"
- - - + + - + - - +		$n_2 = 14$ st "+"
+++++		$R = 6$

Då  $n_1 > 10$  &  $n_2 > 10$  görs en z-transformation

av  $R$  vilket ger testvariabeln:



$$\sqrt{V(R)}$$

approx.  $N(0,1)$  om

$n$

$$\{ |z| > 2.5758 \}$$

$z(R)$

$$\frac{\dots}{\dots}$$

$$= 15.933$$

$$\frac{2 \cdot 16 \cdot 14 (2 \cdot 16 \cdot 14 - 16 - 14)}{(16 + 14)^2 (16 + 14 - 1)}$$

$$\frac{2 \cdot 16 \cdot 14 (2 \cdot 16 \cdot 14 - 16 - 14)}{(16 + 14)^2 (16 + 14 - 1)}$$

$$\approx 2.1749$$

it värde:

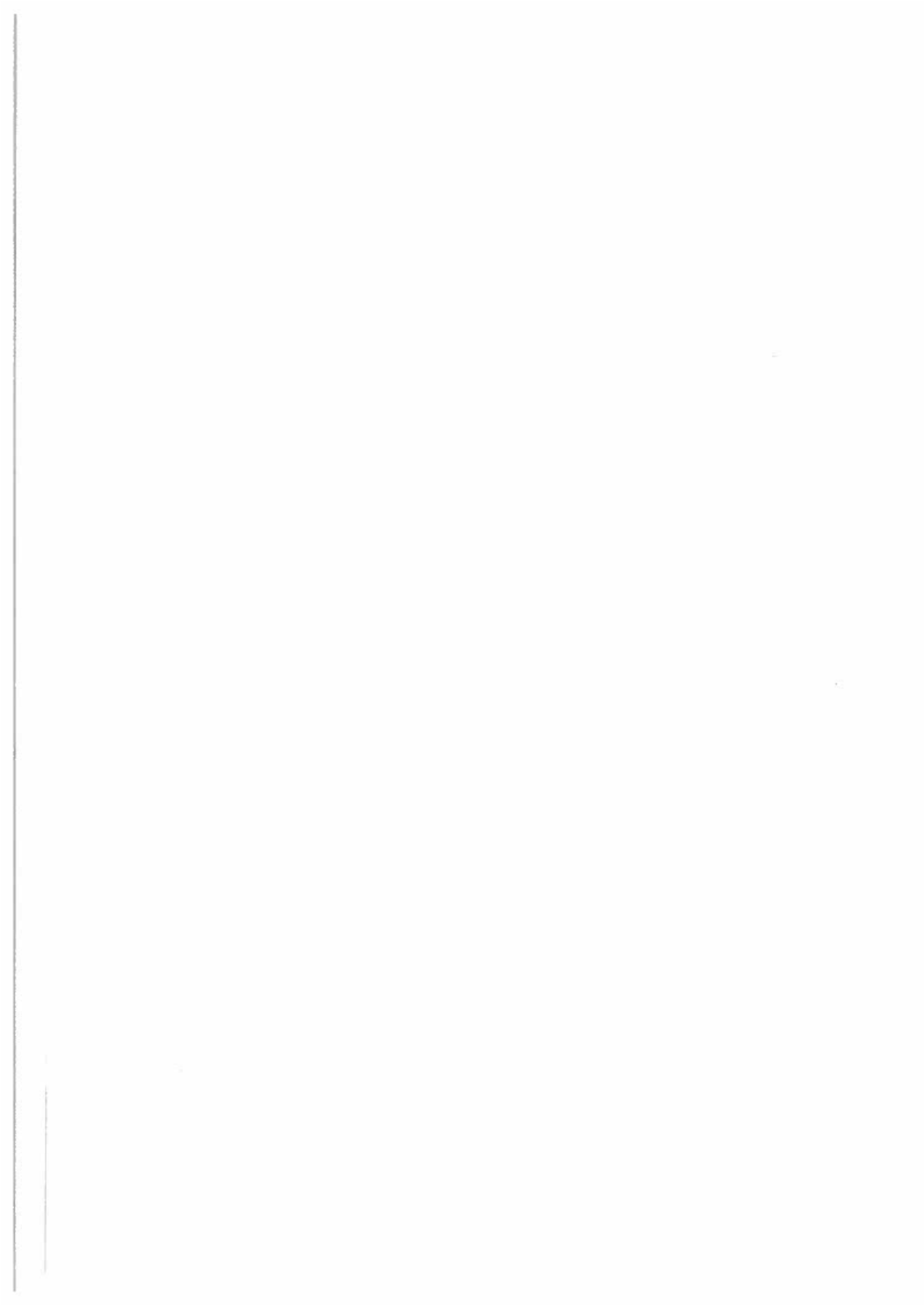
$$\frac{3}{1} \approx -3.7084$$

it

var:

is på sign.nivån 0.01 och slutsatsen  
det s en trend i sekvensen av bränder  
visa att ordningen av positiva och  
neg förän medvärdet är icke-





