

高等学校试用教材

概率论及数理统计

下 册

中山大学数学力学系
《概率论及数理统计》编写小组编

人民教育出版社

51.7

140

7

高等学校试用教材

概率论及数理统计

下 册

中山大学数学力学系
《概率论及数理统计》编写小组编



人民教育出版社

1109326

本书是根据1977年高等学校理科数学教材编写大纲讨论会制定的“概率论及数理统计”编写大纲编写的，全书分上、下两册出版。

下册为数理统计初步(包括第六——第九章，内容为抽样分布、估计理论、假设检验、线性模型与方差分析)；随机过程引论(第十章)及概率论与数理统计在计算方法中的应用(第十一章)。

本书可作为综合大学、师范院校数学专业、计算数学专业的试用教材，也可作其它有关专业的教学参考书。

高等学校试用教材

概率论及数理统计

下 册

中山大学数学力学系

《概率论及数理统计》编写小组编

*

人民教育出版社出版

新华书店北京发行所发行

潜江县印刷厂印装

*

开本 787×1092 1/32 印张 13.125 字数 315,000

1980年7月第1版 1981年1月湖北第1次印刷

印数 00,001—34,500

书号 13012·0487 定价 0.95元

目 录

第六章 抽样分布	1
§ 6.1 基本概念	1
一、总体、个体、简单随机子样	1
二、统计量	3
三、小样问题与大样问题	5
§ 6.2 子样的数字特征及其分布	6
一、经验分布与格列汶科定理	6
二、子样的数字特征	8
三、子样数字特征的分布	9
§ 6.3 抽样分布定理	16
习题	31
第七章 估计理论	34
§ 7.1 矩法与极大似然法	35
一、矩法	35
二、极大似然法	39
§ 7.2 无偏性与优效性	47
一、无偏性	48
二、优效性	57
三、相合性	63
*§ 7.3 充分性与完备性	67
一、充分性	67
二、完备性	77
§ 7.4 区间估计	82
*§ 7.5 质量控制	87
一、平均值控制图	88
二、极差控制图	92
*§ 7.6 贝叶斯估计与极大极小估计	93
一、决策论的基本概念	93

二、极大极小估计	95
三、贝叶斯估计	97
§ 7.7 非参数估计	104
一、最小均方误差估计	104
二、线性最小均方误差估计	105
习题	108
第八章 假设检验	114
§ 8.1 引言	114
§ 8.2 参数假设检验	119
一、数学期望 α 的检验问题	120
二、方差 σ^2 的检验问题	129
§ 8.3 非参数的检验	132
一、分布函数的拟合检验	133
二、不相关与独立性的检验	155
§ 8.4 最佳检验与无偏检验	160
一、最佳检验	160
*二、无偏检验	176
*§ 8.5 子样容量 n 的确定	185
一、参数估计与检验中 n 的确定	185
二、最佳检验中 n 的确定	190
三、验收抽样方案中 n 的确定	191
习题	193
第九章 线性模型与方差分析	197
§ 9.1 线性模型	198
§ 9.2 最小二乘法估计	203
一、参数的最小二乘法估计	203
二、最小二乘法估计量的性质	206
三、举例	214
四、预测与控制	226
*五、将曲线问题线性化	230
§ 9.3 线性模型的假设检验	238
一、线性模型的假设检验	238

二、回归系数的假设检验	239
*三、最优回归的选择	245
*四、回归正交设计	250
§ 9.4 单因子方差分析	262
一、基本思想	263
二、数学模型	267
三、统计分析	269
§ 9.5 多因子方差分析	272
一、二因子方差分析	273
*二、多因子方差分析	280
习题	287
第十章 随机过程引论	291
§ 10.1 随机过程的概念	291
一、随机过程的直观背景和定义	291
二、随机过程的分布及其特征	294
§ 10.2 几类重要的随机过程简介	299
一、独立增量过程(可加过程)	300
二、正态随机过程(高斯过程)	300
三、维纳过程	301
四、泊松过程、随机点过程与计数过程	301
§ 10.3 马氏过程	304
一、马氏链的定义及例子	304
二、齐次马氏链	307
三、遍历性与平稳分布	311
§ 10.4 平稳随机过程	314
一、平稳随机过程的定义及例	314
二、平稳随机过程的相关函数	317
§ 10.5 均方微分与随机微分方程	320
一、随机序列均方收敛	320
二、随机过程的均方连续	322
三、随机过程的均方积分	323
四、随机过程的均方导数	327

