$$f_{\xi}(t)=\int_{-\infty}^{\infty}e^{itx}dF_{\xi}(x)=$$
  $\int_{-\infty}^{\infty}e^{itx}dF_{\xi}(x)=\int_{-\infty}^{\infty}e^{itx}p_{\xi}dx, p_{\xi}$ - плотность распределения Удобно использовать методы ТФКП