Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования «Национальный Исследовательский Университет ИТМО»

ЛАБОРАТОРНАЯ РАБОТА №1
ПРЕДМЕТ «МАТЕМАТИЧЕСКАЯ СТАТИСТИКА»

Вариант 4, 2

Преподаватель: Лимар И. А.
Студент: Румянцев А. А.
Поток: Мат Стат 31.2

Факультет: СУиР
Группа: R3341

Санкт-Петербург
2024

Содержание

1 Задание 1

1.1 Условие

В файле mobile_phones.csv приведены данные о мобильных телефонах. В сколько моделей можно вставить 2 сим-карты, сколько поддерживают 3-G, каково наибольшее число ядер у процессора? Рассчитайте выборочное среднее, выборочную дисперсию, выборочную медиану и выборочную квантиль порядка 2/5, построить график эмпирической функции распределения, гистограмму и box-plot для емкости аккумулятора для всей совокупности и в отдельности для поддерживающих/не поддерживающих Wi-Fi

1.2 Выполнение

Для начала импортируем необходимые библиотеки

```
import numpy as np
import pandas as pd
import matplotlib.pyplot as plt
```

Листинг 1: Импортирование библиотек

Теперь считаем таблицу по ссылке на представленный гугл-диск в переменную df

```
url='https://drive.google.com/file/d/104rFr9xg9aFmkjx4-hl_X0c5O9q65_EW\
    /view?usp=sharing'
url='https://drive.google.com/uc?id=' + url.split('/')[-2]
df = pd.read_csv(url)
```

Листинг 2: Считывание таблицы

В колонках «dual_sim» и «three_g» наличие или отсутствие параметра определяется единицей или нулем соответственно, следовательно, просуммировав значения в этих столбцах, получим количество моделей с наличием данных параметров. Для ядер просто выведем максимум из столбца. Используем методы библиотеки `pandas` – `sum` и `max`

```
# how many models can you insert 2 SIM cards into?
dual_sim_count = df['dual_sim'].sum()
print(f'dual_sim_count={dual_sim_count}')

# how many models support 3-G?
three_g_count = df['three_g'].sum()
print(f'three_g_count={three_g_count}')

# what is the highest number of cores a processor has?
max_cores = df['n_cores'].max()
print(f'max_cores={max_cores}')
```

Листинг 3: Код на ответы на первые три вопроса

Получим следующий вывод в консоль

```
dual_sim_count=1019
three_g_count=1523
max_cores=8
```

Листинг 4: Вывод в консоль: ответы на первые три вопроса

Для расчета необходимых характеристик я написал отдельный метод, куда достаточно передать выборку и ее именование для удобного вывода в консоль. Используем методы библиотеки `pandas` – `mean` посчитает выборочное среднее, `var` выборочную дисперсию, `median` выборочную медиану и `quantile` с параметром `q=2/5` квантиль порядка 2/5

```
# calculating the main values
def calculate_print_values(df: pd.Series, name: str):
    mean = df.mean()
    print(f'mean_{name}={mean}')

    var = df.var()
    print(f'var_{name}={var}')

    median = df.median()
    print(f'median_{name}={median}')

    quantile_2d5 = df.quantile(q=2/5)
    print(f'quantile_2/5_{name}={quantile_2d5}')
```

Листинг 5: Код для подсчета основных характеристик

Зададим сразу три выборки – всю, только модели с наличием Wi-Fi и только с отсутствием. Для составления выборок с конкретным значением требуемого параметра берем нужный столбец и составляем построчную связку индекс-булеан, где значением будет являться результат проверки заданного условия. Обращаемся к исходной таблице по этой связке и получаем новую таблицу только с теми строками, для которых по индексу значение было равным `True`, то есть условие выполнилось. Далее от полученной таблицы отбираем столбец по условию задания. Для удобного вывода добавим метод разделитель, который будем вызывать между операциями с выборками. Вызовем подсчитывающий метод три раза для трех выборок

```
# common separator between unrelated outputs
def print_separate():
    print('----------------')

# the entire sample
all_battery = df['battery_power']
calculate_print_values(all_battery, name='all_battery')

print_separate()

# selection with the condition of wifi availability
wifi_table = df[df['wifi']==1]
wifi_battery = wifi_table['battery_power']
calculate_print_values(wifi_battery, name='wifi_battery')

print_separate()

# selection with the condition of wifi unavailability
nowifi_table = df[df['wifi']==0]
no_wifi_battery = nowifi_table['battery_power']
calculate_print_values(no_wifi_battery, name='no_wifi_battery')
```

