

ТВиМС. Практическое занятие №8

8. Локальная и интегральная теоремы Лапласа

Рассмотрим задачи с применением локальной и интегральной теорем Лапласа.

Вычисления по [формуле Бернулли](#) при больших n громоздки и требуют применение вычислительной техники и правильных алгоритмов нахождения результата. Локальная теорема Лапласа даёт асимптотическую формулу, позволяющую приближённо найти вероятность появления события ровно m раз в n испытаниях, если n достаточно велико.

8.1. Локальная теорема Муавра-Лапласа

Теорема 8.1 (Локальная теорема Муавра-Лапласа). Если вероятность p появления события A в каждом из n независимых испытаний постоянна и отлична от нуля и единицы, то вероятность $P_n(m)$ того, что событие A появится m раз в n испытаниях, приближённо равна (при $n \rightarrow \infty$, $p \neq 0$, $p \neq 1$):

$$P_n(m) \approx \frac{1}{\sqrt{npq}} f\left(\frac{m - np}{\sqrt{npq}}\right), \quad \text{где } f(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{x^2}{2}}. \quad (8.1)$$

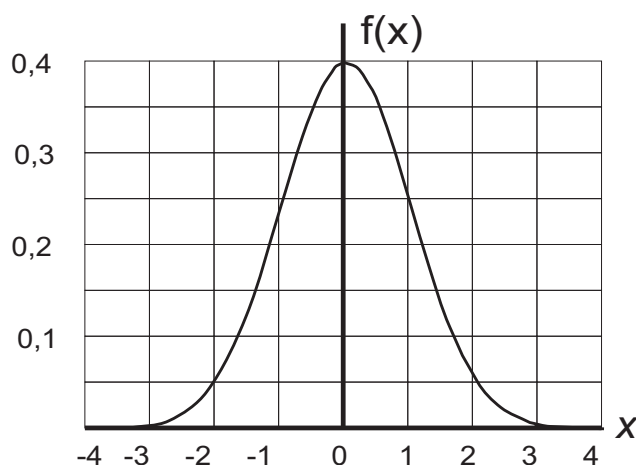


Рисунок 24. Функция $f(x)$

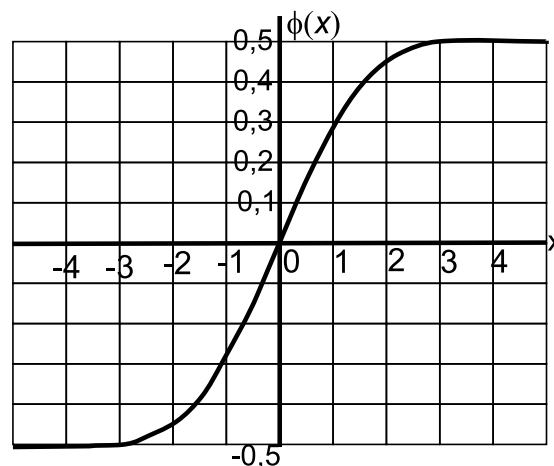


Рисунок 25. Функция $\Phi(x)$

Значение функции $f(x)$ можно найти в таблице [приложение 1](#), или вычислить на калькуляторе. В Excel эта функция встроена и для её вызова надо написать =НОРМ.СТ.РАСП(x;0). На рис. [24](#) представлен график функции

$f(x)$. Из графика видно, что значения функции вне области $|x| < 3$ практически равны нулю. Например, $f(\pm 3) \approx 0,0044$, $f(\pm 4) \approx 0,0001$. Функция является чётной, максимальное значение функции равно $\frac{1}{\sqrt{2\pi}} \approx 0,399$. Следовательно, максимальное значение вероятности достигается при $m = m^* = np$ и равно $P_n(m^*) = \frac{1}{\sqrt{2\pi npq}}$. Найдём значения m при котором вероятности $P_n(m)$ значимы. Решаем неравенство

$$\left| \frac{m - np}{\sqrt{npq}} \right| < 3 \Rightarrow -3\sqrt{npq} < m - np < 3\sqrt{npq} \Rightarrow m \in (np - 3\sqrt{npq}; np + 3\sqrt{npq}).$$

8.2. Интегральная теорема Муавра-Лапласа

Для вычисления суммарной («интегральной») вероятности того, что число появлений события A находится в заданных пределах при больших n также используется асимптотическая формула, позволяющая вычислять эту вероятность приближённо.

