



Stockholms
universitet

Statistiska institutionen

Raul Cano

SKRIVNINGSDATUM: 2016-05-27

Skriftlig tentamen i **Statistikens grunder 2** (6 hp), ingående som moment 3 i kursen **Statistikens grunder, GN, 15 hp**.

Skrivtid: 5 timmar

Hjälpmedel: Miniräknare. Vidhäftade formel- och tabellblad (obs! vidhäftas endast de tabellsidor som behövs för den här tentamen).

Tentamensgenomgång och återlämning: torsdagen den 16 juni, kl. 18.00 i B319.

Därefter kan skrivningarna hämtas på studentexpeditionen, plan 7 i B-huset.

Tentamen består av fem uppgifter som kan ge totalt 100 poäng. För betyget A gäller 90-100 p., för betyget B gäller 80-89 p., för betyget C gäller 70-79 p., för betyget D gäller 60-69 p., för betyget E gäller 50-59 p., för betyget Fx gäller 40-49 p. och för betyget F gäller 0-39 p. För detaljerade betygskriterier se kursbeskrivningen på kurshemsidan.

För full poäng på en uppgift krävs fullständiga och väl motiverade lösningar.

Uppgift 1: (20 poäng)

Aktieanalytiker Daniel på företag BEST har bearbetat en sannolikhetsmodell för företagsaktiers förväntade avkastning och olika tänkbara scenarier för marknadens ränta under nästa år.

Han betraktar företagets avkastning som en normalfördelad stokastisk variabel med μ som förväntat värde och med känd standardavvikelse $\sigma = 1$.

Daniel använder empiriska data, sannolikhetsmodellen och en statistisk programvara för att simulera (skapa) 25 observationer från företagets avkastning som ger ett genomsnittsvärde $\bar{x} = 8\%$.

a). Testa om μ är större än 7,5 %. Genomför hypotesprövningen på signifikansnivå 2,5 % ($\alpha = 0,025$). (10 p.)

Lös inte problemet via ett konfidensintervall, då lösningen ger 0 p.

b). Beräkna testets styrka (the power of the test) ifall μ är lika med 8,5 %. (5 p.)

c). Beräkna p-värdet i samband med ovanstående hypotesprövning. (5 p.)

Uppgift 2: (20 poäng)

På företaget BEST planerar man att införa flexibla arbetstider om det finns de rätta förutsättningarna för att göra det. Aktieanalytiker Daniel undersöker läget om inställningen till flexibla arbetstider hos alla anställda på företaget. Han genomför en statistisk undersökning och intervjuar 50 anställda. Det visar sig att 30 av de tillfrågade var positiva till flexibla arbetstider.

a). Anta att företaget BEST är ett jätte stort företag och testa om andelen personer i företaget som är positiva till flexibla arbetstider är mindre än 0,65. Genomför hypotesprövningen på risknivån 5 % ($\alpha = 0,05$). (10 p.)

Lös inte problemet via ett konfidensintervall, då lösningen ger 0 p.

b). Beräkna testets styrka (the power of the test) ifall andelen personer i företaget som är positiva till flexibla arbetstider är lika med 0,67. (5 p.)

c). Beräkna p-värdet i samband med ovanstående hypotesprövning. (5 p.)

Uppgift 3: (20 poäng)

På företaget BEST vill man undersöka om medelinkomsten per månad bland anställda på företaget är olika för män och kvinnor. Eftersom man inte kan göra en total undersökning p.g.a. sekretess skäl, har man anlitat igen aktieanalytiker Daniel för att göra en stickprovsundersökning. Han intervjuar 3 män och 5 kvinnor och får följande resultat för inkomsten per månad i tusentals kronor:

Män: 28, 30 och 32

Kvinnor: 30, 27, 28, 29 och 26

a). Anta att företaget BEST är ett jätte stort företag och testa om medelinkomsten per månad bland anställda på företaget är olika för män och kvinnor. Genomför hypotesprövningen på risknivån 5 % ($\alpha = 0,05$). Vilken blir din slutsats? (10 p.)

Lös inte problemet via ett konfidensintervall, då lösningen ger 0 p.

b). Ange de antagandena (alltså de statistiska antagandena) som du måste göra för att genomföra ovanstående hypotesprövning. (5 p.)

c). Beräkna p-värdet i samband med ovanstående hypotesprövning. (5 p.)

Uppgift 4: (20 poäng)

Företaget BEST funderar nu att flytta hela verksamheten till Kina. Innan dess vill man undersöka om företagsaktiers avkastning har varit beroende av marknadens ränta under de senaste 10 år.

Aktieanalytiker Daniel är med i bilden igen och han samlar motsvarande uppgifter på 250 olika företagsaktier med följande resultat:

		Avkastning (A)		
		$A \leq 8\%$	$8\% < A < 12\%$	$A \geq 12\%$
Ränta (R)	$R \leq 3\%$	50	60	25
	$3\% < R < 5\%$	20	30	20
	$R \geq 5\%$	10	10	25

a). Ställ upp hypoteser (5 p.) och

b). Testa på signifikansnivå 1 % ($\alpha = 0,01$) om företagsaktiers avkastning har varit beroende av marknadens ränta under de senaste 10 år. Vilken blir din slutsats? (15 p.)

Uppgift 5: (20 poäng)

Nu måste Företaget BEST besluta om företaget flyttar till Kina eller stannar i Sverige. Aktieanalytiker Daniel kommer med följande beslutsmatris (enligt kapitel 19 i kompendiet):

	Goda förutsättningar för företaget	Lagom förutsättningar för företaget	Dåliga förutsättningar för företaget
Sverige	28	15	10
Kina	30	16	14

De vinster man väntar sig att få framgår av beslutsmatrisen ovan.

a). Bestäm med hjälp av maximinkriteriet vilket alternativ Företagsledningen bör välja. (10 p.)

b). Bestäm med hjälp av minimax-regretekriteriet vilket alternativ Företagsledningen bör välja. (10 p.)

FORMLER

VT2013

Räknerregler för väntevärden och varianser (a , b och c är konstanter och X och Y är stokastiska variabler)

$$E(c) = c$$

$$V(c) = 0$$

$$E(X + c) = E(X) + c$$

$$V(X + c) = V(X)$$

$$E(aX) = aE(X)$$

$$V(aX) = a^2V(X)$$

$$E(aX + bY + c) = aE(X) + bE(Y) + c \quad V(aX + bY + c) = a^2V(X) + b^2V(Y) + 2abCov(X, Y)$$

Ändlighetskorrektion: $\frac{N-n}{N-1}$

Stickprovsvarians: $s^2 = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2 = \frac{1}{n-1} (\sum_{i=1}^n x_i^2 - n\bar{x}^2)$

Stickprovskovarians: $s_{xy} = \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y}) = \frac{1}{n-1} (\sum_{i=1}^n x_i y_i - n\bar{x}\bar{y})$

Binomialfördelningen: $f(x) = \binom{n}{x} p^x (1-p)^{n-x} = \frac{n!}{x!(n-x)!} p^x (1-p)^{n-x}$

