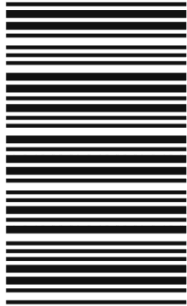


کد کنترل

472

F



472F

## آزمون (نیمه متمرکز) ورود به دوره های دکتری - سال ۱۴۰۲

دفترچه شماره (۱)

صبح پنجشنبه

۱۴۰۱/۱۲/۱۱



جمهوری اسلامی ایران  
وزارت علوم، تحقیقات و فناوری  
سازمان سنجش آموزش کشور

«اگر دانشگاه اصلاح شود مملکت اصلاح می شود.»  
امام خمینی (ره)

آمار (کد ۲۲۳۲)

زمان پاسخ گویی: ۱۳۵ دقیقه

تعداد سؤال: ۴۵

عنوان مواد امتحانی، تعداد و شماره سؤالات

ردیف	مواد امتحانی	تعداد سؤال	از شماره	تا شماره
۱	مجموعه دروس تخصصی: - مبانی آنالیز ریاضی - ریاضی عمومی (۱ و ۲ - احتمال و ۲) - استنباط آماری ۱	۴۵	۱	۴۵

این آزمون نمره منفی دارد.

استفاده از ماشین حساب مجاز نیست.

حق چاپ، تکثیر و انتشار سؤالات به هر روش (الکترونیکی و...) پس از برگزاری آزمون، برای تمامی اشخاص حقیقی و حقوقی تنها با مجوز این سازمان مجاز می باشد و با متخلفین برابر مقررات رفتار می شود.

\* داوطلب گرامی، عدم درج مشخصات و امضا در مندرجات جدول زیر، به منزله عدم حضور شما در جلسه آزمون است.

اینجانب ..... با شماره داوطلبی ..... با آگاهی کامل، یکسان بودن شماره سندلی خود با شماره داوطلبی مندرج در بالای کارت ورود به جلسه، بالای پاسخنامه و دفترچه سؤالات، نوع و کد کنترل درج شده بر روی جلد دفترچه سؤالات و پایین پاسخنامه ام را تأیید می‌نمایم.

امضا:

مجموعه دروس تخصصی: مبانی آنالیز ریاضی - ریاضی عمومی ۲ - احتمال ۱ و ۲ - استنباط آماری ۱:

۱- هرگاه  $x$  عدد حقیقی بر بازه  $[0, 1]$  باشد، کدام مورد برای عبارت  $\lim_{m \rightarrow \infty} \lim_{n \rightarrow \infty} \cos^{2n}(m! \pi x)$  درست است؟

(۱) برای هر  $x$  موجود و برابر صفر است.

(۲) در تمام نقاط گویا ۱ و در نقاط گنگ صفر است.

(۳) در تمام نقاط گویا ۱ و در نقاط گنگ حد موجود نیست.

(۴) در نقاط گنگ صفر و در نقاط گویا حد موجود نیست.

۲- فرض کنید تابع  $f: (0, \infty) \rightarrow \mathbb{R}$  در  $x=1$  پیوسته و در شرط  $f(xy) = f(x) + f(y)$  به ازای هر  $x, y > 0$  صادق باشد.  $f'(1)$  برای هر  $x > 0$ ، کدام است؟

(۱)  $x + f'(x)$

(۲)  $\frac{f'(x)}{x}$

(۳)  $x f'(x)$

(۴)  $f'(x)$  به ازای هر  $x \in \mathbb{N}$

۳- اگر  $f$  پیوسته و  $\lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(x) - f(x-h)}{h} = L$  و  $\lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(x+h) - f(x-h)}{2h} = M$ ، کدام مورد درست است؟

(۱)  $M$  و  $L$  مشتق تابع  $f$  را تضمین نمی‌کنند.

(۲)  $M$  و  $L$  مشتق تابع  $f$  را تضمین می‌کنند.

(۳)  $L$  مشتق تابع  $f$  را تضمین نمی‌کند و  $M = f'(x)$

(۴)  $L = f'(x)$  و  $M$  مشتق تابع  $f$  را تضمین نمی‌کند.