Для пользования этой формулой познакомимся с функцией Лапласа.

Определение 8.1. Функцией Лапласа $\Phi(x)$ называется:

$$\Phi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_0^x e^{-\frac{t^2}{2}} dt. \quad (8.2)$$

График функции Лапласа представлен на рис. 25. Функция является возрастающей, при этом $|\Phi(x)| < 0,5$, $\forall x \in (-\infty; \infty)$.

В Excel для вызова этой функции надо ввести команду: =НОРМ.СТ.РАСП(х,1)-0,5.

Теорема 8.2 (Интегральная теорема Лапласа). Если вероятность p появления события A в каждом из n независимых испытаний постоянна и отлична от нуля и единицы, то вероятность $P_n(m_1 \leq m \leq m_2)$ того, что событие A появится не менее m_1 , но не более m_2 раз в n испытаниях приближённо равна (при $n \rightarrow \infty$, $p \neq 0$, $p \neq 1$):

$$P_n(m_1 \leq m \leq m_2) \approx \Phi\left(\frac{m_2 - np}{\sqrt{npq}}\right) - \Phi\left(\frac{m_1 - np}{\sqrt{npq}}\right), \quad (8.3)$$

где $\Phi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_0^x e^{-\frac{t^2}{2}} dt$ — функция Лапласа.

Пример 8.1. Предприятие за смену выпускает 120 изделий. Вероятность того, что выпущенное изделие будет отнесено к высшему сорту, равна 0,56. Чему равна вероятность того, что среди выпущенных за смену изделий 67 окажется высшего сорта?

◀ В данной задаче $n = 120$, $p = 0,56$.

Следовательно, $q = 0,44$, $m = 67$, $npq = 29,568$.

Применим **локальную теорему Лапласа** (8.9). Найдём аргумент функции $\varphi(x)$

$$x = \frac{m - np}{\sqrt{npq}} = \frac{67 - 120 \cdot 0,56}{\sqrt{29,568}} \approx -0,04.$$

Используя таблицу, **приложение 1**, или используя калькулятор, находим значение функции $\varphi(x)$ $f(-0,04) = f(0,04) \approx 0,3986$.

Подставляем полученные значения в формулу (8.9)

$$P_{120}(67) = \frac{\varphi(x)}{\sqrt{npq}} \approx \frac{0,3986}{\sqrt{29,568}} \approx \mathbf{0,073}.$$

Нетрудно убедиться в том, что **наивероятнейшее число** здесь $m^* = 67$, однако вероятность появления m^* , как видим, сравнительно мала ($\approx 0,07$). Это объясняется тем, что значения вероятности распределены от $m = 0$ до $m = 120$.

Maxima-программа:

numer:true\$

L_Lapl(m, n, p):=(y:1/sqrt(n*p*(1-p)), y/sqrt(2*%pi)*exp(-0.5*((m-n*p)*y)^2));

L_Lapl(67,120,0.56);

(%o3) 0.0733

Ответ: $P_{120}(67) \approx 0,073$ ▶

Пример 8.2. В цехе работают 150 автоматических станков. Вероятность того, что любой станок в течение смены сломается одинакова для всех станков и равна 0,2. Найти вероятности того, что: а) за смену 35 станков потребуют к себе внимания; б) от 25 до 35 станков потребуют к себе внимания.

