

# 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  $\theta$ .

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



ТУТ НУЖНО НАПИСАТЬ ПРИМЕР С ПОСТРОЕНИЕМ ДИ ДЛЯ  $\lambda$  В РАСПРЕДЕЛЕНИИ ПУАССОНА