Poissonfördelningen: $f(x) = \frac{\lambda^x e^{-\lambda}}{x!}$

Diverse konfidensintervall och enkelsidiga testvariabler ($f.g.$ = frihetsgrader):

$$\bar{x} \pm z_{\alpha/2} \frac{\sigma}{\sqrt{n}}$$

$$Z = \frac{\bar{X} - \mu_0}{\sigma/\sqrt{n}} \geq z_{\alpha}$$

$$\bar{x} \pm t_{\alpha/2}^{(f.g.)} \frac{s}{\sqrt{n}}$$

$$T = \frac{\bar{X} - \mu_0}{S/\sqrt{n}} \geq t_{\alpha}^{(f.g.)}$$

$$\bar{x} \pm z_{\alpha/2} \frac{s}{\sqrt{n}}$$

$$Z = \frac{\bar{X} - \mu_0}{S/\sqrt{n}} \geq z_{\alpha}$$

$$\bar{x}_1 - \bar{x}_2 \pm z_{\alpha/2} \sqrt{\frac{\sigma_1^2}{n_1} + \frac{\sigma_2^2}{n_2}}$$

$$Z = \frac{\bar{X}_1 - \bar{X}_2 - 0}{\sqrt{\sigma_1^2/n_1 + \sigma_2^2/n_2}} \geq z_{\alpha}$$

$$\bar{x}_1 - \bar{x}_2 \pm t_{\alpha/2}^{(f.g.)} \cdot s_p \sqrt{\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}}$$

$$T = \frac{\bar{X}_1 - \bar{X}_2 - 0}{S_p \sqrt{1/n_1 + 1/n_2}} \geq t_{\alpha}^{(f.g.)}$$

$$s_p^2 = \frac{(n_1 - 1)s_1^2 + (n_2 - 1)s_2^2}{n_1 + n_2 - 2}$$

$$\bar{x}_1 - \bar{x}_2 \pm z_{\alpha/2} \sqrt{\frac{s_1^2}{n_1} + \frac{s_2^2}{n_2}}$$

$$Z = \frac{\bar{X}_1 - \bar{X}_2 - 0}{\sqrt{S_1^2/n_1 + S_2^2/n_2}} \geq z_{\alpha}$$

Forts. konfidensintervall och enkelsidiga testvariabler (f.g. = frihetsgrader):

$$\bar{d} \pm t_{\alpha/2}^{(f.g.)} \frac{s_d}{\sqrt{n}}$$

$$T = \frac{\bar{D} - 0}{S_D/\sqrt{n}} \geq t_{\alpha}^{(f.g.)}$$

$$\frac{y}{n} \pm z_{\alpha/2} \sqrt{(y/n)(1-y/n)/n}$$

$$Z = \frac{Y/n - \pi_0}{\sqrt{\pi_0(1-\pi_0)/n}} \geq z_{\alpha}$$

$$\hat{p}_1 - \hat{p}_2 \pm z_{\alpha/2} \sqrt{\frac{\hat{p}_1(1-\hat{p}_1)}{n_1} + \frac{\hat{p}_2(1-\hat{p}_2)}{n_2}}$$

$$Z = \frac{Y_1/n_1 - Y_2/n_2 - 0}{\sqrt{\left(\frac{Y_1+Y_2}{n_1+n_2}\right) \left(1 - \frac{Y_1+Y_2}{n_1+n_2}\right) \left(\frac{1}{n_1} + \frac{1}{n_2}\right)}} \geq z_{\alpha}$$

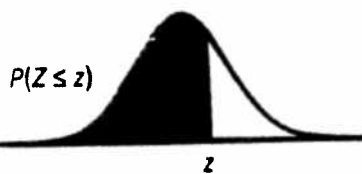
$$\chi^2 = \sum \frac{(n_i - n\pi_i)^2}{n\pi_i} \geq \chi_{\alpha}^2(f.g.)$$

$$\chi^2 = \sum \sum \frac{(n_{ij} - n_i \cdot n_j / n)^2}{n_i \cdot n_j / n} \geq \chi_{\alpha}^2(f.g.)$$

TABELL 1. Normalfördelningen, standardiserad

$\Phi(z) = P(Z \leq z)$ där $Z \in N(0, 1)$.

För negativa värden, utnyttja att $\Phi(-z) = 1 - \Phi(z)$.

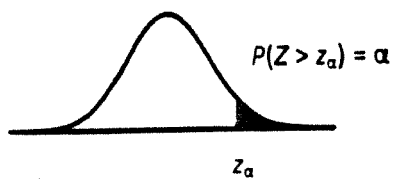


z	0,00	0,01	0,02	0,03	0,04	0,05	0,06	0,07	0,08	0,09
0,0	0,50000	0,50399	0,50798	0,51197	0,51595	0,51994	0,52392	0,52790	0,53188	0,53586
0,1	0,53983	0,54380	0,54776	0,55172	0,55567	0,55962	0,56356	0,56749	0,57142	0,57535
0,2	0,57926	0,58317	0,58706	0,59095	0,59483	0,59871	0,60257	0,60642	0,61026	0,61409
0,3	0,61791	0,62172	0,62552	0,62930	0,63307	0,63683	0,64058	0,64431	0,64803	0,65173
0,4	0,65542	0,65910	0,66276	0,66640	0,67003	0,67364	0,67724	0,68082	0,68439	0,68793
0,5	0,69146	0,69497	0,69847	0,70194	0,70540	0,70884	0,71226	0,71566	0,71904	0,72240
0,6	0,72575	0,72907	0,73237	0,73565	0,73891	0,74215	0,74537	0,74857	0,75175	0,75490
0,7	0,75804	0,76115	0,76424	0,76730	0,77035	0,77337	0,77637	0,77935	0,78230	0,78524
0,8	0,78814	0,79103	0,79389	0,79673	0,79955	0,80234	0,80511	0,80785	0,81057	0,81327
0,9	0,81594	0,81859	0,82121	0,82381	0,82639	0,82894	0,83147	0,83398	0,83646	0,83891
1,0	0,84134	0,84375	0,84614	0,84849	0,85083	0,85314	0,85543	0,85769	0,85993	0,86214
1,1	0,86433	0,86650	0,86864	0,87076	0,87286	0,87493	0,87698	0,87900	0,88100	0,88298
1,2	0,88493	0,88686	0,88877	0,89065	0,89251	0,89435	0,89617	0,89796	0,89973	0,90147
1,3	0,90320	0,90490	0,90658	0,90824	0,90988	0,91149	0,91309	0,91466	0,91621	0,91774
1,4	0,91924	0,92073	0,92220	0,92364	0,92507	0,92647	0,92785	0,92922	0,93056	0,93189
1,5	0,93319	0,93448	0,93574	0,93699	0,93822	0,93943	0,94062	0,94179	0,94295	0,94408
1,6	0,94520	0,94630	0,94738	0,94845	0,94950	0,95053	0,95154	0,95254	0,95352	0,95449
1,7	0,95543	0,95637	0,95728	0,95818	0,95907	0,95994	0,96080	0,96164	0,96246	0,96327
1,8	0,96407	0,96485	0,96562	0,96638	0,96712	0,96784	0,96856	0,96926	0,96995	0,97062
1,9	0,97128	0,97193	0,97257	0,97320	0,97381	0,97441	0,97500	0,97558	0,97615	0,97670
2,0	0,97725	0,97778	0,97831	0,97882	0,97932	0,97982	0,98030	0,98077	0,98124	0,98169
2,1	0,98214	0,98257	0,98300	0,98341	0,98382	0,98422	0,98461	0,98500	0,98537	0,98574
2,2	0,98610	0,98645	0,98679	0,98713	0,98745	0,98778	0,98809	0,98840	0,98870	0,98899
2,3	0,98928	0,98956	0,98983	0,99010	0,99036	0,99061	0,99086	0,99111	0,99134	0,99158
2,4	0,99180	0,99202	0,99224	0,99245	0,99266	0,99286	0,99305	0,99324	0,99343	0,99361
2,5	0,99379	0,99396	0,99413	0,99430	0,99446	0,99461	0,99477	0,99492	0,99506	0,99520
2,6	0,99534	0,99547	0,99560	0,99573	0,99585	0,99598	0,99609	0,99621	0,99632	0,99643
2,7	0,99653	0,99664	0,99674	0,99683	0,99693	0,99702	0,99711	0,99720	0,99728	0,99736
2,8	0,99744	0,99752	0,99760	0,99767	0,99774	0,99781	0,99788	0,99795	0,99801	0,99807
2,9	0,99813	0,99819	0,99825	0,99831	0,99836	0,99841	0,99846	0,99851	0,99856	0,99861
3,0	0,99865	0,99869	0,99874	0,99878	0,99882	0,99886	0,99889	0,99893	0,99896	0,99900
3,1	0,99903	0,99906	0,99910	0,99913	0,99916	0,99918	0,99921	0,99924	0,99926	0,99929
3,2	0,99931	0,99934	0,99936	0,99938	0,99940	0,99942	0,99944	0,99946	0,99948	0,99950
3,3	0,99952	0,99953	0,99955	0,99957	0,99958	0,99960	0,99961	0,99962	0,99964	0,99965
3,4	0,99966	0,99968	0,99969	0,99970	0,99971	0,99972	0,99973	0,99974	0,99975	0,99976
3,5	0,99977	0,99978	0,99978	0,99979	0,99980	0,99981	0,99981	0,99982	0,99983	0,99983
3,6	0,99984	0,99985	0,99985	0,99986	0,99986	0,99987	0,99987	0,99988	0,99988	0,99989
3,7	0,99989	0,99990	0,99990	0,99990	0,99991	0,99991	0,99992	0,99992	0,99992	0,99992
3,8	0,99993	0,99993	0,99993	0,99994	0,99994	0,99994	0,99994	0,99995	0,99995	0,99995
3,9	0,99995	0,99995	0,99996	0,99996	0,99996	0,99996	0,99996	0,99996	0,99997	0,99997
4,0	0,99997	0,99997	0,99997	0,99997	0,99997	0,99997	0,99998	0,99998	0,99998	0,99998

