

Chapitre 7 : Les distributions de probabilité et calcul de paramètres

Objectif général du chapitre :

Connaitre les notions fondamentales de la probabilité et maîtriser le calcul de ses paramètres.

I. Rappel de probabilité

Objectifs spécifiques :

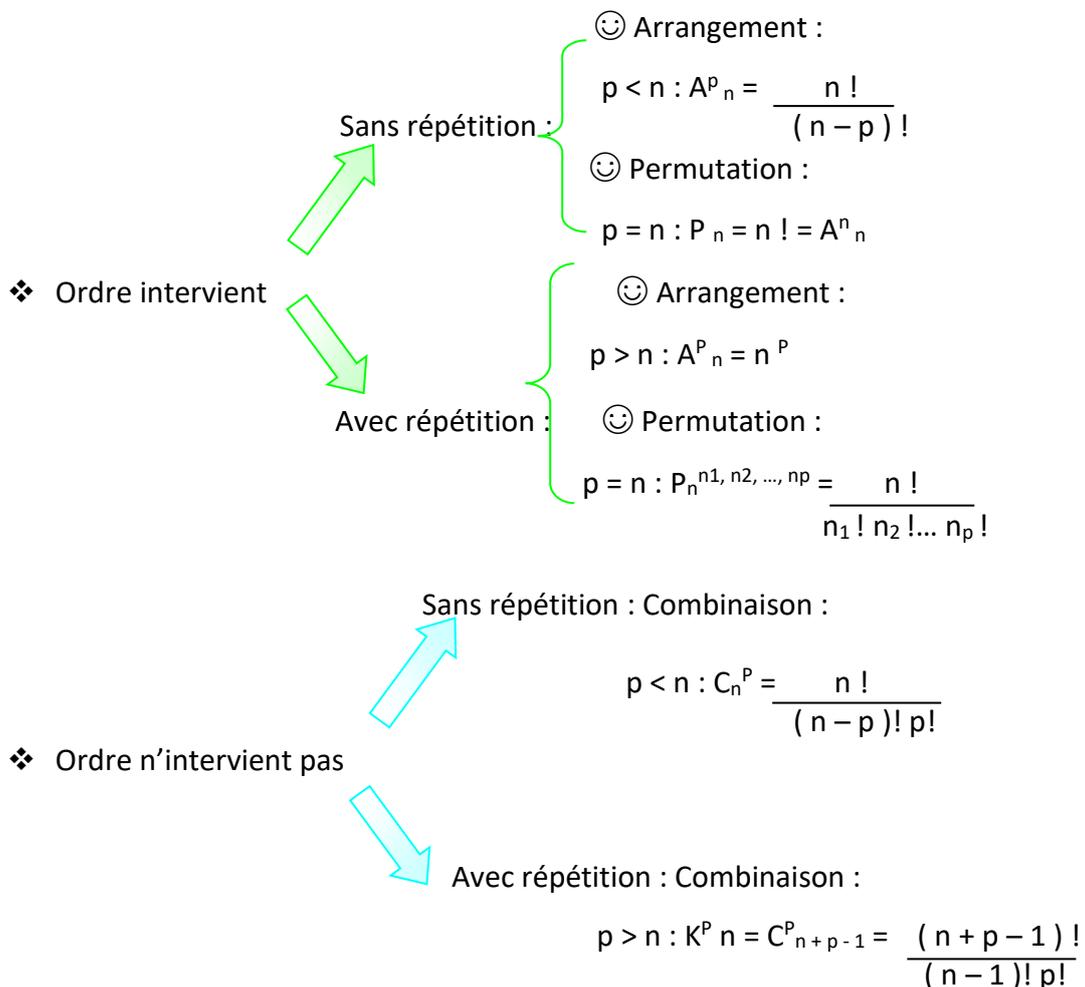
- Rappeler les connaissances ultérieures sur la probabilité.

Durée : 1,5 H.

Contenu :

1) L'analyse combinatoire :

Soit Ω est formé de « n » d'évènements possibles, avec « p » le nombre d'éléments choisis de n.



2) Définitions et axiomes de calcul de probabilités :

A / Définitions :

a – Expérience (ou épreuve) aléatoire : Dont le résultat n'est pas connu à l'avance.

