

636
F

نام
نام خانوادگی
محل امضاء

عصر جمعه
۹۳/۱۱/۱۷



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

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

آزمون ورودی دوره های کارشناسی ارشد ناپیوسته داخل - سال ۱۳۹۴

مجموعه آمار - کد ۱۲۰۷

تعداد سؤال: ۱۳۵
مدت پاسخگویی: ۲۷۰ دقیقه

عنوان مواد امتحانی، تعداد و شماره سؤالات

ردیف	مواد امتحانی	تعداد سؤال	از شماره	تا شماره
۱	زبان عمومی و تخصصی	۳۰	۱	۳۰
۲	دروس پایه (ریاضیات عمومی، مبنای علوم ریاضی، مبنای ماتریس ها و جبرخطی، مبنای آنالیز ریاضی، مبنای آنالیز عددی و مبنای احتمال)	۴۵	۳۱	۷۵
۳	دروس تخصصی (احتمال، آمار ریاضی، نمونه گیری و رگرسیون)	۶۰	۷۶	۱۳۵

این آزمون نمره منفی دارد.
استفاده از ماشین حساب مجاز نیست.

بهمن ماه - سال ۱۳۹۳

حق چاپ، نشر 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.

- 14- 1) 70 percent of
3) 70 percent
- 15- 1) in
2) for
3) over
4) with
- 2) a percentage of 70
4) 70 of the percentage

PART C: Reading Comprehension

Directions: Read the following three passages and answer the questions by choosing the best choice (1), (2), (3), or (4) and then mark the correct choice on your answer sheet.

PASSAGE 1:

In probability theory, the expected value of a random variable is intuitively the long-run average value of repetitions of the experiments it represents. Less roughly, the law of large numbers guarantees that the arithmetic mean of the values almost surely converges to the expected value as the number of repetitions goes to infinity. More practically, the expected value of a discrete random variable is the probability weighted average of all possible values. In other words, each possible value a random variable can assume is multiplied by its probability of occurring, and the resulting products are summed to obtain the expected value. The same works for continuous random variable, except the sum is replaced by an integral and the probabilities by probability densities. For distributions which are neither discrete nor continuous, the expected value of a random variable is the integral of the random variable with respect to its probability measure.

- 16- **The expected value of a discrete random variable is the -----.**
 1) arithmetic mean
 2) average
 3) integral of random variable
 4) sum of the production of random variable values by its probability
- 17- **Which kind of convergence is considered for the law of large numbers?**
 1) Arithmetic mean
 2) Almost surely convergence
 3) Convergence in mean
 4) Expected value
- 18- **For a probability density, the expected value of the related random variable is the -----.**
 1) probability-weighted average
 2) integral of random variable with respect to the probability measure
 3) average of all possible values
 4) continuous random variable
- 19- **Based on the law of large numbers the ----- converges to the expected value.**
 1) harmonic mean
 2) median
 3) arithmetic mean
 4) geometric mean
- 20- **The expected value for distributions which are neither discrete nor continuous is -----.**
 1) integral of random variable with respect to its probability measure
 2) sum of probabilities produce by its values
 3) integral of the random variable multiplied by probability measure
 4) a measure

PASSAGE 2:

We define sample mean $\bar{X} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i$ and sample variance $S^2 = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X})^2$, where $\{X_1, X_2, \dots, X_n\}$ comprises a random sample from some population. It is well known that \bar{X} and S^2 are independent if the population is normally distributed. Now, naturally we can ask a question: Are \bar{X} and S^2 independent without the assumption of normality? The answer to this question is "No" according to the following theorem found in Lukacs (1942).

Theorem: If the variance (or second moment) of a population distribution exists, then a necessary and sufficient condition for the normality of the population distribution is that \bar{X} and S^2 are mutually independent.

Remark: That the normality is a necessary condition for the independence between \bar{X} and S^2 was first proved by Geary (1936) using a mathematical tool provided by R. A. Fisher, but the proof in Lukacs (1942) is easier to understand.

21- What comprises a random sample?

- | | |
|-------------------------------|----------------------|
| 1) $\{X_1, X_2, \dots, X_n\}$ | 2) Normal population |
| 3) Sample mean | 4) Sample variance |

22- \bar{X} and S^2 are independent -----.

- | | |
|--------------------|-----------------------------|
| 1) all the time | 2) under uniform assumption |
| 3) if uncorrelated | 4) under normal assumption |

23- Who first proved the theorem?

- | | | | |
|-----------|-----------|----------|------------|
| 1) Fisher | 2) Lukacs | 3) Geary | 4) Pearson |
|-----------|-----------|----------|------------|

24- Whose proof is easier?

- | | | | |
|-------------|------------|------------|--------------|
| 1) Fisher's | 2) Geary's | 3) Lukacs' | 4) Pearson's |
|-------------|------------|------------|--------------|

25- A condition for the theorem is the existence of the -----.

- | | | | |
|-------------|---------|-----------------|------------------|
| 1) variance | 2) mean | 3) third moment | 4) fourth moment |
|-------------|---------|-----------------|------------------|

PASSAGE 3:

Most departments of statistics teach at least one course on the difficult concepts of convergence in probability (P), almost sure convergence ($a.s.$), convergence in law (L), and convergence in r th mean (r) at the graduate level (see Sethuraman 1995). Indeed, as pointed out by Boyce et al. (2001), "statistical theory is an important part of the curriculum, and is particularly important for students headed for graduate school." Such knowledge is prescribed by learned statistics societies (e.g., the Accreditation of Statisticians by the Statistical Society of Canada and Curriculum Guidelines for Undergraduate Programs in Statistical Science by the American Statistical Association). The main textbooks (e.g., Chung, 1974; Billingsley, 1986; Ferguson, 1996; Lehmann, 2001; Serfling 2002) devote about 15 pages to defining these convergence concepts and their interrelations. Very often, these concepts are provided as definitions, and students are exposed only to some basic properties and to the universal implications.

26- Where do they teach the concepts of convergence?

- | | |
|---------------------------------|-----------------|
| 1) In departments of statistics | 2) In colleges |
| 3) In high schools | 4) In societies |

27- How many concepts of convergence do they teach?

- | | | | |
|--------|----------|--------|---------|
| 1) One | 2) three | 3) Two | 4) four |
|--------|----------|--------|---------|

- 28- At what level are the complicated concepts of convergence taught?
 1) PhD 2) Graduate 3) Undergraduate 4) High school
- 29- How many textbooks devoted to convergence are mentioned in the passage?
 1) One 2) Two 3) Three 4) Five
- 30- How are the concepts often provided?
 1) As definitions 2) As theorems
 3) As examples 4) As homework

دروس پایه:

ریاضیات عمومی

۳۱- انحنای منحنی $\vec{r}(t) = t\vec{i} + \cosh t\vec{j}$ کدام است؟

(۱) $\frac{1}{\cosh t}$

(۲) $\frac{t}{\cosh^2 t}$

(۳) $\frac{1}{\cosh 2t}$

(۴) $\frac{1}{\cosh^2 t}$

۳۲- اگر T مکعبی در $\frac{1}{8}$ اول فضا باشد که رئوس آن $(0,0,0)$ و $(1,0,0)$ و $(0,1,0)$ و $(0,0,1)$ هستند، مقدار

انتگرال $\iiint_T e^{x+y+z} dv$ کدام است؟

(۱) $(e-1)^3$

(۲) $e^3 - 1$

(۳) $e^3 + 1$

(۴) $(e+1)^3$

۳۳- مقدار مشتق پنجم $f(x) = \frac{x}{1-x^2}$ در $x=0$ کدام است؟

(۱) ۱۲۰

(۲) -۱۲۰

(۳) -۱

(۴) ۱

$$-۳۴ \text{ سری } \sum_{n=1}^{\infty} \frac{n}{7^{n-1}} \dots$$

(۱) واگرا است.

(۲) همگراست و مجموع آن $1 + \frac{49}{36}$ است.

(۳) همگراست و مجموع آن $\frac{7}{6}$ است.

(۴) همگراست و مجموع آن $\frac{49}{36}$ است.