五、随机微分方程	332
§ 10.6 弱平稳随机过程的功率谱密度	335
§ 10.7 遍历性定理	340
第十一章 概率统计在计算方法中的一些应用	343
§ 11.1 蒙特卡罗方法与随机数	343
一、什么叫蒙特卡罗方法	343
二、随机数的产生及伪随机数	345
三、伪随机数的产生方法	347
四、随机数的统计检验	351
§ 11.2 任意随机变量的模拟	355
一、离散型情形	355
二、一维连续型情形	358
三、多维连续型情形	364
四、随机游动和马尔可夫链的模拟	366
§ 11.3 定积分的概率计算方法	368
一、常用的两种算法	368
二、重积分的计算	374
§ 11.4 某些方程的概率解法	375
一、线性方程组的求解	375
二、一些偏微分方程的求解	379
附表	384
表 1 χ^2 -分布的上侧临界值表	384
表 2 t -分布的双侧临界值表	386
表 3 F 检验的临界值 (F_α) 表	388
表 4 检验相关系数 $\rho=0$ 的临界值 (r_α) 表	398
表 5 随机数表	399
表 6 常用的正交表	403
译名对照表	406
参考书目	407
下册习题答案	409

第六章 抽样分布

前述各章,是概率论的引论,讲述了概率论的基本内容,为数理统计学建立了重要的数学基础.从本章起的接连四章,是数理统计学的初步,主要讲述估计与检验等原理,线性模型与方差分析等统计方法.

数理统计学是运用概率论的基本知识,对要研究的随机现象进行多次观察或试验,研究如何合理地获得数据资料,建立有效的数学方法,根据所获得的数据资料,对所关心的问题作出估计与检验.数理统计学的重要分支有统计推断、多元分析、试验设计等,其具体方法甚多,应用相当广泛,已成为各学科从事科学研究及生产、经济等部门进行有效工作的必不可少的数学工具.

在这一章中,我们从数理统计学的基本概念讲起,讨论抽样分布及其重要的定理.这些抽样分布及其几个重要的定理,在前述各章中尚未提到,而在后述三章中却经常要用到它们.

§ 6.1 基本概念

一、总体、个体、简单随机子样

总体、个体、子样是数理统计学中三个最基本的术语.我们把对某一个问题的研究对象的全体称为总体(或母体),组成总体的每个基本单元称为个体,从总体中随机抽取的 n 个个体称为容量为 n 的子样.例如,把某月的整批产品视为一总体,则每个产品为个体;又如把某批灯泡视为一总体,则每个灯泡为个体;某地在某季度内每天的日平均气温的全体视为一总体,则其中某天的日平均气温为个体.在数理统计学中,我们是对总体的一个或者若干

1109326

• 1 •

个数量表征进行研究,如日平均气温的度数,用 ξ 表示,灯泡的使用寿命(小时)用 η 表示,这样对总体的研究就归结为讨论随机变数 ξ 或 η 的分布函数及其主要数字特征(如数学期望 $E(\xi)$ 、方差 $D(\xi)$ 等)的研究.又如某月的整批产品为一总体,若只要检查产品的质量,可用数量表征 ξ 来反映,产品为一等品,令 ξ 取值为1;二等品, ξ 取值为2;不合格品, ξ 取值为3.我们研究这批产品的质量规律,就归结为讨论随机变数 ξ 的分布函数及其主要数字特征了.