TABELL 2. Normalfördelningens kvantiler, standardiserad

$Z \in N(0, 1)$. Vilket värde har z_α om $P(Z > z_\alpha) = \alpha$ där α är en given sannolikhet.

Utnyttja även $\Phi(-z) = 1 - \Phi(z)$ för $P(Z \leq -z_\alpha)$.

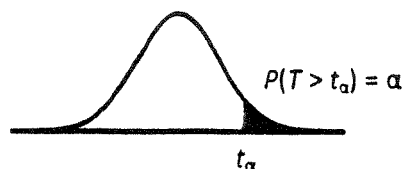


α	z_α
0,1	1,2816
0,05	1,6449
0,025	1,9600
0,010	2,3263
0,005	2,5758
0,0025	2,8070
0,0010	3,0902
0,0005	3,2905
0,00025	3,4808
0,00010	3,7190
0,00005	3,8906
0,000025	4,0556
0,000010	4,2649
0,000005	4,4172

TABELL 3. t -fördelningens kvantiler

$T \in t(v)$ där v = antal frihetsgrader.

Vilket värde har t_α om $P(T > t_\alpha) = \alpha$ där α är en given sannolikhet. Utnyttja även $P(T \leq -t_\alpha) = P(T > t_\alpha)$.



v	$\alpha = 0,1$	0,05	0,025	0,010	0,005	0,0025	0,0010	0,0005
1	3,078	6,314	12,706	31,821	63,657	127,321	318,309	636,619
2	1,886	2,920	4,303	6,965	9,925	14,089	22,327	31,599
3	1,638	2,353	3,182	4,541	5,841	7,453	10,215	12,924
4	1,533	2,132	2,776	3,747	4,604	5,598	7,173	8,610
5	1,476	2,015	2,571	3,365	4,032	4,773	5,893	6,869
6	1,440	1,943	2,447	3,143	3,707	4,317	5,208	5,959
7	1,415	1,895	2,365	2,998	3,499	4,029	4,785	5,408
8	1,397	1,860	2,306	2,896	3,355	3,833	4,501	5,041
9	1,383	1,833	2,262	2,821	3,250	3,690	4,297	4,781
10	1,372	1,812	2,228	2,764	3,169	3,581	4,144	4,587
11	1,363	1,796	2,201	2,718	3,106	3,497	4,025	4,437
12	1,356	1,782	2,179	2,681	3,055	3,428	3,930	4,318
13	1,350	1,771	2,160	2,650	3,012	3,372	3,852	4,221
14	1,345	1,761	2,145	2,624	2,977	3,326	3,787	4,140
15	1,341	1,753	2,131	2,602	2,947	3,286	3,733	4,073
16	1,337	1,746	2,120	2,583	2,921	3,252	3,686	4,015
17	1,333	1,740	2,110	2,567	2,898	3,222	3,646	3,965
18	1,330	1,734	2,101	2,552	2,878	3,197	3,610	3,922
19	1,328	1,729	2,093	2,539	2,861	3,174	3,579	3,883
20	1,325	1,725	2,086	2,528	2,845	3,153	3,552	3,850
21	1,323	1,721	2,080	2,518	2,831	3,135	3,527	3,819
22	1,321	1,717	2,074	2,508	2,819	3,119	3,505	3,792
23	1,319	1,714	2,069	2,500	2,807	3,104	3,485	3,768
24	1,318	1,711	2,064	2,492	2,797	3,091	3,467	3,745
25	1,316	1,708	2,060	2,485	2,787	3,078	3,450	3,725
26	1,315	1,706	2,056	2,479	2,779	3,067	3,435	3,707
27	1,314	1,703	2,052	2,473	2,771	3,057	3,421	3,690
28	1,313	1,701	2,048	2,467	2,763	3,047	3,408	3,674
29	1,311	1,699	2,045	2,462	2,756	3,038	3,396	3,659
30	1,310	1,697	2,042	2,457	2,750	3,030	3,385	3,646
35	1,306	1,690	2,030	2,438	2,724	2,996	3,340	3,591
40	1,303	1,684	2,021	2,423	2,704	2,971	3,307	3,551
45	1,301	1,679	2,014	2,412	2,690	2,952	3,281	3,520
50	1,299	1,676	2,009	2,403	2,678	2,937	3,261	3,496
55	1,297	1,673	2,004	2,396	2,668	2,925	3,245	3,476
60	1,296	1,671	2,000	2,390	2,660	2,915	3,232	3,460
65	1,295	1,669	1,997	2,385	2,654	2,906	3,220	3,447
70	1,294	1,667	1,994	2,381	2,648	2,899	3,211	3,435
75	1,293	1,665	1,992	2,377	2,643	2,892	3,202	3,425