Exemple : jet d'une pièce de monnaie.

b – Ensemble fondamental ou référentiel (noté Ω) :

C'est l'ensemble de toutes les éventualités (ou résultats) possibles d'une expérience aléatoire. Exemple : *Expérience aléatoire*

Jet d'une pièce de monnaie :

$$\Omega = \{ P, F \}.$$

Jet d'un dé :

$$\Omega = \{ 1, 2, 3, 4, 5, 6 \}.$$

Jet de deux dés :

$$\Omega = \{ (1, 1), (1, 2), \dots (6, 6) \}.$$

Ensemble fondamentale

c – Événement A : Est un sous-ensemble quelconque de Ω . Trois remarques sont évidentes :

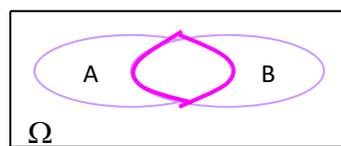
➤ Deux événements A et B peuvent être incompatibles (ne se produisent pas en même temps) ou compatibles (peuvent se réaliser en même temps).

➤ L'événement certain est celui qui se réalise toujours. Par ailleurs, l'événement impossible (noté \emptyset) est celui qui ne se produit jamais.

➤ L'événement contraire de A (noté \bar{A}) est le complémentaire de A dans Ω .

Deux opérations peuvent être effectuées sur les événements :

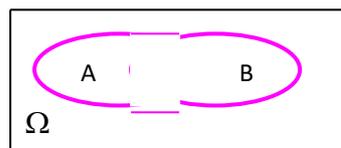
✓ $A \cap B$: est la réalisation simultanée de deux événements A et B.



Titre : Graphique 1 : Diagramme de VENN

L'intersection de deux évènements.

✓ $A \cup B$: est la réalisation d'au moins un des deux événements a et B (soit A ou B, soit les deux).



Titre : Graphique 2 :

L'union de deux évènements.

Ces deux opérations admettent plusieurs propriétés :

- $A \cup \bar{A} = \Omega$; $A \cup \emptyset = A$; $A \cup \Omega = \Omega$
- $A \cap \bar{A} = \emptyset$; $A \cap \emptyset = \emptyset$; $A \cap \Omega = A$
- $\overline{A \cup B} = \bar{A} \cap \bar{B}$ } C'est la loi de MORGAN.
- $A \cap B = \bar{\bar{A} \cup \bar{B}}$ }
- A et B sont deux événements incompatibles $\iff A \cap B = \emptyset$.
- $\overline{\bar{A}} = A$.

B/ Famille probabilisables ou Algèbre de BOOLE :

Soit β une famille d'événement de Ω . β est appelée algèbre de BOOLE si :

- ☼ β est stable par passage au complémentaire : Quel que soit $A \in \beta$, alors $\bar{A} \in \beta$.
- ☼ β est stable par passage à la réunion, quel que soit A et $B \in \beta$, alors, $A \cup B \in \beta$.

Deux conséquences se présentent suite à cette définition :

- ♪ $\Omega \in \beta$ et $\emptyset \in \beta$.
- ♪ Quel que soit A et $B \in \beta$, alors, $A \cap B \in \beta$.

C/ Les axiomes de calcul des probabilités :

a/ Définition :

Soit (Ω, β) un espace probabilisable. Soit une application $P : \beta \rightarrow [0, 1]$, tels que :

Axiome 1 : Quel que soit $A \in \beta$, $P(A) \geq 0$.

Axiome 2 : $P(\Omega) = 1$.

Axiome 3 : Quel que soit A et $B \in \beta$, tel que $A \cap B = \emptyset$, alors, $P(A \cup B) = P(A) + P(B)$.

Axiome 4 : Quel que soit $A_1, A_2, \dots, A_n \in \beta$, tel que $A_i \cap A_j = \emptyset$, avec $i \neq j$, alors :

$$P(A_1 \cup A_2 \cup \dots \cup A_n) = P\left(\bigcup_{i=1}^n A_i\right) = \sum_{i=1}^n P(A_i).$$

Remarque : Soit $\Omega = \{a_1, a_2, \dots, a_n\}$, alors deux choses doivent être notées :

- Les événements élémentaires $\{a_i\}$ sont équiprobables si :

$$P(\{a_1\}) = P(\{a_2\}) = \dots = P(\{a_n\}) = \frac{1}{n}.$$

- Si $A = \{a_1, a_2, \dots, a_k\}$, avec $k \leq n$, on :

$$P(A) = \frac{nb-de-cas-favorables-A}{nb-total-de-cas-possibles} = \frac{card(A)}{card(\Omega)}.$$

La probabilité P vérifie les propriétés suivantes.

b/ Propriétés :

- Quel que soit A et $B \in \beta$, tel que $A \subset B$, alors, $P(A) \leq P(B)$.
- Quel que soit $A \in \beta$, $P(\bar{A}) = 1 - P(A)$.
- $P(\emptyset) = 0$.
- Quel que soit A et $B \in \beta$, tel que $A \cap B = \emptyset$, alors, $P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A \cap B)$.