-۳۵ مجموعه نقاط z در صفحه مختلط که $0 < |z| + 2 < |z|^2 - 3|z|$ کدام است؟

$$(۱) \{x+iy \mid 2 < x^2 + y^2 < 4\}$$

$$(۲) \{x+iy \mid 1 < x^2 + y^2 < 4\}$$

$$(۳) \{x+iy \mid 1 < x^2 + y^2 < 3\}$$

$$(۴) \{x+iy \mid 1 < x^2 + y^2 < 5\}$$

-۳۶ مقدار انتگرال معین $\int_0^{\ln 2} e^x \ln(e^{-x} + 1) dx$ کدام است؟

$$(۱) \ln\left(\frac{4}{27}\right)$$

$$(۲) \ln\left(\frac{27}{4}\right)$$

$$(۳) \ln\left(\frac{27}{16}\right)$$

$$(۴) \ln\left(\frac{9}{4}\right)$$

-۳۷ f تابعی دو بار مشتق پذیر بوده که به ازای $a \neq 0$,

$$\int_0^a (f'(x) + x f''(x)) dx = a$$

مقدار $f'(a)$ کدام است؟

$$(۱) \frac{1}{2}a$$

$$(۲) 0$$

$$(۳) 1$$

$$(۴) a$$

۳۸- ماکسیمم مقدار $f(x,y) = 9 - x^2 - y^2$ روی خط $x + y = 3$ ، کدام است؟

(۱) $\frac{2}{13}$

(۲) $\frac{13}{2}$

(۳) $\frac{9}{2}$

(۴) $\frac{2}{9}$

۳۹- مقدار انتگرال $\iint_A xe^{x^2 - y^2} dy dx$ که در آن A ناحیه محدود به خطوط $y = x$ ، $y = x - 1$ ، $y = 1$ و $y = 0$ باشد، کدام است؟

(۱) $\frac{1}{2}\pi^2 + \frac{1}{4}$

(۲) $\frac{1}{4}e^2 - \frac{1}{4}e - \frac{1}{2}$

(۳) $\frac{1}{2}e^2 - \frac{1}{2}e - \frac{1}{4}$

(۴) $\frac{1}{4}\pi^2 - \frac{1}{2}$

مبانی علوم ریاضی

۴۰- فرض کنیم $g: Y \rightarrow Z$ تابعی دوسویی و $f: X \rightarrow Y$ تابع باشد و $h = \text{gof}: X \rightarrow Z$ کدام یک از گزینه‌های زیر نادرست است؟

(۱) اگر f یک به یک باشد آنگاه h تابع دوسویی است.

(۲) اگر f یک به یک نباشد آنگاه h یک به یک نیست.

(۳) اگر f یک به یک باشد آنگاه h یک به یک است.

(۴) اگر f پوشا باشد آنگاه h هم پوشا است.

۴۱- اگر $A - B = \{x : x \in A \text{ \& } x \notin B\}$ آنگاه کدام گزینه نادرست است؟

(۱) $(A \times C) \cap (B \times D) = (A \cap B) \times (C \cap D)$

(۲) $A \times (B \cup C) = (A \times B) \cup (A \times C)$

(۳) $A \cup (B - C) = (A \cup B) - (A \cup C)$

(۴) $A \cap (B - C) = (A \cap B) - (A \cap C)$

۴۲- کدام گزینه درست است؟

$$(1) \bigcap_{n=2}^{\infty} \left(\frac{1}{n+1}, \frac{1}{n-1} \right) = \{0\}$$

$$(2) \bigcap_{n=1}^{\infty} \left(\frac{1}{n}, 1 + \frac{1}{n} \right) = \{1\}$$

$$(3) \bigcup_{n=1}^{\infty} \left(1 - \frac{1}{n}, 1 + \frac{1}{n} \right) = [0, 2]$$

$$(4) \bigcup_{n=2}^{\infty} \left(-\frac{1}{n}, 1 - \frac{1}{n} \right) = \left(-\frac{1}{2}, 1 \right)$$

۴۳- فرض کنیم $f: X \rightarrow Y$ یک تابع باشد، $A, B \subseteq X$ و $C \subseteq Y$. اگر $A \setminus B$ به مفهوم مکمل B نسبت به A

باشد، کدام گزینه نادرست است؟

$$(1) f(f^{-1}(C)) = f(X) \cap C$$

$$(2) f(A \cap f^{-1}(C)) = f(A) \cap C$$

$$(3) f(A \setminus B) = f(A) \setminus f(B)$$

$$(4) f^{-1}(Y \setminus C) = X \setminus f^{-1}(C)$$

۴۴- فرض کنید $a, b \in \mathbb{R}$ و $m, n \in \mathbb{N}$ در این صورت:

$$(1) \text{ اگر } a < b \text{ آنگاه } a^n < b^n$$

$$(2) \text{ شرط لازم و کافی برای آنکه } a < b \text{ آنست که } a^m < b^m$$

$$(3) \text{ با فرض } a \neq 0, m < n \text{ و تنها اگر } a^m < a^n$$

$$(4) \text{ اگر } a^n < b^n \text{ آنگاه } a < b$$

۴۵- فرض کنیم $\aleph_0 = \text{card}(\mathbb{N})$ عدد اصلی مجموعه اعداد طبیعی \mathbb{N} باشد. کدام گزینه نادرست است؟

$$(1) \aleph_0 + \aleph_0 = \aleph_0$$

$$(2) \aleph_0 = \text{card}([0, 1])$$

$$(3) \text{ به ازای هر } n \in \mathbb{N}, \mathbb{R} \text{ و } \mathbb{R}^n \text{ هم عدد (هم ارز) هستند.}$$

$$(4) \text{ به ازای هر } n \in \mathbb{N}, \aleph_0^n = \aleph_0$$

مبانی ماتریس‌ها و جبر خطی

۴۶- فرض کنیم $A = \begin{pmatrix} 2 & -4 \\ 5 & -2 \end{pmatrix}$. کدام یک از زیرفضاهای $\mathbb{C} \times \mathbb{C}$ روی میدان \mathbb{C} ، تحت A پایا هستند (\mathbb{C} میدان اعداد مختلط است)؟

(۱) $\langle (1+i, 2) \rangle$

(۲) $\langle (1+i, 1-i) \rangle$

(۳) $\langle (2, 2+i) \rangle$

(۴) $\langle (2, 1-2i) \rangle$

۴۷- فرض کنید $X = [1, 0, a, 1, b]$ ماتریسی 1×5 با درایه‌های حقیقی باشد. کدام گزینه در مورد پوچی ماتریس $X^t X$ صحیح است؟

(۱) پوچی برابر ۴ است.

(۲) پوچی برابر ۲ است.

(۳) اگر $a = b = 0$ ، پوچی برابر ۲ است.

(۴) اگر $a = b = 1$ ، پوچی برابر ۱ است.

۴۸- فرض کنید \mathbb{C} میدان اعداد مختلط باشد و فضای برداری $V = \mathbb{C}^4$ را روی \mathbb{C} در نظر بگیرید. فرض کنید

$W = W_1 + W_2$ که $W_1 = \langle (1, 1, 1, 0), (-1, 0, 1, -1) \rangle$ ، $W_2 = \langle (0, 1, 2, -1), (i, 0, 1, 1) \rangle$ ، W_1, W_2 زیر

فضاهای V باشند. در این صورت بعد W به عنوان یک فضای برداری روی \mathbb{R} کدام است؟

(۱) ۳

(۲) ۴

(۳) ۶

(۴) ۸

۴۹- فرض کنید $X = \begin{bmatrix} 1 & 2 \\ 0 & -1 \end{bmatrix}$ و $T: M_{2 \times 2}(\mathbb{R}) \rightarrow M_{2 \times 2}(\mathbb{R})$ یک نگاشت خطی با ضابطه

$T(A) = XA - AX$ باشد. کدام گزینه درباره‌ی بعد هسته T صحیح است؟

(۱) $\dim \ker T = 0$

(۲) $\dim \ker T = 1$

(۳) $\dim \ker T = 2$

(۴) $\dim \ker T = 3$

۵۰- فرض کنید ماتریس $A \in M_{10}(\mathbb{R})$ و $A^2 = A + 2I$ و رتبه‌ی ماتریس $A + I$ برابر ۳ باشد. در این صورت

$\text{tr}(A)$ برابر است با:

(۱) -۲

(۲) -۱

(۳) ۱

(۴) ۲

۵۱- فرض کنید \mathbb{Q} میدان اعداد گویا است و $A \in M_r(\mathbb{Q})$, $A^k = I$. کدام گزینه صحیح است؟

- (۱) $A^2 = I$ (۲) $A^4 = I$
 (۳) $A^3 = I$ (۴) $A^2 = -I$

مبانی آنالیز ریاضی

۵۲- هرگاه $\{a_n\}$ دنباله‌ای از اعداد مثبت و $\sigma_n = \frac{a_1 + a_2 + \dots + a_n}{n}$ آنگاه کدام گزینه درست است؟

(۱) $\limsup a_n \leq \limsup \sigma_n$

(۲) $\liminf a_n \leq \liminf \sigma_n$

(۳) $\liminf \sigma_n \leq \liminf a_n$

(۴) اگر دنباله $\{\sigma_n\}$ همگرا باشد آنگاه دنباله $\{a_n\}$ همگرا است.

۵۳- تابع $f: [0, 1] \rightarrow \mathbb{R}$ با ضابطه:

$$f(x) = \begin{cases} x & x \notin \mathbb{Q} \\ m \sin \frac{1}{n} & x \in \mathbb{Q}, x = \frac{m}{n}, (m, n) = 1 \end{cases}$$

تعریف می‌شود. کدام گزینه درست است؟

(۱) f بر $[0, 1]$ پیوسته است.

(۲) f در هر نقطه از بازه $[0, 1]$ حد دارد.

(۳) تعداد نقاط پیوستگی f در $[0, 1]$ شمارا است.

(۴) ناپیوستگی‌های f در صورت وجود از نوع دوم است.

