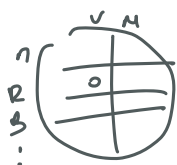


Ω
 \oplus Ce qui nous intéresse c'est les sous-ensembles de Ω et on cherche à les caractériser. = événements

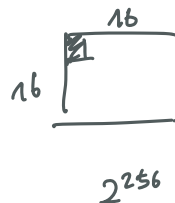
$P: \mathcal{P}(\Omega) \rightarrow [0,1]$ probabilité

Variable aléatoire: $S: \{G, F\} \rightarrow \mathcal{P}(\Omega)$



$$P(\{S=G\}) = P(G)$$

$$P(E=n, C=r)$$



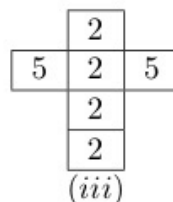
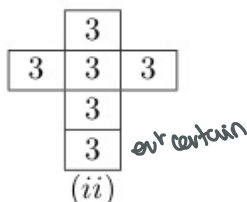
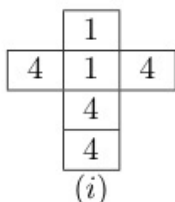
$$P_{11}, P_{12}, \dots, P_{16}, P_{16}$$

$$0 \quad 0 \quad \dots \quad 0$$

$$1 \quad 1 \quad \dots \quad 1$$

Exercice 1 – Dés de Gardner

Dans un numéro de la revue *Scientific American* de 1974, M. Gardner proposait un jeu consistant à choisir un dé parmi les trois dés à 6 faces non pipés ci-dessous, de manière à essayer d'obtenir le nombre le plus élevé en lançant le dé une seule fois.



Q 1.1 On vous propose de jouer au jeu à 2 joueurs suivant : chaque joueur mise M euros. Puis on vous demande de choisir un des dés ci-dessus, votre adversaire en choisit ensuite un autre et enfin chacun lance son dé. Celui qui obtient le nombre le plus élevé remporte la mise.

Q 1.1.1 Calculez, pour chaque couple (x, y) de dés la probabilité qu'en jouant avec le dé x on obtienne un résultat plus élevé qu'avec y .

Q 1.1.2 Sachant que la mise est de 30 euros, devez-vous accepter de jouer et, le cas échéant, quel dé devez-vous choisir ? Formellement, quel critère vous permet de statuer ?



$$S_i x = i$$

$$P(D_x = 1) = \frac{2}{6}$$

$$P(D_x = 2) = 0$$

$$P(D_x = 4) = \frac{1}{3}$$

→ multiplication de fonctions

$$D_x \perp D_y \text{ . donc } P(D_x, D_y) = P(D_x) \cdot P(D_y)$$

$$1000 \times 1000 = 1000 \cdot 1000$$

$$\Leftrightarrow \forall a, \forall b. P(D_x = a, D_y = b) = P(D_x = a) \cdot P(D_y = b).$$

$$\text{donc } P(D_{x|D_y}) = P(D_x)$$

$$D_{(i)} \in \{1, 4\} \quad D_{(ii)} \in \{3\} \quad D_{(iii)} = \{2, 5\}$$

$$P(D_{(i)} = 1) = \frac{4}{6} \quad P(D_{(ii)} = 3) = 1 \quad P(D_{(iii)} = 2) = \frac{2}{6}$$

$$P(D_{(i)} = 4) = \frac{2}{6} \quad P(D_{(iii)} = 5) = \frac{1}{6}$$

Si D_{ci} vs D_{cii}

$$D_{ci} = \begin{matrix} 0 & 1 \\ 1 & 4 \end{matrix} \begin{matrix} 2/9 & 1/9 \\ 4/9 & 2/9 \end{matrix}$$

$D_{ci} \perp D_{cii} \Rightarrow IP(D_{ci}, D_{cii}) = IP(D_{ci}) \cdot IP(D_{cii})$

B distribution de proba

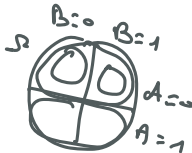
Somme = 1 et $0 \leq \text{probas} \leq 1$

$IP(A, B) =$ loi jointe.

$IP(A) =$ loi marginale.
 $IP(B)$

$IP(A|B) = \frac{IP(A, B)}{IP(B)}$ loi conditionnelle.