今后我们常用“总体 ξ 服从什么分布”这样的术语,它是指总体的某个具体数量表征 ξ 服从什么分布规律.我们说对总体进行 n 次独立的重复试验或 n 次独立的观察,就是从总体中随机地抽取容量为 n 的子样,并用 ξ_1, \dots, ξ_n 表示.不难理解, ξ 及 ξ_1, \dots, ξ_n 都是随机变数, (ξ_1, \dots, ξ_n) 是 n 维随机向量.例如我们说整批灯泡的寿命分布如何,是指灯泡的寿命 ξ 服从什么分布.从整批灯泡中随机抽取容量为 n 的子样,是指随机抽取 n 个灯泡,观察这 n 个灯泡的寿命,用 ξ_1, \dots, ξ_n 表示,其中 ξ_i 表示随机抽取到的第 i 个灯泡的寿命,显然 ξ_i 也是一随机变数($i=1, \dots, n$).为区别总体与子样的概念,我们今后常用诸如“总体 ξ 服从什么分布”、“从总体 ξ 中抽取子样 ξ_1, \dots, ξ_n ”等这类术语.

我们在对总体进行研究中,当总体相当大时(指个体相当多时),只可能从总体中抽取部分个体来作研究,即抽取容量为 n 的子样来作研究.我们要从子样的观察或试验结果的特性来对总体的特性作出估计与推断,一方面自然要研究应该怎样从总体中抽取子样,使得子样在尽可能大的程度上能反映总体的特性;同时必须建立一整套的方法,使能根据所选取的子样的性质,来对总体的特性进行估计与推断.因此,我们在抽取子样来对总体作出估计与推断时,从总体中抽取子样必须是随机的,即每一个体都有同等

概率被抽取(当总体中的个体是有限个时,要用有返回抽取方式).其具体要求为两个方面:独立性,是指 ξ_1, \dots, ξ_n 相互独立;代表性,是指 ξ_1, \dots, ξ_n 中每一个都与总体 ξ 有相同分布.

定义 6.1.1 (简单随机子样) 设 ξ_1, \dots, ξ_n 为来自总体 ξ 的容量为 n 的子样, 如果 ξ_1, \dots, ξ_n 相互独立且每一个都是与总体 ξ 有相同分布的随机变数, 则称 ξ_1, \dots, ξ_n 为总体 ξ 的简单随机子样, 简称为简单子样或子样①.

在这一章中, 我们所讲子样 ξ_1, \dots, ξ_n , 无特别声明的话, 都是指简单子样, 即 ξ_1, \dots, ξ_n 相互独立且每一个都与总体 ξ 有相同的分布. 引入简单随机子样, 是基于要从子样所获得的概率统计特性来对总体的概率统计特性作出估计与推断. 对于简单随机子样, 我们可以应用概率论中对独立随机变数的情形所建立的许多重要的定理, 这些重要的结论为数理统计学提供了必要的基础.

二、统计量

子样 ξ_1, \dots, ξ_n 也可看作为 n 维随机向量 (ξ_1, \dots, ξ_n) . 记 x_i 为 ξ_i 的一次观察值, 并称 (x_1, \dots, x_n) 为子样的一次观察值. 子样 (ξ_1, \dots, ξ_n) 的所有可能取值的全体称为子样空间, 记作 \mathcal{X} , 它是 n 维空间或它的一个子集. 子样的一次观察值 (x_1, \dots, x_n) 就是子样空间 \mathcal{X} 中的一个点, 即 $(x_1, \dots, x_n) \in \mathcal{X}$.

定义 6.1.2 (统计量) 设 ξ_1, \dots, ξ_n 为总体 ξ 的子样, T 为子样空间 \mathcal{X} 中点 (x_1, \dots, x_n) 的实值函数, 作子样的函数 $T = T(\xi_1, \dots, \xi_n)$, T 的取值记为 $t = T(x_1, \dots, x_n)$. 若 $T(\xi_1, \dots, \xi_n)$ 也为一随机变数②, 则称 T 或 $T(\xi_1, \dots, \xi_n)$ 为统计量.