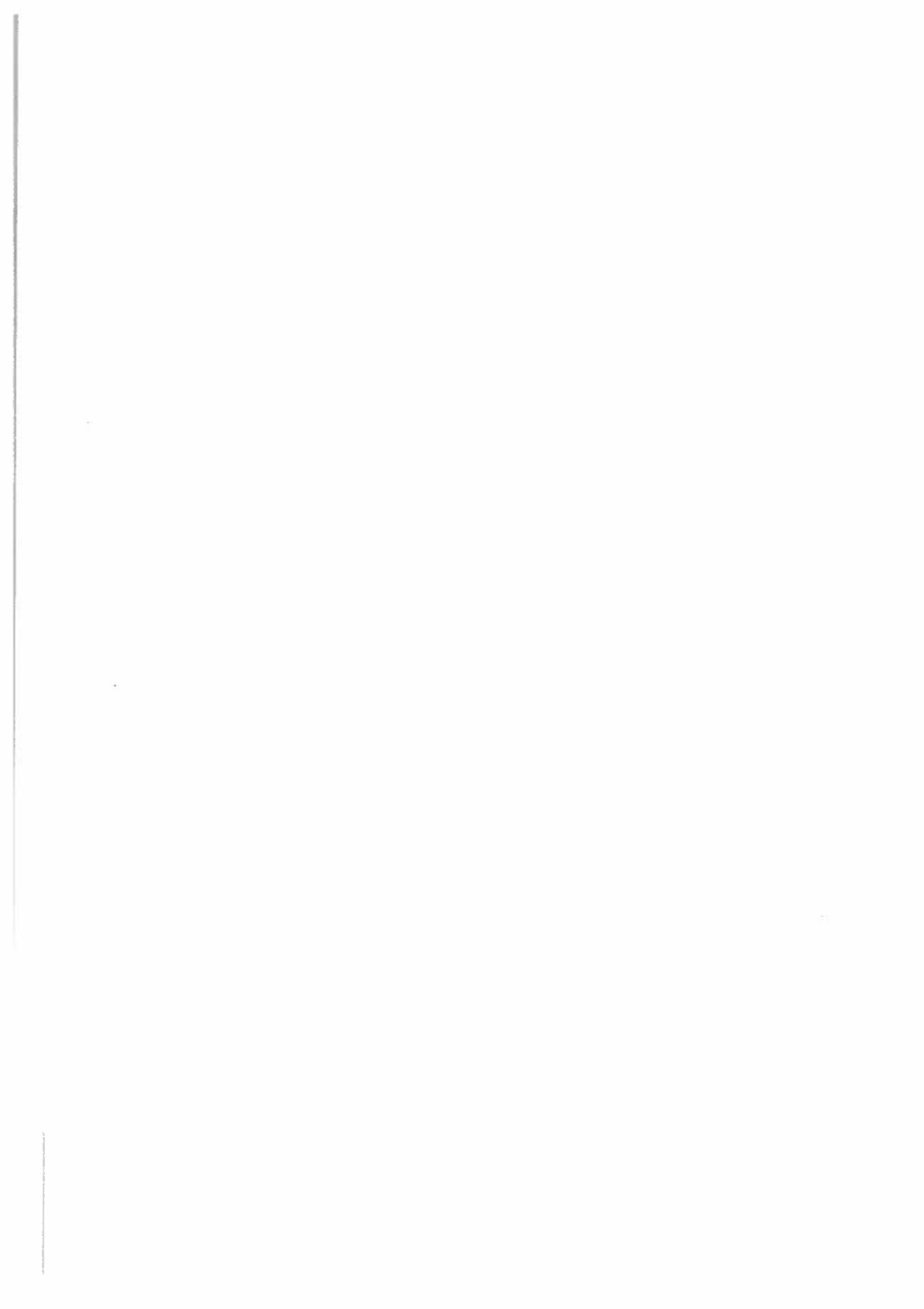
also

$$\begin{array}{l} H_0: \mu_1 = \mu_2 \\ H_a: \mu_1 \neq \mu_2 \end{array} \Leftrightarrow \left. \begin{array}{l} \mu_1 - \mu_2 = 0 \\ \mu_1 - \mu_2 \neq 0 \end{array} \right\} \begin{array}{l} \text{g\u00fcller b\u00e4de} \\ \text{a) \& b)} \end{array}$$

a) t-test, n\u00f6dv\u00e4ndiga f\u00f6ruts\u00e4ttningar \u00e4r oberoende inom grupperna (som kan antas d\u00e5 personerna valts ut slumpm\u00e4ssigt) samt oberoende mellan grupperna (som kan antas d\u00e5 det \u00e4r 5 olika personer i varje grupp), att b\u00e4de  $\Sigma_1$  och  $\Sigma_2$  kan antas vara n-f. och att  $\sigma_1^2 = \sigma_2^2 = \sigma^2$  (s\u00e5 att unavslansansorna kan poolas)

Testvariabel:

$$T = \frac{\bar{Y}_1 - \bar{Y}_2}{s_p \sqrt{\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}}} \sim t(n_1 + n_2 - 2) \text{ om } H_0 \text{ \u00e4r sann}$$