Cette dernière propriété peut être généralisée de la manière suivante :

Quel que soit $A_1, A_2, \dots, A_n \in \beta$, tels que $A_i \cap A_j = \emptyset$, avec $i \neq j$,

Alors, $P(A_1 \cup A_2 \cup \dots \cup A_n)$

$$= \sum_{i=1}^n P(A_i) - \sum_{i < j \leq n} P(A_i \cap A_j) + \sum_{i < j < k \leq n} P(A_i \cap A_j \cap A_k) - \dots + (-1)^{n-1} P(A_1 \cap A_2 \cap \dots \cap A_n).$$

Par exemple,

$$P(A_1 \cup A_2 \cup A_3) = P(A_1) + P(A_2) + P(A_3) - P(A_1 \cap A_2) - P(A_1 \cap A_3) - P(A_2 \cap A_3) + P(A_1 \cap A_2 \cap A_3).$$

D/ Les probabilités composées :

a/ La probabilité conditionnelle :

Soit A et $B \in \beta$, on appelle « probabilité conditionnelle de A relative à B » ou « probabilité

de réalisation de A sachant que B est réalisée » : $P(A / B) = \frac{P(A \cap B)}{P(B)}$, avec $P(B) \neq 0$.

De même, « probabilité de réalisation de B sachant que A est réalisée » : $P(B / A) = \frac{P(A \cap B)}{P(A)}$, avec

$P(A) \neq 0$.

b/ Les probabilités composées :

A partir des deux formules précédentes, on peut déduire que :

$$P(A \cap B) = P(A) \times P(B / A) = P(B) \times P(A / B).$$

c/ L'indépendance entre deux événements:

Deux événements A et B sont indépendants si : $P(A \cap B) = P(A) \times P(B)$.

L'indépendance est une relation réciproque.

Si A et B sont indépendants, alors, on remarque les propriétés suivantes :

- $P(A / B) = P(A)$, si $P(B) \neq 0$.
- $P(B / A) = P(B)$, si $P(A) \neq 0$.
- \bar{A} et B sont indépendants.
- A et \bar{B} sont indépendants.

- \bar{A} et \bar{B} sont indépendants.

d/ L'indépendance totale :

Les trois événements A, B, C seront dits totalement indépendants si les quatre conditions suivantes sont vérifiées :

- A et B sont indépendants.
- A et C sont indépendants.
- B et C sont indépendants.
- A, B et C sont indépendants ($P(A \cap B \cap C) = P(A) \times P(B) \times P(C)$).

II. Les distributions de probabilité

Objectifs spécifiques :

- Comprendre les distributions de probabilités et dénombrer leurs principes.

Durée : 1,5 H.

Contenu :

1) Définition d'une variable aléatoire (V. a) :

Soit (Ω, β, P) un espace probabilisé fini, on appelle Va X la fonction suivante :

$$X : \Omega \rightarrow \mathfrak{R}$$

$$\omega \rightarrow X(\omega) = x.$$

X est une variable aléatoire dont les valeurs sont des nombres donnés par les résultats d'une expérience.

Exemple 1 : On lance une pièce de monnaie deux fois et on considère la Va X suivante : le nombre de pile obtenues. Déterminer l'ensemble des valeurs possibles de X : $X(\Omega)$.

$$\Omega = \{ (P, P), (P, F), (F, P), (F, F) \}.$$

Donc, ω_1 nous donne deux fois pile, ω_2 : une pile puis une face, ω_3 : une face puis une pile. ω_4 : 2 fois face. (L'ordre intervient).

$$\text{Alors, } X(\Omega) = \{ 0, 1, 2 \}.$$

Selon la nature de la $X(\Omega)$, on définit deux types de variables aléatoires (discrète et continue).