① 是指若 ξ 为定义在概率空间 (Ω, \mathcal{F}, P) 上的随机变数, 则 ξ_1, \dots, ξ_n 为概率空间 (Ω, \mathcal{F}, P) 上 n 个相互独立的并同 ξ 具有相同分布的随机变数.

② 具体要求就是 $T(\xi_1, \dots, \xi_n)$ 是 n 元可测实函数, 也就是在第二章中所述的 n 元随机变数, 它满足对每一 $t \in R_1$, 有 $\{T(\xi_1, \dots, \xi_n) = t\} \in \mathcal{F}$.

我们在用子样 ξ_1, \dots, ξ_n 获得的信息来对总体 ξ 作出估计与推断时,是按不同的统计问题的要求而规定子样的各种函数.在这本教材中,所涉及到的子样的各种函数 $T(\xi_1, \dots, \xi_n)$, $T(x_1, \dots, x_n)$ 一般都是多维连续函数,因而 $T(\xi_1, \dots, \xi_n)$ 都是随机变数.

例 6.1.1 设 ξ_1, \dots, ξ_n 为总体 ξ 的容量为 n 的子样,记

$$\bar{\xi} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \xi_i, \quad S^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (\xi_i - \bar{\xi})^2,$$

则 $\bar{\xi}$ 及 S^2 都是统计量,称 $\bar{\xi}$ 及 S^2 分别为子样 ξ_1, \dots, ξ_n 的平均值及方差.子样的观察值为 x_1, \dots, x_n , $\bar{\xi}$ 及 S^2 的观察值分别记作

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

今后,大写的 S^2 表示统计量,小写的 s^2 表示统计量 S^2 的观察值.

定义 6.1.3 (顺序统计量) 设 ξ_1, \dots, ξ_n 为总体 ξ 的子样,今由子样建立 n 个函数:

$$\xi_k^* = \xi_k^*(\xi_1, \dots, \xi_n) \quad k=1, \dots, n,$$

其中 ξ_k^* 为这样的统计量,它的观察值为 x_k^* , x_k^* 为子样 ξ_1, \dots, ξ_n 的观察值 x_1, \dots, x_n 中按大小由小至大排列:

$$x_1^* \leq \dots \leq x_k^* \leq \dots \leq x_n^*$$

后的第 k 个数值,则称 ξ_1^*, \dots, ξ_n^* 为顺序统计量.

易见, $\xi_1^* = \min\{\xi_1, \dots, \xi_n\}$, $\xi_n^* = \max\{\xi_1, \dots, \xi_n\}$. 称 ξ_1^* 为最小项统计量, ξ_n^* 为最大项统计量. 若 n 为奇数,则称 $\xi_{\frac{n+1}{2}}^*$ 为子样的中值; 若 n 为偶数,则称 $\xi_{\frac{n}{2}+1}^*$ 为子样的中值.

定义 6.1.4 (极差) 设 ξ_1, \dots, ξ_n 为总体 ξ 的子样,则称统计量 $D_n^* = \xi_n^* - \xi_1^*$ 为子样的极差.它是子样中最大值与最小值之差,反映了子样观察值的波动幅度.它同方差一样是反映观察值离散程度的数量指标,而且计算最方便.

• 4 •

例 6.1.2 设 ξ_1, \dots, ξ_5 为 ξ 的容量为 5 的子样, 今对这个子样作了三次观察, 其值如表 6.1.1 所示, 试求 $\bar{\xi}$ 、 S^2 及 D_n^* 的观察值.

