Loi de probabilité á densité.

I. Introduction.

1) Variable aléatoire discrète

Exemple : Soit l'expérience aléatoire : "On lance un dé à six faces et on regarde le résultat." L'ensemble de toutes les issues possibles $\Omega = \{1 ; 2 ; 3 ; 4 ; 5 ; 6\}$ s'appelle l'univers des possibles. On considère l'événement A : "On obtient un résultat pair." On a donc : $A = \{2; 4; 6\}$. On considère l'événement élémentaire E : "On obtient un 5". On a donc : $E = \{5\}$.

On considère le jeu suivant :

- Si le résultat est pair, on gagne 1€.
- Si le résultat est 1, on gagne 5€.
- Si le résultat est 3 ou 5, on perd 2€.

On a défini ainsi une variable aléatoire X sur $\Omega = \{1; 2; 3; 4; 5; 6\}$ qui peut prendre les valeurs 1 , 5 ou -2.
On a donc : $X(1) = \frac{1}{6}$, $X(2) = \frac{1}{6}$, $X(3) = \frac{1}{6}$, $X(4) = \frac{1}{6}$, $X(5) = \frac{1}{6}$, $X(6) = \frac{1}{6}$
Pour une variable aléatoire discrète, la loi de probabilité peut être résumée dans un tableau :

x_i	1	5	-2
$P(X = x_i)$	$\frac{3}{6}$	1/6	2/6

La variable aléatoire ne prend qu'un nombre fini de valeurs, elle est dite discrète.

....

....

....

Il existe des variables aléatoires qui prennent n'importe quelle valeur dans un intervalle de IR.

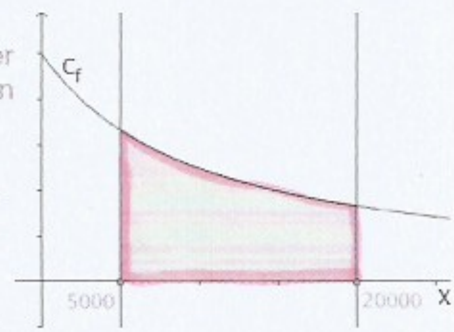
2) Variable aléatoire continue

Exemple : Une entreprise fabrique des disques durs. On définit une variable aléatoire qui, à chaque disque dur, associe sa durée de vie en heures. Cette durée n'est pas nécessairement un nombre entier et peut prendre toutes les valeurs de l'intervalle $[0 ; +\infty[$. Une telle variable aléatoire est dite continue.

3) Fonction à densité

Dans le cas d'une variable aléatoire continue qui prend pour valeurs les réels d'un intervalle I, sa loi de probabilit n'est pas associée à la probabilité de chacune de ses valeurs (comme dans le cas discret) mais à la probabilité d tout intervalle inclus dans I. On a ainsi recours à une fonction définie sur un intervalle I de IR et appelée fonction d densité.

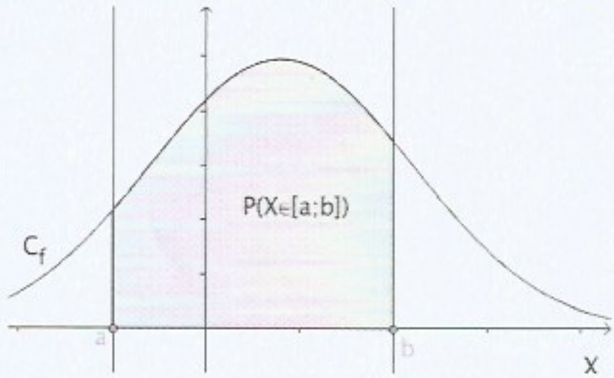
Exemple :Dans l'exemple précédent, on peut par exemple être mené à calculer $P(5000 \leq X \leq 20000)$ correspondant à la probabilité que la durée de vie d'un disque dur soit comprise entre 5000 heures et 20000 heures.
Pour cela, on utilise la fonction de densité f définissant la loi de probabilité.
La probabilité $P(5000 \leq X \leq 20000)$ est l'aire comprise entre l'axe des abscisses, la courbe représentative de la fonction de densité et les droites d'équations x=5000 et x=20000.



Ainsi : $P(5000 \leq X \leq 20000) = \int_{5000}^{20000} f(t)\,dt$.

Définition

On appelle **fonction de densité** (ou **densité**) toute fonction f définie, continue et positive sur un intervalle I telle que l'intégrale de f sur I soit égale à 1.
Si X est une variable aléatoire continue sur $[a;b]$, la probabilité de l'événement $\{X \in [a;b]\}$, où $[a;b]$ est un intervalle de I, est égale à l'aire sous la courbe f sur $[a;b]$, soit : $P(X \in [a;b]) = \int_a^b f(t)dt$.



Remarque :
- Dans le cas d'une variable aléatoire discrète, la somme des probabilités des événements $\{X = x_i\}$ est égale à 1.
- Dans le cas de variables aléatoires continues, on a :

$P(X \leq a) = P(X < a)$ car $P(X = a) = \int_a^a f(x)\,dx = 0$.