Листинг 6: Подготовка для удобного и быстрого получения результатов

С заданными ранее параметрами получаем следующий вывод в консоль

```
mean_all_battery=1238.5185
var_all_battery=193088.35983766883
median_all_battery=1226.0
```

```
quantile_2/5_all_battery=1076.0
----------------
mean_wifi_battery=1234.9043392504932
var_wifi_battery=190296.40051422242
median_wifi_battery=1233.0
quantile_2/5_wifi_battery=1077.8000000000002
----------------
mean_no_wifi_battery=1242.235294117647
var_no_wifi_battery=196128.43798148702
median_no_wifi_battery=1222.0
quantile_2/5_no_wifi_battery=1076.0
```

Листинг 7: Вывод в консоль: посчитанные основные характеристики

Теперь построим графики в соответствии с заданием. Напишем метод, который принимает выборку и название графика – таким образом, достаточно будет вызвать метод для каждой выборки и получить все графики. Используем библиотеку `matplotlib` для отрисовки, `pandas` для подсчета необходимых данных. Для построения графика эмпирической функции распределения находим по сортированным данным без сохранения индексов связку ключ-значение, где ключ – `battery_power`, значение – вероятность встретить именно такую `battery_power`. После составляем кумулятивные суммы по этим вероятностям. Для гистограммы определяем количество интервалов правилом Стёрджеса: $n = 1 + \log_2 N$ и округляем вниз

```
# plotting basic graphs
def show_graphs(df: pd.Series, name='sample'):
    # the resulting axis will be labeled 0, 1, ..., n - 1
    sorted_ = df.sort_values(ignore_index=True)

    # normalize for proportions (probabilities) instead of freqs
    # sorting by DataFrame column values (not by freqs)
    idx_prob = sorted_.value_counts(normalize=True, sort=False)

    # parsing x & y then cumsum for distribution function
    plt.plot(idx_prob.index, idx_prob.values.cumsum())
    plt.title(f'Empirical distribution function of {name}')
    plt.xlabel('battery_power')
    plt.ylabel('probability')
    plt.grid()
    plt.gcf().set_size_inches(10, 5)
    plt.show()

    # Sturges' rule
    n = np.int64(np.floor(1+3.322*np.log10(df.shape[0])))
    plt.hist(df, bins=n)
    plt.title(f'Histogram of {name}')
    plt.xlabel('battery_power')
    plt.ylabel('count')
    plt.grid()
    plt.gcf().set_size_inches(10, 5)
    plt.show()

    plt.boxplot(df)
    plt.title(f'Boxplot of {name}')
    plt.ylabel('battery_power')
    plt.grid()
    plt.gcf().set_size_inches(10, 5)
    plt.show()
```