表 6.1.1

x	ξ	ξ_1	ξ_2	ξ_3	ξ_4	ξ_5
	1		3	1	10	5
2		2	6	7	2	8
3		8	3	9	10	5

表 6.1.2

ξ_1^*	ξ_2^*	ξ_3^*	ξ_4^*	ξ_5^*	\bar{x}	s^2	D_n^*
1	3	5	6	10	5	9.2	9
2	2	6	7	8	5	6.4	6
3	5	8	9	10	7	6.8	7

三、小样问题与大样问题

统计量是我们对总体 ξ 的分布函数或数字特征进行估计与推断最重要的基本概念, 求出统计量 $T(\xi_1, \dots, \xi_n)$ 的分布函数是数理统计学的基本问题之一. 统计量的分布, 称为抽样分布.

设总体 ξ 的分布函数表达式已知, 对于任一自然数 n , 如能求出给定统计量 $T(\xi_1, \dots, \xi_n)$ 的分布函数, 这分布称为统计量 T 的精确分布. 求出统计量 T 的精确分布, 这对于数理统计学中的所谓小样问题 (即在子样容量 n 比较小的情况下所讨论的各种统计问题) 的研究是很重要的.

但一般说来, 要确定一个统计量的精确分布其难度比较大. 只对一些重要的特殊情形, 如总体 ξ 服从正态分布时, 已求出 t 统计量、 χ^2 统计量、 F 统计量等的精确分布. 它们在参数的估计及检验中起很重要的作用.

若统计量 $T(\xi_1, \dots, \xi_n)$ 的精确分布求不出来, 或其表达式非常复杂而难于应用, 但如能求出它在 $n \rightarrow \infty$ 时的极限分布, 那么这个统计量的极限分布对于数理统计学中的所谓大样问题 (即在子样容量 n 比较大的情况下讨论的各种统计问题) 的研究很有用. 但要注意, 在应用极限分布时, 要求子样的容量 n 比较大. 如第八章的 § 8.3 所讨论的非参数性假设检验问题, 是用检验统计量的极限分布, 因而子样容量 n 应取得比较大才行.

没有一般的标准来规定子样容量 n 所谓比较大或比较小. 确定较大或较小的标准, 同所考虑的统计量和讨论的统计问题及其要求有关. 同样大小的子样, 对于某个统计量来说是较大的, 而对于另一个统计量也许就不能认为较大了.

§ 6.2 子样的数字特征及其分布

一、经验分布与格列汶科定理

在实际工作中遇到各种各样的随机变数, 怎样确定它的分布函数 $F(x)$? 在概率论中, 我们介绍了常用的几种分布函数以及它们的一些性质, 在那里我们假定它们都是事先给定了的. 现在, 我们介绍用独立重复试验的方法, 利用子样建立一定的概率模型, 用由此所获得的概率统计特性来对总体 ξ 的分布函数 $F(x)$ 等作出估计与推断.

定义 6.2.1 (经验分布函数) 从总体 ξ 中抽取容量为 n 的子样 ξ_1, \dots, ξ_n , 当顺序统计量 $\xi_1^*, \xi_2^*, \dots, \xi_n^*$ 的值固定时, 对任何实数 x , 我们定义函数 $F_n^*(x)$:

$$F_n^*(x) = \begin{cases} 0, & x \leq \xi_1^* \\ \frac{k}{n}, & \xi_k^* < x \leq \xi_{k+1}^*, \quad k=1, \dots, n-1, \\ 1, & x > \xi_n^* \end{cases} \quad (6.2.1)$$

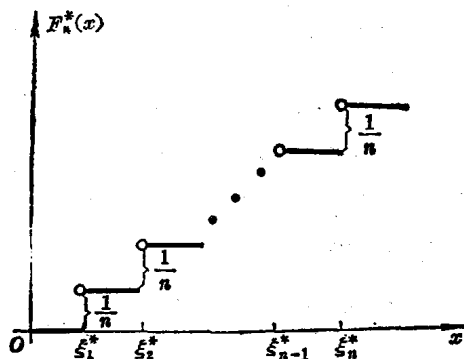


图 6.2.1

称 $F_n^*(x)$ 为总体 ξ 的经验分布函数^①.