R { }  
{ }

$$\bar{Y}_1 = 184.2, \quad \bar{Y}_2 = 192.8$$

$$s_1^2 = 53.7, \quad s_2^2 = 93.7$$

$$s_p^2 = \frac{4 \cdot 53.7 + 4 \cdot 93.7}{8} = 73.7$$

obs. värde på testvariabeln:

$$t = \frac{184.2 - 192.8}{\sqrt{73.7} \sqrt{\frac{1}{5} + \frac{1}{5}}} \approx -1.5839$$

Itu förkastas ej då  $| -1.5839 | = 1.5839 < 2.31$

Svar: Itu förkastas inte på signifikansnivån 0.05, det gör inte alltså några skillnad mellan de två materialen när det gäller slaglängd

ö p.



p

Testvariable:

$$T = \frac{\bar{D}}{s_d / \sqrt{n}} \sim t(n-1) \text{ om } H_0 \text{ är sann}$$

$$RR = \{|t| > t_{\alpha/2}(n-1)\} = \{|t| > t_{0.025}(4)\} = \{|t| > 2.78\}$$

Natur A      Natur B

$\bar{Y}_1$	$\bar{Y}_2$	$D = \bar{Y}_1 - \bar{Y}_2$
177	187	-10
195	192	3
188	198	-10
179	181	-2
182	206	-24