Листинг 8: Код для построения необходимых графиков

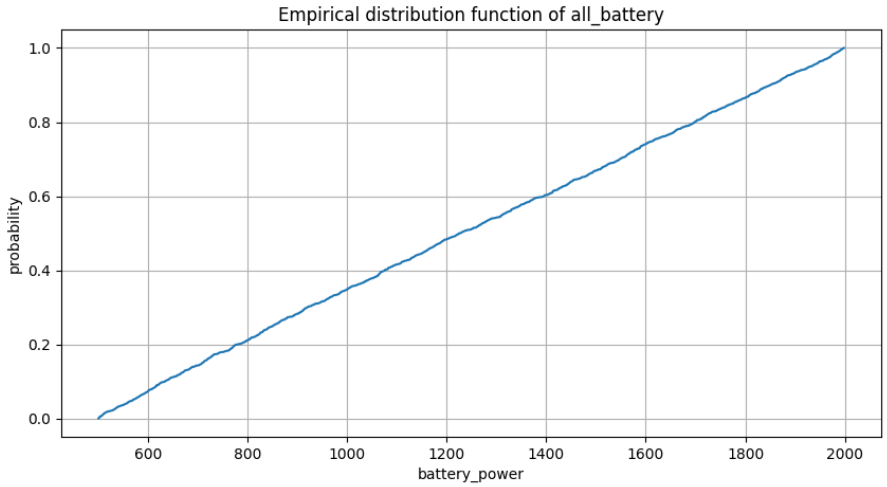

Рис. 1: График эмпирической функции распределения для всей выборки

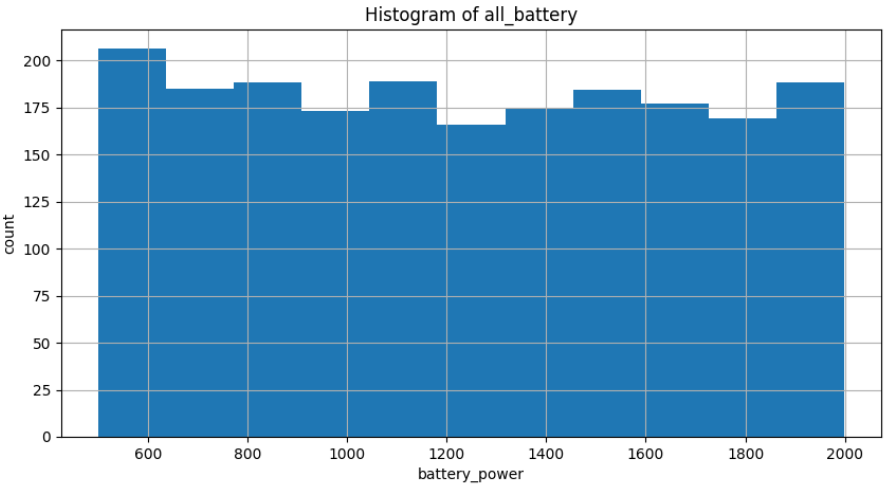

Рис. 2: Гистограмма для всей выборки

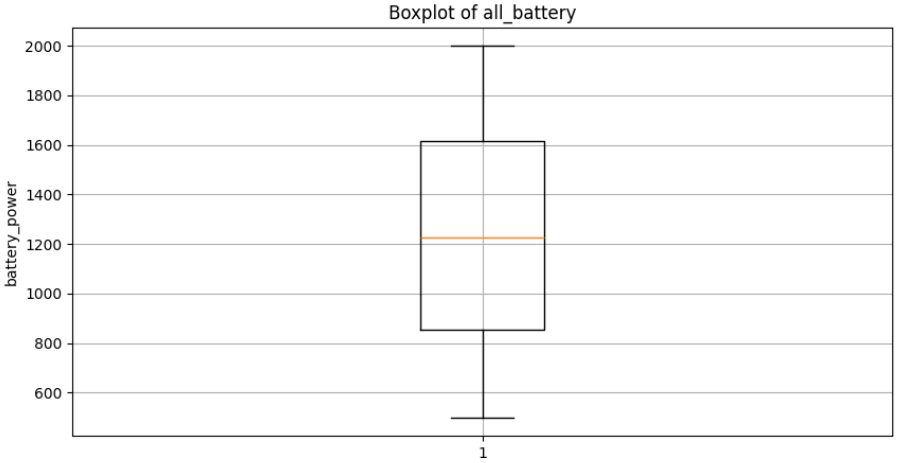

Рис. 3: Ящик с усами для всей выборки

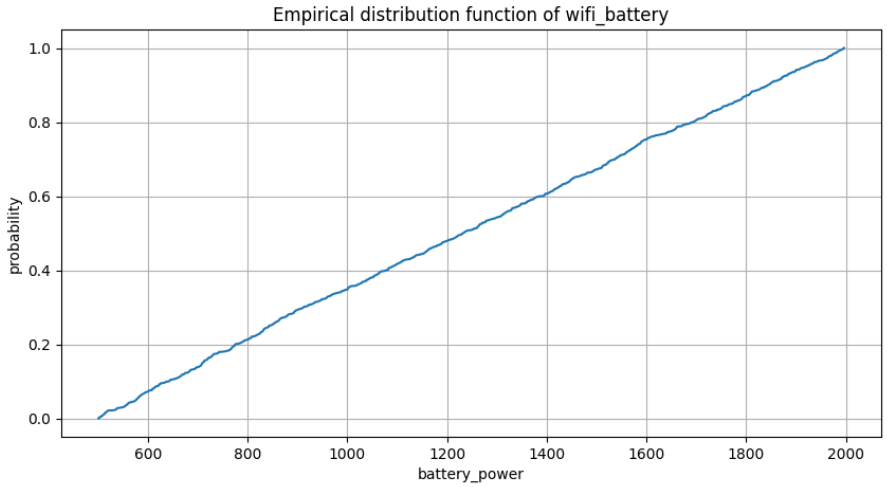

Рис. 4: График эмпирической функции распределения для выборки моделей с Wi-Fi

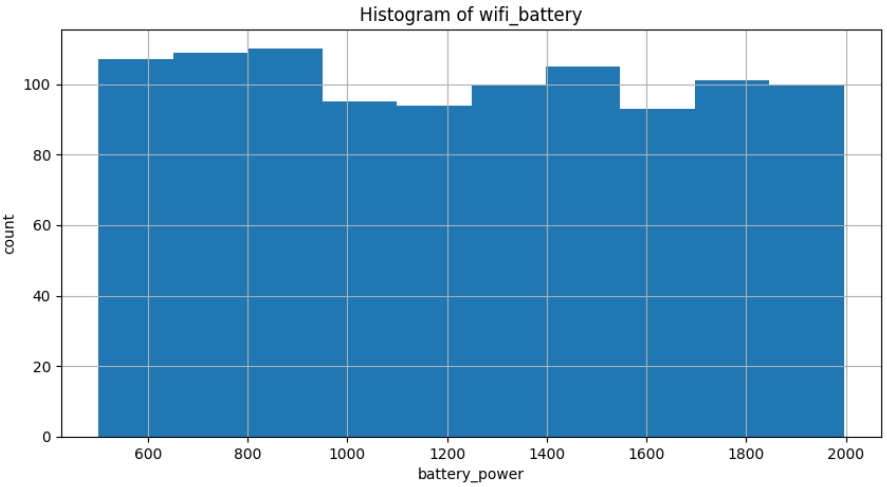

Рис. 5: Гистограмма для выборки моделей с Wi-Fi

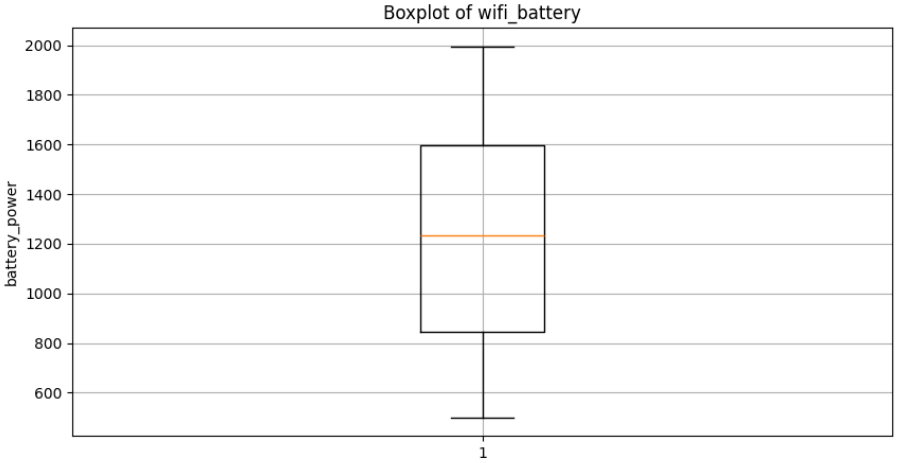

Рис. 6: Ящик с усами для выборки моделей с Wi-Fi

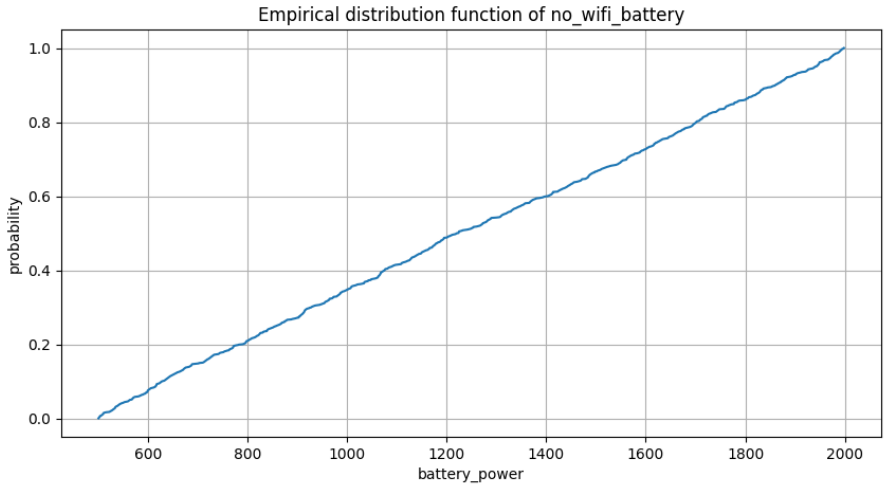

Рис. 7: График эмпирической функции распределения для выборки моделей без Wi-Fi

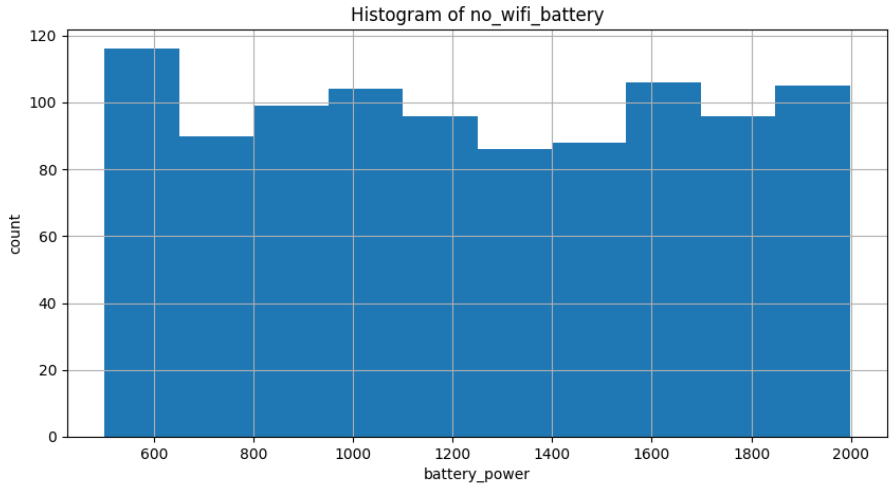

Рис. 8: Гистограмма для выборки моделей без Wi-Fi

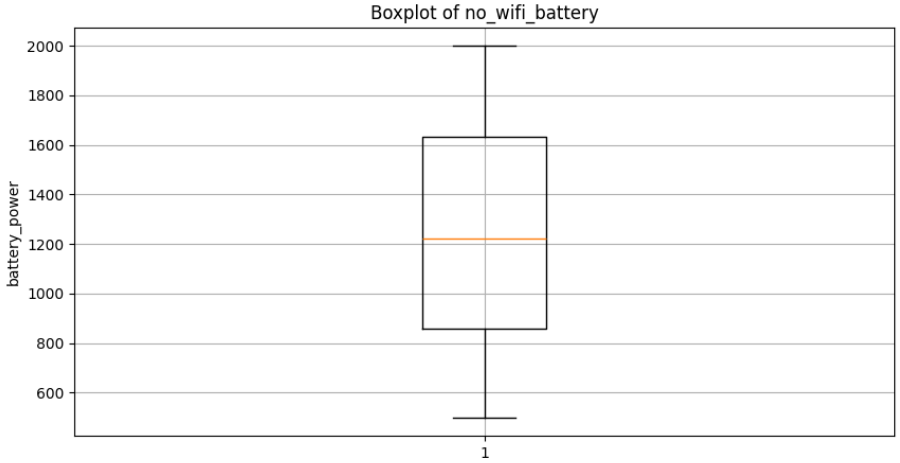

Рис. 9: Ящик с усами для выборки моделей без Wi-Fi

Исходя из результирующих графиков можно сделать вывод, что мы верно посчитали характеристики, представленные в листинге 7. На рис. 1 вероятность всегда неубывает, медиана прослеживается в районе значения, посчитанного ранее. На рис. 2 столбцы примерно одинаковой высоты – распределение скорее всего равномерное. На рис. 3 медиана отмечена оранжвой прямой, находится примерно в центре ящика – распределение данных относительно симметрично, и, ее