

Primjer 0.1 Slučajna promjenljiva X ima normalnu raspodjelu sa parametrima m i σ^2 , ako je njena gustina

$$\varphi(t) = \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma^2}} e^{-\frac{(t-m)^2}{2\sigma^2}}, t \in \mathbb{R}.$$

Koristimo notaciju $X : \mathcal{N}(m, \sigma^2)$. Ako je $m = 0, \sigma^2 = 1$ koristimo notaciju $X^* : \mathcal{N}(0, 1)$, a za slučajnu promjenljivu X^* kažemo da ima standardnu normalnu raspodjelu. Za funkciju raspodjele slučajne promjenljive X^* koristi se oznaka Φ te je

$$\Phi(x) = P\{X^* < x\} = \int_{-\infty}^x \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{t^2}{2}}, -\infty < x < \infty.$$

Postoje tablice normalne raspodjele i u njima su date vrijednosti funkcije

$$\Phi^*(x) = \int_0^x \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{t^2}{2}}, x > 0.$$

Pomoću tablice tj. odgovarajućih vrijednosti za $\Phi^*(x)$ se dobijaju vrijednosti za

$$P\{X^* < a\}, P\{X^* > a\}, P\{a \leq X^* < b\}.$$

ПОСЛЈЕДИЦА 1.1 Моавр-Лепласова теорема. Нека $S_n : \mathcal{B}(n, p)$. Тада

$$(\forall x \in \mathbb{R}) P\left\{\frac{S_n - np}{\sqrt{npq}} < x\right\} \rightarrow \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^x e^{-\frac{t^2}{2}} dt, n \rightarrow \infty,$$

$$\text{tj. } \frac{S_n - np}{\sqrt{npq}} \xrightarrow{R} \mathcal{N}(0, 1) \text{ ili } \left(\frac{S_n}{n} - p\right) \sqrt{\frac{n}{pq}} \xrightarrow{R} \mathcal{N}(0, 1).$$

Дакле, у случају кад је n велико, случајне промјенљиве $\frac{S_n - np}{\sqrt{npq}}$ и $\left(\frac{S_n}{n} - p\right) \sqrt{\frac{n}{pq}}$ имају приближно $\mathcal{N}(0, 1)$ расподјелу.

Нормална апроксимација биномне расподјеле

Када је у биномном закону расподјеле $S : \mathcal{B}(n, p)$ број понављања опита n велики

израчунавање биномних вјероватноћа $P(S = k) = \binom{n}{k} p^k (1-p)^{n-k}$ постаје веома

компликовано због нумеричких тешкоћа.

Ако вјероватноћа p_n реализације догађаја A у n -том опиту зависи од n , тј. ако је $S_n \sim \mathcal{B}(n, p_n)$ тада се у случају да је $\lim_{n \rightarrow \infty} np_n = \lambda \geq 10$ користи нормална апроксимација

$$P(S_n = k) = P(S_n - np = k - np) = P\left(\frac{S_n - np}{\sqrt{npq}} = \frac{k - np}{\sqrt{npq}}\right) \sim \frac{1}{\sqrt{npq}} \varphi\left(\frac{k - np}{\sqrt{npq}}\right), n \rightarrow \infty \text{ гдје се}$$

вриједности функције $\varphi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{x^2}{2}}, -\infty < x < +\infty$ узимају из табеле (са стране 3 овог

документа).

Такође је $P(a \leq S_n \leq b) = P(a - np \leq S_n - np \leq b - np) =$

$$P\left(\frac{a - np}{\sqrt{npq}} \leq \frac{S_n - np}{\sqrt{npq}} \leq \frac{b - np}{\sqrt{npq}}\right) = P\left(\alpha \leq \frac{S_n - np}{\sqrt{npq}} \leq \beta\right) \approx \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{\alpha}^{\beta} e^{-\frac{x^2}{2}} dx = \Phi(x) \Big|_{\alpha}^{\beta}. \text{ У књигама се}$$

могу наћи табеле вриједности функције расподеле у једном од облика

$$\Phi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_0^x e^{-\frac{t}{2}} dt, x > 0 \text{ или } \Phi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^x e^{-\frac{t}{2}} dt, x > 0.$$

Примјер:

У једном складишту од 1000 производа је 20% производа прве класе. Ради контроле квалитета је 100 пута са враћањем узиман по један производ. Наћи вјероватноћу да број првокласних производа буде:

- а. Тачно 15 б. Мање од 15 ц. Најмање 30
 д. Не више од 25 е. Ни мање од 10 ни више од 20 ф. Бар 35.