$$\bar{d} = -8.6$$

$$s_d^2 = 104.8$$



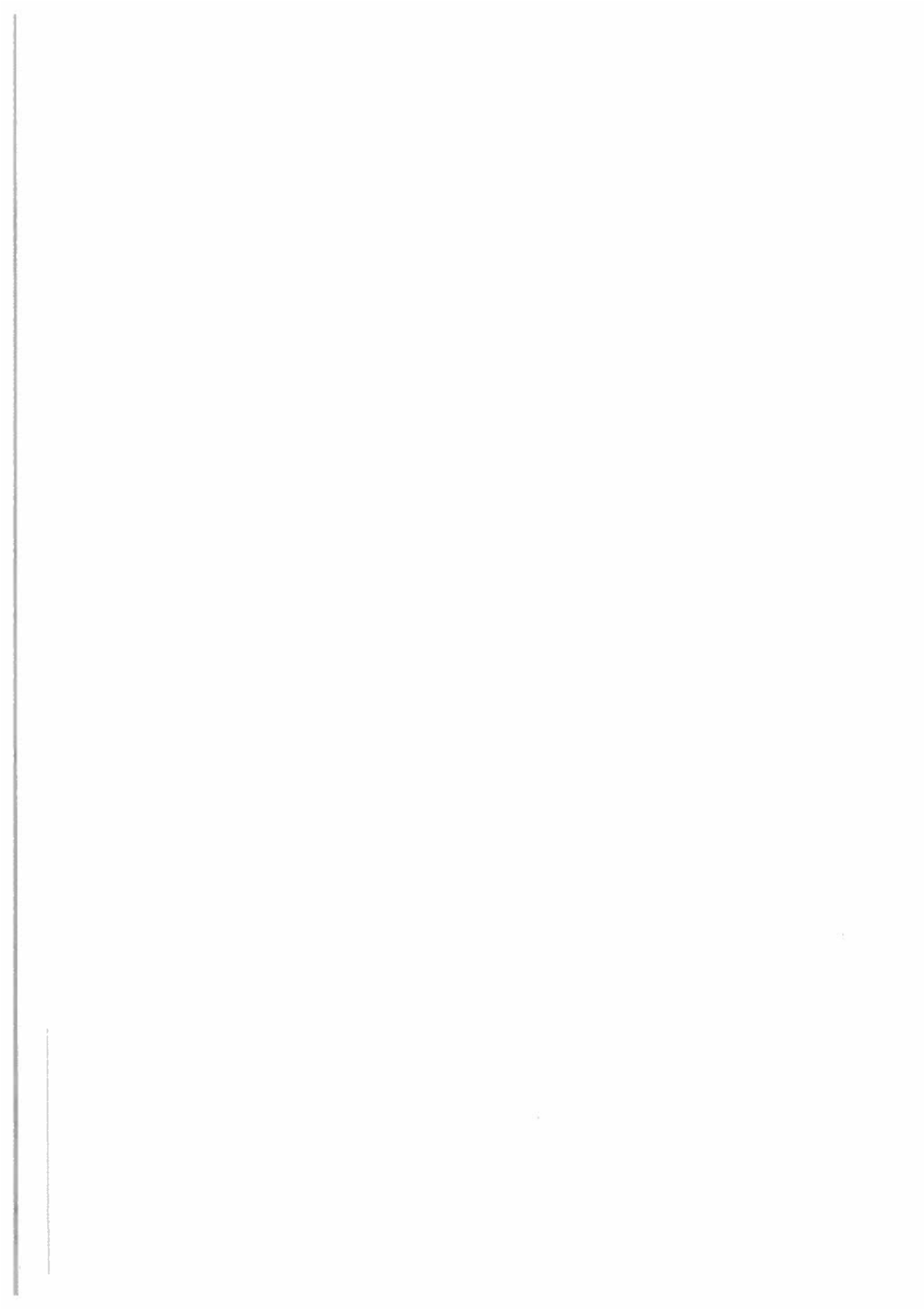
$$\sqrt{\dots 015}$$

Ita förkastas ej då  $|-1.8785| = 1.8785 > 2.78$

Svar: samma som i a)

c) I b)-uppgiften används en parvis design där samma person testar båda sockas klubbor, vilket är ett fördelen då variation från personer elimineras. Det betyder att variationen för den skattade skillnaden mellan medelsteglängderna rednecras i b) jämf med den icke-parvisa designen i a). (När det är pos. korr. mellan mät. som i detta fall)





