

Sejam X_1, X_2, \dots, X_n uma sequência de variáveis aleatórias independentes e distribuídas de forma igual com $E[X_i] = \mu$ e $\text{Var}[X_i] = \sigma^2 < \infty$, e denote

$$S_n = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i$$

suas médias. Então quando n tende ao infinito, as variáveis aleatórias $\sqrt{n}(S_n - \mu)$ convergem em distribuição para uma normal $N(0, \sigma^2)$.