۵۴- کدام تابع بر $(0, \infty)$ یکنواخت پیوسته است؟

(۱) x^2

(۲) $x \sin x$

(۳) $x \sin \frac{1}{x}$

(۴) $\sin \frac{1}{x}$

۵۵- فرض کنیم $f: [a, b) \rightarrow \mathbb{R}$ تابعی کراندار باشد و تابع $g: [a, b) \rightarrow \mathbb{R}$ با ضابطه $g(x) = \inf_{a \leq t \leq x} f(t)$ تعریف

شود. در این صورت:

(۱) تابع g یکنواخت پیوسته است.

(۲) تابع g پیوسته است اما لزوماً یکنواخت پیوسته نیست.

(۳) اگر تابع f یکنواخت پیوسته باشد آنگاه تابع g نیز یکنواخت پیوسته است.

(۴) اگر تابع f یکنواخت پیوسته باشد آنگاه تابع g پیوسته است اما لزوماً یکنواخت پیوسته نیست.

۵۶- فرض کنیم تابع غیر ثابت $f: [0, 1] \rightarrow \mathbb{R}$ مشتق پذیر باشد، f و f' صفر مشترک نداشته باشند و مجموعه صفرهای f' ناتهی باشد. در این صورت مجموعه صفرهای تابع f :

- (۱) تهی است.
- (۲) ناشمارا است.
- (۳) متناهی است.
- (۴) شمارای نامتناهی است.

۵۷- فرض کنیم تابع $f: [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ مشتق پذیر باشد و $f'(a) < f'(b)$. کدام گزینه درست است؟

- (۱) مجموعه $f'([a, b])$ فشرده است.
- (۲) مجموعه $f'([a, b])$ یک بازه است.
- (۳) مجموعه $f'([a, b])$ کراندار است.
- (۴) مجموعه $\{x \in [a, b]: f'(a) \leq f'(x) \leq f'(b)\}$ یک بازه است.

۵۸- فرض کنیم $f: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ پیوسته باشد. تساوی $f(0) = 0$ از کدام گزینه نتیجه می شود؟

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_0^1 f(x+n) dx = 0 \quad (۱)$$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_0^1 f\left(\frac{x}{n}\right) dx = 0 \quad (۲)$$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_0^1 (f(x))^n dx = 0 \quad (۳)$$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_0^1 f(nx) dx = 0 \quad (۴)$$

۵۹- فرض کنیم $A = \{x > 0: \sum_{n=1}^{\infty} (\sqrt[n]{x} - 1) \text{ همگرا است}\}$. در این صورت:

$$A = \{1\} \quad (۱)$$

$$A = (0, \infty) \quad (۲)$$

$$A = (0, 1] \quad (۳)$$

$$A = \left(\frac{1}{e}, e\right) \quad (۴)$$

۶۰- فرض کنیم $\{a_n\}$ دنباله‌ای در \mathbb{R} باشد و $a_n^+ = \frac{a_n + |a_n|}{2}$, $a_n^- = \frac{a_n - |a_n|}{2}$. کدام گزینه نادرست است؟

(۱) اگر $\sum_{n=1}^{\infty} a_n$ همگرا باشد، آنگاه $\sum_{n=1}^{\infty} a_n^+ a_n^-$ همگرا است.

(۲) اگر $\sum_{n=1}^{\infty} a_n^+$ و $\sum_{n=1}^{\infty} a_n^-$ همگرا باشند، آنگاه $\sum_{n=1}^{\infty} a_n$ همگرای مطلق است.

(۳) اگر $\sum_{n=1}^{\infty} a_n$ همگرای مشروط باشد، آنگاه $\sum_{n=1}^{\infty} a_n^+$ و $\sum_{n=1}^{\infty} a_n^-$ همگرا هستند.

(۴) اگر $\sum_{n=1}^{\infty} a_n$ همگرای مشروط باشد، آنگاه $\sum_{n=1}^{\infty} a_n^+$ و $\sum_{n=1}^{\infty} a_n^-$ واگرا هستند.

۶۱- فرض کنیم A, B دو زیر مجموعه در \mathbb{R}^n باشند و $A - B = \{a - b : a \in A, b \in B\}$ در این صورت:

(۱) اگر $A - B$ همبند باشد حداقل یکی از A و B همبند است.

(۲) اگر A و B همبند باشند آنگاه $A - B$ همبند است.

(۳) اگر A و B بسته باشند آنگاه $A - B$ بسته است.

(۴) اگر A فشرده و B بسته باشد آنگاه $A - B$ فشرده است.

۶۲- فرض کنیم E و F دو زیر مجموعه ناتهی در \mathbb{R} باشند. کدام گزینه درست است؟

(۱) اگر $(x, y) \in (E \times F)^\circ$ آنگاه $x \in E^\circ$ و $y \in F^\circ$.

(۲) اگر $(x, y) \in (E \times F)'$ آنگاه $x \in E'$ و $y \in F'$.

(۳) اگر $(E \times F)' \neq \emptyset$ آنگاه $E' \neq \emptyset$ و $F' \neq \emptyset$.

(۴) اگر $E^\circ \cup F^\circ \neq \emptyset$ آنگاه $(E \times F)^\circ \neq \emptyset$.

۶۳- حداقل شرایط روی زیر مجموعه E از \mathbb{R} که گزاره زیر راست باشد کدام است؟

برای هر دنباله نزولی و تودرتوی $\{K_n\}_{n=1}^{\infty}$ از زیر مجموعه‌های فشرده \mathbb{R} ، اگر $\bigcap_{k=1}^{\infty} K_n \subseteq E$ آنگاه یک n

وجود دارد که $K_n \subseteq E$.

(۱) E بسته و لزوماً کراندار است.

(۲) E بسته و نه لزوماً کراندار است.

(۳) E باز و لزوماً کراندار است.

(۴) E باز و نه لزوماً کراندار است.

مبانی آنالیز عددی

۶۴- در یک دستگاه ممیز شناور نرمال شده برای اعداد حقیقی با روش بریدن برای ارقام غیر قابل نمایش در مبنا ۲، هر عدد $x \neq 0$ به صورت $\pm(0.d_1d_2d_3d_4d_5d_6)_2 \times 2^{\pm d_7}$ نمایش داده می‌شود که $1 \leq d_i \leq 2$ ، $0 \leq d_7 \leq 2$ ، $i = 1, \dots, 6$ ، فاصله بین عدد ۷ و کوچک‌ترین عدد قابل نمایش بزرگ‌تر از ۷ چقدر است؟

$$\frac{1}{9} \quad (1)$$

$$\frac{1}{7} \quad (2)$$

$$\frac{1}{6} \quad (3)$$

$$\frac{1}{3} \quad (4)$$

۶۵- در رابطه زیر گزینه صحیح برای نقطه چین کدام است؟

$$\frac{f(x+\frac{h}{2}) - 2f(x) + f(x-\frac{h}{2}))}{\frac{h^2}{2}} + o(h^2) = \dots$$

$$f'(x) \quad (1)$$

$$f''(x+h) \quad (2)$$

$$f''(x) \quad (3)$$

$$f'(x+h) \quad (4)$$

۶۶- فرض کنید روش نیوتن برای حل مساله $\max(\sin x \cos x - 1)$ به یک عدد مثبت x^* همگرا شده است. نرخ همگرایی مجانبی برابر کدام است؟

$$(1) \text{ یک}$$

$$(2) \text{ دو}$$

$$(3) \text{ خطی}$$

$$(4) \text{ زبرخطی}$$

۶۷- مقدار d ، تخمین مشتق تابع $y(x) = \sqrt{x}$ در نقطه $\bar{x} = 1,05$ با $d = \frac{y_1 - y_2}{0,05}$ که در آن، $y_1 = \sqrt{1,05}$ و

$y_2 = 1$ ، خطای برشی متناسب با دارد.

$$(1) 0,0001$$

$$(2) 0,001$$

$$(3) 0,015$$

$$(4) 0,1$$

۶۸- فرمول انتگرال گیری عددی $\int_0^1 f(\sqrt{x})dx \approx w_1 f(0) + w_2 f'(0) + w_3 f(1)$ برای چند جمله‌ای‌های تا

درجه‌ی ۲ دقیق است. تقریب این فرمول برای $\int_0^1 \frac{dx}{1+x}$ کدام است؟

(۱) $\frac{3}{4}$

(۲) $\frac{7}{12}$

(۳) $\frac{11}{12}$

(۴) $\frac{5}{6}$

۶۹- تخمین $y(0.1)$ برای جواب معادله دیفرانسیل به صورت $y(0) = 1$ ، $y'(x) = e^{x^3}$ با استفاده از سری تیلور مرتبه ۳ (تا مشتق سوم) به ازای یک قدم $h = 0.1$ برابر کدام است؟

(۱) $1/13$

(۲) $1/11$

(۳) $1/1$

(۴) $1/1$

مبانی احتمال

۷۰- داده‌های آماری با یک رقم اعشار با نمودار ساقه و برگ (تنه و شاخه) زیر داده شده است.