4.

ta

$$f(y) = \alpha y^{\alpha-1}, \quad 0 < y < 1$$

$$a) \quad L(\alpha) = \prod_{i=1}^n f(y_i | \alpha) = \prod_{i=1}^n \alpha y_i^{\alpha-1} = \alpha^n \left( \prod_{i=1}^n y_i \right)^{\alpha-1}$$

↑  
pga ord

logaritmera: ( $l(\alpha)$  och  $L(\alpha)$  har max på samma ställe)

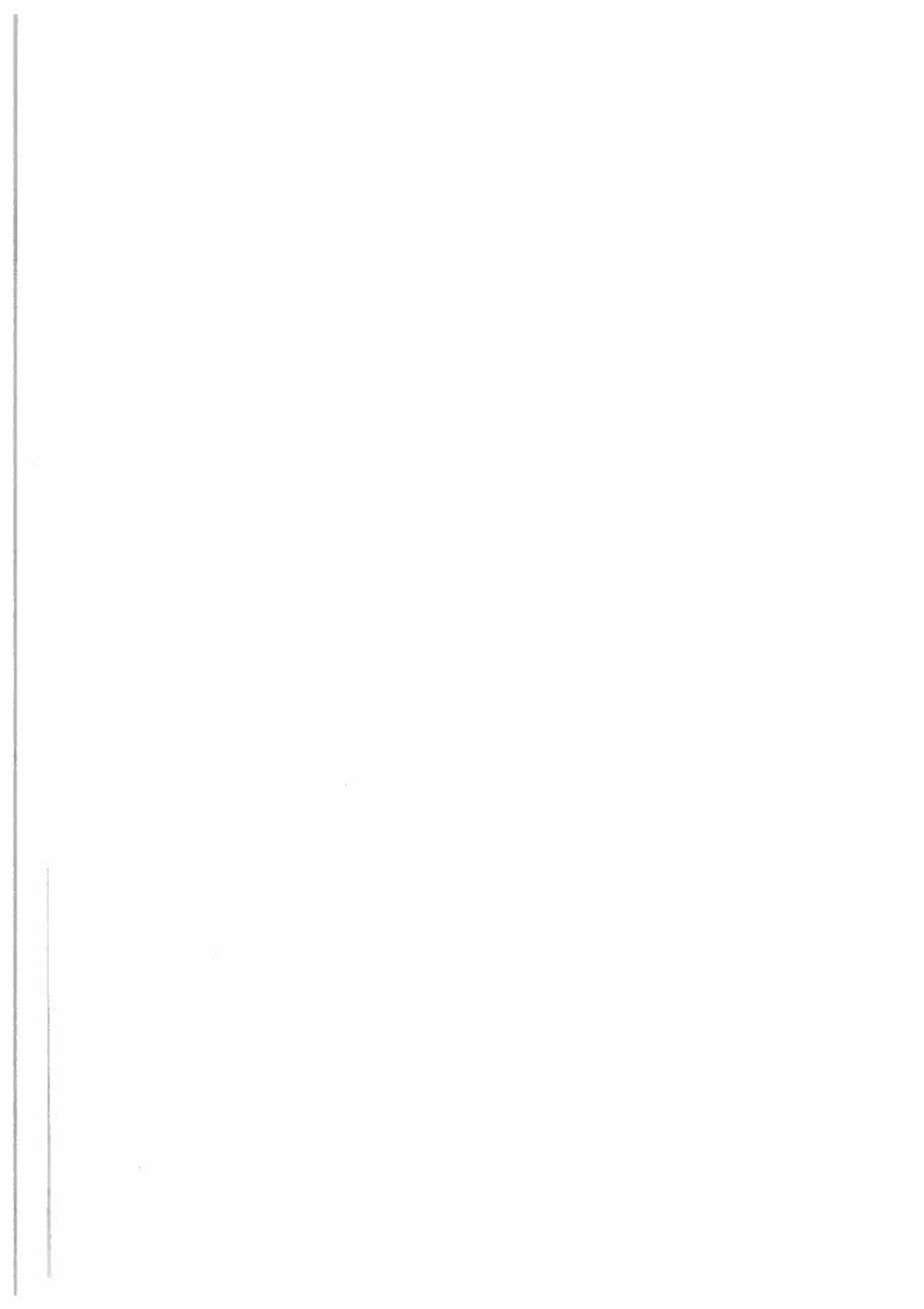
$$l(\alpha) = n \ln(\alpha) + (\alpha-1) \ln\left(\prod_{i=1}^n y_i\right) =$$
$$n \ln(\alpha) + (\alpha-1) \sum_{i=1}^n \ln(y_i)$$