◀ а) В первом случае можно применить **локальную теорему Лапласа**, так как $n = 150$, $m = 35$, $p = 0,2$, $q = 0,8$ величина $npq = 24$. Найдём x по формуле (8.9)

$$x = \frac{m - np}{\sqrt{npq}} = \frac{35 - 150 \cdot 0,2}{\sqrt{24}} = \frac{5}{\sqrt{24}} \approx 1,02.$$

По таблице **приложение 1**, найдем $f(1,02) = 0,2371$ и, согласно (8.9), получим:

$$P_{150}(35) \approx 0,2371/\sqrt{24} \approx \mathbf{0,048}.$$

б) Во втором случае используем **интегральную теорему** (8.2). Здесь $m_1 = 25$, $m_2 = 35$,

$$x_1 = \frac{m_1 - np}{\sqrt{npq}} = \frac{25 - 30}{\sqrt{24}} \approx -1,02, \quad x_2 = \frac{m_2 - np}{\sqrt{npq}} = \frac{35 - 30}{\sqrt{24}} \approx 1,02.$$

Применяя формулу (8.3) и таблицу для **функции Лапласа**, **приложение 2**, найдем искомую вероятность

$$P_{150}(25 \leq m \leq 35) \approx \Phi(1,02) - \Phi(-1,02) = 2\Phi(1,02) \approx 2 \cdot 0,346 = \mathbf{0,692}. \quad \blacktriangleleft$$

Maxima-программа:

```
numer:true$ fpprintprec:4$ n:150$ p:0.2$ m1:25$ m2:35$
```

```
load(distrib)$
```

```
pdf_binomial(35,n,p);
```

```
(%o7) 0.067
```

```
c:1/sqrt(n*p*(1 - p)); x1:(m1-n*p)*c; x2:(m2 - n*p)*c;
```

```
(%o9) -1.021
```

```
(%o10) 1.021
```

```
/* Результаты по интегральной теореме Лапласа.*/
```

```
PL:cdf_normal(x2, 0, 1) - cdf_normal(x1, 0, 1);
```

```
(%o11) 0.693
```

Результаты по интегральной теореме Лапласа дают несколько заниженные значения.

Ответ: $P_{150}(35) \approx 0,048$; $P_{150}(25 \leq m \leq 35) \approx 0,739$. ▶

Пример 8.3. Доля изделий продукции завода высшего качества составляет 40%. Найти вероятности того, что из отобранных 300 изделий окажется высшего качества: а) от 110 до 140 изделий, б) не менее 110 изделий, в) не более 109 изделий.

◀ Воспользуемся **интегральной теоремой Лапласа**.

Здесь $n = 300$, $p = 0,4$, $q = 0,6$, $np = 120$.

а) Найдем аргументы функции Лапласа при $m_1 = 110$ и $m_2 = 140$:

$$x_1 = \frac{m_1 - np}{\sqrt{npq}} = \frac{110 - 300 \cdot 0,4}{\sqrt{72}} = -\frac{5}{3\sqrt{2}} \approx -1,18,$$

$$x_2 = \frac{m_2 - np}{\sqrt{npq}} = \frac{140 - 300 \cdot 0,4}{\sqrt{72}} = \frac{10}{3\sqrt{2}} \approx 2,36.$$

Тогда

$$P_{300}(110 \leq m \leq 140) \approx \Phi(2,36) - \Phi(-1,18) \approx 0,491 + 0,381 = \mathbf{0,872}.$$

Эта вероятность оказалась довольно высокой вследствие того, что были просуммированы вероятности вблизи **наивероятнейшего числа** $m^* = 120$.

б) В этой части задачи нужно положить $m_1 = 110$, а $m_2 = 300$. Значение x_1 было найдено в пункте а, другой параметр

$$x_2 = \frac{300 - 120}{\sqrt{72}} = \frac{180}{6\sqrt{2}} \approx 21,21.$$

Используя нечетность **функции Лапласа**, находим соответствующую вероятность,

$$P_{300}(110 \leq m \leq 300) \approx \Phi(21,21) - \Phi(-1,18) \approx 0,5 + 0,381 = \mathbf{0,881}.$$

в) Так как сумма вероятностей

$$P_{300}(0 \leq m \leq 109) \quad \text{и} \quad P_{300}(110 \leq m \leq 300)$$

равна 1, то

$$P_{300}(0 \leq m \leq 109) = 1 - P_{300}(110 \leq m \leq 300) \approx 1 - 0,881 = \mathbf{0,119}. \quad \blacktriangleright$$

Ответ: $P_{300}(110 \leq m \leq 140) \approx 0,872$; $P_{300}(110 \leq m \leq 300) \approx 0,881$;
 $P_{300}(0 \leq m \leq 109) \approx 0,119$.