Forts. nästa sida

TABELL 3 forts. t-fördelningens kvantiler

v	$\alpha = 0,1$	0,05	0,025	0,010	0,005	0,0025	0,0010	0,0005
80	1,292	1,664	1,990	2,374	2,639	2,887	3,195	3,416
85	1,292	1,663	1,988	2,371	2,635	2,882	3,189	3,409
90	1,291	1,662	1,987	2,368	2,632	2,878	3,183	3,402
95	1,291	1,661	1,985	2,366	2,629	2,874	3,178	3,396
100	1,290	1,660	1,984	2,364	2,626	2,871	3,174	3,390
125	1,288	1,657	1,979	2,357	2,616	2,858	3,157	3,370
150	1,287	1,655	1,976	2,351	2,609	2,849	3,145	3,357
175	1,286	1,654	1,974	2,348	2,604	2,843	3,137	3,347
200	1,286	1,653	1,972	2,345	2,601	2,839	3,131	3,340
300	1,284	1,650	1,968	2,339	2,592	2,828	3,118	3,323
400	1,284	1,649	1,966	2,336	2,588	2,823	3,111	3,315
500	1,283	1,648	1,965	2,334	2,586	2,820	3,107	3,310
1000	1,282	1,646	1,962	2,330	2,581	2,813	3,098	3,300
2000	1,282	1,646	1,961	2,328	2,578	2,810	3,094	3,295
3000	1,282	1,645	1,961	2,328	2,577	2,809	3,093	3,294
4000	1,282	1,645	1,961	2,327	2,577	2,809	3,092	3,293
5000	1,282	1,645	1,960	2,327	2,577	2,808	3,092	3,292

TABELL 4. χ^2 -fördelningens kvantiler

$Q \in \chi^2(v)$ där v = antal frihetsgrader.

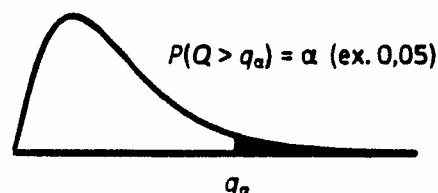
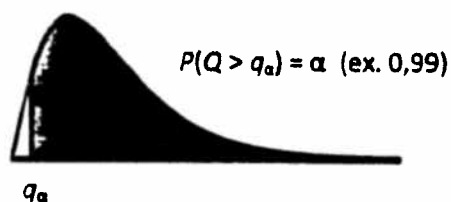
Vilket värde har q_α om $P(Q > q_\alpha) = \alpha$ där α är en sannolikhet.

v	$\alpha = 0,999$	0,995	0,99	0,975	0,95	0,05	0,025	0,01	0,005	0,001
1	0,000	0,000	0,000	0,001	0,004	3,841	5,024	6,635	7,879	10,828
2	0,002	0,010	0,020	0,051	0,103	5,991	7,378	9,210	10,597	13,816
3	0,024	0,072	0,115	0,216	0,352	7,815	9,348	11,345	12,838	16,266
4	0,091	0,207	0,297	0,484	0,711	9,488	11,143	13,277	14,860	18,467
5	0,210	0,412	0,554	0,831	1,145	11,070	12,833	15,086	16,750	20,515
6	0,381	0,676	0,872	1,237	1,635	12,592	14,449	16,812	18,548	22,458
7	0,598	0,989	1,239	1,690	2,167	14,067	16,013	18,475	20,278	24,322
8	0,857	1,344	1,646	2,180	2,733	15,507	17,535	20,090	21,955	26,124
9	1,152	1,735	2,088	2,700	3,325	16,919	19,023	21,666	23,589	27,877
10	1,479	2,156	2,558	3,247	3,940	18,307	20,483	23,209	25,188	29,588
11	1,834	2,603	3,053	3,816	4,575	19,675	21,920	24,725	26,757	31,264
12	2,214	3,074	3,571	4,404	5,226	21,026	23,337	26,217	28,300	32,909
13	2,617	3,565	4,107	5,009	5,892	22,362	24,736	27,688	29,819	34,528
14	3,041	4,075	4,660	5,629	6,571	23,685	26,119	29,141	31,319	36,123
15	3,483	4,601	5,229	6,262	7,261	24,996	27,488	30,578	32,801	37,697
16	3,942	5,142	5,812	6,908	7,962	26,296	28,845	32,000	34,267	39,252
17	4,416	5,697	6,408	7,564	8,672	27,587	30,191	33,409	35,718	40,790
18	4,905	6,265	7,015	8,231	9,390	28,869	31,526	34,805	37,156	42,312
19	5,407	6,844	7,633	8,907	10,117	30,144	32,852	36,191	38,582	43,820
20	5,921	7,434	8,260	9,591	10,851	31,410	34,170	37,566	39,997	45,315
21	6,447	8,034	8,897	10,283	11,591	32,671	35,479	38,932	41,401	46,797
22	6,983	8,643	9,542	10,982	12,338	33,924	36,781	40,289	42,796	48,268
23	7,529	9,260	10,196	11,689	13,091	35,172	38,076	41,638	44,181	49,728
24	8,085	9,886	10,856	12,401	13,848	36,415	39,364	42,980	45,559	51,179
25	8,649	10,520	11,524	13,120	14,611	37,652	40,646	44,314	46,928	52,620
26	9,222	11,160	12,198	13,844	15,379	38,885	41,923	45,642	48,290	54,052
27	9,803	11,808	12,879	14,573	16,151	40,113	43,195	46,963	49,645	55,476
28	10,391	12,461	13,565	15,308	16,928	41,337	44,461	48,278	50,993	56,892
29	10,986	13,121	14,256	16,047	17,708	42,557	45,722	49,588	52,336	58,301
30	11,588	13,787	14,953	16,791	18,493	43,773	46,979	50,892	53,672	59,703
32	12,811	15,134	16,362	18,291	20,072	46,194	49,480	53,486	56,328	62,487
34	14,057	16,501	17,789	19,806	21,664	48,602	51,966	56,061	58,964	65,247
36	15,324	17,887	19,233	21,336	23,269	50,998	54,437	58,619	61,581	67,985
38	16,611	19,289	20,691	22,878	24,884	53,384	56,896	61,162	64,181	70,703
40	17,916	20,707	22,164	24,433	26,509	55,758	59,342	63,691	66,766	73,402
42	19,239	22,138	23,650	25,999	28,144	58,124	61,777	66,206	69,336	76,084
44	20,576	23,584	25,148	27,575	29,787	60,481	64,201	68,710	71,893	78,750
46	21,929	25,041	26,657	29,160	31,439	62,830	66,617	71,201	74,437	81,400
48	23,295	26,511	28,177	30,755	33,098	65,171	69,023	73,683	76,969	84,037
50	24,674	27,991	29,707	32,357	34,764	67,505	71,420	76,154	79,490	86,661