derivera m.a.p  $\alpha$ :

$$\frac{d l(\alpha)}{d \alpha} = \frac{n}{\alpha} + \sum_{i=1}^n \ln(y_i)$$

sätt derivatan lika med noll och lös ut  $\alpha$ :

$$\frac{n}{\alpha} + \sum \ln(y_i) = 0$$



$$\sum \ln(y_i)$$

$$\overline{\ln(y_i)} \quad \text{dvs} \quad \hat{\alpha}_{ML} = - \frac{n}{\sum_{i=1}^n \ln(\bar{Y}_i)}$$

urval blir:

$$\hat{\alpha}_{ML}$$

$$\frac{7}{\ln(0.354) + \ln(0.201) + \dots + \ln(0.581)} \approx \underline{\underline{0.8224}}$$

mer ska uppkallas så första urvals-  
lut sätts lika med första pop.momentet:

$$\mu'_1$$

5

$$\mu'_1 = E(\bar{Y}) = \frac{\alpha}{\alpha+1} \quad \text{dvs}$$

$$\hat{\alpha}_{mom} = \frac{\bar{Y}}{1-\bar{Y}}$$

i detta urval är  $\bar{y} = 0.3757$ :

$$\hat{\alpha}_{mom} \approx \underline{\underline{0.5913}}$$

6p.



uppgift 2

$\bar{Y}$  = "voltmeterens mätning"

$Y \sim \text{Unif}(\theta, \theta+1)$

$Y_1, Y_2, \dots, Y_n$  s.k. av voltmeterens mätningar

$$a) E(\bar{Y}) = E\left(\frac{\sum_{i=1}^n Y_i}{n}\right) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n E(Y_i) =$$

$$/ E(Y) = \frac{\theta + \theta + 1}{2} = \frac{2\theta + 1}{2} = \theta + 0.5 /$$

$$= \frac{1}{n} n (\theta + 0.5) = \theta + 0.5$$

$$) = E(\bar{Y}) - \theta = \theta + 0.5 - \theta = 0.5$$

: Biasen är 0.5

p.