Для случая, когда n велико и p мало (меньше 0,1), выражение (8.3) даёт плохую оценку. В этом случае пользуются асимптотической формулой Пуассона.

8.3. Формула Пуассона

Если вероятность p появления события A в испытании Бернулли близка к 0 или 1, то теоремы 8.1 и 8.2 неприменимы. В этом случае следует пользоваться приближённой формулой Пуассона для вычисления $P_n(m)$ при больших n .

Теорема 8.3. Если вероятность p появления события A в каждом из n независимых испытаний постоянна и близка к нулю, а n велико, то вероятность $P_n(m)$ того, что событие A появится m раз в n испытаниях приближённо равна (при $n \rightarrow \infty$, $p \rightarrow 0$, $np \rightarrow a$):

$$P_n(m) \approx \frac{(np)^m}{m!} e^{-np}. \quad (8.4)$$

Замечание 8.1. Случай, когда $p \approx 1$, сводится к рассмотренному, если вместо $P_n(m)$ вычислять равную ей вероятность $P_n(n-m)$ появления $n-m$ раз противоположного события \bar{A} , вероятность появления которого в одном испытании $q = 1 - p \approx 0$.

Пример 8.4. Вероятность того, что взятый наудачу с полки магазина компьютер неисправен, равна 0,003. В магазине находятся 200 компьютеров. Найти вероятности того, что в магазине три компьютера неисправны.

◀ Поскольку $n = 200$, $m = 3$, $p = 0,003 \Rightarrow np = 0,6$, поэтому можно применить формулу Пуассона (8.4).

$$P_{200}(3) = \frac{0,6^3 \cdot e^{-0,6}}{3!} \approx \mathbf{0,019}. \quad \blacktriangleright$$

Ответ: $P_{200}(3) \approx 0,019$.

Пример 8.5. Вероятность остановки автобуса из-за поломки в течение смены равна 0,004. Найти вероятности того, что в течение смены из 1000 машин, вышедших на линии, остановятся: а) две машины, б) пять машин, в) ни одна не остановится; г) менее пяти; д) более пяти.

◀ В данном случае $n = 1000$, $p = 0,004$, $np = 4$, поэтому можно применить формулу Пуассона (8.4).

а) Здесь $m = 2$ и

$$P_{1000}(2) = \frac{4^2 \cdot e^{-4}}{2!} = \frac{8}{e^4} \approx \mathbf{0,147}.$$

б) Так как $m = 5$, то

$$P_{1000}(5) = \frac{4^5 \cdot e^{-4}}{5!} \approx \frac{128}{15 \cdot 54,6} \approx \mathbf{0,156}.$$

в) При $m = 0$

$$P_{1000}(0) = \frac{1}{e^4} \approx \frac{1}{54,6} \approx \mathbf{0,018}.$$

г) $m < 5$

$$\begin{aligned} P_{1000}(m < 5) &= P_{1000}(0) + P_{1000}(1) + P_{1000}(2) + P_{1000}(3) + P_{1000}(4) = \\ &= \frac{1}{e^4} \left(1 + \frac{4}{1} + \frac{4^2}{2} + \frac{4^3}{6} + \frac{4^4}{24} \right) \approx \mathbf{0,629}. \end{aligned}$$

д) $m > 5$

$$P_{1000}(m > 5) = 1 - P_{1000}(m \leq 5) = 1 - (P_{1000}(m < 5) + P_{1000}(5)) \approx \mathbf{0,215}.$$

Ответ:

$$\begin{aligned} P_{1000}(2) &\approx 0,147; \quad P_{1000}(5) \approx 0,156; \quad P_{1000}(0) \approx 0,018; \\ P_{1000}(m < 5) &\approx 0,629; \quad P_{1000}(m > 5) \approx 0,215. \end{aligned}$$