Решење:

Нека је случајна промјенљива S_{100} једнака броју првокласних производа. Тада је

$$S_{100} : B(100, 0.2) \text{ јер је } n = 100, p = 0.2, np = 20, \sqrt{npq} = 4, S_{100}^* = \frac{S_{100} - 20}{4}.$$

$$\text{а. } P(S_{100} = 15) = P\left(\frac{S_{100} - 20}{4} = \frac{15 - 20}{4}\right) = P(S_{100}^* = -1.25) = \frac{1}{4} \varphi(1.25) = \frac{0.1826}{4} = 0.04315.$$

$$\begin{aligned} \text{б. } P(S_{100} < 15) &= P(0 \leq S_{100} \leq 14) = P\left(\frac{0 - 20}{4} \leq S_{100}^* \leq \frac{14 - 20}{4}\right) \\ &= P(-5 \leq S_{100}^* \leq -1.5) = \Phi(5) - \Phi(1.5) = 0.5 - 0.43319 = 0.06681 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \text{ц. } P(S_{100} \geq 30) &= P(30 \leq S_{100} \leq 100) = P\left(\frac{10}{4} \leq S_{100}^* \leq \frac{80}{4}\right) \\ &= P(2.5 \leq S_{100}^* \leq 20) = \Phi(20) - \Phi(2.5) = 0.5 - 0.49379 = 0.00621 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \text{д. } P(S_{100} \leq 25) &= P(0 \leq S_{100} \leq 25) = P\left(\frac{0 - 20}{4} \leq S_{100}^* \leq \frac{25 - 20}{4}\right) \\ &= P(-5 \leq S_{100}^* \leq 1.25) = \Phi(1.25) + \Phi(5) = 0.39435 + 0.5 = 0.89435 \end{aligned}$$

$$\text{е. } P(10 \leq S_{100} \leq 20) = P\left(\frac{10 - 20}{4} \leq S_{100}^* \leq \frac{20 - 20}{4}\right) = P(-2.5 \leq S_{100}^* \leq 0) = \Phi(2.5) = 0.49379$$

$$\begin{aligned} \text{ф. } P(S_{100} \geq 35) &= P(35 \leq S_{100} \leq 100) = P\left(\frac{15}{4} \leq S_{100}^* \leq \frac{80}{4}\right) \\ &= P(3.75 \leq S_{100}^* \leq 20) = \Phi(20) - \Phi(3.75) = 0.5 - 0.49991 = 0.00009 \end{aligned}$$

Познато је да у серији од 15000 производа има 12000 производа прве класе. Наћи вјероватноћу да у узорку од 300 случајно изабраних производа из те серије буде бар 70 производа друге класе.

Решење

Нека је

n = број изабраних производа,

p = вјероватноћа да производ буде друге класе, $q = 1 - p$,

S_n = случајна величина - број изабраних производа друге класе међу n изабраних производа,

k = захтијевани број изабраних производа друге класе међу n изабраних производа,

$$P(S_n \geq k) = P(k \leq S_n \leq n) = P\left(\frac{k - np}{\sqrt{npq}} \leq \frac{S_n - np}{\sqrt{npq}} \leq \frac{n - np}{\sqrt{npq}}\right) = P(\alpha \leq S_n^* \leq \beta), \quad S_n^* : N(0;1)$$

$$n = 300, p = \frac{3000}{15000} = 0.2, q = 0.8, k = 70, np = 60, npq = 48, \alpha = 1.44, \beta = 34.64,$$

$$P(S_n \geq 70) = P(\alpha \leq S_n^* \leq \beta) = P(1.44 \leq S_n^* \leq 34.64) = \Phi(34.64) - \Phi(1.44) = 0.5 - 0.4251 = 0.0749$$

Tablice

A) Normalna funkcija raspodjele: $\Phi^*(z_\alpha) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_0^{z_\alpha} e^{-\frac{t^2}{2}} dt$.