4) Espérance

Définition

Soit X une variable aléatoire continue de fonction de densité f sur un intervalle $[a;b]$.

L'espérance mathématique de X est le réel $\boxed{E(X) = \int_a^b t\,f(t)\,dt}$.

☑Savoir-faire : Savoir utiliser une loi de densité

Une entreprise produit des dalles en plâtre suivant une variable aléatoire continue X, en tonnes, qui prend ses valeurs dans l'intervalle [0 ; 20] avec une densité de probabilité f définie par : $f(x) = 0{,}015x - 0{,}00075x^2$
a) Démontrer que f est une densité de probabilité sur [0 ; 20].
b) Calculer la probabilité de l'événement E "La production quotidienne est supérieure ou égale à 12 tonnes".
c) Calculer l'espérance mathématique de X.

a) * f est continue car fonction polynome du second degré

*

x		0		20	
signes de $f(x)$	$-$	0	$+$	0	$-$

Donc f est positive sur [0;20]

* $\int_0^{20} f(x)dx = [0{,}0075x^2 - 0{,}00025x^3]_0^{20} = 0{,}0075 \times 20^2 - 0{,}00025 \times 2$
$= 1$

Donc f est continue, positive sur [0;20] et $\int_0^{20} f(x)dx = 1$
Donc f est une fonction de densité

b) $\int_{12}^{20} fx\,dx = [0{,}0075x^2 - 0{,}00025x^3]_{12}^{20} = 0{,}0075 \times 20^2 - 0{,}00025 \times 20^3 -$
$0{,}0075 \times 12^2 - 0{,}00025 \times 12^3$
$= 0{,}352$

c) $E(x) = \int_0^{20} xf(x)dx = \int_0^{20} 0{,}015x^2 - 0{,}00075x^3\,dx =$
$[0{,}005x^3 - 0{,}0001875x^4]_0^{20} = 10 - 0$
$E(x) = 10$

on peut esperer en moyenne une production de 10 tonnes cotidiennents.

$*\quad f(x) = k$

$\int_a^b f(x)\,dx = [kx]_a^b = kb - ka = 1$

$= k(b-a) = 1$

$k = \frac{1}{b-a}$

II. Loi uniforme.

1) Définition et propriété

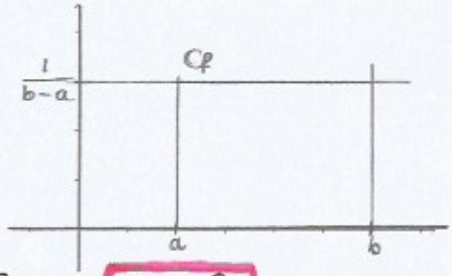
Définition

Soit a et b deux réels tels que $a < b$. La loi uniforme sur $[a;b]$, notée $U([a;b])$, est la loi ayant pour densité de probabilité la fonction constante f définie sur $[a;b]$ par : $f(x) = \frac{1}{b-a}$ *explication

Propriété

Soit X une variable aléatoire qui suit une loi uniforme $U([a;b])$.

Alors, pour tout x de $[a;b]$, on a : $P(a \leq X \leq x) = \frac{x-a}{b-a}$.



Démonstration :

$P(a \leqslant X \leqslant x) = \int_a^x \frac{1}{b-a}\,dt = \left[\frac{t}{b-a}\right]_a^x = \frac{x}{b-a} - \frac{a}{b-a} = \boxed{\frac{x-a}{b-a}}$

2) Espérance mathématique

Propriété

Soit X une variable aléatoire qui suit une loi uniforme $U([a;b])$. Alors : $E(X) = \frac{a+b}{2}$.

Démonstration :

$E(X) = \int_a^b x f(x)\,dx$. $f(x) = \frac{1}{b-a}$ $\quad E(X) = \int_a^b \frac{x}{b-a}\,dx = \left[\frac{1}{2}\frac{x^2}{(b-a)}\right]_a^b$

$= \frac{1}{2}\frac{b^2}{(b-a)} - \frac{1}{2}\frac{a^2}{(b-a)} = \frac{b^2-a^2}{2(b-a)} = \frac{(a+b)(b-a)}{2\,(b-a)} = \frac{a+b}{2}$.

III. Loi exponentielle.

1) Définition et propriétés

Définition

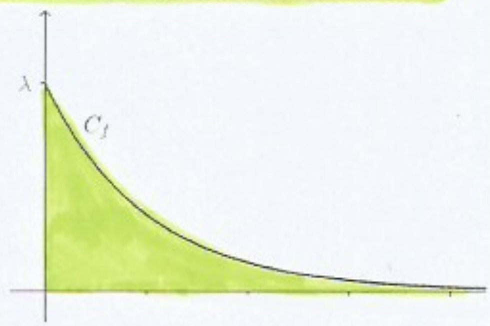
Soit λ un réel strictement positif. La loi exponentielle de paramètre λ est la loi ayant pour densité de probabilité la fonction f définie sur $[0;+\infty[$ par : $f(x) = \lambda e^{-\lambda x}$. $\int_0^{+\infty} \lambda e^{-\lambda t} = 1$

Contextes d'utilisation : *Durée de vie de composants électroniques, tremblement de terre, désintégration d'un noyau radioactif, …*

Propriété

Soit X une variable aléatoire qui suit une loi exponentielle de paramètre λ.