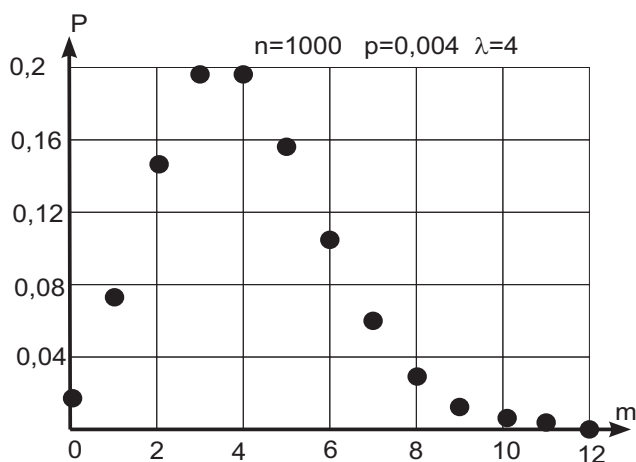


Рисунок 26. К примеру 8.5

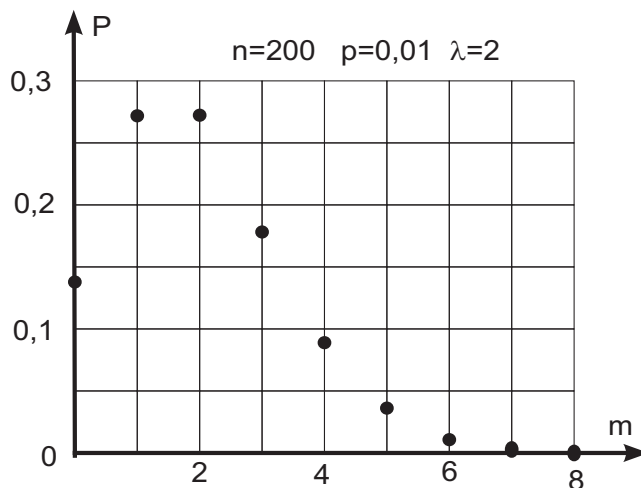


Рисунок 27. К примеру 8.6

Представим геометрическое изображение зависимости $P_n(m)$ примера 8.5, рис. 26.

```
kill(all)$ fpprintprec:4$
n:1000$ p:0.004$ L:n*p; array(P,n)$
fillarray(P, makelist(L^k/k!*exp(-L), k, 0 ,12))$
G:makelist([k,P[k]], k, 0, 12);
plot2d([discrete,G], [x,0,12],[style,points],
[gnuplot_postamble, "set grid;"],[title, "n=1000 p=0.004"])$
```


Пример 8.6. *Продукция некоторого производства содержит 1% бракованных изделий. Найти вероятность того, что среди 200 изделий окажется бракованных: а) ровно три, б) менее трёх, в) более трёх, г) хотя бы одно.*

◀ Так как $n = 200$, $p = 0,01$, $np = 2$. Следовательно можно применить формулу Пуассона (8.4)

а) Вероятность того, что три ($m = 3$) изделия будут бракованными,

$$P_{200}(3) = \frac{2^3 \cdot e^{-2}}{3!} \approx \mathbf{0,180}.$$

б) Вероятность того, что менее трёх ($m < 3$) изделий будут бракованными, найдется как сумма

$$P_{200}(m < 3) = P_{200}(0) + P_{200}(1) + P_{200}(2) = \frac{2^0 \cdot e^{-2}}{0!} + \frac{2^1 \cdot e^{-2}}{1!} + \frac{2^2 \cdot e^{-2}}{2!} = e^{-2}(1 + 2 + 2) \approx \mathbf{0,677}.$$

в) Поскольку сумма

$$\sum_{m=0}^{200} P_{200}(m) = 1,$$

то вероятность наличия более трёх ($m > 3$) бракованных изделий

$$P_{200}(m > 3) = 1 - \sum_{m=0}^3 P_{200}(m) \approx 1 - (0,677 + 0,180) = \mathbf{0,143}.$$

г) События «хотя бы одно изделие бракованное» и «ни одно изделие небракованное» противоположные, поэтому искомая вероятность

$$P = 1 - P_{200}(0) = 1 - e^{-2} \approx \mathbf{0,865}.$$

Представим геометрическое изображение зависимости $P_n(m)$ примера 8.6, рис. 27. ▶

Ответ: $P_{200}(3) \approx 0,180$; $P_{200}(m < 3) \approx 0,677$; $P_{200}(m > 3) \approx 0,143$.