۴- فرض کنید  $x > 0$ ؛  $\Gamma(x) = \int_0^{\infty} e^{-t} t^{x-1} dt$  و  $\psi(x) = \frac{d}{dx}(\ln \Gamma(x))$ . حاصل عبارت

$\Delta \psi(x) = \psi(x+1) - \psi(x)$ ، کدام است؟

(۱)  $\frac{1}{x}$

(۲)  $\frac{1}{x-1}$

(۳)  $\frac{1}{x+1}$

(۴)  $\frac{1}{x^2}$

۵- مقدار  $\lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{\ln\left(\cos\left(\frac{1}{n}\right)\right)}{\sinh\left(\frac{1}{n}\right)}$  ، کدام است؟

(۱) صفر

(۲)  $\ln(2)$

(۳) ۱

(۴)  $+\infty$

۶- کدام مورد برای  $f(x, y) = \begin{cases} 1 & x > 0 \\ 0 & \text{o.w} \end{cases}$  درست است؟

(۱) تابع  $f$  در  $(0, 0)$  دیفرانسیل پذیر است.

(۲)  $\frac{\partial f}{\partial x}(0, 0)$  و  $\frac{\partial f}{\partial y}(0, 0)$  موجود نیستند.

(۳)  $\frac{\partial f}{\partial x}(0, 0)$  موجود است ولی  $\frac{\partial f}{\partial y}(0, 0)$  موجود نیست.

(۴)  $\frac{\partial f}{\partial x}(0, 0)$  موجود است ولی  $\frac{\partial f}{\partial y}(0, 0)$  موجود نیست.

۷- فرض کنید  $u = f(r, s, t)$  ،  $t = z - x$  ،  $s = y - z$  و  $r = x - y$  . کدام مورد درست است؟

(۱)  $\frac{\partial u}{\partial x} + \frac{\partial u}{\partial y} + \frac{\partial u}{\partial z} = 0$

(۲)  $-\frac{\partial u}{\partial x} + \frac{\partial u}{\partial y} + \frac{\partial u}{\partial z} = 0$

(۳)  $\frac{\partial u}{\partial x} - \frac{\partial u}{\partial y} + \frac{\partial u}{\partial z} = 0$

(۴)  $\frac{\partial u}{\partial x} + \frac{\partial u}{\partial y} - \frac{\partial u}{\partial z} = 0$

۸- مقدار  $\int_0^{\infty} \sqrt{x} e^{-x^3} dx$  ، کدام است؟

(۱)  $\frac{\pi}{2}$

(۲)  $\frac{\pi}{3}$

(۳)  $\frac{\sqrt{\pi}}{2}$

(۴)  $\frac{\sqrt{\pi}}{3}$

۹- مقدار متوسط تابع  $f(x, y) = e^{-(x^2+y^2)}$  بر طوق  $a \leq \sqrt{x^2+y^2} \leq b$ ،  $a > 0$ ، کدام است؟

(۱)  $\frac{e^{-a^2} - e^{-b^2}}{\pi(b^2 - a^2)}$

(۲)  $\frac{e^{-a^2} - e^{-b^2}}{b^2 - a^2}$

(۳)  $\frac{e^{-(b^2+a^2)}}{b^2 - a^2}$

(۴)  $\frac{e^{-(b^2+a^2)}}{\pi(b^2 - a^2)}$

۱۰- با توجه به اتحاد  $(|x| < 1)$ ،  $\sum_{n=0}^{\infty} x^n = \frac{1}{1-x}$ ،  $\sum_{n=1}^{\infty} \frac{n}{r^{n-1}}$  همگرا به کدام عدد است؟

(۱) ۲

(۲) ۳

(۳)  $\frac{7}{2}$

(۴) ۴

۱۱- جعبه‌ای شامل ۴ مهره قرمز و ۴ مهره سفید است. از این جعبه ۵ مهره به تصادف و با جایگذاری انتخاب می‌شود. احتمال اینکه حداقل یک مهره قرمز و حداقل یک مهره سفید انتخاب شده باشد، کدام است؟

(۱)  $\frac{1}{16}$  (۲)  $\frac{15}{16}$  (۳)  $\frac{1}{32}$  (۴)  $\frac{31}{32}$