$IP(B|A) = \frac{IP(A, B)}{IP(A)}$ \rightarrow P de B sachant A



$IP(B|A)$ famille de distributions de proba

$$\begin{matrix} 2/3 & 1/3 \\ 2/3 & 1/3 \end{matrix}$$

$W(D_{ci}, D_{cii}) \rightarrow \{0, 1\}$

$E_{IP(D_{ci}, D_{cii})} W = \sum_{a \in D_{ci}} \sum_{b \in D_{cii}} IP(a, b) f(a, b)$

$= \frac{2}{9} \cdot 0 + \frac{1}{9} \cdot 0 + \frac{4}{9} \cdot 1 + \frac{2}{9} \cdot 0 = \frac{4}{9}$ Victoire pour D_i

$E_{IP(D_{cii}, D_{ci})} W = \frac{2}{9} \cdot 1 + \frac{1}{9} \cdot 1 + \frac{4}{9} \cdot 0 + \frac{2}{9} \cdot 1 = \frac{6}{9}$

D_i vs D_{ii}

$$\begin{matrix} 1 & 4 \\ 1 & 4 \end{matrix} \begin{matrix} 1/3 & 2/3 \\ 1/2 & 2/3 \end{matrix}$$

$E_{IP(D_i, D_{ii})} W = \frac{1}{3} \cdot 0 + \frac{2}{3} \cdot 1 = \frac{2}{3}$

$E_{IP(D_{ii}, D_i)} W = \frac{1}{3} \cdot 1 + \frac{2}{3} \cdot 0 = \frac{1}{3}$

D_{iii} vs D_{ii}

$$\begin{matrix} 2 & 5 \\ 2 & 5 \end{matrix} \begin{matrix} 2/3 & 1/3 \\ 2/3 & 1/3 \end{matrix}$$

$E_{IP(D_{ii}, D_{iii})} W = \frac{2}{3} \cdot 0 + \frac{1}{3} \cdot 1 = \frac{1}{3}$

$E_{IP(D_{iii}, D_{ii})} W = \frac{2}{3} \cdot 1 + \frac{1}{3} \cdot 0 = \frac{2}{3}$

Si joueur 1 choisit D_i , joueur 2 choisit D_{ii} pour gagner

D_{ii}
 D_{ii}

D_i
 D_{ii}

Conclusion : Aucun de n'est le meilleur. (resultat paradoxal)

$E_p(aW+b) = aE_p W + b$

Q2

On change la fct de cout aW+b avec $a > 0$

\Rightarrow ça ne change rien

$W \in \{-30, 30\}$
 $60W - 30$

Exercice 2 – Indépendance

Soit deux dés à six faces non pipés, un de couleur blanc et un de couleur noir. Les deux sont jetés une fois. On définit les événements suivants :

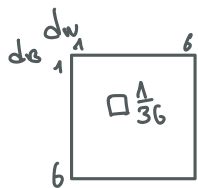
- le dé blanc donne 1, 2 ou 3.
- le dé blanc donne 2, 3 ou 6.
- la somme des deux dés est égal à 9.
- les deux dés donnent deux nombres égaux, dont la somme est inférieure à 9.

Q 2.1 Quel est la probabilité des ces événements ?

Q 2.2 Quels événements sont deux-à-deux indépendants ?

Q 2.3 Les 4 événements sont-ils mutuellement indépendants ? Si non, trouvez les groupes de trois événements qui sont mutuellement indépendants.

$$(d_b, d_n) \quad A = d_b \in \{1, 2, 3\} = (1, -) \cup (2, -) \cup (3, -)$$



$$\text{Or } (1, -) \cap (2, -) = \emptyset \Rightarrow \text{mutuellement exclusifs} \Rightarrow P(A \cup B) = P(A) + P(B)$$

$$\text{En general } P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A \cap B)$$

$$P(A) = P(1, -) + P(2, -) + P(3, -)$$

$$= \sum_a P(1, a) + \sum_b P(2, b) + \sum_c P(3, c)$$

$$= 6 \cdot \frac{1}{36} + 6 \cdot \frac{1}{36} + 6 \cdot \frac{1}{36} = \frac{1}{2}$$

$$B = "d_b \in \{2, 3, 6\}" \quad P(B) = \frac{1}{2}$$

$$C = "d_b + d_n = 9" \quad (3, 6) \cup (4, 5) \cup (5, 4) \cup (6, 3)$$

mutuellement exclusifs

$$P(C) = 4 \cdot \frac{1}{36} = \frac{1}{9}$$

$$D = d_b = d_n \text{ et } d_b + d_n < 9 \quad (1, 1) \cup (2, 2) \cup (3, 3) \cup (4, 4)$$

