中級統計学／経済統計 I：復習テスト 10

学籍番号____________________氏名____________________

2021 年 5 月 21 日（甲南）／ 24 日（府大）

注意： すべての質問に解答しなければ提出とは認めない．正答に修正した上で，復習テスト 9〜13 を（左上で）ホチキス止めし，第 2 回中間試験実施日にまとめて提出すること．

1. $U \sim \mathrm{U}[a, b]$ とする．

  (a) $\mathrm{E}(U)$ を求めなさい．

  (b) $\mathrm{E}\left(U^2\right)$ を求めなさい．

  (c) $\mathrm{var}(U)$ を求めなさい．

2. $X \sim \mathrm{N}(1,9)$ とする．標準正規分布表を利用して以下の確率を求めなさい．

(a) $\Pr[X \leq 0]$

(b) $\Pr[1 < X \leq 2]$

(c) $\Pr[X > 3]$

(d) $\Pr[-4 < X \leq 5]$

(e) $\Pr[|X| \geq 6]$

解答例

1. (a)

$$\begin{aligned}
\mathrm{E}(U) &:= \int_{-\infty}^{a} u \cdot 0 \,\mathrm{d}u + \int_{a}^{b} u \cdot \frac{1}{b-a} \,\mathrm{d}u + \int_{b}^{\infty} u \cdot 0 \,\mathrm{d}u \\
&= \frac{1}{b-a} \left[\frac{u^2}{2} \right]_a^b \\
&= \frac{b^2 - a^2}{2(b-a)} \\
&= \frac{a+b}{2}
\end{aligned}$$

(b)

$$\begin{aligned}
\mathrm{E}\left(U^2\right) &:= \int_{-\infty}^{a} u^2 \cdot 0 \,\mathrm{d}u + \int_{a}^{b} u^2 \cdot \frac{1}{b-a} \,\mathrm{d}u + \int_{b}^{\infty} u^2 \cdot 0 \,\mathrm{d}u \\
&= \frac{1}{b-a} \left[\frac{u^3}{3} \right]_a^b \\
&= \frac{b^3 - a^3}{3(b-a)} \\
&= \frac{a^2 + ab + b^2}{3}
\end{aligned}$$

(c)

$$\begin{aligned}
\mathrm{var}(U) &= \mathrm{E}\left(U^2\right) - \mathrm{E}(U)^2 \\
&= \frac{a^2 + ab + b^2}{3} - \left(\frac{a+b}{2} \right)^2 \\
&= \frac{4a^2 + 4ab + 4b^2}{12} - \frac{3a^2 + 6ab + 3b^2}{12} \\
&= \frac{a^2 - 2ab + b^2}{12} \\
&= \frac{(a-b)^2}{12}
\end{aligned}$$

2. $Q(.) := 1 - \Phi(.)$ とする．教科書の標準正規分布表は $Q(.)$ の値を記載している．$\Phi(.)$ や $\Phi(.) - .5$ の値を記載する場合もあるので要注意.

(a)

$$\begin{aligned}
\Pr[X \leq 0] &= \Pr\left[\frac{X-1}{3} \leq \frac{0-1}{3} \right] \\
&= \Phi\left(-\frac{1}{3} \right) \\
&= Q\left(\frac{1}{3} \right) \\
&= .37070
\end{aligned}$$

(b)

$$\Pr[1 < X \leq 2] = \Pr[X \leq 2] - \Pr[X \leq 1]$$

ここで

$$
\begin{aligned}
\Pr[X \leq 2] &= \Pr\left[\frac{X-1}{3} \leq \frac{2-1}{3}\right] \\
&= \Phi\left(\frac{1}{3}\right) \\
&= 1 - Q\left(\frac{1}{3}\right) \\
&= 1 - .37070 \\
&= .62930 \\
\Pr[X \leq 1] &= \Pr\left[\frac{X-1}{3} \leq \frac{1-1}{3}\right] \\
&= \Phi(0) \\
&= .5
\end{aligned}
$$

したがって

$$
\begin{aligned}
\Pr[1 < X \leq 2] &= .62930 - .5 \\
&= .12930
\end{aligned}
$$

(c)

$$
\begin{aligned}
\Pr[X > 3] &= \Pr\left[\frac{X-1}{3} > \frac{3-1}{3}\right] \\
&= Q\left(\frac{2}{3}\right) \\
&= .25143
\end{aligned}
$$

(d)

$$
\Pr[-4 < X \leq 5] = \Pr[X \leq 5] - \Pr[X \leq -4]
$$

ここで

$$
\begin{aligned}
\Pr[X \leq 5] &= \Pr\left[\frac{X-1}{3} \leq \frac{5-1}{3}\right] \\
&= \Phi\left(\frac{4}{3}\right) \\
&= 1 - Q\left(\frac{4}{3}\right) \\
&= 1 - .091759 \\
&= .908241 \\
\Pr[X \leq -4] &= \Pr\left[\frac{X-1}{3} \leq \frac{-4-1}{3}\right] \\
&= \Phi\left(-\frac{5}{3}\right) \\
&= Q\left(\frac{5}{3}\right) \\
&= .047460
\end{aligned}
$$

したがって

$$\begin{aligned}\Pr[-4 < X \leq 5] &= .908241 - .047460 \\ &= .860781\end{aligned}$$

(e)

$$\Pr[|X| \geq 6] = \Pr[X \leq -6] + \Pr[X \geq 6]$$

ここで

$$\begin{aligned}\Pr[X \leq -6] &= \Pr\left[\frac{X-1}{3} \leq \frac{-6-1}{3}\right] \\ &= \Phi\left(-\frac{7}{3}\right) \\ &= Q\left(\frac{7}{3}\right) \\ &= .0099031 \\ \Pr[X \geq 6] &= \Pr\left[\frac{X-1}{3} \geq \frac{6-1}{3}\right] \\ &= Q\left(\frac{5}{3}\right) \\ &= .047460\end{aligned}$$

したがって

$$\begin{aligned}\Pr[|X| \geq 6] &= .0099031 + .047460 \\ &= .0573631\end{aligned}$$