2) La variable aléatoire discrète (V a D) :

a/ Définition : On dit que la variable aléatoire X est discrète si l'une de ces deux conditions est satisfaite :

- $X(\Omega)$ est un ensemble fini et dénombrable (exemple 1 : nombre de piles).
- $X(\Omega)$ est un ensemble infini et dénombrable (\mathbb{N}). Exemple 2 : Va X est le nombre de jets successifs nécessaire pour obtenir pile pour la première fois. $X(\Omega) = \{ 1, 2, \dots, n \}$.

b/ Loi de probabilité d'une Va D ou la distribution de probabilité de X : (notée P_x)

$$P_x: X(\Omega) \rightarrow [0, 1]$$

$$x \rightarrow P_x = P [X = x] = P [\omega / X(\omega) = x]$$

$P [X = x]$: est la probabilité que la Va X prenne la valeur x .

$P [\omega / X(\omega) = x]$: est la probabilité de l'événement ω pour lequel la Va X prenne la valeur x .

P_x possède deux propriétés :

◆ Quelque soit $x \in X(\Omega)$, $P_x \geq 0$.

$$\text{◆ } \sum_{i=1}^n P_{x_i} = 1.$$

Application à l'exemple 1 : Déterminez la loi de probabilité de la Va X (le nombre de piles).

$$\Omega = \{ (P, P), (P, F), (F, P), (F,F) \}.$$

$$X(\Omega) = \{ 0, 1, 2 \}.$$

Quelque soit $x \in X(\Omega)$, $P_x = P [X = x]$

$$P_0 = P [X = 0] = P [(F, F)] = \frac{1}{4}.$$

$$P_1 = P [X = 1] = P [(P, F), (F,P)] = \frac{2}{4}.$$

$$P_2 = P [X = 2] = P [(P, P)] = \frac{1}{4}.$$

| $X(\Omega)$ | P_x |
|-------------|---------------|
| $x_1 = 0$ | $\frac{1}{4}$ |
| $x_2 = 1$ | $\frac{2}{4}$ |
| $x_3 = 2$ | $\frac{1}{4}$ |
| Total | 1 |

Titre : Tableau 1 : Répartition de la loi de probabilité d'une pièce de monnaie selon le nombre de piles.

c/ La fonction de répartition d'une Va D (f. r) :

La fonction de répartition d'une Va D est, par définition, l'application :

$$F: \mathfrak{R} \rightarrow [0, 1]$$

$$x \rightarrow F(x) = P [X < x]$$

La formule de calcul de cette fonction de répartition est la suivante : $F(X) = P [X < x] = \sum_{xi(x)} P_{xi}$

Remarque : il faut noter qu'à partir de la fonction de répartition, on peut déterminer la loi de probabilité P_x grâce à la relation suivante : $P_{x_i} = F(x_{i+1}) - F(x_i)$.

La fonction de répartition présente les quatre propriétés suivantes :

- ◆ Quelque soit $x \in X(\Omega)$, $0 \leq F(x) \leq 1$.
- ◆ $\lim_{x \rightarrow -\infty} F(x) = 0$; $\lim_{x \rightarrow +\infty} F(x) = 1$.
- ◆ F est une fonction croissante : pour tout $x_1 > x_2$, $F(x_1) \geq F(x_2)$.
- ◆ F est une fonction continue à gauche et discontinue à droite.

Application à l'exemple 1 : Déterminez la fonction de répartition de la Va X (le nombre de pille).

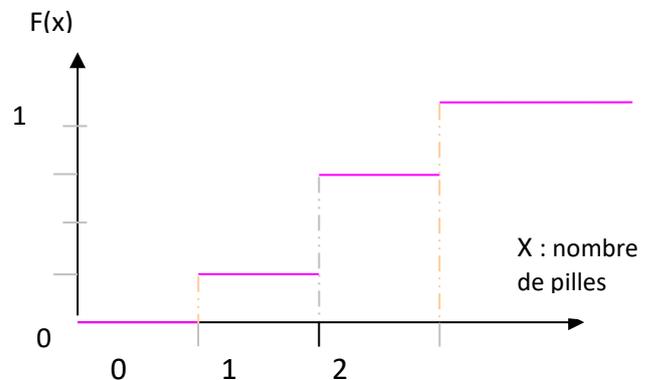
$$F(X) = P [X < x] = \sum_{xi(x)} P_{xi}$$

$$F(0) = P [X < 0] = \sum_{xi(0)} P_{xi} = 0.$$

$$F(1) = P [X < 1] = \sum_{xi(1)} P_{xi} = P_0 = \frac{1}{4}.$$

$$F(2) = P [X < 2] = \sum_{xi(2)} P_{xi} = P_0 + P_1 = \frac{3}{4}.$$

| X (Ω) | P _x | F(x) |
|--------------------|----------------|-------------------|
| x ₁ = 0 | $\frac{1}{4}$ | 0 |
| x ₂ = 1 | $\frac{2}{4}$ | $\frac{1}{4}$ |
| x ₃ = 2 | $\frac{1}{4}$ | $\frac{3}{4} < 1$ |
| Total | 1 | |



