

Лекция 8. Случайные векторы

Усиленный закон больших чисел Этемади (завершение доказательства). Усиленный закон больших чисел Колмогорова для независимых одинаково распределенных величин. Формулировка усиленного закона больших чисел Колмогорова для независимых случайных величин с конечной дисперсией. Произведение мер. Теорема Фубини. Абсолютная непрерывность мер. Теорема Радона-Никодима (формулировка). Случайные векторы со значениями в пространстве \mathbb{R}^n . Функция распределения и плотность распределения (по мере Лебега) случайного вектора.

ВОПРОСЫ, КОТОРЫЕ ВОЙДУТ В ЭКЗАМЕНАЦИОННУЮ ПРОГРАММУ

8.1. Усиленный закон больших чисел Этемади. Усиленный закон больших чисел Колмогорова для независимых одинаково распределенных величин. Формулировка усиленного закона больших чисел Колмогорова для независимых случайных величин с конечной дисперсией.

8.2. Произведение вероятностных мер. Теорема Фубини.