

36. Построение доверительных интервалов с помощью нормального приближения.



Status

Completed

1. Строим некую функцию $G(\vec{X}, \theta) \Rightarrow \eta \sim N_{0,1}$
2. $P(t_1 < G < t_2) = 1 - \epsilon$, t_1, t_2 - квантили $N_{0,1}$.
3. Решаем двойное неравенство в вероятности для θ .

Обычно функция G использует ЦПТ и заменяет дисперсию или среднее в зависимости от свойств исходного распределения.



ТУТ НУЖНО НАПИСАТЬ ПРИМЕР С ПОСТРОЕНИЕМ ДИ ДЛЯ λ В РАСПРЕДЕЛЕНИИ ПУАССОНА