значение совпадает с вычисленным. Интервал между минимумом и максимумом значений в ящике получился широким, что подтверждает большое значение вычисленной ранее дисперсии. Выбросы отсутствуют (нет точек вне усов). Рассуждения аналогичны для графиков с другой выборкой.

2 Задание 2

2.1 Условие

Методом моментов найти оценку квадрата масштабирующего параметра θ распределения Лапласа (сдвиг считать нулевым). Эксперимент при $\theta = 0.5$. **Указание**: для плотности используйте параметризацию

$$f_\theta(x) = \frac{1}{2\theta} \exp\left\{-\frac{|x|}{\theta}\right\}$$

Найти смещение, дисперсию, среднеквадратическую ошибку (**теоретические**) и указать свойства оценок. Также провести эксперимент при указанных параметрах по следующей схеме:

1. Задайте массив объемов выборки
2. Для каждого объема выборки n сгенерируйте m выборок из вашего распределения и для каждой сгенерированной выборки посчитайте оценку параметра согласно полученной формуле
3. Обработайте результаты (посчитайте выборочные характеристики для разницы между оценкой и реальным параметром для каждого объема выборки, количество выборок, для которых оценка отличается от реального параметра более чем на заданный вами порог и т. п.), визуализируйте результат

2.2 Выполнение

Чтобы найти $\hat{\theta}^2$ методом моментов, необходимо приравнять теоретический и эмпирический моменты порядка k. Теоретический выражается как функция от параметров распределения, которые мы оцениваем. Эмпирический определяется на основе данных выборки.