۷	۱	۲	۳	۳	۶	۷	۸
۸	۲	۳	۴	۴	۵	۶	۶
۹	۲	۳	۳				

داده‌های کم‌تر از چارک اول و بیشتر از چارک سوم را حذف می‌کنیم میانگین داده‌های باقیمانده کدام است؟

(۱) $8/11$

(۲) $8/16$

(۳) $8/2$

(۴) $8/34$

۷۱- فرض کنید H ، G و \bar{x} به ترتیب نمایانگر میانگین‌های همساز (هارمونیک، توافقی)، هندسی و حسابی

نمونه باشند. با فرض $x_i = ar^{i-1}$ که در آن $r > 0$ و $a > 0$ ، کدام رابطه همواره درست است؟

(۱) $G^2 = \bar{x} \times H$

(۲) $\bar{x}^2 = G \times H$

(۳) $G = \frac{\bar{x} + H}{2}$

(۴) $H^2 = \bar{x} \times G$

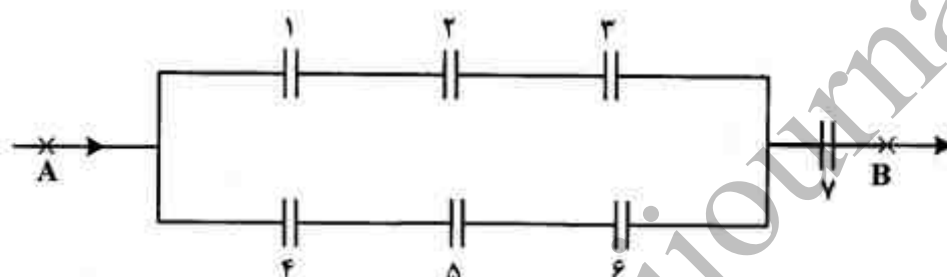
۷۲- در یک شرکت میانگین حقوق ماهیانه کارکنان مرد ۱,۲۰۰,۰۰۰ تومان، میانگین حقوق کارکنان زن ۷۰۰,۰۰۰ تومان و میانگین حقوق کلیه کارکنان ۱,۰۰۰,۰۰۰ تومان است، چند درصد کارکنان زن هستند؟

- (۱) ۳۰٪
 (۲) ۴۰٪
 (۳) ۵۰٪
 (۴) ۶۰٪

۷۳- سه جعبه با برچسب‌های ۱۰، ۲۵ و ۵۰ تومان مشخص شده‌اند، به چند طریق می‌توان این سه جعبه را با سکه‌های مناسب فوق پر کرد تا ارزش مجموع سه جعبه ۲۰۰۰ تومان باشد؟

- (۱) ۷۰۳
 (۲) ۷۱۶
 (۳) ۸۲۰
 (۴) ۸۶۱

۷۴- در شکل زیر فرض کنید احتمال این که هر کدام از ۷ رله‌ی شبکه ارتباطی نشان داده شده درست کار کنند برابر p است. در صورتیکه رله‌ها مستقل از یکدیگر کار کنند، احتمال این که بتوان بین دو نقطه A و B ارتباط برقرار کرد کدام است؟



- (۱) $p^7(2-p^2)$
 (۲) $p^7(2-p^3)$
 (۳) $p^6(1-p^3)$
 (۴) $p^7(1-p^3)$

۷۵- فردی سه سکه در جیب دارد که یکی سالم و دو تای دیگر هر دو طرف شیر هستند. اگر این فرد یک سکه به تصادف از جیب خود خارج و ۲ بار پرتاب کند و هر دو بار شیر مشاهده شود، احتمال اینکه سکه سالم انتخاب شده باشد کدام است؟

- (۱) $\frac{8}{9}$
 (۲) $\frac{4}{5}$
 (۳) $\frac{1}{5}$
 (۴) $\frac{1}{9}$

۷۶- اگر تعداد زیر مجموعه‌های ۳ عضوی یک مجموعه با تعداد زیر مجموعه‌های ۴ عضوی آن برابر باشد، تعداد کل زیر مجموعه‌های آن کدام است؟

(۱) ۶۴

(۲) ۱۲۸

(۳) ۲۵۶

(۴) ۵۱۲

۷۷- مقدار $\sum_{i=0}^{20} i \binom{20}{i}$ کدام است؟

(۱) 2^{20} (۲) 2^{21} (۳) 5×2^{20} (۴) 5×2^{21}

۷۸- اگر X_1 و X_2 به ترتیب تعداد خال‌های ظاهر شده در پرتاب مستقل دو تاس سالم باشند، احتمال اینکه X_1 کمتر از X_2 باشد کدام است؟

(۱) $\frac{4}{12}$ (۲) $\frac{5}{12}$ (۳) $\frac{6}{12}$ (۴) $\frac{7}{12}$

۷۹- دو نقطه به تصادف و مستقل از یکدیگر در فاصله $[0, 1]$ انتخاب می‌شود. اگر D فاصله بین این دو نقطه باشد، مقدار $P(D \leq 0.1)$ کدام است؟

(۱) ۰/۱۸

(۲) ۰/۱۹

(۳) ۰/۸۱

(۴) ۰/۹۱

۸۰- اگر متغیر تصادفی پیوسته X دارای تابع توزیع زیر باشد، مقدار k کدام است؟

$$F(x) = \begin{cases} 0 & x < 1 \\ k(x-1)^4 & 1 \leq x < 3 \\ 1 & x \geq 3 \end{cases}$$

$$\frac{1}{16} \quad (1)$$

$$\frac{1}{8} \quad (2)$$

$$\frac{1}{4} \quad (3)$$

$$1 \quad (4)$$

۸۱- اگر Y_1, \dots, Y_n یک نمونه تصادفی از توزیع نرمال لگاریتمی (LN) (لاگ نرمال) با میانگین صفر و واریانس ۱

باشد، توزیع متغیر تصادفی $X = \prod_{i=1}^n Y_i^\alpha$ که در آن $\alpha > 0$ ، کدام است؟

$$N(0, n\alpha) \quad (1)$$

$$N(0, n\alpha^2) \quad (2)$$

$$LN(0, n\alpha) \quad (3)$$

$$LN(0, n\alpha^2) \quad (4)$$

۸۲- فرض کنید X_1, \dots, X_n یک نمونه تصادفی از توزیع پواسن با میانگین ۱ باشد. اگر $T = \bar{X}(n - \bar{X})$ ، کران

بالا برای $P(T=0)$ کدام است؟

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

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

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

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

۸۳- فرض کنید برای متغیرهای تصادفی هم توزیع X_1, \dots, X_n داشته باشیم:

$$(X_i, X_j) = (X_1, X_r) ; \forall i \neq j, \sum_{i=1}^n X_i = 0$$

ضریب همبستگی X_1 و X_r کدام است؟

$$-\frac{1}{n-1} \quad (1)$$

$$-\frac{1}{n} \quad (2)$$

$$\frac{1}{n} \quad (3)$$

$$\frac{2}{n(n-1)} \quad (4)$$

۸۴- اگر $Z \sim N(0, 1)$ ، مقدار $\text{Var}(Z | |Z|)$ کدام است؟

$\frac{1}{2}$ (۱)

۱ (۲)

۳ (۳)

۴ (۴)

۸۵- فرض کنید X_1, X_2, X_3, X_4 متغیرهای تصادفی iid از توزیع برنولی با پارامتر p باشند، قرار دهید

مقدار $E[X_1 | X = 2]$ کدام است؟ $X = \sum_{i=1}^4 X_i$

0.25 (۱)

$\frac{1}{3}$ (۲)

0.5 (۳)

۱ (۴)

۸۶- فرض کنید $X \sim U(0, 2)$ و $Y = \begin{cases} 2 & X < 1 \\ 2X & X \geq 1 \end{cases}$ مقدار $E(Y)$ کدام است؟

۳ (۱)

۴ (۲)

$\frac{9}{2}$ (۳)

۵ (۴)

۸۷- فرض کنید $X \sim N(0, 1)$ ، $P(T=1) = P(T=-1) = \frac{1}{2}$ و متغیرهای تصادفی X و T از یکدیگر مستقل

باشند، توزیع $Y = XT$ کدام است؟

$N(0, \frac{1}{4})$ (۱)

$N(0, 1)$ (۲)

$\text{bin}(2, \frac{1}{4})$ (۳)

$\text{bin}(2, \frac{1}{2})$ (۴)

۸۸- فرض کنید X_1, \dots, X_n یک نمونه تصادفی از توزیعی با تابع چگالی احتمال $f(x) = 2x, 0 < x < 1$ باشد.