۱۲- از بین ۱۰۰۰ کارت شماره‌گذاری شده از ۱ تا ۱۰۰۰ یک کارت به تصادف انتخاب می‌شود. احتمال اینکه بر ۸ بخش پذیر نباشد، چقدر است؟

(۱)  $\frac{7}{8}$  (۲)  $\frac{1}{8}$  (۳)  $\frac{7}{8}$  (۴)  $\frac{1}{8}$

۱۳- فرض کنید  $\{A_n, n \geq 1\}$  دنباله‌ای از پیشامدهای مستقل تصادفی باشد، به طوری که

$P(A_1) = \frac{1}{4}$  و  $P(A_{n+1}) = \frac{1}{4}P(A_n)$ ،  $(n \geq 1)$  مقدار  $\sum_{n=1}^{+\infty} P(A_n \cup A_{n+1})$ ، کدام است؟

(۱)  $\frac{11}{24}$  (۲)  $\frac{15}{24}$  (۳)  $\frac{17}{24}$  (۴)  $\frac{7}{12}$

۱۴- روی دایره‌ای به مرکز  $(0, 0)$  و شعاع ۱، دایره‌ای به مرکز  $(0, 0)$  و شعاع  $X$  رسم می‌کنیم که در آن  $X \sim U(0, 1)$ . در این صورت دایره به شعاع ۱ به دو قسمت تقسیم می‌شود. اگر  $Y$  مساحت قسمت بزرگ‌تر باشد، مقدار

$P(Y \leq \frac{2\pi}{3})$ ، کدام است؟

(۱)  $\frac{\sqrt{6}}{3}$  (۲)  $\frac{\sqrt{2}-1}{3}$  (۳)  $\frac{\sqrt{2}}{3}$  (۴)  $\frac{\sqrt{6}-\sqrt{3}}{3}$

۱۵- فرض کنید  $X$  یک متغیر تصادفی با تابع مولد احتمال زیر باشد، مقدار  $P(X=2)$ ، کدام است؟

$$\phi(z) = \frac{1}{6}(1+z+z^2)(1+z)$$

(۲)  $\frac{1}{3}$

(۱)  $\frac{1}{6}$

(۴)  $\frac{1}{4}$

(۳)  $\frac{1}{2}$

۱۶- فرض کنید  $X$  یک متغیر تصادفی نامنفی و  $E(X^n) = \frac{2^n}{n+1}$ ،  $n \geq 1$  باشد. مقدار  $P(-\ln(X) + 2\ln(2) > 5)$ ، کدام است؟

(۲)  $1 - e^{-5}$

(۱)  $2e^{-5}$

(۴)  $1 - 2e^{-5}$

(۳)  $e^{-5}$

۱۷- اگر  $X_1$  و  $X_2$  یک نمونه تصادفی دوتایی از توزیع  $U(0,1)$  باشد و  $Y = \begin{cases} X_2 & X_1 < X_2 \\ 2X_1 & X_1 > X_2 \end{cases}$ ، مقدار  $E(Y)$ ، کدام است؟

(۲)  $\frac{3}{2}$

(۱) ۱

(۴)  $\frac{5}{2}$

(۳) ۲

۱۸- فرض کنید  $X$  یک متغیر تصادفی از توزیع  $N(0,1)$  باشد. همچنین فرض کنید متغیر تصادفی  $Z$  مستقل از  $X$  با تابع

احتمال  $P(Z=0) = P(Z=1) = \frac{1}{2}$  باشد. اگر متغیر تصادفی  $Y$  به صورت زیر تعریف شود، کدام مورد درست است؟

$$Y = \begin{cases} X & Z=1 \\ -X & Z=0 \end{cases}$$

(۲)  $\text{Corr}(Z, Y) = 1$

(۱)  $\text{Var}(Y+Z) = 2$

(۴) توزیع  $Y$  نرمال با میانگین ۰ و واریانس ۱

(۳)  $\text{Corr}(X, Y) = 1$

۱۹- اگر  $X, Y, Z$  متغیرهای تصادفی مستقل با توزیع یکنواخت روی بازه  $(0, 2)$  باشند، مقدار  $P(X \geq YZ)$ ، کدام است؟