Если в условиях применимости интегральной теоремы Лапласа требуется оценить отклонение относительной частоты появления события от соответствующей вероятности, то используют приближённую формулу (8.5).

8.4. Отклонение частоты от вероятности

Пусть проводятся испытания **Бернулли** с постоянной вероятностью p появления события A в каждом из них; событие A появилось m раз в n испытаниях. Найдем **вероятность** того, что **отклонение относительной частоты $\frac{m}{n}$ от вероятности p** по абсолютной величине не превышает заданного числа ε .

$$P\left(\left|\frac{m}{n} - p\right| \leq \varepsilon\right) \approx 2\Phi\left(\varepsilon\sqrt{\frac{n}{pq}}\right). \quad (8.5)$$

Пример 8.7. Вероятность появления события в каждом из 800 независимых испытаний равна 0,6. Найти вероятность того, что относительная частота появления события отклонится от его вероятности по абсолютной величине не более чем на 0,03.

◀ Здесь $n = 800$, $p = 0,6$, $q = 0,4$, $\varepsilon = 0,03$. Нужно найти вероятность

$$P\left(\left|\frac{m}{800} - 0,6\right| \leq 0,03\right).$$

По формуле (8.5) эта вероятность равна

$$2 \cdot \Phi\left(0,03 \cdot \sqrt{\frac{800}{0,6 \cdot 0,4}}\right) \approx 2 \cdot \Phi(1,73).$$

По таблицам найдем $\Phi(1,73) \approx 0,4582$. Следовательно, искомая вероятность равна $2 \cdot 0,4582 = \mathbf{0,9164}$. ▶

Ответ: $\approx 0,916$.

Пример 8.8. Вероятность появления события в каждом испытании равна 0,2. Сколько нужно провести испытаний, чтобы вероятность отклонения относительной частоты от вероятности этого события менее, чем 0,05 по абсолютной величине, была равно 0,95?

◀ Применяем формулу (8.5) $P\left(\left|\frac{m}{n} - p\right| \leq \varepsilon\right) \approx 2\Phi\left(\varepsilon\sqrt{\frac{n}{pq}}\right)$.

Здесь $p = 0,2$, $q = 1 - p = 0,8$, $\varepsilon = 0,05$. Левую часть уравнения приравняем к 0,95. Получаем уравнение

$$0,95 = 2\Phi\left(0,05 \cdot \frac{\sqrt{n}}{\sqrt{0,16}}\right).$$

$$\Phi\left(\frac{\sqrt{n}}{8}\right) = 0,475.$$

Из [таблицы для функции Лапласа](#) находим значение аргумента, при котором функция равна 0,475. Получаем

$$\frac{\sqrt{n}}{8} = 1,96 \Rightarrow n = (8 \cdot 1,96)^2 = 245,86 \Rightarrow \mathbf{n=246.} \quad \blacktriangleright$$

Ответ: $n = 246.$

Пример 8.9. В жилом доме имеется 1200 ламп, вероятность включения каждой из них в вечернее время равна 0,25.

- 1) Найти вероятность того, что число одновременно включенных ламп будет между 275 и 350.
- 2) Найти вероятность того, что относительная частота включенных лампочек будет отклоняться от вероятности менее чем на 0,01.
- 3) Найти наивероятнейшее число включенных лампочек m^* и значение вероятности $P_{1200}(m^*)$.