Для начала определимся с тем, сколько нужно задать функций $g_i(x)$, по которым мы будем искать оценки $\hat{\theta}_i$ параметров распределения – нам известен сдвиг $\mu = 0$ и нужно оценить только θ^2, следовательно количество неизвестных $d = 1$, а значит нам нужно задать одну функцию $g(x)$ и по ней найти одну оценку $\hat{\theta}^2$.

Начнем с нахождения теоретического момента. Нам необходимо задать такую функцию

$$g(x) = x^k,$$

которая при поиске k-го момента позволит нам получить выражение с θ^2, чтобы после приравнивания моментов мы могли выразить оценку $\hat{\theta}^2$ этого параметра.

Попробуем задать $g(x) = x$. В таком случае, согласно википедии, получим первый момент (математическое ожидание) для распределения Лапласа, равный(-ое) сдвигу μ, который в нашем случае отсутствует

$$\mathbb{E}\left[g(x)\right] = \mathbb{E}\left[x\right] = \mu = 0$$

С первым моментом выражения с θ^2 не получилось. Тогда, пусть $g(x) = x^2$ – теперь найдем второй момент для распределения Лапласа. Пользуясь википедией, получим

$$\mathbb{E}\left[g(x)\right] = \mathbb{E}\left[x^2\right] = \int\limits_{-\infty}^{\infty} x^2 f(x)\, dx = \mu^2 + 2\theta^2 = /\mu = 0/ = 2\theta^2$$

Мы получили теоретический момент порядка $k = 2$ для распределения Лапласа.