(۲)  $\frac{1}{4}$

(۱)  $\frac{1}{8}$

(۴)  $\frac{3}{8}$

(۳)  $\frac{1}{2}$

۲۰- فرض کنید  $(X, Y)$  دارای توزیع یکنواخت روی ناحیه زیر باشد. مقدار  $E(X|Y=0.2)$ ، کدام است؟

$$\mathbb{R} = \{(x, y) : x > 0, x + |y| < 1\}$$

(۲)  $0.2$

(۱) صفر

(۴)  $0.64$

(۳)  $0.4$

۲۱- با فرض  $E(Y|X) = 1$ ، کدام مورد درست است؟

(۲)  $\text{Var}(XY) = \text{Var}(X)$

(۱)  $\text{Var}(XY) > \text{Var}(X)$

(۴)  $\text{Var}(XY) = \text{Var}(X)\text{Var}(Y)$

(۳)  $\text{Var}(XY) \leq \text{Var}(X)$

۲۲- فرض کنید  $X_1, X_2, X_3$  یک نمونه تصادفی از توزیعی با تابع احتمال زیر باشد. تابع مولد گشتاور  $W = X_1^3 X_2^2 X_3$ ، کدام است؟

$$P(X = x) = \begin{cases} \frac{1}{3} & x = 0 \\ \frac{2}{3} & x = 1 \\ 0 & \text{سایر جاها} \end{cases}$$

$$\frac{1}{27} + \frac{8}{27} e^{3t} \quad (2)$$

$$\frac{1}{3} + \frac{2}{3} e^{3t} \quad (1)$$

$$\frac{19}{27} + \frac{8}{27} e^t \quad (4)$$

$$\left( \frac{1}{3} + \frac{2}{3} e^t \right)^3 \quad (3)$$

۲۳- فرض کنید  $N \sim \text{Bin}(10, 1 - e^{-2})$  و  $X_i$  ها، متغیرهای تصادفی مستقل و هم توزیع و مستقل از  $N$  با تابع احتمال زیر باشند. مقدار  $P\left(\sum_{i=1}^N X_i = 0\right)$ ، کدام است؟

$$P(X_1 = 2) = p, \quad P(X_1 = 0) = q \quad (p + q = 1)$$

$$(e^{-2} - qe^{-2})^{10} \quad (2)$$

$$(q + pe^{-2})^{10} \quad (1)$$

$$(e^{-2} - pe^{-2})^{10} \quad (4)$$

$$(p + e^{-2}q)^{10} \quad (3)$$

۲۴- فرض کنید  $X_1, \dots, X_n$  یک نمونه تصادفی از توزیع نرمال استاندارد باشد. با فرض  $Y_n = \sum_{i=1}^n X_i^2$ ، توزیع حدی  $Z_n = \sqrt{\frac{n}{2}} \left( \frac{1}{n} Y_n - 1 \right)$ ، کدام است؟

(۲) نرمال استاندارد

(۱) نمایی با میانگین ۱

(۴) تباهیده در نقطه صفر

(۳) کای دو با ۱ درجه آزادی

۲۵- فرض کنید  $X_1, X_2, \dots$  دنباله‌ای از متغیرهای تصادفی مستقل و با توزیع یکسان نمایی با میانگین  $\frac{1}{\theta}$  باشند و برای هر  $n \in \mathbb{N}$  تعریف کنید  $Y_n = \min\{k \geq 1 : X_k > n\}$ . مقدار  $\lim_{n \rightarrow \infty} P(Y_n \leq E(Y_n))$ ، کدام است؟

$$1 - e^{-1} \quad (4)$$

$$e^{-2} \quad (3)$$

$$1 - e^{-2} \quad (2)$$

$$e^{-1} \quad (1)$$

۲۶- فرض کنید  $Y_1, \dots, Y_n$  یک نمونه تصادفی از توزیع یکنواخت در بازه  $(0, \theta)$ ،  $\theta > 1$  باشد. اگر مشاهدات ما به صورت زیر باشد،

$$X_i = \begin{cases} Y_i & Y_i \geq 1 \\ 1 & Y_i < 1 \end{cases} \quad i = 1, \dots, n$$

