

Ifølge den centrale grænseværdisætningen kan fordelingen af antal “kroner” — som jo er en binomialfordeling med antalsparameter 100 og sandsynlighedsparameter $\frac{1}{2}$ — approksimeres med en normal fordeling med middelværdi 50 og standardafvigelse $\sqrt{100 \times 0.5 \times 0.5} = \sqrt{25} = 5$. Fordelingen af antal kroner er altså approksimativt den samme som fordelingen af $50 + 5U$, hvor U er normeret normalfordelt.