Найдем эмпирический момент порядка $k = 2$ для распределения Лапласа. Имеем на данный момент такое выражение

$$\mathbb{E}\left[g(x)\right] = \mathbb{E}\left[x^2\right] = 2\theta^2$$

Запишем вместо математического ожидания $\mathbb{E}\left[x^2\right]$ выборочный аналог таким способом

$$\mathbb{E}\left[g_i(x_j)\right] = \frac{1}{n}\sum_{j=1}^{n} g_i(x_j) \Rightarrow \mathbb{E}\left[g(x_j)\right] = \mathbb{E}\left[x_j^2\right] = \frac{1}{n}\sum_{j=1}^{n} x_j^2$$

Полученное для $\mathbb{E}\left[x_j^2\right]$ выражение является эмпирическим вторым моментом для распределения Лапласа.

Приравняем эмпирический и теоретический моменты второго порядка и выразим оценку квадрата параметра θ

$$\frac{1}{n}\sum_{j=1}^{n} x_j^2 = 2\theta^2 \Rightarrow \hat{\theta}^2 = \frac{1}{2n}\sum_{j=1}^{n} x_j^2$$

Таким образом, методом моментов оценка квадрата масштабирующего параметра θ распределения Лапласа имеет вид

$$\hat{\theta}^2 = \frac{1}{2n}\sum_{j=1}^{n} x_j^2$$

Далее будем находить характеристики и проводить эксперименты с данным в условии значением $\theta = 0.5$.

Смещение можно найти по следующей формуле

$$\text{bias}\left[\hat{\theta},\, \theta\right] = \mathbb{E}\left[\hat{\theta}\right] - \theta$$

Если результат выражения выше равен нулю, значит оценка является несмещенной. В нашем случае имеем

$$\text{bias}\left[\hat{\theta}^2,\, \theta^2\right] = \mathbb{E}\left[\hat{\theta}^2\right] - \theta^2$$

Вычислим это выражение, применяя свойства математического ожидания. θ^2 является константой и мы сразу можем ее вычислить. Рассмотрим подробнее $\mathbb{E}\left[\hat{\theta}^2\right]$

$$\mathbb{E}\left[\hat{\theta}^2\right] = \mathbb{E}\left[\frac{1}{2n}\sum_{j=1}^{n} x_j^2\right] = \frac{1}{2n}\mathbb{E}\left[\sum_{j=1}^{n} x_j^2\right] = \frac{1}{2n}\sum_{j=1}^{n}\mathbb{E}\left[x_j^2\right],$$

$$\sum_{j=1}^{n}\mathbb{E}\left[x_j^2\right] = \begin{bmatrix}\mathbb{E}\left[x^2\right] = 2\theta^2 \\ \mathbb{E}\left[x_1^2\right] = 2\theta^2 \\ \vdots \\ \mathbb{E}\left[x_n^2\right] = 2\theta^2\end{bmatrix} = n \cdot 2\theta^2,$$

$$\frac{1}{2n}\sum_{j=1}^{n}\mathbb{E}\left[x_j^2\right] = \frac{1}{2n}\cdot n \cdot 2\theta^2 = \theta^2 \Rightarrow \mathbb{E}\left[\hat{\theta}^2\right] = \theta^2$$

Теперь вычислим смещение

$$\mathrm{bias}\left[\hat{\theta}^2,\, \theta^2\right] = \mathbb{E}\left[\hat{\theta}^2\right] - \theta^2 = \theta^2 - \theta^2 = 0$$

Таким образом, оценка является несмещенной.

Вычислим теоретическую дисперсию оценки, пользуясь свойствами дисперсии и математического ожидания. В ходе вычислений вспомним биномиальный коэффициент и гамма функцию

$$\mathrm{Var}\left[\hat{\theta}^2\right] = \mathbb{E}\left[\hat{\theta}^4\right] - \left(\mathbb{E}\left[\hat{\theta}^2\right]\right)^2 = \begin{bmatrix}\mathbb{E}\left[\hat{\theta}^2\right] = \theta^2 \\ \mathbb{E}\left[\hat{\theta}^4\right] = \mathbb{E}\left[\left(\hat{\theta}^2\right)^2\right]\end{bmatrix} = \mathbb{E}\left[\left(\frac{1}{2n}\sum_{j=1}^{n} x_j^2\right)^2\right] - \left(\theta^2\right)^2,$$

$$\mathbb{E}\left[\left(\frac{1}{2n}\sum_{j=1}^{n} x_j^2\right)^2\right] = \frac{1}{4n^2}\mathbb{E}\left[\left(\sum_{j=1}^{n} x_j^2\right)^2\right],$$