قرار دهید $Y_n = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i^2$. اگر $\frac{\sqrt{n}(Y_n - a)}{b} \xrightarrow{d} N(0, 1)$ ، مقادیر a و b کدام است؟

$$a = \frac{1}{2}, b = \sqrt{\frac{1}{12}} \quad (1)$$

$$a = \frac{1}{2}, b = \frac{1}{2} \quad (2)$$

$$a = \frac{1}{4}, b = \sqrt{\frac{1}{12}} \quad (3)$$

$$a = \frac{1}{4}, b = \frac{1}{2} \quad (4)$$

۸۹- برای یک نمونه تصادفی 3 تایی از توزیع یکنواخت روی فاصله $(0, 1)$ ، احتمال اینکه میانه نمونه بین $\frac{1}{4}, \frac{3}{4}$ باشد کدام است؟

$$\frac{9}{16} \quad (1)$$

$$\frac{10}{16} \quad (2)$$

$$\frac{11}{16} \quad (3)$$

$$\frac{12}{16} \quad (4)$$

۹۰- ده دوچرخه سوار در یک مسابقه شرکت دارند. هر دوچرخه سوار مسابقه را در مدت زمان T (ساعت) با تابع چگالی احتمال زیر به پایان می‌رساند، احتمال اینکه دوچرخه سواری با کمتر از نیم ساعت برنده مسابقه شود، کدام است؟

$$f_T(t) = te^{-t}, t > 0$$

$$1 - \left(\frac{3}{2}e^{-0.5}\right)^{10} \quad (1)$$

$$1 - \left(\frac{1}{2}e^{-0.5}\right)^{10} \quad (2)$$

$$\left(\frac{3}{2}e^{-0.5}\right)^{10} \quad (3)$$

$$\left(\frac{1}{2}e^{-0.5}\right)^{10} \quad (4)$$

۹۱- متغیر تصادفی X دارای تابع مولد گشتاوری به صورت زیر است. تابع احتمال این متغیر کدام است؟

$$M_X(t) = \frac{1}{2} \left[2 + \frac{t^2}{2!} + \frac{t^4}{4!} + \dots \right]$$

$$P(X=k) = \frac{3}{4} \left(\frac{1}{2}\right)^{2k}; k=0, 1, 2, \dots \quad (1)$$

$$P(X=k) = \frac{e^{-1}}{k!}; k=0, 1, 2, \dots \quad (2)$$

$$P(X=k) = \frac{1}{4} \text{ if } k=1, -1, 2, -2, \dots \quad (3)$$

$$P(X=k) = \begin{cases} \frac{1}{4} & \text{if } k=1, -1 \\ \frac{1}{2} & \text{if } k=0 \end{cases} \quad (4)$$

۹۲- اگر متغیر تصادفی X دارای توزیع $N(1,1)$ باشد، مقدار $\text{Var}(e^X)$ کدام است؟

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

$$e(e-1) \quad (2)$$

$$e^2(e-1) \quad (3)$$

$$e^2(e-1) \quad (4)$$

۹۳- تعداد زمین لرزه‌ها در یک منطقه از توزیع پواسن با نرخ λ زمین لرزه در سال پیروی می‌کند. در صورتیکه

بدانیم دقیقاً دو زمین لرزه در یک سال رخ داده، احتمال اینکه هر دو زمین لرزه در سه ماهه اول سال رخ داده باشد کدام است؟ (برای سادگی همه ماه‌ها را سی روزه و هر سال را ۱۲ ماه یعنی ۳۶۰ روز در نظر

بگیرید.)

$$\frac{1}{16} \quad (1)$$

$$\frac{1}{12} \quad (2)$$

$$\frac{64}{225} \quad (3)$$

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

۹۴- فرض کنید X به شرط $Y = y$ دارای توزیع یکنواخت در بازه $(0, y)$ و توزیع Y ، گاما با پارامتر شکل α و پارامتر مقیاس β باشد. واریانس X کدام است؟

$$\frac{\alpha\beta^2}{12} \quad (1)$$

$$\frac{\alpha\beta^2(\alpha+4)}{12} \quad (2)$$

$$\frac{\alpha\beta(1+\beta)}{12} \quad (3)$$

$$\frac{\alpha\beta^2(1+4\beta)}{12} \quad (4)$$

۹۵- اگر دنباله‌ای از متغیرهای تصادفی مستقل از هم با توزیع یکسان $U(0,1)$ باشند. توزیع حدی $Y_n = n X_{(1)}$ کدام است؟

$$\text{Exp}\left(\frac{1}{4}\right) \quad (1)$$

$$\text{Exp}\left(\frac{1}{2}\right) \quad (2)$$

$$\text{Exp}(1) \quad (3)$$

$$\text{Exp}(2) \quad (4)$$

۹۶- فرض کنید X_1, \dots, X_n و Y_1, \dots, Y_n دو نمونه تصادفی مستقل از توزیع‌های به ترتیب $E(\lambda)$ و $\Gamma(1, \lambda)$ باشند. آماره بسنده می‌نیمال کدام است؟

$$(Y - \Gamma(\alpha, \lambda) \rightarrow f_{\alpha, \lambda}(x) = \frac{\lambda^\alpha}{\Gamma(\alpha)} x^{\alpha-1} e^{-\lambda x}, \quad X - E(\lambda) \rightarrow f_\lambda(x) = \lambda e^{-\lambda x}, \quad x > 0; \text{راهنمایی:})$$

$$\sum_{i=1}^n X_i \cdot Y_i^{-1} \quad (1)$$

$$\prod_{i=1}^n X_i \cdot Y_i^{-1} \quad (2)$$

$$\sum_{i=1}^n (X_i + Y_i^{-1}) \quad (3)$$

$$\prod_{i=1}^n (X_i + Y_i^{-1}) \quad (4)$$

۹۷- فرض کنید X_1, \dots, X_n یک نمونه تصادفی از توزیع $B(1, \theta)$ باشد. کدامیک از آماره‌های زیر بسنده هستند؟

$$(i) (X_1, \dots, X_n), \quad (ii) (X_1^r, \dots, X_n^r), \quad (iii) \left(\sum_{i=1}^k X_i, \sum_{i=k+1}^n X_i \right)$$

$$(iv) \sum_{i=1}^n X_i, \quad (v) \bar{X}, \quad (vi) \sum_{i=1}^n X_i^r, \quad (vii) \left(\sum_{i=1}^n X_i \right)^r$$

(۱) فقط آماره‌های (i) - (v) برای θ بسنده هستند.

(۲) فقط آماره‌های (i) - (vi) برای θ بسنده هستند.

(۳) کلیه آماره‌ها به جز (vi) برای θ بسنده هستند.

(۴) کلیه آماره‌ها برای θ بسنده هستند.

۹۸- فرض کنید X دارای تابع چگال احتمال زیر باشد،

$$f(x) = c f_1(x) f_2^r(x), \quad x = 0, 1, \dots, m$$

که در آن $f_1(x)$ تابع احتمال توزیع دو جمله‌ای با پارامترهای (m, θ) و $f_2(x)$ تابع احتمال توزیع هندسی با پارامتر θ می‌باشند. بر اساس یک نمونه تصادفی X_1, \dots, X_n از X آماره بسنده برای θ کدام است؟

$$\sum_{i=1}^n X_i \quad (۱)$$

$$\prod_{i=1}^n X_i \quad (۲)$$

$$\sum_{i=1}^n \binom{m}{X_i} \quad (۳)$$

$$\prod_{i=1}^n \binom{m}{X_i} \quad (۴)$$

۹۹- تعداد k سکه سالم را ۱۰ بار مستقل از هم پرتاب می‌کنیم. اگر تعداد شیرها در ۱۰ پرتاب به صورت زیر باشد، برآورد گشتاوری k کدام است؟

۷, ۸, ۸, ۴, ۳, ۱۰, ۸, ۶, ۷, ۹

۲۰ (۱)

۱۴ (۲)

۱۰ (۳)

۷ (۴)

۱۰۰- اگر X_1, \dots, X_n یک نمونه تصادفی از تابع چگالی احتمال زیر باشد. برآوردگر ماکزیمم درست‌نمایی (MLE) پارامتر p کدام است؟

$$f(x, p) = \begin{cases} p & x = 1 \\ 1-p & x = -1 \end{cases}$$

$$\frac{\bar{X}}{2} \quad (1)$$

$$\bar{X} \quad (2)$$

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

$$\frac{\bar{X}+1}{2} \quad (4)$$

۱۰۱- فرض کنید X_1, \dots, X_n یک نمونه‌ی تصادفی از توزیع هندسی با تابع احتمال زیر باشد. اگر

$$u(t) = \begin{cases} 1 & t \geq 0 \\ 0 & t < 0 \end{cases} \quad \text{است. } T = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i u(X_i - 2)$$

برآوردگر ناریب کدام است؟

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

$$\frac{1}{\theta} - \theta \quad (1)$$

$$\theta - \frac{1}{\theta} \quad (2)$$

$$\frac{1-\theta}{\theta} \quad (3)$$

$$\frac{\theta}{1-\theta} \quad (4)$$

۱۰۲- فرض کنید X_1, \dots, X_n یک نمونه‌ی تصادفی از توزیع $N(0, \theta)$ باشد. برآوردگر ناریب با کمترین واریانس (UMVUE) پارامتر θ^k کدام است؟

$$\Gamma(k+n) \left(\sum X_i^2 \right)^k \quad (1)$$

$$\frac{\Gamma\left(\frac{n}{2}\right) \left(\sum X_i^2 \right)^k}{\Gamma\left(k + \frac{n}{2}\right) r^k} \quad (2)$$

$$\sum_i X_i^{rk} \quad (3)$$

$$\left(\sum_i X_i^2 \right)^k \quad (4)$$

۱۰۳- اگر X_1, \dots, X_n یک نمونه‌ی تصادفی از توزیعی با تابع چگالی احتمال زیر باشد:

$$f(x, \theta) = \begin{cases} \frac{\theta x^{\theta-1}}{(1+x)^{\theta+1}} & x > 0 \\ 0 & \text{otherwise} \end{cases}$$