易见, $F_n^*(x)$ 是单调、非降、左连续且在 $x = \xi_k^*$ 点有间断点, 在每个间断点上跳跃量都是 $\frac{1}{n}$. 显然, $0 \leq F_n^*(x) \leq 1$, 并具有分布函数的其它性质.

由定义 6.2.1 知, 对于 x 的每一数值而言, 经验分布函数 $F_n^*(x)$ 为子样 ξ_1, \dots, ξ_n 的函数, 它是一统计量, 即为一随机变数, 其可能取值为 $0, \frac{1}{n}, \dots, \frac{n-1}{n}, 1$. 事件 " $F_n^*(x) = \frac{k}{n}$ " 发生的概率, 由于 ξ_1, \dots, ξ_n 相互独立且有相同的分布函数 $F(x)$, 因而它等价于 n 次独立重复试验的贝努里概型中事件 " $\xi < x$ " 发生 k 次而其余 $n-k$ 次不发生的概率, 即有:

$$P\left\{F_n^*(x) = \frac{k}{n}\right\} = C_n^k \{F(x)\}^k \{1-F(x)\}^{n-k} \quad (6.2.2)$$

其中 $F(x) = P(\xi < x)$, 它是总体 ξ 的分布函数.

我们从第五章所讲的大数定律知道, 在满足一定的条件下, 事

^① 对于每一 ω , 即子样的一次观察值, 由 (6.2.1) 定义的 $F_n^*(x)$ 是实数 x 的函数, $x \in R_1$. 而对于每一 x 值, $F_n^*(x)$ 依赖于子样的观察值, 即为 ω 的函数, 因而 $F_n^*(x)$ 为一统计量.

件发生的频率依概率收敛于这个事件发生的概率。人们自然要问，总体 ξ 的经验分布函数 $F_n^*(x)$ ，即“ $\xi < x$ ”事件发生的频率，当 n 足够大时，是否也渐近于事件“ $\xi < x$ ”发生的概率，即总体 ξ 的分布函数 $F(x)$ 呢？格列汶科于 1933 年作了肯定的回答。

格列汶科定理 设总体 ξ 的分布函数为 $F(x)$ ，经验分布函数为 $F_n^*(x)$ ，对于任何实数 x ，记

$$D_n = \sup_{-\infty < x < +\infty} |F_n^*(x) - F(x)|, \quad (6.2.3)$$

则有

$$P\{\lim_{n \rightarrow \infty} D_n = 0\} = 1. \quad (6.2.4)$$

我们知道 $F_n^*(x)$ 为一统计量，因而 D_n 也为一统计量。 D_n 这个统计量用来衡量 $F_n^*(x)$ 同 $F(x)$ 之间在所有的 x 值上最大的差异程度。格列汶科定理证明了统计量 D_n 以概率为 1 地收敛于零。通俗地说，就是当 n 足够大时，对于所有的 x 值， $F_n^*(x)$ 同 $F(x)$ 之差的绝对值都很小这个事件发生的概率等于 1。但是格列汶科定理还未阐明统计量 D_n 服从什么分布或以什么分布为其极限分布。我们将在第八章的 § 8.3 中叙述两个重要定理，即柯尔莫哥洛夫定理和斯米尔诺夫定理。这两个定理找到了统计量 D_n 的极限分布表达式，这些定理在分布函数的假设检验中有重要的作用。

格列汶科定理的证明，附在本章的末尾，用小字体叙述。

二、子样的数字特征

1. 子样矩

设 $F_n^*(x)$ 为总体 ξ 的经验分布函数，记

$$A_r = \int_{-\infty}^{\infty} x^r dF_n^*(x) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \xi_i^r, \quad (6.2.5)$$

$$B_r = \int_{-\infty}^{\infty} (x - \bar{x})^r dF_n^*(x) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (\xi_i - \bar{\xi})^r. \quad (6.2.6)$$

称 A_r 及 B_r 分别为子样的 r 阶原点矩 及 r 阶中心矩, $r=1, 2, \dots$. 显然 $A_1 = \bar{\xi}$, $B_2 = S^2$. 由于 A_r 及 B_r 都是子样的连续函数, 因而都是统计量, 也即都是随机变数.