$$\left(\sum_{j=1}^{n} x_j^2\right)^2 = \sum_{j=1}^{n} x_j^4 + 2\sum_{i\neq j} x_i^2 x_j^2 \Rightarrow \mathbb{E}\left[\hat{\theta}^4\right] = \frac{1}{4n^2}\mathbb{E}\left[\sum_{j=1}^{n} x_j^4 + 2\sum_{i\neq j} x_i^2 x_j^2\right],$$

$$\mathbb{E}\left[\sum_{j=1}^{n} x_j^4 + 2\sum_{i\neq j} x_i^2 x_j^2\right] = \mathbb{E}\left[\sum_{j=1}^{n} x_j^4\right] + \mathbb{E}\left[2\sum_{i\neq j} x_i^2 x_j^2\right] = \sum_{j=1}^{n} E\left[x_j^4\right] + 2\sum_{i\neq j}\mathbb{E}\left[x_i^2 x_j^2\right],$$

$$\sum_{i\neq j}\mathbb{E}\left[x_i^2 x_j^2\right] = /\text{случ. вел. } x_i \text{ независимы}/ = \sum_{i\neq j}\mathbb{E}\left[x_i^2\right]\mathbb{E}\left[x_j^2\right],$$

$$2\sum_{i\neq j}\mathbb{E}\left[x_i^2 x_j^2\right] = 2\sum_{i\neq j}\mathbb{E}\left[x_i^2\right]\mathbb{E}\left[x_j^2\right] = /\mathbb{E}\left[x^2\right] = 2\theta^2/ = 2\sum_{i\neq j} 2\theta^2 \cdot 2\theta^2 = 8\theta^4\sum_{i\neq j} 1,$$

$$\sum_{i\neq j} 1 = /\text{бином. коэфф.}/ = \binom{n}{k=2>0} = \frac{n\,(n-1)}{2},$$

$$2\sum_{i\neq j}\mathbb{E}\left[x_i^2 x_j^2\right] = 8\theta^4 \cdot \frac{n\,(n-1)}{2} = 4\theta^4 n\,(n-1),$$

$$\sum_{j=1}^{n} \mathbb{E}\left[x_j^4\right] = \begin{bmatrix} \mathbb{E}\left[x^4\right] = \alpha \\ \mathbb{E}\left[x_1^4\right] = \alpha \\ \vdots \\ \mathbb{E}\left[x_n^4\right] = \alpha \end{bmatrix} = n \cdot \mathbb{E}\left[x^4\right], \text{ где } \mathbb{E}\left[x^4\right] \text{ – четвертый момент,}$$

$$\mathbb{E}\left[x^4\right] = \int_{-\infty}^{\infty} x^4 f(x)\, dx = \int_{-\infty}^{\infty} x^4 \cdot \frac{1}{2\theta} \exp\left\{-\frac{|x|}{\theta}\right\} dx = \frac{1}{2\theta} \int_{-\infty}^{\infty} x^4 \exp\left\{-\frac{|x|}{\theta}\right\} dx$$

Так как в нашем распределении Лапласа сдвиг отсутствует ($\mu = 0$), то это означает, что распределение симметрично относительно нуля. Тогда, вычислим интеграл только для положительных значений x и умножим его на два. При условии $x \geq 0$ получаем $|x| = x$

$$\mathbb{E}\left[x^4\right] = \frac{1}{2\theta} \int_{-\infty}^{\infty} x^4 \exp\left\{-\frac{|x|}{\theta}\right\} dx = 2 \cdot \frac{1}{2\theta} \int_{0}^{\infty} x^4 \exp\left\{-\frac{x}{\theta}\right\} dx = \frac{1}{\theta} \int_{0}^{\infty} x^4 \exp\left\{-\frac{x}{\theta}\right\} dx,$$

$$\frac{1}{\theta} \int_{0}^{\infty} x^4 \exp\left\{-\frac{x}{\theta}\right\} dx = \begin{bmatrix} u = \dfrac{x}{\theta} \\ du = \dfrac{dx}{\theta} \end{bmatrix} = \frac{1}{\theta} \int_{0}^{\infty} u^4 \theta^4 e^{-u} \theta\, du = \theta^4 \int_{0}^{\infty} u^4 e^{-u}\, du = \theta^4 \cdot \Gamma(z),$$

$$\Gamma(z) = \int_{0}^{\infty} t^{z-1} e^{-t}\, dt \Rightarrow \int_{0}^{\infty} u^4 e^{-u}\, du = \Gamma(z - 1 = 4) = \Gamma(5) = 24 \Rightarrow \mathbb{E}\left[x^4\right] = \theta^4 \cdot \Gamma(5) = \theta^4 \cdot 24,$$

$$\sum_{j=1}^{n} \mathbb{E}\left[x_j^4\right] = n \cdot \mathbb{E}\left[x^4\right] = n \cdot \theta^4 \cdot 24,$$