3) La variable aléatoire continue (Va C) :

a/ Définition : Une variable aléatoire X est dite continue si $X(\Omega)$ est un ensemble infini non dénombrable (prend la forme d'un intervalle ou une réunion d'intervalles).

Exemple 3 : X est le temps d'attente d'un bus, $X(\Omega) = [0, 20 \text{ min }]$.

b/ La fonction de répartition d'une Va C (f, r) :

La fonction de répartition d'une Va C est l'application $F : \mathfrak{R} \rightarrow [0, 1]$

$$x \rightarrow F(X) = P [X < x]$$

Sa formule de calcul s'écrit de la manière suivante : $F(X) = P [X < x] = \int_{-\infty}^x f(t) dt$

avec $f(t)$ la densité de probabilité (d. d. p) associée à Va t .

Cette fonction de répartition admet les propriétés suivantes :

- Quelque soit $x \in X (\Omega)$, $0 \leq F (X) \leq 1$.
- $\lim_{x \rightarrow -\infty} F(x) = 0$; $\lim_{x \rightarrow +\infty} F(x) = 1$.
- F est une fonction croissante : pour tout $x_1 > x_2$, $F (x_1) \geq F (x_2)$.
- F est une fonction continue et dérivable (sauf en un nombre finie de points).
- Quelque soit $x \in [a, b]$, avec a et b deux constantes, on a :

$$P [a \leq X \leq b] = P [X \leq b] - P [X \leq a] = F(b) - F(a).$$

- Quelque soit $x \in [a, b]$, avec a et b, c trois constantes, on a :

$$P [X \geq c] = 1 - P [X \leq c] = 1 - F(c).$$

- $P [X = a] = P [a \leq X \leq a] = F(a) - F(a) = 0$.

c/ La densité de probabilité d'une Va C (d d p) :

C'est la fonction $f(x) = F'(x)$.

Elle présente les propriétés suivantes :

♣ Quelque soit $x \in X (\Omega)$, $f(x) \geq 0$.

♣ Quelque soit $x \notin X (\Omega)$, $f(x) = 0$.

$$\spadesuit \int_{-\infty}^{+\infty} f(x) dx = 1.$$

Exemple d'application :
Soit la fonction suivante $f(x) = \begin{cases} k e^{-x/2}, & \text{si } x \geq 0. \\ 0 & , \text{sinon.} \end{cases}$

- Déterminez la constante k pour que $f(x)$ soit une d d p.
- Déterminez sa fonction de répartition (f, r).
- Déterminez la probabilité que : $\begin{cases} 2 < x < 4. \\ 5 < x. \\ x < -2. \end{cases}$

Solution :

1- $X (\Omega) = [0, +\infty [$, alors, $k e^{-x/2} \geq 0$, d'où $k \geq 0$.

Pour que $f(x)$ soit une d d p, il faut que $\int_{-\infty}^{+\infty} f(x) dx = 1 \Leftrightarrow \int_{-\infty}^0 f(x) dx + \int_0^{+\infty} f(x) dx = 1$

$$\Leftrightarrow \int_0^{+\infty} f(x) dx = 1 \text{ car } \int_{-\infty}^0 f(x) dx = 0 \text{ (puisque } f(x) \text{ n'est pas définie dans }] - \infty, 0] \text{).}$$

$$\Leftrightarrow \int_0^{+\infty} k e^{-\frac{x}{2}} dx = 1 \Leftrightarrow k \int_0^{+\infty} e^{-\frac{x}{2}} dx = 1 \Leftrightarrow k [-2 e^{-x/2}]_0^{+\infty} = 1,$$

puisque la primitive de e^{ax} est $\frac{e^{ax}}{a}$.