برآوردگر گشتاوری (MME) پارامتر  $\theta$  بر حسب  $X_i$  ها، کدام است؟

$$\bar{X} + \sqrt{\bar{X}^2 - 1} \quad (2)$$

$$\frac{1}{2}(\bar{X} + \sqrt{\bar{X}^2 - 1}) \quad (1)$$

$$\bar{X} - \sqrt{\bar{X}^2 - 1} \quad (4)$$

$$\frac{1}{2}(\bar{X} - \sqrt{\bar{X}^2 - 1}) \quad (3)$$

۲۷- فرض کنید  $X$  یک مشاهده از توزیعی با یکی از تابع چگالی احتمال‌های زیر باشد.

$$f(x|\theta=2) = \begin{cases} \frac{1}{4}|x|, & |x| < 2 \\ 0 & \text{سایر جاها} \end{cases} \quad \text{و} \quad f(x|\theta=5) = \begin{cases} \frac{3}{16}x^2, & |x| < 2 \\ 0 & \text{سایر جاها} \end{cases}$$

برآوردگر ماکزیمم درست‌نمایی (MLE)  $\theta$ ، کدام است؟

$$\hat{\theta} = \begin{cases} 2 & |X| < \frac{3}{4} \\ 5 & |X| > \frac{3}{4} \end{cases} \quad (2) \quad \hat{\theta} = \begin{cases} 2 & |X| < \frac{4}{3} \\ 5 & |X| > \frac{4}{3} \end{cases} \quad (1)$$

$$\hat{\theta} = \begin{cases} 2 & |X| > \frac{3}{4} \\ 5 & |X| < \frac{3}{4} \end{cases} \quad (4) \quad \hat{\theta} = \begin{cases} 2 & |X| > \frac{4}{3} \\ 5 & |X| < \frac{4}{3} \end{cases} \quad (3)$$

۲۸- فرض کنید  $X$  یک مشاهده از توزیعی با تابع چگالی احتمال زیر باشد.

$$f_{\theta}(x) = \theta e^{-x} + 2(1-\theta) e^{-2x}, \quad x > 0, \quad 0 < \theta < 1$$

برآورد  $\theta$  به روش ماکزیمم درست‌نمایی (MLE)، کدام است؟

$$\hat{\theta} = \begin{cases} 1 & x \geq 2 \\ 0 & x < 2 \end{cases} \quad (2) \quad \hat{\theta} = \begin{cases} 1 & x \leq 2 \\ 0 & x > 2 \end{cases} \quad (1)$$

$$\hat{\theta} = \begin{cases} 1 & x \geq \ln 2 \\ 0 & x < \ln 2 \end{cases} \quad (4) \quad \hat{\theta} = \begin{cases} 1 & x \leq \ln 2 \\ 0 & x > \ln 2 \end{cases} \quad (3)$$

۲۹- فرض کنید  $X_1, \dots, X_n$  یک نمونه تصادفی از توزیع  $N(\mu, 1)$  باشد. اگر  $i = 1, \dots, n$ ،  $Y_i = \begin{cases} 1 & X_i < 0 \\ 0 & X_i \geq 0 \end{cases}$  و  $\Phi$  نمایانگر تابع توزیع نرمال استاندارد باشد، برآوردگر ماکزیمم درست‌نمایی  $\mu$  بر پایه  $Y_i$  ها، کدام است؟

$$-\Phi^{-1}(2\bar{Y}) \quad (2) \quad -\Phi^{-1}(\bar{Y}) \quad (1)$$

$$\Phi^{-1}(\bar{Y}) \quad (4) \quad \Phi^{-1}(2\bar{Y}) \quad (3)$$

۳۰- فرض کنید  $X_1, \dots, X_n$  متغیرهای تصادفی مستقل با تابع چگالی احتمالی زیر باشند.

$$f_{X_i}(x|\theta) = \begin{cases} e^{x+i\theta} & x+i\theta < 0 \\ 0 & \text{سایر جاها} \end{cases}$$

کدام مورد، برای  $\theta$  آماره بسنده نیست؟

$$\min\left(-\frac{X_i}{i}\right) \quad (2) \quad \max\left(\frac{X_i}{i}\right) \quad (1)$$

$$\left(\frac{X_1}{1}, \frac{X_2}{2}, \dots, \frac{X_n}{n}\right) \quad (4) \quad \max\left(-\frac{X_i}{i}\right) \quad (3)$$