برآوردگر UMVU پارامتر $\frac{1}{\theta}$ کدام است؟

$$\frac{1}{n+1} \sum_{i=1}^n \left(\frac{X_i}{X_i+1} \right) \quad (1)$$

$$\frac{1}{n+1} \sum_{i=1}^n \ln \left(1 + \frac{1}{X_i} \right) \quad (2)$$

$$\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ln \left(1 + \frac{1}{X_i} \right) \quad (3)$$

$$\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \ln \left(\frac{X_i}{1+X_i} \right) \quad (4)$$

۱۰۴- فرض کنید X_1, \dots, X_n یک نمونه‌ی تصادفی از توزیع $N(\theta, 1)$ باشد. پارامتر UMVUE پارامتر $\gamma(\theta) = P_{\theta}(X_1 + X_2 \leq a)$ که در آن a مقدار ثابت و معلوم است، کدام است؟ Φ نمایانگر تابع توزیع نرمال استاندارد است.

$$\Phi \left(\sqrt{\frac{\gamma n}{n-\gamma}} \left(\frac{a}{\gamma} - \bar{X} \right) \right) \quad (1)$$

$$\Phi \left(\sqrt{\frac{n}{n-1}} (a - \bar{X}) \right) \quad (2)$$

$$\Phi \left(\sqrt{\frac{\gamma n}{n-\gamma}} (a - \bar{X}) \right) \quad (3)$$

$$\Phi \left(\sqrt{\frac{n}{n-1}} (\gamma a - \bar{X}) \right) \quad (4)$$

۱۰۵- فرض کنید X_1, \dots, X_n یک نمونه‌ی تصادفی n تایی از توزیع $N(\mu, 1)$ باشد. کران پائین کرامر - رانو برای واریانس برآوردگر ناریب $P(X_1 > 2\mu)$ ، کدام است؟

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

$$(2) \frac{e^{-\mu}}{n}$$

$$(3) \frac{\mu^2}{2\pi n}$$

$$(4) \frac{e^{-\mu^2}}{2\pi n}$$

۱۰۶- فرض کنید X_1, \dots, X_n یک نمونه‌ی تصادفی از تابع چگالی احتمال زیر باشد. ضریب اطمینان فاصله‌ی تصادفی $(\min(X_i), \max(X_i))$ کدام است؟

$$f(x; \theta) = \frac{1}{2} e^{-|x-\theta|} \quad -\infty < x < \infty, \quad -\infty < \theta < \infty$$

$$(1) 1 - \frac{1}{2^n}$$

$$(2) 1 - \frac{1}{2^{n-1}}$$

$$(3) 1 - \frac{1}{2^{n-2}}$$

$$(4) 1 - \frac{1}{2^{n+1}}$$

۱۰۷- فرض کنید X_1, \dots, X_n یک نمونه‌ی تصادفی از توزیعی با تابع چگالی احتمال زیر باشد. یک بازه اطمینان $100(1-\alpha)$ درصدی با دم‌های برابر برای θ بر پایه‌ی MLE پارامتر θ کدام است؟

$$f(x, \theta) = e^{-x+\theta}, \quad x > \theta$$

$$(1) \bar{X} - 1 \pm \frac{1}{\sqrt{n}} z_{\frac{\alpha}{2}}$$

$$(2) X_{(1)} \pm \frac{1}{\sqrt{n}} z_{\frac{\alpha}{2}}$$

$$(3) \left(X_{(1)} + \frac{1}{n} \ln\left(\frac{\alpha}{2}\right), X_{(1)} + \frac{1}{n} \ln\left(1 - \frac{\alpha}{2}\right) \right)$$

$$(4) \left(\bar{X} - \frac{1}{2n} X_{\frac{\alpha}{2}}^2(2n), \bar{X} + \frac{1}{2n} X_{1-\frac{\alpha}{2}}^2(2n) \right)$$

۱۰۸- متغیر تصادفی X در فاصله $(0, 1)$ دارای تابع توزیع احتمال $F(x) = x^6$ یا $G(x) = x^3$ است. بر اساس یک مشاهده، پرتوانترین آزمون برای $H_0: X \sim F$ در برابر $H_1: X \sim G$ را در نظر می‌گیریم. رابطه میان احتمال خطای نوع اول (α) و توان آزمون (π) کدام است؟

$$\pi = \alpha^2 \quad (1)$$

$$\alpha = \pi^2 \quad (2)$$

$$1 - \alpha = (1 - \pi)^2 \quad (3)$$

$$\alpha = (1 - \pi)^2 \quad (4)$$

۱۰۹- فرض کنید X دارای تابع احتمال زیر باشد

$$f_{\theta}(x) = \begin{cases} \theta & x = -1 \\ (1 - \theta)^2 \theta^x & x = 0, 1, 2, \dots \end{cases}$$

برای انجام آزمون $H_0: \theta = \frac{1}{2}$ در مقابل $H_1: \theta = \frac{3}{4}$ ، پرتوان‌ترین آزمون اندازه $\alpha = \frac{1}{32}$ کدام است؟

$$\varphi(x) = \begin{cases} 1 & x \geq 4 \\ \frac{1}{16} & x = -1 \\ 0 & 0 \leq x < 4 \end{cases} \quad (1)$$

$$\varphi(x) = \begin{cases} 1 & x \geq 4 \\ 0 & x < 4 \end{cases} \quad (2)$$

$$\varphi(x) = \begin{cases} 1 & x \geq 5 \\ \frac{1}{32} & x = -1 \\ 0 & 0 \leq x \leq 4 \end{cases} \quad (3)$$

$$\varphi(x) = \begin{cases} 1 & x \geq 5 \\ \frac{1}{64} & x = -1 \\ 0 & 0 \leq x \leq 4 \end{cases} \quad (4)$$

۱۱۰- فرض کنید X_1 و X_2 متغیرهای تصادفی مستقل و هم توزیع با تابع چگالی احتمال زیر باشند،

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

ناحیه رد آزمون پرتوان (MP) برای آزمون $H_0: \theta = 1$ در مقابل $H_1: \theta = 2$ در سطح $\alpha = \frac{1}{2}(1 - \ln 2)$ کدام است؟

$$X_1 X_2 > \frac{1}{2} \quad (1)$$

$$X_1 + X_2 > \frac{1}{2} \quad (2)$$

$$X_1 X_2 < \frac{1}{2} \quad (3)$$

$$X_1 + X_2 < \frac{1}{2} \quad (4)$$

۱۱۱- اگر X_1, \dots, X_n نمونه‌ای تصادفی از توزیع یکنواخت در بازه $(0, \theta)$ باشد، $\theta > 0$ ، تابع توان پرتوان‌ترین آزمون یکنواخت (UMP) برای آزمون $H_0: \theta \leq 1$ در برابر $H_1: \theta > 1$ کدام است؟

$$\frac{1-\alpha}{\theta^n} \quad (1)$$

$$1 - \frac{1-\alpha}{\theta^n} \quad (2)$$

$$1 - \frac{\alpha}{\theta^n} \quad (3)$$

$$1 - \left(\frac{1-\alpha}{\theta}\right)^n \quad (4)$$

۱۱۲- فرض کنید X_1, \dots, X_n نمونه‌ای تصادفی و مستقل از توزیع $U(-\theta, \theta)$ باشد. برای آزمون $H_0: \theta = 1$ در مقابل $H_1: \theta > 1$ ناحیه ردی به شکل $\max |X_i| > c$ در نظر گرفته شده است. مقدار c و تابع توان آزمون،

$\beta^*(\theta)$ برای سطح α کدام است؟

$$c = \sqrt[n]{1-\alpha}, \quad \beta^*(\theta) = 1 - \frac{1-\alpha}{\theta^n} \quad (1)$$

$$c = \sqrt[n]{\alpha}, \quad \beta^*(\theta) = \theta^{-n} \alpha \quad (2)$$

$$c = \sqrt[n]{\alpha}, \quad \beta^*(\theta) = 1 - \frac{1-\alpha}{(\sqrt[n]{2}\theta)^n} \quad (3)$$

$$c = \sqrt[n]{1-\alpha}, \quad \beta^*(\theta) = 1 - \frac{1-\alpha}{\theta^n} \quad (4)$$