Forts. nästa sida

TABELL 4 forts. χ^2 -fördelningens kvantiler

v	$\alpha = 0,999$	0,995	0,99	0,975	0,95	0,05	0,025	0,01	0,005	0,001
55	28,173	31,735	33,570	36,398	38,958	73,311	77,380	82,292	85,749	93,168
60	31,738	35,534	37,485	40,482	43,188	79,082	83,298	88,379	91,952	99,607
65	35,362	39,383	41,444	44,603	47,450	84,821	89,177	94,422	98,105	105,988
70	39,036	43,275	45,442	48,758	51,739	90,531	95,023	100,425	104,215	112,317
75	42,757	47,206	49,475	52,942	56,054	96,217	100,839	106,393	110,286	118,599
80	46,520	51,172	53,540	57,153	60,391	101,879	106,629	112,329	116,321	124,839
85	50,320	55,170	57,634	61,389	64,749	107,522	112,393	118,236	122,325	131,041
90	54,155	59,196	61,754	65,647	69,126	113,145	118,136	124,116	128,299	137,208
95	58,022	63,250	65,898	69,925	73,520	118,752	123,858	129,973	134,247	143,344
100	61,918	67,328	70,065	74,222	77,929	124,342	129,561	135,807	140,169	149,449
120	77,755	83,852	86,923	91,573	95,705	146,567	152,211	158,950	163,648	173,617
150	102,113	109,142	112,668	117,985	122,692	179,581	185,800	193,208	198,360	209,265
200	143,843	152,241	156,432	162,728	168,279	233,994	241,058	249,445	255,264	267,541
300	229,963	240,663	245,972	253,912	260,878	341,395	349,874	359,906	366,844	381,425
400	318,260	330,903	337,155	346,482	354,641	447,632	457,305	468,724	476,606	493,132
500	407,947	422,303	429,388	439,936	449,147	553,127	563,852	576,493	585,207	603,446



6

Statistiska institutionen



Stockholms
universitet

Rättningsblad

Datum: 27/5-2016

Sal: Värtasalen

Tenta: Statistikens grunder 2

Kurs: Statistikens grunder, kväll

ANONYMKOD:

SGK 0023

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.									
20p	20p	10p	20p	20p					

POÄNG	BETYG	Lärarens sign.
90p	A	RC

1) 20p

1) $X \sim N(\mu, \sigma=1)$ $n=25$ $\bar{x}=8\%$

a) För en normalfördelad stokastisk variabel med känd populationsvarians på signifikansnivå $\alpha=0,025$ använder vi $Z_{\alpha}=1,96$

$H_0: \mu \leq 7,5$

$H_1: \mu > 7,5$

Förkasta H_0 om $Z_{obs} > 1,96$
 $\alpha = 0,025$

$Z_{obs} = \frac{8-7,5}{\sqrt{1/25}} = 2,5$

$Z_{obs} > 1,96$

Vi förkastar H_0 på signifikansnivå $\alpha=0,025$, $Z_{obs} > Z_{krit}$

Vi förkastar hypotesen om att genomsnittsvärdet är mindre än 7,5%

b) Testets styrka = $P(\text{Förkasta } H_0 | H_0 \text{ är falsk})$
 $= 1 - \beta$

Vi förkastar H_0 vid X värde:

$\frac{\bar{x} - 7,5}{\sqrt{1/25}} > 1,96$

$\Rightarrow \bar{x} \geq 7,5 + 1,96 \cdot \frac{1}{\sqrt{25}}$

$\Rightarrow \bar{x} \geq 7,892$ (motsträngighet till standardiserade 1,96)

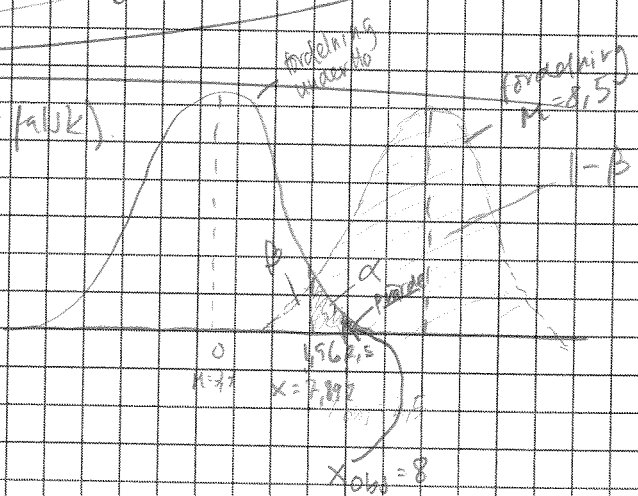
Om $\mu = 8,5$ ges testets styrka av:

$P(\bar{x} \geq 7,892 | \mu = 8,5) = P(Z > \frac{7,892 - 8,5}{1/\sqrt{25}}) = P(Z > -3,04)$
 $= 1 - P(Z \leq -3,04) = 1 - (1 - \Phi(3,04))$
 $= 1 - (1 - 0,99882) = 0,99882$

Testets styrka = 0,99882 (ses i bilden, dvs $1 - \beta$ där $\beta = P(\text{typ I fel})$)

c) $\beta = P(X > X_{obs} | H_0 \text{ är sann})$ ($X_{obs} = 7,5 + 2,5 \cdot \frac{1}{\sqrt{25}} = 8$)

$\beta = P(X > 8) = P(Z > 2,5) = 1 - P(Z \leq 2,5) = 1 - \Phi(2,5) = 1 - 0,99379 = 0,00621$ (ses som markerat i bilden).



$P(\text{acceptera } H_0 | H_0 \text{ är falsk})$

2) 20p

undersökning

- 50 anställda intervjuade, $n=50$
- Antal positiva till flex är $V=30$
- uppskattade andelen positiva är $\hat{p} = 30/50 = 0,6$

Eftersom $n > 30$ och $n\pi_0(1-\pi_0) > 5$ kan vi approximera med normalfördelning och använda z-transformation till standardisering $\sim N(0,1)$

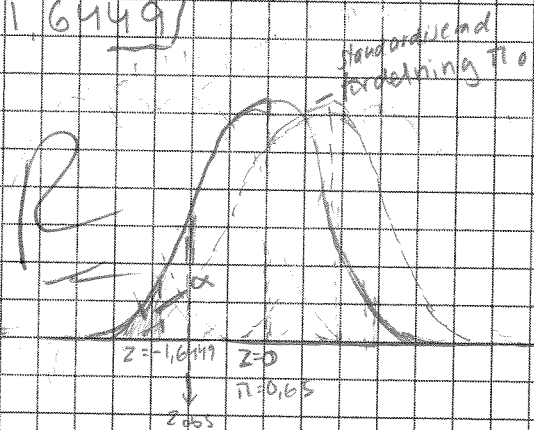
a) $H_0: \pi \equiv 0,65$ $\alpha = 0,05$, ensidigt test
 $H_1: \pi < 0,65$ $Z_\alpha = Z_{0,05} = 1,6449 \rightarrow -Z_{0,05} = -1,6449$

Vi förkastar H_0 om $Z_{obs} < -1,6449$

$$Z_{obs} = \frac{\hat{p} - \pi_0}{\sqrt{\pi_0(1-\pi_0)/n}} = \frac{0,6 - 0,65}{\sqrt{0,65(1-0,65)/50}}$$

$\Rightarrow Z_{obs} = -0,741249$

Vi kan ej förkasta H_0
 $Z_{obs} \geq -1,6449$ ($\alpha = 0,05$)



b) Testets styrka = $1 - \beta = P(\text{förkasta } H_0 \mid H_0 \text{ är falsk})$
 om $\pi = 0,67$ är H_0 falsk. (under H_1 är $\pi_0 = 0,65$)