Alors, pour tout x de $[0;+\infty[$, on a : $P(X \leq x) = 1 - e^{-\lambda x}$.



Démonstration :

$P(X \leq x) = \int_0^x \lambda e^{-\lambda t}\, dt = \left[-e^{-\lambda t}\right]_0^x = e^{-\lambda x} - \left(-e^{-\lambda \times 0}\right) = 1 - e^{-\lambda x}$.

Exemple : X une variable aléatoire qui suit une loi exponentielle de paramètre 0,1.

$$P(1 \leq X \leq 3) = P(X \leq 3) - P(X < 1) = 1 - e^{-0,1\times 3} - \left(1 - e^{-0,1\times 1}\right) = e^{-0,1} - e^{-0,3} \approx 0,164$$

2) Durée de vie sans vieillissement

Propriété

Soit X une variable aléatoire qui suit une loi exponentielle de paramètre λ.
Alors, pour tout réel t et h positifs, on a : $P_{X \geq t}(X \geq t + h) = P(X \geq h)$

Démonstration :

$P_{(X\geq t)}(X \geq t+h) = \dfrac{P(X \geq t+h \text{ et } X \geq t)}{P(X \geq t)} = \dfrac{P(X \geq t+h)}{P(X \geq t)} = \dfrac{1 - P(X \leq t+h)}{1 - P(X \leq t)} = \dfrac{1-(1-e^{-\lambda(t+h)})}{1-(1-e^{-\lambda t})}$

$= \dfrac{e^{-\lambda(t+h)}}{e^{-\lambda t}} = e^{-\lambda(t+h)} \times e^{\lambda t} = e^{-\lambda h} = P(X \geq h)$

Remarque :
Cette propriété porte le nom de "durée de vie sans vieillissement" car elle montre que la durée de vie sur une période h ne dépend pas de l'âge t à partir duquel on considère cet événement.

☑ **Savoir-faire : Savoir utiliser la durée de vie sans vieillissement :**

La durée de vie, exprimée en heures, d'un petit composant électronique d'une carte d'anniversaire musicale est une variable aléatoire qui suit une loi exponentielle de paramètre $\lambda = 0,0035$.
Sachant qu'un composant testé a fonctionné plus de 200 heures, calculer la probabilité qu'il tombe en panne avant 300 heures

$P_{(X\geq 200)}(X \geq 300)$ $\quad P_{(X \geq 200)}(X \geq 300) = P(X \geq 100) = 1 - P(X \leq 100)$

$= 1 - \int_0^{100} 0,0035\, e^{-0,0035}\, dt = 1 - \left[e^{-0,0035t}\right]_0^{100} = 1 - (-e^{-0,35} + 1] = e^{-0,35}$

$= 0,705$

3) Espérance mathématique

Propriété

Soit X une variable aléatoire qui suit une loi exponentielle de paramètre λ. Alors : $E(X) = \dfrac{1}{\lambda}$.

Démonstration (ROC exigible BAC) :

f désigne la densité de la loi exponentielle de paramètre λ. La fonction $g : t \mapsto t f(t)$ est continue sur tout intervalle $[0;x]$, avec $x > 0$, donc elle admet des primitives sur cet intervalle.

$E(X) = \int_0^{+\infty} \lambda t\, e^{-\lambda t}\, dt = \lim\limits_{A \to +\infty} \int_0^A \lambda t e^{-\lambda t}\, dt$

soit $g(t) = \lambda t\, e^{-\lambda t}$ alors $g'(x) = \lambda e^{-\lambda t} + -\lambda e^{-\lambda t} \times \lambda t$

$= \lambda e^{-\lambda t} - \lambda^2 t e$

$g'(x) = \lambda e^{-\lambda t} - \lambda g(x)$

soit G prim de g | $g(t) = -e^{-\lambda t} - \lambda G(t)$
$G(t) = \dfrac{-g(t) - e^{-\lambda t}}{\lambda} = -t e^{-\lambda t}$

$[G(t)]' = -e^{-\lambda t} + \lambda t e^{-\lambda t} + e^{-\lambda t} = g(t)$

Donc $\int_0^A \lambda t e^{-\lambda t} \, dt = \left[- t e^{-\lambda t} - \frac{1}{\lambda} e^{-\lambda t} \right]_0^A$

$= -A e^{-\lambda A} + \frac{1}{\lambda}$

$\boxed{\text{Donc } \lim_{A \to +\infty} \int_0^A \lambda t e^{-\lambda t} \, dt = \lim_{A \to +\infty} -A e^{-\lambda A} - \frac{1}{\lambda} = \frac{1}{\lambda}}$

Donc $E(X) = \frac{1}{\lambda}$.