۳۱- فرض کنید  $P_i = \{f_\theta : \theta \in \Theta_i\}$  که در آن  $f_\theta$  تابع چگالی احتمال و  $\Theta$  فضای پارامتر است. اگر  $T$  یک آماره و  $\Theta_1 \subset \Theta_2$  باشند، کدام مورد درست است؟

- (۱) اگر  $T$  در  $P_1$  بسنده باشد آنگاه در  $P_2$  نیز بسنده است.
  - (۲) اگر  $T$  در  $P_2$  بسنده کامل باشد آنگاه در  $P_1$  نیز بسنده کامل است.
  - (۳) اگر خانواده چگالی احتمال در  $P_1$  کامل کراندار باشد، آنگاه کامل است.
  - (۴) اگر  $T$  در  $P_1$  بسنده مینیمال و در  $P_2$  نیز بسنده باشد آنگاه در  $P_2$  نیز بسنده مینیمال است.
- ۳۲- فرض کنید  $X$  دارای توزیعی با تابع احتمال زیر باشد. کدام مورد، درست است؟

$$f_\theta(x) = \begin{cases} \frac{1}{2} \binom{n}{|x|} \theta^{|x|} (1-\theta)^{n-|x|} & x = \pm 1, \pm 2, \dots, \pm n \\ (1-\theta)^n & x = 0 \end{cases} \quad 0 < \theta < 1$$

- (۱) خانواده توزیع‌های  $\{f_\theta(x) : \theta \in (0, 1)\}$  کامل است.
  - (۲) خانواده توزیع‌های  $\{f_\theta(x) : \theta \in (0, 1)\}$  کامل نیست.
  - (۳) خانواده توزیع‌های  $\{f_\theta(x) : \theta \in (0, 1)\}$  بسنده کامل است.
  - (۴) خانواده توزیع‌های  $\{f_\theta(x) : \theta \in (0, 1)\}$  بسنده مینیمال است.
- ۳۳- فرض کنید  $X_1, \dots, X_n$  یک نمونه تصادفی از توزیعی با تابع چگالی احتمال زیر باشد.

$$f_\theta(x) = \theta \left( \frac{1}{x+1} \right)^{\theta+1} \quad x > 0, \theta > 0$$

برآوردگر نأربب با کمترین واریانس (UMVUE) پارامتر  $\theta$ ، کدام است؟

$$\begin{aligned} & \prod_{i=1}^n \frac{1}{X_i + 1} \quad (۲) & \frac{n}{\sum_{i=1}^n \ln(X_i + 1)} \quad (۱) \\ & -\ln \left( \prod_{i=1}^n \frac{1}{X_i + 1} \right) \quad (۴) & \frac{n-1}{\sum_{i=1}^n \ln(X_i + 1)} \quad (۳) \end{aligned}$$

۳۴- فرض کنید  $X_1, X_2, \dots, X_n$  یک نمونه تصادفی از توزیع پواسن با پارامتر  $\lambda$  باشد، UMVUE پارامتر  $e^{a\lambda}$ ، کدام است؟ ( $a > 0$  معلوم است).

$$\begin{aligned} & \left( \frac{a}{a+n} \right)^{\sum X_i} \quad (۲) & \left( \frac{a+n}{n} \right)^{\sum X_i} \quad (۱) \\ & \left( \frac{a+n}{a} \right)^{\sum X_i} \quad (۴) & \left( \frac{n}{a+n} \right)^{\sum X_i} \quad (۳) \end{aligned}$$



۳۵- فرض کنید  $X_1, \dots, X_n$  یک نمونه تصادفی از توزیعی با تابع چگالی احتمال زیر باشد.

$$f_{\theta}(x) = \frac{\theta x^{\theta-1}}{(x+1)^{\theta+1}} \quad x > 0, \theta > 0$$

بر آوردگر نأریب با کمترین واریانس یکنواخت (UMVUE) برای  $\frac{1}{\theta}$ ، کدام است؟

$$\begin{aligned} (1) \quad & \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ln \left( \frac{X_i}{1+X_i} \right) \\ (2) \quad & \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ln(1+X_i) \\ (3) \quad & \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \frac{X_i}{1+X_i} \\ (4) \quad & \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n -\ln \left( \frac{X_i}{1+X_i} \right) \end{aligned}$$