◀ 1) Воспользуемся [интегральной теоремой Лапласа](#) (8.3)

$$P_n(m_1 \leq m \leq m_2) \approx \Phi\left(\frac{m_2 - np}{\sqrt{npq}}\right) - \Phi\left(\frac{m_1 - np}{\sqrt{npq}}\right).$$

Здесь $n = 1200$, $m_1 = 275$, $m_2 = 350$, $p = 0,25$, $q = 0,75$. \Rightarrow

$$np = 300, \quad \sqrt{npq} = \sqrt{1200 \cdot \frac{1}{4} \cdot \frac{3}{4}} = \sqrt{225} = 15.$$

Получаем

$$P_{1200}(275 \leq m \leq 350) \approx \Phi\left(\frac{50}{15}\right) - \Phi\left(\frac{-25}{15}\right) = \\ = \Phi(3,33) + \Phi(1,67) \approx 0,49 + 0,4525 = \mathbf{0,9425}.$$

2) Применяем формулу (8.5) $P\left(\left|\frac{m}{n} - p\right| \leq \varepsilon\right) \approx 2\Phi\left(\varepsilon \sqrt{\frac{n}{pq}}\right).$

$$P\left(\left|\frac{m}{1200} - 0,25\right| \leq 0,01\right) \approx 2\Phi\left(0,01 \cdot \sqrt{\frac{1200}{0,75 \cdot 0,25}}\right) = \\ = 2\Phi(0,01 \cdot 80) = 2\Phi(0,8) = 2 \cdot 0,2881 = \mathbf{0,576}.$$

3) Применяем формулу для [наивероятнейшего числа](#) (7.3)

$$(n+1)p - 1 \leq m^* \leq (n+1)p.$$

Эту формулу можно записать в виде $np - q \leq m^* \leq np + p$.

Получаем, $299,25 \leq m^* \leq 300,25 \Rightarrow m^* = 300$.

Применим [локальную теорему Муавра-Лапласа](#). Находим искомую вероятность по формуле (8.9):

$$P_n(m) \approx \frac{1}{\sqrt{npq}} f\left(\frac{m - np}{\sqrt{npq}}\right), \quad \text{где } f(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{x^2}{2}}.$$

Получаем

$$P_{1200}(300) \approx \frac{1}{15} f(0) = \frac{0,3989}{15} \approx \mathbf{0,027}. \blacktriangleright$$

Ответ: 1) $\approx 0,9425$; 2) $\approx 0,576$; 3) $\approx 0,027$.

Задания для самостоятельной работы

8.1. Брак выпускаемых цехом деталей составляет 6%. Определить наиболее вероятное число m^* годных деталей в партии из 500 штук и найти вероятность того, что в этой партии будет m^* бракованных деталей.

Ответ $m^*=30$, $P=0,073$.

8.2. Предприятие выпускает 10% изделий второго сорта. Найти вероятность того, что из 200 выбранных случайным образом изделий, будет 15 изделий второго сорта.

Ответ: 0,05.

8.3. Вероятность того, что деталь не прошла проверку, равна 0,2. Найти вероятность того, что среди 400 случайно отобранных деталей непроверенными окажутся от 70 до 90.

Ответ: 0,7888

8.4. Вероятность, что изделие фабрики будет отличного качества, равна 0,75. Найти вероятность того, что из 100 изделий фабрики отличного качества будет: а) не менее 71 и не более 80 изделий, б) не менее 71 изделий, в) не более 70 изделий.

8.5. Вероятность брака при производстве деталей равна 0,001. Найти вероятности того, что в партии из 5000 деталей окажется: а) две бракованные детали, б) не менее двух бракованных деталей.

8.6. В институте 2500 студентов. Вероятность того, что один студент заболевает в течение недели, равна 0,002. Найти вероятность того, что в течение недели заболеет менее четырёх студентов.

8.7. Отдел технического контроля проверяет 625 изделий на брак. Вероятность того, что изделие бракованное, равна 0,02. Найти с вероятностью 0,95 границы, в которых будет заключено число m бракованных изделий среди проверенных.

8.8. Вероятность того, что диаметр вала меньше допустимого, больше допустимого и в допустимых пределах, равны соответственно 0,05; 0,08; 0,87. Из общей партии берутся для проверки 100 валов. Определить вероятность того, что среди них будет два вала с меньшим диаметром и один вал с большим диаметром.

8.9. Вероятность изготовления подшипникового шарика ниже третьего класса равна 0,0002. а) Определить вероятность того, что в партии из 400 шариков содержится хотя бы один ниже третьего класса. б) Какой должен быть объём партии, чтобы вероятность наличия в ней хотя бы одного бракованного шарика была не более $p_1 = 0,03$?