

25. Теорема Гливенко-Кантелли.



Status

Completed

Теорема Гливенко-Кантелли

Пусть $X \sim F$, тогда при $n \rightarrow \infty$

$$\sup_y |F_n^*(y) - F(y)| \xrightarrow{P} 0.$$

Просто эмпирическая функция распределения сходится к теоретической.