THÉORÈME DE GLIVENKO (C5, E)
(04 / 11 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

(i) Soit $(\Omega, \mathscr{T}, P)$ un **espace probabilisé** et $X = (X_n)_{n \in \mathbf{N}^*}$ une **suite** de **va** réelles. On note $\varphi = (\varphi_n)_{n \in \mathbf{N}}$ la suite des **fonctions caractéristiques** associées à leurs **lois** respectives $P^{X(n)} = X_n(P)$, $\forall$ n $\in$ **N**.

Si φ tend (simplement) vers une fonction φ_∞ (cf **convergence simple**), alors le **théorème de V.I. GLIVENKO** consiste en la propriété suivante :

(1) $X_n \xrightarrow{\mathscr{L}} X_\infty \Leftrightarrow \varphi_\infty = \lim_n \varphi_n$ est une fonction caractéristique.

De plus, on a :

(2) $\varphi_\infty = \varphi_{X(\infty)}$ (fonction caractéristique de la variable X_∞ , notée ici $X(\infty)$).

(ii) La propriété précédente est à comparer au **théorème de DUGUÉ**.