1.5 kommer att vara vår

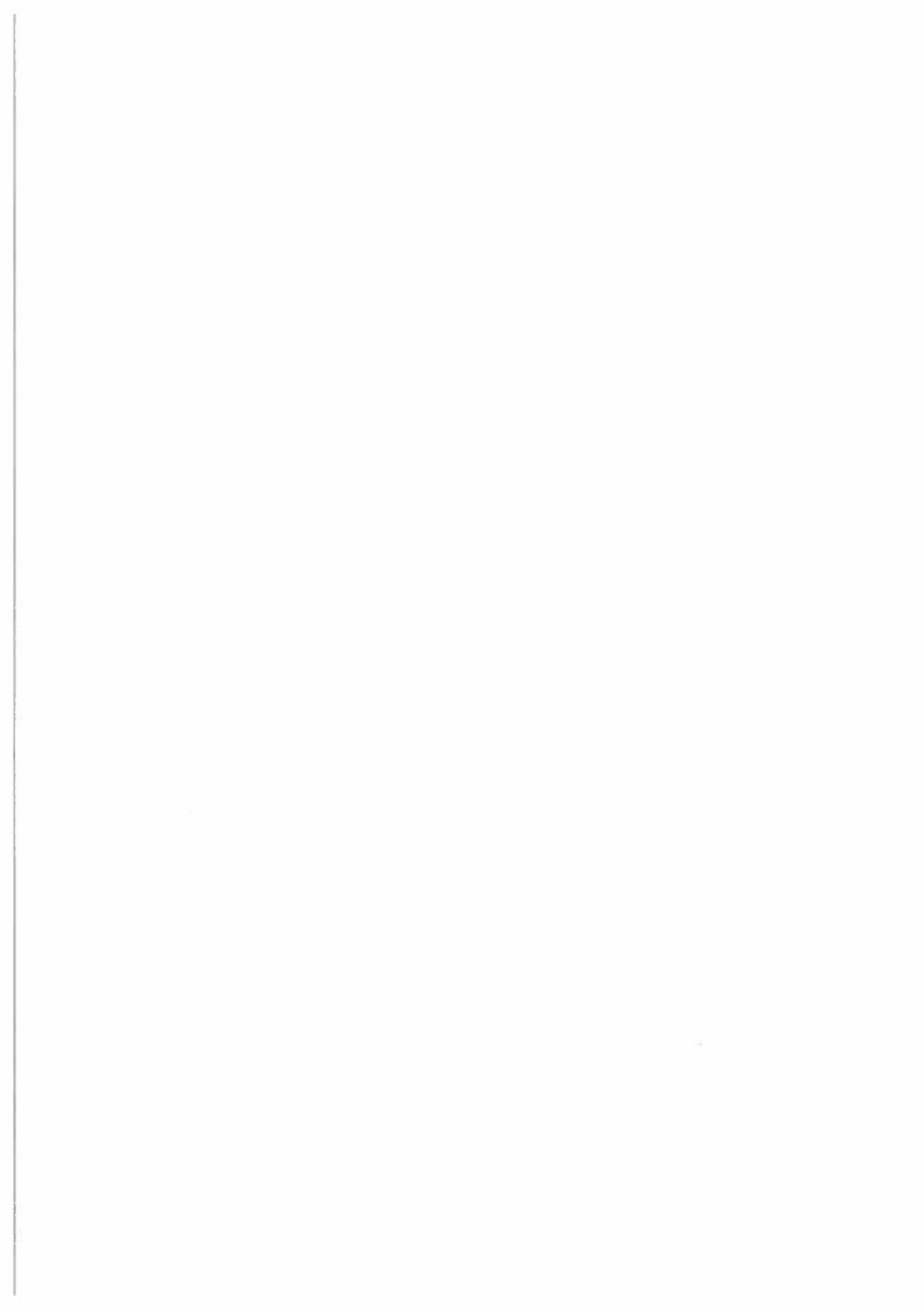
$\hat{\theta}$

$$E(\bar{Y} - 0.5) = E(\bar{Y}) - 0.5 =$$

$$\bar{Y} = \theta$$

165:

$\bar{Y} - 0.5$  är en vgr estimator för  $\theta$  30.



$$) = V(\bar{Y}) + B(\bar{Y})^2$$

$$V\left(\frac{\sum_{i=1}^n Y_i}{n}\right) \underset{\text{pgn obr.}}{=} \frac{1}{n^2} \sum_{i=1}^n V(Y_i) =$$

$$= \frac{(\theta + 1 - \theta)^2}{12} = \frac{1}{12} / =$$

$$\frac{1}{2} = \frac{1}{12n}$$

$$1 \quad \text{Var}(\bar{Y}) = \frac{1}{12n} + 0.5^2 = \frac{1}{12n} + 0.25$$

.25

ip

• konstant um

da  $n \rightarrow \infty$ .

$\bar{y}$

er konstant, ip