2. 协方差与相关系数

设 ξ_1, \dots, ξ_n 为总体 ξ 的子样, η_1, \dots, η_n 为总体 η 的子样, 记

$$\begin{aligned}\bar{\xi} &= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \xi_i, & S_1^2 &= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (\xi_i - \bar{\xi})^2 \\ \bar{\eta} &= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \eta_i, & S_2^2 &= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (\eta_i - \bar{\eta})^2 \\ S_{12} &= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (\xi_i - \bar{\xi})(\eta_i - \bar{\eta})\end{aligned}\quad (6.2.7)$$

称统计量 S_{12} 为两个子样之间的协方差, 称统计量

$$R = \frac{S_{12}}{S_1 \cdot S_2} \quad (6.2.8)$$

为两个子样之间的相关系数.

三、子样数字特征的分布

我们在这一段叙述子样的平均值、极值与极差的分布, 子样相关系数 R 的分布将在 § 8.3 中叙述, 子样方差 S^2 的分布在下一节中叙述.

1. 子样平均值的分布

设 $\varphi(t)$ 为总体 ξ 的特征函数, ξ_1, \dots, ξ_n 为总体 ξ 的子样, 则子样平均值 $\bar{\xi}$ 的特征函数为:

$$\begin{aligned}\varphi_1(t) &= [\varphi_0(t)]^n \\ &= \left[\varphi\left(\frac{t}{n}\right) \right]^n,\end{aligned}\quad (6.2.9)$$

其中 $\varphi_0(t) = \varphi\left(\frac{t}{n}\right)$, 它是 $\frac{1}{n}\xi$ 的特征函数.

例 6.2.1 设总体 ξ 服从正态 $N(a, \sigma)$, 求子样平均值 $\bar{\xi}$ 的

分布.

解 因 ξ 的特征函数为

$$\varphi(t) = \exp\left[-\frac{\sigma^2}{2}t^2 + jat\right],$$

则 $\bar{\xi}$ 的特征函数为

$$\begin{aligned}\varphi_1(t) &= \left\{ \exp\left[-\frac{\sigma^2}{2}\left(\frac{t}{n}\right)^2 + ja\frac{t}{n}\right] \right\}^n \\ &= \exp\left[-\frac{t^2}{2}\left(\frac{\sigma}{\sqrt{n}}\right)^2 + jat\right],\end{aligned}$$

即 $\bar{\xi}$ 服从正态 $N\left(a, \frac{\sigma}{\sqrt{n}}\right)$.

例 6.2.2 设总体 ξ 服从具有参数 λ 的泊松分布, 求子样平均值 $\bar{\xi}$ 的分布.

解 因 ξ 的特征函数为

$$\varphi(t) = \exp[\lambda(e^{jt} - 1)],$$

则 $\bar{\xi}$ 的特征函数为

$$\varphi_1(t) = \exp[n\lambda(e^{j\frac{t}{n}} - 1)],$$

即 $\bar{\xi}$ 的概率分布为

$$P\left(\bar{\xi} = \frac{k}{n}\right) = \frac{e^{-n\lambda}(n\lambda)^k}{k!}, \quad k=0, 1, 2, \dots$$

这是参数为 $n\lambda$ 的泊松分布.

例 6.2.3 设总体 ξ 服从具有参数为 λ 的指数分布, 求子样平均值 $\bar{\xi}$ 的分布.

ξ 的密度函数为

$$f(x) = \begin{cases} \lambda e^{-\lambda x}, & x > 0, \lambda > 0, \\ 0, & x \leq 0. \end{cases}$$

解 ξ 的特征函数为

$$\varphi(t) = \frac{\lambda}{\lambda - jt} = \left(1 - j\frac{t}{\lambda}\right)^{-1} \quad \lambda > 0,$$