

T.D. X - Variables aléatoires à densité

I - Densités

Exercice 1. Soit $a > 0$ et f définie par

$$f(t) = \begin{cases} \frac{t}{2a^2} & \text{si } t \in [0, 2a] \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}$$

Montrer que f est une densité de probabilité.

Exercice 2. Soit f définie par

$$f(x) = \begin{cases} \frac{\ln(x)}{x^2} & \text{si } x \geq 1 \\ 0 & \text{si } x < 1 \end{cases}$$

Montrer que la fonction f est une densité de probabilité.

On admettra que pour tout $A \geq 1$, $\int_1^A \frac{\ln(x)}{x^2} dx = -\frac{\ln(A)}{A} - \frac{1}{A} + 1$.

Exercice 3. Soit n un entier supérieur ou égal à 2 et f_n définie par

$$f_n(t) = \begin{cases} nt^{n-1} & \text{si } t \in [0, 1] \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}$$

Montrer que f_n est une densité de probabilité.

Exercice 4. Soit $a \in]0, 1]$ et f définie par

$$f(t) = \begin{cases} \frac{t}{a^2} & \text{si } 0 \leq t \leq a \\ \frac{2a-t}{a^2} & \text{si } a < t \leq 2a \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}$$

Montrer que f est une densité de probabilité.

Exercice 5. On considère la fonction f définie sur \mathbb{R} par

$$f(t) = \begin{cases} k \frac{t}{1+t} & \text{si } t \in [0, 1] \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}$$

Déterminer la valeur de k pour laquelle f est une fonction de densité.

On admettra que $\int_0^1 \frac{t}{1+t} dt = 1 - \ln(2)$.

II - Fonctions de répartition, Espérances, Variances

Exercice 6. Soit f définie par

$$f(x) = \begin{cases} \frac{1}{(1+x)^2} & \text{si } x \geq 0 \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}$$

1. Montrer que f est une densité de probabilité.

Soit T une variable aléatoire de densité f .

2. Déterminer la fonction de répartition de T .

Exercice 7. Soit X une variable aléatoire de densité f définie par

$$f(t) = \begin{cases} e^{-t/2} - e^{-t} & \text{si } t \geq 0 \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}$$

1. Déterminer la fonction de répartition F_X de X .

2. Si Y est une variable aléatoire de loi exponentielle de paramètre $a > 0$, rappeler une densité et l'espérance de Y . En déduire la valeur de $\int_0^{+\infty} t e^{-at} dt$.

3. En déduire l'espérance de X .

Exercice 8. Soit X une variable aléatoire de densité f définie par

$$f(x) = \begin{cases} \frac{\ln(x)}{x^2} & \text{si } x \geq 1 \\ 0 & \text{si } x < 1 \end{cases}$$

1. Déterminer la fonction de répartition G de X .

2. Montrer que X n'admet pas d'espérance.

Exercice 9. Soit $a > 0$ et X une variable aléatoire de densité f définie par

$$f(t) = \begin{cases} \frac{t}{2a^2} & \text{si } t \in [0, 2a] \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}$$

1. Déterminer $\mathbf{E}[X]$.
2. Déterminer $\mathbf{E}[X^2]$ et en déduire $\mathbf{V}(X)$.

Exercice 10. Soit $a \in]0, 1]$ et X une variable aléatoire de densité f définie par

$$f(t) = \begin{cases} \frac{t}{a^2} & \text{si } 0 \leq t \leq a \\ \frac{2a-t}{a^2} & \text{si } a < t \leq 2a \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}$$

1. Déterminer $\mathbf{E}[X]$.
2. Déterminer $\mathbf{E}[X^2]$ et en déduire $\mathbf{V}(X)$.

Exercice 11. Soit a un réel et f la fonction définie pour tout t réel par

$$f(t) = \begin{cases} a e^{2-t} & \text{si } t \geq 2, \\ 0 & \text{sinon.} \end{cases}$$

1. a) Déterminer la valeur de a pour laquelle f est une densité de probabilité.

b) Représenter graphiquement f .

Soit X une variable aléatoire de densité f .

2. a) Déterminer la fonction de répartition F de X .

b) Représenter graphiquement la fonction F .

3. Déterminer les probabilités suivantes :

a) $\mathbf{P}([X \leq 3])$.	c) $\mathbf{P}([0 < X < 3])$.
b) $\mathbf{P}([1 < X < 2])$.	d) $\mathbf{P}([X \geq 4])$.

4. Soit $Y \hookrightarrow \mathcal{E}(1)$.

a) Rappeler la formule (avec une intégrale) et la valeur de $\mathbf{E}[Y]$.

b) On pose $Z = Y + 2$. Déterminer la fonction de répartition puis une densité de Z .

c) En déduire que X admet une espérance et la calculer.

Exercice 12. Soit a un réel et f la fonction définie pour tout t réel par

$$f(t) = \begin{cases} a e^{3-t} & \text{si } t \geq 3 \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}.$$

1. a) Déterminer la valeur de a pour laquelle f est une densité de probabilité.

b) Représenter graphiquement f .

Soit X une variable aléatoire de densité f .

2. a) Déterminer la fonction de répartition F de X .

b) Représenter graphiquement la fonction F .