۱۱۳- فرض کنید X_1, \dots, X_n یک نمونه تصادفی از توزیع $E(\theta, 1)$ با تابع چگالی احتمال زیر باشد، برای آزمون $H_0: \theta \leq 2$ در مقابل $H_1: \theta > 2$ در سطح $\alpha = e^{-2}$ ناحیه رد آزمون UMP کدام است؟

$$f_{\theta}(x) = e^{-(x-\theta)}; x \geq \theta$$

$$X_{(1)} > 2\left(1 + \frac{1}{n}\right) \quad (1)$$

$$X_{(1)} > 2\left(1 + \frac{1}{n}\right) \quad (2)$$

$$X_{(1)} > 2\left(1 - \frac{1}{n}\right) \quad (3)$$

$$X_{(1)} > 2\left(1 - \frac{1}{n}\right) \quad (4)$$

۱۱۴- فرض کنید X تک مشاهده‌ای از خانواده‌های توزیع‌های زیر باشد. هم‌چنین فرض کنید $\Theta_0 = \{\theta_1, \theta_2\}$ باشد، برای آزمون فرض $H_0: \theta \in \Theta_0$ در مقابل $H_1: \theta \notin \Theta_0$ و در سطح $\alpha = 0.05$ ، آزمون نسبت درست‌نمایی تعمیم یافته کدام است؟

	x_1	x_2	x_3
θ_1	0.05	0.15	0.8
θ_2	0.8	0.1	0.1
θ_3	0.7	0.25	0.05

$$\varphi(x) = \begin{cases} \frac{1}{3} & x = x_1, x_2 \\ 0 & x = x_3 \end{cases} \quad (1)$$

$$\varphi(x) = \begin{cases} \frac{1}{16} & x = x_2 \\ 0 & x \neq x_2 \end{cases} \quad (2)$$

$$\varphi(x) = \begin{cases} 1 & x = x_1 \\ 0 & x \neq x_1 \end{cases} \quad (3)$$

$$\varphi(x) = \begin{cases} \frac{1}{2} & x = x_2 \\ 0 & x \neq x_2 \end{cases} \quad (4)$$

۱۱۵- فرض کنید X_1, \dots, X_n نمونه‌ای تصادفی از توزیع $E(\mu, \sigma)$ با تابع چگالی احتمال زیر باشد. برای آزمون فرض $H_0: \mu = 2$ در مقابل $H_1: \mu \neq 2$ آماره آزمون نسبت درست‌نمایی تعمیم یافته و توزیع آن تحت H_0 کدام است؟

$$f_{\mu, \sigma}(x) = \frac{1}{\sigma} e^{-(x-\mu)/\sigma}; \quad x \geq \mu$$

$$F_{\tau, \tau n} \text{ و دارای توزیع } \frac{n(X_{(1)} - \tau)}{\sum_{i=1}^n (X_i - \tau)} \quad (1)$$

$$F_{\tau, \tau n - \tau} \text{ و دارای توزیع } \frac{n(X_{(1)} - \tau)}{\sum_{i=1}^n (X_i - X_{(1)})} \quad (2)$$

$$F_{\tau, \tau n - \tau} \text{ و دارای توزیع } \frac{n(n-1)(X_{(1)} - \tau)}{\sum_{i=1}^n (X_i - X_{(1)})} \quad (3)$$

$$F_{\tau n, \tau} \text{ و دارای توزیع } \frac{\sum_{i=1}^n (X_i - X_{(1)})}{n(n-1)(X_{(1)} - \tau)} \quad (4)$$

۱۱۶- یک نمونه تصادفی ساده (بدون جای‌گذاری) اولیه به حجم n را در نظر بگیرید. اگر بدانیم که با دو برابر کردن حجم نمونه واریانس برآوردگر میانگین جامعه ۳ برابر می‌شود، کسر نمونه‌گیری اولیه کدام است؟

$$\frac{1}{6} \quad (1)$$

$$\frac{1}{4} \quad (2)$$

$$\frac{1}{3} \quad (3)$$

$$\frac{1}{2} \quad (4)$$

۱۱۷- در یک نمونه‌گیری تصادفی ساده با جای‌گذاری به حجم n از جامعه‌ای به حجم N ، احتمال انتخاب شدن دو عضو اول و دوم جامعه در نمونه کدام است؟

$$\left[1 - \left(1 - \frac{1}{N}\right)^n\right]^2 \quad (1)$$

$$1 - \left(1 - \frac{1}{N}\right)^{2n} \quad (2)$$

$$1 - \left(1 - \frac{2}{N}\right)^n \quad (3)$$

$$1 - 2\left(1 - \frac{1}{N}\right)^n + \left(1 - \frac{2}{N}\right)^n \quad (4)$$

۱۱۸- از جامعه‌ای به حجم ۱۰۰۰ نمونه‌ای به حجم ۱۰ به روش تصادفی ساده با جای‌گذاری گرفته‌ایم، اگر میانگین نمونه‌ای برابر حجم نمونه و مجموع توان دوم واحدهای نمونه، $2/5$ برابر حجم جامعه باشد، برآورد ناریب واریانس میانگین نمونه‌ای چقدر است؟

$$16/5 \quad (1)$$

$$16/67 \quad (2)$$

$$15 \quad (3)$$

$$25/67 \quad (4)$$

۱۱۹- فرض کنید بدانیم نسبت افراد طرفدار یک کاندید انتخاباتی در سال گذشته ۶۰٪ بوده است. می‌خواهیم با یک تحقیق نمونه‌ای، این نسبت را طوری برآورد کنیم که با ضریب اطمینان ۹۵٪ این نسبت در فاصله اطمینان $(0/5, 0/7)$ قرار گیرد. با صرف‌نظر کردن از نسبت نمونه‌گیری، تعداد نمونه لازم کدام است؟

$$Z_{0/025} = 2$$

$$90 \quad (1)$$

$$92 \quad (2)$$

$$95 \quad (3)$$

$$97 \quad (4)$$

۱۲۰- در نمونه‌گیری تصادفی ساده (بدون جای‌گذاری) به حجم n از جامعه‌ای متناهی به حجم N اگر حداکثر واریانس برآوردگر نسبت جامعه برابر با $\frac{1}{100}$ باشد، مقدار n کدام است؟

$$n = \frac{25N}{N+24} \quad (1)$$

$$n = \frac{25N}{N-1} \quad (2)$$

$$n = \frac{24N}{N+25} \quad (3)$$

$$n = \frac{96N}{N+96} \quad (4)$$

۱۲۱- فرض کنید جامعه‌ای به حجم N موجود است. در یک نمونه‌گیری از دو طبقه مایلیم بجای n_1 و n_2 در تخصیص نیمن داشته باشیم $n_1 = n_2$. اگر $\text{var}(\bar{Y}_{st})$ معرف واریانس در حالت $n_1 = n_2$ و $\text{var}_{opt}(\bar{Y}_{st})$ ، واریانس مربوط به تخصیص نیمن باشد، در صورتیکه N به اندازه کافی بزرگ و $n_2 = 3n_1$ آنگاه در مورد

نسبت $ef = \frac{\text{var}_{opt}(\bar{Y}_{st})}{\text{var}(\bar{Y}_{st})}$ کدام گزینه صحیح است؟

$$ef = \frac{1}{5} \quad (1)$$

$$ef = \frac{4}{5} \quad (2)$$

$$ef = \frac{2}{5} \quad (3)$$

$$ef = \frac{3}{5} \quad (4)$$

۱۲۲- در چه صورت در نمونه‌گیری طبقه‌ای تخصیص متناسب، بهینه است؟

- (۱) حجم طبقات برابر باشد.
- (۲) تغییرات داخل طبقات کوچک باشد.
- (۳) تغییرات داخل طبقات یکسان باشد.
- (۴) حجم طبقات متناسب با واریانس طبقات باشد.

۱۲۳- اگر داده‌های حاصل از یک روش نمونه‌گیری طبقه‌ای را بدون در نظر گرفتن طبقه‌ها با یکدیگر ادغام نموده و از میانگین معمولی مشاهدات برای برآورد میانگین جامعه استفاده کنیم، یک شرط کافی برای ناریب بودن این برآوردگر کدام است؟

- (۱) حجم نمونه‌ها برابر باشند.
- (۲) حجم طبقه‌ها یکسان باشند.
- (۳) نسبت حجم نمونه در هر دو طبقه دلخواه ثابت باشد.
- (۴) نسبت حجم نمونه به حجم طبقه در تمام طبقات جامعه برابر باشد.

۱۲۴- جامعه‌ای به حجم N را در نظر بگیرید. فرض کنید کوچکترین و بزرگترین عضو جامعه معلوم و به ترتیب برابر $y(1)$ و $y(N)$ باشند. دو برآوردکننده برای برآورد مجموع عناصر جامعه به صورت زیر در نظر گرفته می‌شود

$$T_1 = N\bar{y}_n \quad \text{و} \quad T_2 = y(1) + y(N) + (N-2)\bar{y}'_n$$

که در آن \bar{y}_n و \bar{y}'_n به ترتیب میانگین نمونه‌ای حاصل از انتخاب n نمونه به روش تصادفی ساده بدون جای-گذاری از کل جامعه و از جامعه بدون عناصر $y(1)$ و $y(N)$ است. کدام عبارت صحیح است؟

- (۱) T_2 برآوردکننده‌ای اریب است و واریانس آن از واریانس T_1 بیشتر است.
- (۲) T_2 برآوردکننده‌ای اریب است و واریانس آن از واریانس T_1 کمتر است.
- (۳) T_2 برآوردکننده‌ای ناریب است و واریانس آن از واریانس T_1 کمتر است.
- (۴) T_2 برآوردکننده‌ای ناریب است و واریانس آن از واریانس T_1 بیشتر است.