Vi förkastar H_0 vid:

$$\frac{\hat{p} - 0,65}{\sqrt{\frac{0,65(1-0,65)}{50}}} < -1,6449 \Rightarrow \hat{p}_{crit} = 0,65 + (-1,6449) \sqrt{\frac{0,65(1-0,65)}{50}} \approx 0,539$$

Sannolikheten att förkasta H_0 ($H_0: \pi = 0,65$) om den egentliga populationsandelen är $\pi = 0,67$ ges av:

$$P(\hat{p} < 0,539 \mid \pi = 0,67) = P(Z < \frac{0,539 - 0,67}{\sqrt{\frac{0,67(1-0,67)}{50}}}) = P(Z < -1,96998)$$

$$= \Phi(-1,97) = 1 - \Phi(1,97)$$

$$= 1 - 0,97558 = 0,02442$$

$$c) p = P(Z < -0,741249 | H_0 \text{ sann})$$

$$\Rightarrow \Phi(-0,741249) = 1 - \Phi(0,74) = 1 - 0,77035 = 0,22965$$

3) 10 p

3)

män: $n=3$

Kvinnor: $m=5$

X_m	$(X_m - \bar{X}_m)^2$	$\bar{X}_m = 30$	X_k	$(X_k - \bar{X}_k)^2$	$\bar{X}_k = 28$
28	4	$S_m^2 = \frac{8}{2} = 4$	30	4	$S_k^2 = \frac{10}{4} = 2,5$
30	0		27	1	
32	4		28	0	
$\Sigma 90$	8		29	1	
			26	4	
		$\Sigma 28$	10		

$$S_0^2 = \frac{(3-1)4 + (5-1)2,5}{5+3-2} = 3$$

Jamt oändl populationer

a) Vet inte bakomliggande fördelning och har ett litet urval

$$\Rightarrow t_{\alpha/2, (n+m-2)} \Rightarrow t_{0,025, (6)} = 2,447 \quad \text{R} \quad (\alpha = 0,05)$$

$$H_0: \mu_m - \mu_k = 0$$

$$H_A: \mu_m - \mu_k \neq 0$$

Dubbelsidigt test: forkasta H_0 om $t_{obs} < -2,447$ eller $t_{obs} > 2,447$.

$$t_{obs} = \frac{30 - 28 - 0}{\sqrt{3 \left(\frac{1}{3} + \frac{1}{5} \right)}} = 1,5811 \quad \text{R}$$

Slutsats: $t_{obs} \neq t_{0,025, (6)}$ Kan ej forkasta H_0 på sign. nivå 0,05

(Notering: Kan även göra enkelsidigt test om man startar med hypotesen att kvinnors löner är lägre. Dvs alternativhypotesen blir då: $\mu_m - \mu_k > 0$. $F_{obs}(6) = 1,943$. Detta hypotestest får därmed också som resultat att vi inte kan förkasta H_0 . (test $\neq 1,943$). Jag testade dubbelsidigt pga att ingen sådan missräkning nämndes)

b) För att kunna jämföra medelvärden på 2 populationer (här män och kvinnor i företaget) behöver vi anta att allt annat är lika (eller, det finns inga andra variabler som påverkar medelvärdet på det vi undersöker än just könshuden i den mellan populationen)

SE KURSUTTERÅTTOR

Det vill säga; kvinnor har inte kortare arbetslister än män, lägre posten osv.

Eftersom företaget är jätte stort kan vi anta att fördelningarna är någotända lika

Vänd \rightarrow

c) $p = P(\bar{X}_m - \bar{X}_k > 0,2 | H_0 \text{ sann})$
 $= P(t^* > 1,5811) \approx 0,0875^*$ (approximerat) ($t^* = 1,9$)

* Genom att avläsa tabellen för t-fördelningen hittar vi värdet $t_{(6)} = 1,6915$ mot emellan $\alpha = 0,1$ och $\alpha = 0,05$ (dvs $\alpha = 0,075$).

Vi söker värdet 1,5811. Mellan $\alpha = 0,1$ och $\alpha = 0,075$

finns 1,566 som ger sannolikheten 0,0875 för att ett värde ska vara större än detta.

Sannolikheten för att få ett värde större än 1,5811

(om H_0 är sann) approximeras därför med ungefär 0,0875.

För

4) 20p

4)

		Arkastning			n_{ij}	Förväntade värden $E(n_{ij}) = n_{i.} \cdot n_{.j} / n$			
		0,92	0,7	0,28		A_1	A_2	A_3	
		A_1	A_2	A_3					
R_1	$n_{1.} = 0,54$	50	60	25	135	43,2	54	37,8	
R_2	$n_{2.} = 0,28$	20	30	20	70	22,4	28	19,6	
R_3	$n_{3.} = 0,18$	10	10	25	45	14,4	18	12,6	
		80	100	70	250				

a) H_0 : Företagsaktiers arkastning är ej beroende av marknadsränta (oberoende fördeliger mellan variablerna R och A)

H_1 : Företagsaktiers arkastning är beroende av marknadsränta

b) Teststatistika: $\chi^2_{\alpha}(r)$

$r = (3-1)(3-1) = 4$

$\chi^2_{0,01}(4) = 13,277$

Förkasta H_0 om $\chi^2_{obs} > 13,277$

$\chi^2_{obs} = \sum \frac{(n_{ij} - E(n_{ij}))^2}{E(n_{ij})} \Rightarrow$

$\chi^2_{obs} = \frac{(50-43,2)^2}{43,2} + \frac{(60-54)^2}{54} + \frac{(25-37,8)^2}{37,8} + \frac{(20-22,4)^2}{22,4} + \frac{(30-28)^2}{28} + \frac{(20-19,6)^2}{19,6} + \frac{(10-14,4)^2}{14,4} + \frac{(10-18)^2}{18} + \frac{(25-12,6)^2}{12,6} \approx 23,58$

$\chi^2_{obs} > 13,277$

Förkasta H_0 ($\alpha = 0,01$). Företagsaktiers arkastning har varit beroende av marknadsränta under de senaste 10 åren.

5) 20p

5)

	Goda burs.	Lagom burs.	Dåliga burs.	maximin	minimax-regret
Sverige	28	15	10	10	610
Kina	30	16	14	14	000

a

a) Använder sig Daniel av maximinkriteriet (börta av samman) bör företaget flytta bil Kina (se ovan)

R

b) Använder sig Daniel av minimax-regret kriteriet (beräkna alternativkostnader) bör företaget flytta till Kina (se ovan)

(Total alternativkostnad Menge: 7)
(Total -11- Kina 10)

R

7

Statistiska institutionen



Stockholms
universitet

Rättningsblad

Datum: 27/5-2016

Sal: Värtasalen

Tenta: Statistikens grunder 2

Kurs: Statistikens grunder, kväll

ANONYMKOD:

SG-0025

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. 15p	15p	18p	20p	20p					

POÄNG 88p	BETYG B	Lärarens sign. RC
---------------------	-------------------	-----------------------------