۳۶- فرض کنید  $Y_1, Y_2, \dots, Y_n$  نمونه تصادفی از توزیعی با تابع چگالی احتمال زیر باشد.

$$f(y) = \frac{\theta}{y^2} e^{-\frac{\theta}{y}}, \quad y > 0, \theta > 0$$

UMVUE پارامتر  $\theta$ ، کدام است؟

$$\begin{aligned} (1) \quad & \sum_i \frac{n-1}{Y_i^{-1}} \\ (2) \quad & \sum_i \frac{n-1}{Y_i} \\ (3) \quad & \sum_i \frac{1}{n-1} Y_i \\ (4) \quad & \sum_i \frac{1}{n-1} Y_i^{-1} \end{aligned}$$

۳۷- فرض کنید  $T$  بر آوردگر نأریب با کمترین واریانس (UMVUE) برای  $\theta$  باشد. اگر  $U$  یک «بر آوردگر نأریب صفر»

و  $k$  یک عدد صحیح مثبت باشد، مقدار  $\rho_{T^k, U}$  (ضریب همبستگی خطی  $T^k, U$ )، کدام است؟

- (۱) همیشه مثبت است.  
 (۲) همیشه منفی است.  
 (۳) بستگی به مقدار  $k$  دارد.  
 (۴) همیشه مثبت است.

۳۸- فرض کنید  $X_1, \dots, X_n$  یک نمونه تصادفی از توزیع نمایی با میانگین  $\frac{1}{\theta}$  و  $\theta$  دارای توزیع گاما با پارامتر شکل  $\alpha$

و پارامتر مقیاس  $\beta$  باشد. بر آوردگر بیز پارامتر  $\theta$  تحت تابع زیان  $L(\theta, \delta) = e^{\theta-\delta} - (\theta - \delta) - 1$ ، کدام است؟

$$\begin{aligned} (1) \quad & \frac{\alpha}{\bar{X} + \beta} \\ (2) \quad & \frac{\alpha + \sum X_i}{n + \frac{1}{\beta}} \\ (3) \quad & \frac{\bar{X} + \beta}{\alpha} \\ (4) \quad & -(n + \alpha) \ln \left( 1 - \frac{1}{\sum X_i + \frac{1}{\beta}} \right) \end{aligned}$$

۳۹- فرض کنید  $X \sim N(\theta, 1)$  و  $\theta$  دارای توزیع یکنواخت روی مجموعه  $\{-1, 1\}$  باشد. برآوردگر بیز  $\theta$  تحت تابع زیان درجه ۲ (SEL) کدام است؟

$$\frac{e^X - e^{-X}}{e^X + e^{-X}} \quad (۲) \qquad \frac{e^{-X} - e^X}{e^{-X} + e^X} \quad (۱)$$

$$\frac{e^X}{e^X + e^{-X}} \quad (۴) \qquad \frac{e^{-X}}{e^X + e^{-X}} \quad (۳)$$

۴۰- فرض کنید  $X_1, \dots, X_n$  یک نمونه تصادفی از توزیع  $N(\theta, \sigma^2)$  و  $\frac{1}{\theta}$  دارای توزیع گاما با پارامتر شکل  $\alpha$  و پارامتر مقیاس  $\beta$  باشد. برآوردگر بیز پارامتر  $\theta^2$  تحت تابع زیان  $L(\theta, \delta) = \theta(\theta - \delta)^2$  کدام است؟

$$\frac{\sum_{i=1}^n X_i^2 + \frac{\gamma}{\beta}}{n + 2\alpha - 2} \quad (۲) \qquad \frac{(\sum_{i=1}^n X_i^2 + \frac{\gamma}{\beta})^2}{(n + 2\alpha - 4)(n + 2\alpha - 2)} \quad (۱)$$

$$\left[ \frac{\sum_{i=1}^n X_i^2 + \frac{\gamma}{\beta}}{n + 2\alpha - 2} \right]^2 \quad (۴) \qquad \frac{(\sum_{i=1}^n X_i^2 + \frac{\gamma}{\beta})^2}{(n + 2\alpha - 4)(n + 2\alpha - 6)} \quad (۳)$$