$$\Leftrightarrow -2k [e^{-\infty} - e^0] = 1 \Leftrightarrow 2k = 1, \text{ car } e^{-\infty} = 0 \text{ et } e^0 = 1 \Leftrightarrow k = \frac{1}{2}.$$

$$\Leftrightarrow f(x) = \begin{cases} \frac{1}{2} e^{-x/2}, & \text{si } x \geq 0. \\ 0 & , \text{sinon.} \end{cases}$$

2- La fonction de répartition de $f(x)$:

$$F(X) = P[X < x] = \int_{-\infty}^x f(t) dt \text{ avec } f(t) = \begin{cases} \frac{1}{2} e^{-t/2}, & \text{si } t \geq 0. \\ 0 & , \text{sinon.} \end{cases}$$

$$\text{Pour } x \in]-\infty, 0], F(X) = \int_{-\infty}^x f(t) dt = 0.$$

$$\begin{aligned} \text{Pour } x \in [0, +\infty[, F(X) &= \int_{-\infty}^x f(t) dt = \int_{-\infty}^0 f(t) dt + \int_0^x f(t) dt = \int_0^x f(t) dt \\ &= \frac{1}{2} \int_0^x e^{-\frac{t}{2}} dt = \frac{1}{2} [-2 e^{-\frac{t}{2}}]_0^x = -e^{-\frac{x}{2}} + e^0 = 1 - e^{-\frac{x}{2}}. \end{aligned}$$

$$\text{D'où, } F(x) = \begin{cases} 1 - e^{-\frac{x}{2}}, & \text{si } x \geq 0. \\ 0 & , \text{sinon.} \end{cases}$$

$$\begin{aligned} 3 - P[2 < X < 4] &= F(4) - F(2) \\ &= (1 - e^{-\frac{4}{2}}) - (1 - e^{-\frac{2}{2}}) = e^{-1} - e^{-2} = 0,232. \end{aligned}$$

$$* P[5 < x] = 1 - P[x < 5] = 1 - F(5) = 1 - (1 - e^{-\frac{5}{2}}) = 0,082.$$

$$* P[x < -2] = F(-2) = 0, \text{ car } -2 \notin X(\Omega).$$

III. Les caractéristiques d'une probabilité

Objectifs spécifiques :

- Identifier et maîtriser les caractéristiques d'une probabilité.

Durée : 1,5 H.

Contenu :

1) L'espérance mathématique :

a/ Définition : L'espérance mathématique d'une Va X , notée $E(X)$, est une moyenne arithmétique.

On va distinguer les deux cas : discret et continu.

Va D

$$E(X) = \sum_{i=1}^n x_i P_{xi}$$

Application à l'exemple 1 :

$$E(X) = (0 \times \frac{1}{4}) + (1 \times \frac{2}{4}) + (2 \times \frac{1}{4}) = 1$$

Va C

$$E(X) = \int_{-\infty}^{+\infty} xf(x)dx$$

Application à l'exemple 3 :

$$E(X) = \int_{-\infty}^{+\infty} x \frac{1}{2} e^{-\frac{x}{2}} dx$$

Rappel de l'intégration par partie :

$$\int_a^b u(t)v'(t)dt = [u(t)v(t)]_a^b - \int_a^b u'(t)v(t)dt$$

$$\text{On pose: } \begin{cases} u(t) = x \rightarrow u'(t) = 1 \\ v(t) = -e^{-\frac{x}{2}} \rightarrow v'(t) = \frac{1}{2} e^{-\frac{x}{2}} \end{cases}$$

$$\begin{aligned} E(X) &= \frac{1}{2} [x(-2)e^{-\frac{x}{2}}]_0^{+\infty} - \frac{1}{2} \int_0^{+\infty} -2e^{-\frac{x}{2}} dx \\ &= [-x e^{-\frac{x}{2}}]_0^{+\infty} + [-2 e^{-\frac{x}{2}}]_0^{+\infty} \\ &= 0 - 0 + (-2)(e^{\infty} - e^0) = -2(0 - 1) \\ E(X) &= 2. \end{aligned}$$

b/ Propriétés:

- La linéarité : quel que soit $(a, b) \in \mathbb{R}^2$, on a : $E(a + bX) = a + bE(X)$,
 $E(aX) = aE(X)$,
 $E(aX + b) = aE(X) + b$.
- Soit X et Y deux variables aléatoires, on a : $E(X + Y) = E(X) + E(Y)$.
- Soit X et Y deux variables aléatoires indépendantes, on a : $E(X \times Y) = E(X) \times E(Y)$

2) La variance :

a/ Définition : la variance d'une Va X (notée par V(X)) est définie par : $V(X) = E[X - E(X)]^2$.