1) 15p

Uppgift 1a

$$\sigma = 1 \quad \bar{x} = 8\% \quad n = 25 \quad \alpha = 2,5\%$$

$$H_0: \mu < 7,5\% \quad H_1: \mu > 7,5\%$$

Beslutregel: förkasta H_0 om $\underline{z_{obs} > z_{\alpha}}$

$$t = \frac{(\bar{x} - \mu_0)}{(\sigma/\sqrt{n})} = \frac{(8 - 7,5)}{(1/\sqrt{25})} = 2,5$$

$$z_{0,025} = 1,96$$

Da $2,5 > 1,96$ förkastas H_0 ($\alpha = 2,5\%$)

$$b) \frac{(\bar{x} - \mu_0)}{\sigma/\sqrt{n}} > 1,96 = \frac{\sigma}{\sqrt{n}} \cdot \frac{\bar{x} - \mu_0}{\sigma/\sqrt{n}} > 1,96 \cdot \frac{\sigma}{\sqrt{n}}$$

$$\bar{x} - \mu_0 + \mu_0 > 1,96 \cdot \frac{\sigma}{\sqrt{n}} + \mu_0$$

$$\bar{x} > 1,96 \cdot \left(\frac{1}{\sqrt{25}}\right) + 7,5 = 7,892$$

$$\text{Power of the test: } \left(\frac{7,892 - 8,5}{(1/\sqrt{25})}\right) = -3,04$$

$$\Rightarrow p(Z > -3,04 | H_0 \text{ sann})$$

$$\Rightarrow 1 - p(Z \leq -3,04) = 1 - \Phi(-3,04) =$$

$$1 - 0,99882 = 0,00118$$

$$c) p\text{-värde: } 1 - \Phi(2,5) = 1 - 0,99379 = 0,00621$$

R

Uppgift 2 a;

1) 15 p

Start stickprov! $n = 50$ $\hat{p} = 30/50 = 0,6$

$$H_0: \mu > 0,65$$

$$H_1: \mu < 0,65$$

$$Z = \frac{(\hat{p} - p_0)}{\sqrt{\frac{p_0(1-p_0)}{n}}}$$

Beslutsregel: förkasta H_0 om $Z_{obs} < -Z_\alpha$

$$Z_{0,05} = 1,6449$$

$$Z = \frac{(0,6 - 0,65)}{\sqrt{\frac{0,65 \cdot (1 - 0,65)}{50}}} = \frac{(-0,05)}{\sqrt{0,00455}} = -0,741249$$

$-0,74 < -1,6449$ H_0 kan ej förkastas
med $\alpha = 5\%$.

$$b) \frac{(\hat{p} - p_0)}{\sqrt{\frac{p_0(1-p_0)}{n}}} > 1,6449 \Rightarrow \frac{\hat{p} - p_0}{\sqrt{\frac{p_0(1-p_0)}{n}}} > 1,6449 \cdot \sqrt{\frac{p_0(1-p_0)}{n}}$$

$$+P_0 \hat{p} - p_0 > 1,6449 \cdot \sqrt{\frac{p_0(1-p_0)}{n}} + p_0$$

$$\hat{p} > 1,6449 \cdot \sqrt{\frac{0,65 \cdot (1 - 0,65)}{50}} + 0,65 = 0,76095$$

$$\text{Power of the test: } \frac{(0,76095 - 0,67)}{\sqrt{\frac{0,67 \cdot (1 - 0,67)}{50}}} = 1,3677$$

$$1 - \Phi(1,36) = 1 - 0,91309 = 0,08691$$

c) P-värde hypotesprövning: $P(Z > 0,74129 / H_0 \text{ sann})$
 $= 1 - P(Z < 0,74129) \Rightarrow 1 - \Phi(0,74129)$
 $= 1 - 0,77035 = 0,22965$

Uppgift 3a:

$$n \text{ kvinnor} = 5 \quad n \text{ män} = 3$$

$$\bar{x} \text{ kvinnor: } (30 + 27 + 28 + 29 + 26) = 28 \leftarrow (\bar{x}_2)$$

$$\bar{x} \text{ män: } (28 + 30 + 32) = 30 \leftarrow (\bar{x}_1)$$

$$\text{Litet stickprov: } T = \frac{\bar{x}_1 - \bar{x}_2 - 0}{s_p \sqrt{(1/n_1) + (1/n_2)}}$$

$$s^2 \text{ kvinnor: } ((30 - 28)^2 + (27 - 28)^2 + (28 - 28)^2 + (29 - 28)^2 + (26 - 28)^2) \cdot \left(\frac{1}{5-1}\right) = 2,5$$

$$s^2 \text{ män: } ((28 - 30)^2 + (30 - 30)^2 + (32 - 30)^2) \cdot \left(\frac{1}{3-1}\right) = 4$$

H_0 : Det är ingen skillnad mellan kvinnor & män

H_1 : Det finns en skillnad

Bestämsregel: förkasta H_0 om $t_{obs} > t_{\alpha}(f.g)$

$$s_p^2 = \left(\frac{(3-1) \cdot 4 + (5-1) \cdot 2,5}{5+3-2} \right) = 3 \quad s = \sqrt{3} = 1,7320$$

$$T = \frac{(30 - 28)}{(1,732 \cdot \sqrt{(1/3) + (1/5)})} = 1,58118$$

$$t_{0,05(5+3-2)} = 1,943$$

F(-2)

Slutsats: Da 1,58 ej är större än 1,943 kan H_0 ej förkastas. Vi kan inte dra några slutsatser om det finns en skillnad mellan kvinnor och män gällande medaljinkomst med $\alpha = 0,05$.

V.G.V

⇒

3b) Jag misste anta att populationen
är normalfördelade och att populations-
varianterna är lika stora.

(1,58)

3c) P-värdet t är approximativt
mellan $\alpha = 0,1$ och $\alpha = 0,05$ → t P (SE PACT)

$$\text{ca } 0,057 \quad (1 - \Phi(1,58)) = 1 - 0,94295 = 0,057$$

4) 20p

Uppgift 1 (a) H_0 : arkastning har inte varit beroende av maskinens ränka de senaste 10 åren.

H_1 : arkastningen har varit beroende de senaste 10 åren

Beskrivregel: förkasta

6)	50 (43,2)	60 (54)	25 (37,8)	135	H_0 om $\chi^2_{obs} > \chi^2_{0,01}(4)$
	20 (22,4)	30 (28)	20 (19,6)	70	
	10 (14,4)	10 (18)	25 (12,6)	45	
	80	100	70	250	

$$\hat{e}_{11} = (n_{i1} \cdot n_{1j}) / n = (135 \cdot 80) / 250 = 43,2$$

$$(135 \cdot 100) / 250 = 54$$

$$f.g = (3-1) \cdot (3-1) = 4$$

$$(135 \cdot 70) / 250 = 37,8$$

$$\chi^2_{0,01}(4) = 13,277$$

$$(70 \cdot 80) / 250 = 22,4$$

$$(70 \cdot 100) / 250 = 28$$

$$(70 \cdot 70) / 250 = 19,6$$

$$(45 \cdot 80) / 250 = 14,4$$

$$(45 \cdot 100) / 250 = 18$$

$$(45 \cdot 70) / 250 = 12,6$$

$$\chi^2 = \left(\frac{50-43,2}{43,2} \right)^2 + \left(\frac{60-54}{54} \right)^2 + \left(\frac{25-37,8}{37,8} \right)^2 + \left(\frac{20-22,4}{22,4} \right)^2$$

$$+ \left(\frac{30-28}{28} \right)^2 + \left(\frac{20-19,6}{19,6} \right)^2 + \left(\frac{10-14,4}{14,4} \right)^2 + \left(\frac{10-18}{18} \right)^2$$

$$+ \left(\frac{25-12,6}{12,6} \right)^2 = 23,5827$$

V.G.V



Bestudregyl; förkastat H_0 om

$$\chi^2_{obs} > \chi^2_{0,01}(4)$$

Da $23,5827 > 13,277$ så förkastas

H_0 . Företagsaktiernas avkastning har varit lägre än den marknadens ränta de senaste 10 åren ($\alpha = 0,01$).