۴۱- فرض کنید  $X_1, \dots, X_n$  یک نمونه تصادفی از توزیع پواسون با پارامتر  $\theta$  و  $\theta$  دارای توزیع گاما با پارامتر شکل  $\alpha$  و پارامتر مقیاس  $\beta$  باشد. برآوردگر بیز پارامتر  $\theta$  تحت تابع زیان  $L(\theta, \delta) = e^{-\theta}(\theta - \delta)^2$  کدام است؟

$$\frac{\alpha + \sum X_i}{n + \frac{1}{\beta}} \quad (۲) \qquad e^{-\bar{X}} \quad (۱)$$

$$\frac{\alpha + \sum_{i=1}^n X_i}{n + \beta} \quad (۴) \qquad \frac{\beta(\alpha + \sum X_i)}{(n+1)\beta + 1} \quad (۳)$$

۴۲- فرض کنید  $X$  دارای توزیع لجستیک با پارامتر مکان  $\theta$  با تابع توزیع زیر باشد.

$$F_{\theta}(x) = \frac{1}{1 + e^{-(x-\theta)}}, \quad -\infty < x < \infty, \quad \theta \in \mathbb{R}$$

اگر  $\theta$  دارای توزیع پیشین ناسره  $\pi(\theta) = 1$  باشد، برآوردگر بیز تعمیم یافته  $\theta$  تحت تابع زیان قدر مطلق خطا کدام است؟

$$2X \quad (۲) \qquad \frac{1}{2}X \quad (۱)$$

$$X \quad (۴) \qquad |X| \quad (۳)$$

۴۳- فرض کنید  $X$  یک تک‌مشاهده از توزیع برنولی با پارامتر  $p$  باشد که در آن  $p \in \{\frac{1}{4}, \frac{3}{4}\}$ . چهار برآورد  $\delta_1, \delta_2, \delta_3, \delta_4$  را به صورت زیر در نظر بگیرید.

$$\delta_1(0) = a_1, \delta_1(1) = a_2, \quad \delta_2(0) = \delta_2(1) = a_1$$

$$\delta_3(0) = \delta_3(1) = a_2, \quad \delta_4(0) = a_2, \delta_4(1) = a_1$$

تحت جدول تابع زبان زیر، کدام برآورد(ها) مینمکس است؟

$a \backslash p$	$a_1$	$a_2$
$\frac{1}{4}$	۳	۲
$\frac{3}{4}$	۱	۴

$\delta_1, \delta_4$  (۱)

$\delta_2$  (۲)

$\delta_3$  (۳)

$\delta_3, \delta_4$  (۴)

۴۴- فرض کنید  $X_1, \dots, X_n$  یک نمونه تصادفی از توزیع  $N(0, \theta)$  باشد. کدام مورد نادرست است؟

(۱)  $\overline{X^2}$ ، برای  $\theta$  سازگار است.

(۲)  $\overline{X^2}$ ، UMVUE برای  $\theta$  است.

(۳) تحت تابع درجه دوم،  $\overline{X^2}$  برآوردگر پذیرفتنی (مجاز، روا) برای  $\theta$  است.

(۴) تحت تابع زبان درجه دوم، در رده برآوردگرهای  $a\overline{X^2}$ ، برآوردگر  $\frac{n}{n+2}\overline{X^2}$  برای  $\theta$ ، دارای کمترین تابع مخاطره است.

۴۵- فرض کنید  $X_1, \dots, X_n$  نمونه تصادفی از توزیع  $N(0, \theta)$  باشد. تحت تابع زبان درجه ۲ (SEL)، در کلاس

برآوردگرهای به فرم  $D = \left\{ c\overline{X^2} : c > 0, \overline{X^2} = \frac{1}{n} \sum X_i^2 \right\}$ ، برآوردگر پذیرفتنی (مجاز، روا) کدام است؟

$$\overline{X^2} \quad (۱)$$

$$\frac{n}{n+2}\overline{X^2} \quad (۲)$$

$$\frac{1}{n+2}\overline{X^2} \quad (۴)$$

$$\frac{n}{n+1}\overline{X^2} \quad (۳)$$