$$\mathbb{E}\left[\hat{\theta}^4\right] = \frac{1}{4n^2} \left(\sum_{j=1}^{n} E\left[x_j^4\right] + 2 \sum_{i \neq j} \mathbb{E}\left[x_i^2 x_j^2\right] \right) = \frac{1}{4n^2} \left(24\theta^4 n + 4\theta^4 n\,(n-1)\right),$$

$$\frac{1}{4n^2} \left(24\theta^4 n + 4\theta^4 n\,(n-1)\right) = \frac{4\theta^4 n}{4n^2} (6 + n - 1) = \frac{\theta^4}{n} (n + 5) = \theta^4 \left(1 + \frac{5}{n}\right) = \mathbb{E}\left[\hat{\theta}^4\right],$$

$$\mathrm{Var}\left[\hat{\theta}^2\right] = \mathbb{E}\left[\hat{\theta}^4\right] - \left(\mathbb{E}\left[\hat{\theta}^2\right]\right)^2 = \theta^4 \left(1 + \frac{5}{n}\right) - \theta^4 = \theta^4 \left(1 + \frac{5}{n} - 1\right) = \frac{5\theta^4}{n}$$

При условии, что эксперимент проводится для $\theta = 0.5$, получим

$$\mathrm{Var}\left[\hat{\theta}^2\right] = \frac{5 \cdot 0.5^4}{n} = \frac{0.3125}{n}$$

На самом деле, вследствие независимости случайных величин x_i достаточно было вычислить выражение ниже, чтобы избежать лишних шагов, так как ковариации между независимыми случайными величинами равны нулю

$$\mathrm{Var}\left[\hat{\theta}^2\right] = \mathrm{Var}\left[\frac{1}{2n} \sum_{j=1}^{n} x_j^2\right] = \frac{1}{4n^2} \left(\sum_{j=1}^{n} \mathrm{Var}\left[x_j^2\right] + 2 \sum_{i \neq j} \mathrm{Cov}\ \left[x_i^2, x_j^2\right] \right) = \frac{1}{4n^2} \sum_{j=1}^{n} \mathrm{Var}\left[x_j^2\right]$$

Найдем теоретическую среднеквадратическую ошибку. Так как оценка является несмещенной, то теоретические среднеквадратическая ошибка и дисперсия равны. Таким образом, получим

$$\mathrm{MSE}\left[\hat{\theta}^2\right] = \mathrm{Var}\left[\hat{\theta}^2\right] = \frac{0.3125}{n}$$

Далее распишем свойства оценки. Мы уже знаем, что оценка является **несмещенной**, так как смещение $\text{bias}\left[\hat{\theta^2},\, \theta^2\right] = 0$ ($\mathbb{E}\left[\hat{\theta^2}\right] = \theta^2$), т. е. отсутствует.

Проверим состоятельность оценки

$$\lim_{n\to\infty} \text{MSE}\left[\hat{\theta^2}\right] = \lim_{n\to\infty} \text{Var}\left[\hat{\theta^2}\right] = \lim_{n\to\infty} \frac{0.3125}{n} = \left\{\frac{0.3125}{\infty}\right\} = 0,$$

из чего следует, что оценка является **состоятельной**, так как чем больше данных, тем более точной становится оценка.

Так как других оценок кроме полученной не имеется, не можем сравнить среднеквадратические ошибки оценок и на этой основе сделать вывод об эффективности – **эффективность не гарантируется**.

Проверим асимптотическую нормальность. Так как случайные величины

1. Независимы,
2. Одинаково распределены (все случ. вел. x_i имеют одно и то же распределение с одинаковыми мат. ожиданиями и дисперсией),
3. Имеют конечные математическое ожидание и дисперсию,

и, дисперсия среднего (то есть дисперсия квадрата оценки масштабирующего параметра θ) с увеличенем объема выборки уменьшается, то, по центральной предельной теореме (ЦПТ) сумма (или среднее) этих случайных величин при $n \to \infty$ будет приближаться по распределению d к нормальному распределению, то есть

$$\sqrt{n}\left(\hat{\theta} - \theta\right) \xrightarrow{d} \mathcal{N}\left(0, \sigma^2\left[\theta\right]\right),$$

что в нашем случае будет иметь вид

$$\sqrt{n}\left(\hat{\theta^2} - \theta^2\right) \xrightarrow{d} \mathcal{N}\left(0, \text{Var}\left[\hat{\theta^2}\right]\right),$$

$$\sqrt{n}\left(\frac{1}{2n}\sum_{j=1}^{n} x_j^2 - \theta^2\right) \xrightarrow{d} \mathcal{N}\left(0, \frac{5\theta^4}{n}\right),$$

где $\dfrac{1}{2n}\sum\limits_{j=1}^{n} x_j^2$ – среднее квадратичных отклонений. Следовательно, оценка является **асимптотически нормальной**.