On distingue les deux cas suivants :

Va D

$$\begin{aligned} V(X) &= E[X - E(X)]^2 \\ &= \sum_{i=1}^n [x_i - E(X)]^2 P_{xi} \end{aligned}$$

Va C

$$\begin{aligned} V(X) &= E[X - E(X)]^2 \\ &= \int_{-\infty}^{+\infty} [x - E(X)]^2 f(x)dx \end{aligned}$$

$$\sigma_{(X)} = \sqrt{V(X)}$$

Application à l'exemple 1:

| | | | |
|----------------|-----|-----|-----|
| X | 0 | 1 | 2 |
| P _x | 1/4 | 2/4 | 1/4 |

On a $E(X) = 1$,

$$V(X) = (0 - 1)^2 \frac{1}{4} + (1 - 1)^2 \frac{2}{4} + (2 - 1)^2 \frac{1}{4} = \frac{1}{2}$$

b/ Propriétés :

♠ La formule développée de la variance est : $V(X) = E(X^2) - [E(X)]^2$.

♠ La linéarité : quel que soit $(a, b) \in \mathbb{R}^2$, on a : $V(b) = 0$,

$$V(aX) = a^2 V(X),$$

$$V(aX + b) = a^2 V(X).$$

$$\sigma_{(aX+b)} = |a| \sigma(X).$$

♠ Soit X et Y deux variables indépendantes, on a : $V(X + Y) = V(X) + V(Y)$.

Exercice :

On tire, simultanément, deux boules sans remise d'une urne qui contient : une boule rouge, une blanche et une jaune. On considère que la Va X est : le nombre de boules rouge tirées.

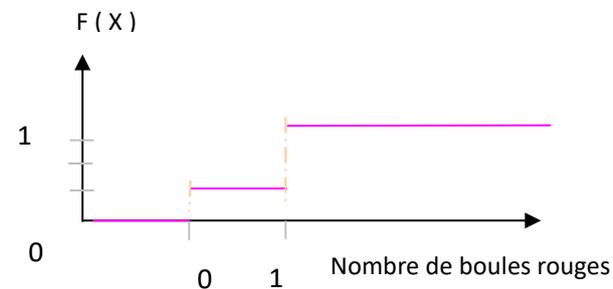


$\Omega = \{ (R, B), (R, J), (J, B) \}$
 $X(\Omega) = \{ 0, 1 \}$.

$$P_0 = \frac{1}{3}, P_1 = \frac{2}{3}.$$

$$F(X) = P[X \leq x] = \sum_{x_i(x)} P_{x_i}$$

| X (Ω) | P _x | F (X) |
|-------|----------------|-------|
| 0 | 1 / 3 | 0 |
| 1 | 2 / 3 | 1 / 3 |
| Total | 1 | |



$$E(X) = \sum_{i=1}^n x_i P_{x_i} = 0 \times \frac{1}{3} + 1 \times \frac{2}{3} = \frac{2}{3}.$$

$$V(X) = \sum_{i=1}^n [x_i - E(X)]^2 P_{x_i} = (0 - \frac{2}{3})^2 \times \frac{1}{3} + (\frac{1}{3} - \frac{2}{3})^2 \times \frac{2}{3} = \frac{2}{9}.$$

Exercice :

On lance trois pièces de monnaie une fois, combien d'entre elles présentent le côté face et quelles sont leurs probabilités correspondantes ?

| Résultat du lancement | FFF | FFP | FPF | PFF | FPP | PFP | PPF | PPP |
|-----------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| Nombre de face | 3 | 2 | 2 | 2 | 1 | 1 | 1 | 0 |
| Probabilité | 1 / 8 | 1 / 8 | 1 / 8 | 1 / 8 | 1 / 8 | 1 / 8 | 1 / 8 | 1 / 8 |

Titre : Tableau 4 : Probabilité d'une pièce de monnaies, lancée 3 fois, selon le nombre de faces.

La probabilité d'avoir deux fois face est :

| Nombre de face | 0 | 1 | 2 | 3 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|
| Probabilité | 1 / 8 | 3 / 8 | 3 / 8 | 1 / 8 |

Titre : Tableau 5 : Probabilité associée au nombre de faces.