3. Déterminer les probabilités suivantes :

a) $\mathbf{P}([X \leq 3])$.	c) $\mathbf{P}([0 < X < 5])$.
b) $\mathbf{P}([1 < X < 2])$.	d) $\mathbf{P}([X \geq 4])$.

4. Soit $Y \hookrightarrow \mathcal{E}(1)$.

a) Rappeler la formule (avec une intégrale) et la valeur de $\mathbf{E}[Y]$.

b) On pose $Z = Y + 3$. Déterminer une fonction de répartition puis une densité de Z .

c) En déduire que X admet une espérance et la calculer.

III - Transformation de variables aléatoires

Exercice 13. Soit $U \hookrightarrow \mathcal{U}([0, 1])$. Déterminer la fonction de répartition, une densité, puis identifier éventuellement la loi des variables aléatoires suivantes :

1. $X = 3U$.	4. $W = X^2$.
2. $Y = U + 1$.	5. $H = \ln(X)$.
3. $Z = \frac{1}{2}X + 1$.	6. $E = -\ln(X)$.

Exercice 14. Soit $U \hookrightarrow \mathcal{U}([0, 1])$. Déterminer la fonction de répartition, une densité, puis identifier éventuellement la loi des variables aléatoires suivantes :

- | | |
|-----------------------------|--------------------|
| 1. $X = 4U$. | 4. $W = X^2$. |
| 2. $Y = U + 2$. | 5. $H = \ln(X)$. |
| 3. $Z = \frac{1}{2}X + 1$. | 6. $E = -\ln(X)$. |

Exercice 15. Soit n un entier naturel non nul et f_n définie par

$$f_n(t) = \begin{cases} nt^{n-1} & \text{si } t \in [0, 1] \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}$$

On admet que f_n est une densité de probabilité et on note X_n est une variable aléatoire de densité f_n .

- Déterminer la fonction de répartition F_n de X_n .
- Déterminer $\mathbf{E}[X_n]$.

On pose $Y_n = -\ln(X_n)$.

- Déterminer la fonction de répartition G_n de Y_n .
- Reconnaître la loi de Y_n .
- En déduire $\mathbf{E}[Y_n]$ et $\mathbf{V}(Y_n)$.

Exercice 16. Soit $a \geq 0$ et f définie par

$$f(t) = \begin{cases} 0 & \text{si } t < a \\ 2e^{2a}e^{-2t} & \text{sinon} \end{cases}$$

On admet que f est une densité de probabilité et on considère une variable aléatoire X de densité f . On pose $Y = X - a$.

- Déterminer la fonction de répartition F de X .
- Déterminer la fonction de répartition G de Y .
- Reconnaître la loi de Y , en déduire son espérance et sa variance.
- Déterminer l'espérance et la variance de X .

IV - Lois usuelles

Exercice 17. Soit $X \hookrightarrow \mathcal{N}(0, 1)$ et $Y \hookrightarrow \mathcal{N}(5, 4)$. En utilisant la table de la loi normale, calculer

- | | |
|-------------------------------|------------------------------------|
| 1. $\mathbf{P}([X \leq 2])$. | 3. $\mathbf{P}([Y < 1])$. |
| 2. $\mathbf{P}([X > 2,5])$. | 4. $\mathbf{P}([3 < Y \leq 10])$. |

Exercice 18. Soit $X \hookrightarrow \mathcal{N}(0, 1)$ et $Y \hookrightarrow \mathcal{N}(2, 9)$. En utilisant la table de la loi normale, calculer

- | | |
|---------------------------------|-----------------------------------|
| 1. $\mathbf{P}([X \leq 2,5])$. | 3. $\mathbf{P}([Y < 1])$. |
| 2. $\mathbf{P}([X > 1,49])$. | 4. $\mathbf{P}([3 < Y \leq 6])$. |

Exercice 19. Un archer lance deux flèches en direction d'une cible de rayon d'un mètre. On suppose qu'il atteint systématiquement la cible et que ses lancers sont indépendants. Pour tout $i \in \{1, 2\}$, on note R_i la variable aléatoire égale à la distance (en mètres) de la flèche numéro i au centre de la cible et on suppose que $R_i \hookrightarrow \mathcal{U}([0, 1])$. On note également $R = \min\{R_1, R_2\}$.

- Soit $x \in \mathbb{R}$. Justifier que $\mathbf{P}([R > x]) = \mathbf{P}([R_1 > x] \cap [R_2 > x])$.
- En déduire, pour tout x réel, la fonction de répartition F de R .
- Calculer la probabilité que la flèche la mieux lancée par l'archer soit située à moins de 50cm de la cible.

Exercice 20. Un appareil électronique utilise deux piles dont les durées de vie respectives sont T_1 et T_2 . On suppose que T_1 et T_2 sont indépendantes et suivent une loi exponentielle de paramètre 1. Pour le fonctionnement, une seule pile suffit et l'appareil cesse donc de fonctionner au bout d'un temps $T = \max\{T_1, T_2\}$.

- Soit $x \in \mathbb{R}$. Justifier que $\mathbf{P}([T \leq x]) = \mathbf{P}([T_1 \leq x] \cap [T_2 \leq x])$.
- En déduire, pour tout x réel, la fonction de répartition F de T .
- Calculer la probabilité que l'appareil fonctionne, en excluant toute autre panne, durant au moins 6 mois.