	0.00	0.01	0.02	0.03	0.04	0.05	0.06	0.07	0.08	0.09
0.0	.0000	.0040	.0080	.0120	.0159	.0199	.0239	.0279	.0319	.0359
0.1	.0398	.0438	.0478	.0517	.0557	.0596	.0636	.0675	.0714	.0753
0.2	.0793	.0832	.0871	.0910	.0948	.0987	.1026	.1064	.1103	.1141
0.3	.1179	.1217	.1255	.1293	.1331	.1368	.1406	.1443	.1480	.1517
0.4	.1554	.1591	.1628	.1664	.1700	.1736	.1772	.1808	.1844	.1879
0.5	.1915	.1950	.1985	.2019	.2054	.2088	.2123	.2157	.2190	.2224
0.6	.2257	.2291	.2324	.2357	.2389	.2422	.2454	.2486	.2518	.2549
0.7	.2580	.2612	.2642	.2673	.2704	.2734	.2764	.2794	.2823	.2852
0.8	.2881	.2910	.2939	.2967	.2995	.3023	.3051	.3078	.3106	.3133
0.9	.3159	.3186	.3212	.3238	.3264	.3289	.3315	.3340	.3365	.3380
1.0	.3413	.3438	.3461	.3485	.3508	.3531	.3554	.3577	.3599	.3621
1.1	.3643	.3665	.3686	.3718	.3729	.3749	.3770	.3790	.3810	.3830
1.2	.3849	.3869	.3888	.3907	.3925	.3944	.3962	.3980	.3997	.4015
1.3	.4032	.4049	.4066	.4083	.4099	.4115	.4131	.4147	.4162	.4177
1.4	.4192	.4207	.4222	.4236	.4251	.4265	.4279	.4292	.4306	.4319
1.5	.4332	.4345	.4357	.4370	.4382	.4394	.4406	.4418	.4430	.4441
1.6	.4452	.4463	.4474	.4485	.4495	.4505	.4515	.4525	.4535	.4545
1.7	.4554	.4564	.4573	.4582	.4591	.4599	.4608	.4616	.4625	.4633
1.8	.4641	.4649	.4656	.4664	.4671	.4678	.4686	.4693	.4699	.4706
1.9	.4713	.4719	.4726	.4732	.4738	.4744	.4750	.4758	.4762	.4767
2.0	.4773	.4778	.4783	.4788	.4793	.4798	.4803	.4808	.4812	.4817
2.1	.4821	.4826	.4830	.4834	.4838	.4842	.4846	.4850	.4854	.4857
2.2	.4861	.4865	.4868	.4871	.4875	.4878	.4881	.4884	.4887	.4890
2.3	.4893	.4896	.4898	.4901	.4904	.4906	.4909	.4911	.4913	.4916
2.4	.4918	.4920	.4922	.4925	.4927	.4929	.4931	.4932	.4934	.4936
2.5	.4938	.4940	.4941	.4943	.4945	.4946	.4948	.4949	.4951	.4952
2.6	.4953	.4955	.4956	.4957	.4959	.4960	.4961	.4962	.4963	.4964
2.7	.4965	.4966	.4967	.4968	.4969	.4970	.4971	.4972	.4973	.4974
2.8	.4974	.4975	.4976	.4977	.4977	.4978	.4979	.4980	.4980	.4981
2.9	.4981	.4982	.4983	.4984	.4984	.4984	.4985	.4985	.4986	.4986
3.0	.4986	.4987	.4987	.4988	.4988	.4988	.4989	.4989	.4989	.4990