۱۲۵- می‌خواهیم از یک جامعه متناهی به حجم N یک نمونه تصادفی ساده به حجم n انتخاب کنیم. اگر در چارچوب این جامعه نام عنصر اول به اشتباه دو بار ثبت شده باشد، آریبی برآوردگر میانگین مشاهدات برای میانگین کل جامعه \bar{y}_N کدام است؟

$$y_1 \quad (1)$$

$$\frac{y_1}{N+1} \quad (2)$$

$$\frac{\bar{y}_N - y_1}{N} \quad (3)$$

$$\frac{y_1 - \bar{y}_N}{N+1} \quad (4)$$

۱۲۶- در یک مدل رگرسیون خطی ساده $Y_i = \beta_0 + \beta_1 x_i + \varepsilon_i$ ، $i = 1, 2, \dots, n$ ، $\text{var}(Y_i - \hat{Y}_i)$ ، کدام است؟

$$\text{var}(Y_i) \quad (1)$$

$$\text{var}(Y_i) - \text{var}(\hat{Y}_i) \quad (2)$$

$$\text{var}(Y_i) - 2 \text{var}(\hat{Y}_i) \quad (3)$$

$$\text{var}(Y_i) + \text{var}(\hat{Y}_i) \quad (4)$$

۱۲۷- در مدل رگرسیون خطی ساده $Y = \beta_0 + \beta_1 x + \varepsilon$ می‌خواهیم فرض $H_0: \beta_1 = 0$ را در مقابل فرض $H_1: \beta_1 \neq 0$ آزمون کنیم. بر اساس یک نمونه تصادفی ۱۸ تایی معادله خط رگرسیونی y روی x و x روی y به ترتیب عبارتند از $\hat{y} = 0.67 + 1.2x$ و $\hat{x} = 2.5 + 0.3y$. مقدار آماره آزمون و درجه آزادی آماره کدام است؟ (فرض نرمال بودن ε برقرار است).

$$t = 3 \text{ با } 16 \text{ درجه آزادی} \quad (1)$$

$$t = -3 \text{ با } 16 \text{ درجه آزادی} \quad (2)$$

$$F = 3 \text{ با درجه‌های آزادی یک و } 16 \quad (3)$$

$$F = 9 \text{ با درجه‌های آزادی یک و } 17 \quad (4)$$

۱۲۸- مدل $y_i = \beta_0 + \sum_{j=1}^6 \beta_j X_{ij} + \varepsilon_i$ ، $\varepsilon_i \stackrel{iid}{\sim} N(0, \sigma^2)$ و $(i = 1, 2, \dots, n)$ را در نظر بگیرید. اگر $\hat{\beta}_7 = -3$ با

خطای معیار $1/5$ بدست آمده باشد، برای آزمون $H_0: \beta_7 = 0$ مقدار آماره F کدام است؟

$$\frac{4}{3} \quad (1)$$

$$\frac{16}{9} \quad (2)$$

$$2 \quad (3)$$

$$4 \quad (4)$$

۱۲۹- فرض کنید مشاهدات Y_1, Y_2, Y_3, Y_4 به صورت زیر داده شده است، که در آن پارامترهای مدل و $\varepsilon_i \sim N(0, \sigma^2)$ ها مستقل از هم هستند، برآورد پارامترهای (β_1, β_2) ، به روش کمترین توان دوم خطا کدام است؟

$$y_1 = \beta_1 + \beta_2 + \varepsilon_1$$

$$y_2 = \beta_1 + \varepsilon_2$$

$$y_3 = -\beta_2 + \varepsilon_3$$

$$y_4 = \beta_1 - \beta_2 + \varepsilon_4$$

$$\left(\frac{y_1 + y_2 + y_4}{3}, \frac{y_1 - y_2 - y_4}{3} \right) \quad (1)$$

$$\left(\frac{2y_1 + y_2 - y_3}{4}, \frac{2y_1 - y_2 + y_4}{4} \right) \quad (2)$$

$$\left(\frac{y_1 + y_2 + y_3 + y_4}{4}, \frac{y_1 + y_2 - y_3 - y_4}{4} \right) \quad (3)$$

$$\left(\frac{y_1 + y_2 + y_4}{4}, \frac{y_1 + y_2 + y_4}{3} \right) \quad (4)$$

۱۳۰- در مدل رگرسیون خطی ساده $Y_i = \beta_0 + \beta_1 x_i + \varepsilon_i$ ، $i = 1, \dots, n$ براساس برآوردهای روش کمترین توان دوم خطا، اگر ضریب همبستگی نمونه‌ای بین بردارهای $x = (x_1, \dots, x_n)'$ و $y = (y_1, \dots, y_n)'$ باشد، ضریب همبستگی نمونه‌ای بین بردارهای $\hat{y} = (\hat{y}_1, \dots, \hat{y}_n)'$ و $y = (y_1, \dots, y_n)'$ برحسب $r_{x,y}$ کدام است؟

$$r_{x,y} \quad (1)$$

$$r_{x,y}^2 \quad (2)$$

$$|r_{x,y}| \quad (3)$$

$$\frac{n}{n-2} r_{x,y}^2 \quad (4)$$

۱۳۱- در رگرسیون خطی ساده مدل را براساس n مشاهده برازش می‌دهیم. اگر مشاهده جدید (\bar{x}, \bar{y}) که در آن \bar{x} و \bar{y} میانگین‌های n مشاهده اول اند به داده‌ها افزوده شود، مقدار آماره F جدول تحلیل واریانس چقدر افزایش می‌یابد؟

(۱) تغییر نمی‌کند.

$$\frac{R}{\sqrt{1-R^2}} \quad (2)$$

$$\frac{R^2}{1-R^2} \quad (3)$$

$$\frac{(n-1)R^2}{1-R^2} \quad (4)$$

۱۳۲- داده‌های زیر را در نظر بگیرید:

$$Y: -3 \quad 2 \quad -1 \quad 2 \quad 0 \quad 4$$

$$X_1: -2 \quad -2 \quad 0 \quad 0 \quad 2 \quad 2$$

$$X_2: -2 \quad 2 \quad -2 \quad 2 \quad -2 \quad 2$$

چنانچه مدل خطی $y = \beta_0 + \beta_1 X_1 + \beta_2 X_2 + \varepsilon$ که در آن $\varepsilon \sim N(0, \sigma^2)$ مناسب باشد، برآورد پارامترهای $(\beta_0, \beta_1, \beta_2)$ به روش کمترین توان دوم خطا کدام است؟

$$(1) \left(\frac{4}{6}, \frac{10}{16}, 1 \right)$$

$$(2) \left(\frac{3}{2}, -1, \frac{1}{4} \right)$$

$$(3) \left(2, -2, \frac{1}{2} \right)$$

$$(4) \left(\frac{3}{16}, \frac{7}{24}, 2 \right)$$

۱۳۳- در برازش مدل رگرسیونی $E(y) = \beta_0 + \beta_1 X + \beta_2 X^2 + \beta_3 X^3$ ، $SSR = 150$ ، $MSE = 3$ بدست آمده است. همچنین در برازش مدل $E(y) = \beta_0 + \beta_1 X$ ، $SSR = 120$ حاصل شده است. برای آزمون $H_0: \beta_2 = \beta_3 = 0$ مقدار آماره F کدام است؟

$$(1) 5$$

$$(2) 10$$

$$(3) 14/5$$

$$(4) 28/3$$

۱۳۴- براساس یک نمونه تصادفی ۱۰ تایی از (x, y) داریم:

$$r = -0.80, \quad S_{XX} = \sum (X_i - 5)^2 = 16 \quad \text{و} \quad S_{YY} = \sum (Y_i + 2)^2 = 25$$

خط رگرسیون برازش شده به روش کمترین توان دوم خطا کدام است؟

$$(1) \hat{y} = 3 - 1/2x$$

$$(2) \hat{y} = -3 - 0.16x$$

$$(3) \hat{y} = 3 - x$$

$$(4) \hat{y} = -7 - 0.16x$$

۱۳۵- اگر به جای مدل رگرسیون خطی واقعی $Y = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \beta_2 x_2 + \varepsilon$ ، مدل $Y = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \varepsilon$ برازش داده شده باشد و $\hat{\beta}_1$ برآوردگر پارامتر β_1 به روش کمترین توان‌های دوم خطا در مدل برازش داده شده باشد، آنگاه کدام گزینه درست است؟

- (۱) $\hat{\beta}_1$ برآوردگر ناریب β_1 است.
- (۲) $\hat{\beta}_1$ برآوردگر ناریب β_1 می‌شود اگر x_1 و x_2 ناهمبسته باشند.
- (۳) واریانس $\hat{\beta}_1$ بیشتر از واریانس برآوردگر کمترین توان‌های دوم خطای β_1 براساس مدل واقعی است.
- (۴) اگر x_1 و x_2 ناهمبسته باشند، واریانس $\hat{\beta}_1$ بیشتر از واریانس برآوردگر کمترین توان‌های دوم خطای β_1 براساس مدل واقعی است.

www.isijournal.net