R

5) 20p

Uppgift 5a;	S1	S2	S3	Minsta nyttor
A1	28	15	10	10
A2	30	16	14	14

← Störst av de minsta

Ledningen bör välja A2.

5(b)

	S1	S2	S3
A1	28	15	10
A2	30	16	14
	30	16	14

} Maximal nyttor

	S1	S2	S3	
A1	$30 - 28 = 2$	$16 - 15 = 1$	$14 - 10 = 4$	4
A2	$30 - 30 = 0$	$16 - 16 = 0$	$14 - 14 = 0$	0

Maximal regret

Ledningen bör välja A2.

① a) $X \sim N(\mu, \sigma=1)$ $\bar{x} = 8\%$ $n = 25$ $\sqrt{n} = 5$

$H_0: \mu \leq 7,5\%$ $H_1: \mu > 7,5\%$ $\alpha = 0,025$ $Z_\alpha = 1,96$

FÖRKASTA H_0 OM $Z = \frac{\bar{X} - \mu_0}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}} > Z_\alpha = 1,96$

$Z = \frac{8 - 7,5}{\frac{1}{\sqrt{25}}} = \frac{0,5}{\frac{1}{5}} = 2,5 > 1,96$ H_0 FÖRKASTAS

b) $\frac{\bar{x} - 7,5}{\frac{1}{5}} > 1,96$ $\bar{x} > 7,892$

TESTETS STYRKA = $P(\bar{X} > 7,892 \mid \mu = 8,5) =$

$= P\left(\frac{\bar{X} - 8,5}{\frac{1}{5}} > \frac{7,892 - 8,5}{\frac{1}{5}}\right) = P(Z > -3,04) =$

$= 1 - P(Z \leq -3,04) = 1 - \Phi(-3,04) =$

$= 1 - [1 - \Phi(3,04)] = \Phi(3,04) = 0,99882$

c) p-VÄRDET = $P(Z > 2,5) = 1 - \Phi(2,5) =$

$= 1 - 0,99379 = 0,0621$

$$(2) a) \quad n=50 \quad \hat{p} = \frac{30}{50} = 0,60 \quad \alpha = 0,05 \quad -Z_{\alpha} = -1,6449$$

$$H_0: p \geq 0,65 \quad H_1: p < 0,65 \quad \text{FÖRKASTA } H_0 \text{ OM } Z < -Z_{\alpha}$$

$$Z = \frac{0,60 - 0,65}{\sqrt{\frac{(0,65)(0,35)}{50}}} = -0,741249315$$

EFTERSOM $-0,741249315 \not< -1,6449$ EJ FÖRKASTA H_0

$$b) \quad \frac{\hat{p} - p_0}{\sqrt{\frac{p_0(1-p_0)}{n}}} < -Z_{\alpha} \quad \hat{p} < 0,65 - 1,6449 \cdot \sqrt{\frac{(0,65)(0,35)}{50}}$$

$$\hat{p} < 0,539045429 \approx 0,539$$

$$\text{TESTETS STYRKA} = P(\hat{p} < 0,539 \mid p = 0,67) =$$

$$= P\left(Z < \frac{0,539 - 0,67}{\sqrt{\frac{(0,67)(0,33)}{50}}}\right) = P(Z < -1,969980497) \approx$$

$$\approx P(Z < -1,97) = \Phi(-1,97) = 1 - \Phi(1,97) =$$

$$= 1 - 0,97558 = \underline{0,02442}$$

$$c) \quad p\text{-VÄRDEN} = P(Z \leq -0,741249315) \approx$$

$$\approx P(Z \leq -0,74) = \Phi(-0,74) =$$

$$= 1 - \Phi(0,74) = 1 - 0,77035 =$$

$$= \underline{0,22965}$$

$$\textcircled{3} \quad 28, 30, 32 \quad n_1 = 3 \quad \bar{x}_1 = \frac{90}{3} = 30$$

$$a) \quad 30, 27, 28, 29, 26 \quad n_2 = 5 \quad \bar{x}_2 = \frac{140}{5} = 28$$

$$S_1^2 = \frac{1}{2} [28^2 + 30^2 + 32^2 - 3(30)^2] = \frac{8}{2} = 4$$

$$S_2^2 = \frac{1}{4} [30^2 + 27^2 + 28^2 + 29^2 + 26^2 - 5(28)^2] = \frac{10}{4} = 2,5$$

$$S_p^2 = \frac{(2)(4) + (4)(2,5)}{3 + 5 - 2} = \frac{18}{6} = 3 \quad S_p = \sqrt{3} = 1,7320$$

$$t = \frac{30 - 28}{\sqrt{3} \cdot \sqrt{\frac{1}{3} + \frac{1}{5}}} = \frac{2}{\sqrt{3} \cdot \sqrt{\frac{8}{15}}} = \frac{2}{(1,732050808)(0,73029674)}$$

$$= \frac{2}{1,264911064} = 1,58113883 \approx 1,581$$

$$H_0: \mu_1 = \mu_2 \quad H_1: \mu_1 \neq \mu_2 \quad \alpha = 0,05 \quad \alpha/2 = 0,025$$

FÖRKASTA H_0 OM $t < -t_{\alpha/2, (n_1+n_2-2)}$ ELLER $t > t_{\alpha/2, (n_1+n_2-2)}$

$$t_{\alpha/2, (n_1+n_2-2)} = t_{0,025, (6)} = 2,447$$

EFTERSOM $1,581 < -2,447$ OCH $1,581 < 2,447$

H_0 EJ FÖRKASTAS

b) SE KONSULTERATUR
SE KOMPLEMENT

$$c) \quad p\text{-VÄRDET} = 2 \cdot P(t > 1,581)$$

$P(t > 1,581)$ LIGGER MELLAN 0,1 OCH 0,05

p-VÄRDET LIGGER MELLAN 0,20 OCH 0,10

- 4) a) H_0 : AVKASTNINGEN HAR INTE VÄRIT BERÖENDE AV
 MARKNADENS RÄNTA. MARKNADENS
 H_1 : AVKASTNINGEN HAR VÄRIT BERÖENDE AV RÄNTA.

b)

		A			
R	50	43,2	54	37,8	135
	20	22,4	28	19,6	70
	10	14,4	18	12,6	45
		80	100	70	250

T. EX. $\frac{80 \times 135}{250} = 43,2$

$\chi^2_{0,01}(4) = 13,277$

$\chi^2 = 23,5771 > 13,277$

H_0 FÖRKASTAS

5) a)

		G	L	D	
S	28	15	10	10	
K	30	16	14	14	

14 → VÄLJ KINA

b)

		G	L	D
S	28	15	10	
K	30	16	14	
		30	16	14

		G	L	D
S	2	1	4	
K	0	0	0	

4
 0 → VÄLJ KINA