36. Построение доверительных интервалов с помощью нормального приближения.



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

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