

Задания

- 1) Напишите подпрограмму генерирования одной реализации нормального случайного вектора (ξ_1, \dots, ξ_n) с известными средними значениями компонент и матрицей ковариаций.
- 2) Сгенерируйте выборку объема $N=1000$ реализаций нормального случайного вектора. Вектор средних и матрицу ковариаций задайте самостоятельно.
- 3) По χ^2 -критерию проверьте нормальность всех компонент полученного вектора при уровне значимости $\alpha = 0.05$. Сравните выборочные средние и матрицу ковариаций с теоретическими.