mutuellement exclusifs

$$P(D) = \frac{1}{9}$$

$$P(A) = \frac{1}{2} \quad P(B) = \frac{1}{2} \quad P(C) = \frac{1}{9} \quad P(D) = \frac{1}{9}$$

$$P(A \cap B) = P(d_b = 2 \text{ ou } 3) = \frac{1}{3} \quad \frac{1}{3} \neq \frac{1}{2} \cdot \frac{1}{2} \text{ donc } A \text{ et } B \text{ pas indépendants.}$$

$$P(A \cap C) = P((3, 6)) = \frac{1}{36} \neq \frac{1}{2} \cdot \frac{1}{9} \text{ pas indep}$$

$$P(A \cap D) = P((1, 1), (2, 2), (3, 3)) = \frac{3}{36} = \frac{1}{12} \neq \frac{1}{2} \cdot \frac{1}{9} \text{ pas indep.}$$

$$P(B \cap C) = P((3, 6) \cup (6, 3)) = \frac{2}{36} = \frac{1}{18} = \frac{1}{2} \cdot \frac{1}{9} \quad B \text{ et } C \text{ sont indep.}$$

$$P(B \cap D) = P((2, 2) \cup (3, 3)) = \frac{1}{18} = \frac{1}{2} \cdot \frac{1}{9} \quad B \text{ et } D \text{ sont indep.}$$

$$P(C \cap D) = 0 \neq \frac{1}{9} \cdot \frac{1}{9} \text{ donc pas indep.} \quad A \perp B \Leftrightarrow P(A \cap B) = P(A) \cdot P(B)$$

Mutuelle indépendance $P(A \cap B \cap C \cap D) = P(A) \cdot P(B) \cdot P(C) \cdot P(D)$

et $\forall S \subset \{A, B, C, D\}, P(S) = \prod_{x \in S} P(x)$

$$P(A \cap B \cap C \cap D) = 0 \neq \frac{1}{2} \cdot \frac{1}{2} \cdot \frac{1}{9} \cdot \frac{1}{9} \quad \cdot A, B, C, D \text{ pas mutuelles } \perp$$

$$P(A \cap B \cap C) = P(\{3, 6\}) = \frac{1}{36} = \frac{1}{2} \cdot \frac{1}{2} \cdot \frac{1}{9} \quad \checkmark$$

Mais $A \not\perp B$ donc pas mutuelle indep.

⋮

$$P_1 = \{0, 1, 2\}$$

$$P_2 = \{0, 1, 2\}$$

$$P_1 \text{ XOR } P_2$$

$P_1, P_2, P_1 \text{ XOR } P_2$ non \perp

mais sous eux \perp .

Exercice 4 – Paradoxe de Simpson

Le recensement des jugements prononcés dans l'état de Floride entre 1973 et 1978 a permis d'établir le tableau suivant, qui présente les sentences en fonction de la couleur de peau de l'accusé :

meurtrier	peine de mort	autre sentence
noir	59	2547
blanc	72	2185

$$59 + 2547$$

$$72 + 2185$$

Q 4.1 Calculez la probabilité d'obtenir la peine de mort sachant que l'on est noir, puis sachant que l'on est blanc. Qu'en concluez-vous ?

Q 4.2 En fait le tableau ci-dessus est une synthèse du tableau ci-dessous :

victime	meurtrier	peine de mort	autre sentence
blanche	noir	48	238
	blanc	72	2074
noire	noir	11	2309
	blanc	0	111

Calculez la probabilité d'obtenir la peine de mort conditionnellement à la couleur de peau de l'accusé et de la victime. La justice est-elle clémentine envers les noirs dans l'état de Floride ? Justifiez votre réponse.

Pour calculer les marginales, on supprime fréquence \sim proba. si effectif grand.

$$P(P|C_M)$$

		P	
		M	A
C _A	N	$\frac{59}{2547+59}$	$\frac{2547}{2547+59}$
	B	$\frac{72}{2185+72}$	$\frac{2185}{2185+72}$

2.265%	100 - 2.265%
3.15%	100 - 3.15%

Q2 $P(P|C_M, C_V)$

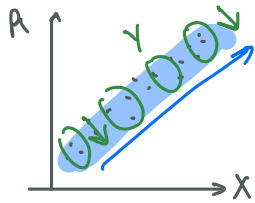
BN	$\frac{48}{48+238}$	$\frac{238}{48+238}$
BB		
NN		
NB		

M	A
16.8%	
335%	
0.475%	
0%	

Un accusé blanc > accusé noir

mais victime B accusé B < accusé N
victime N accusé B < accusé N

pas indep
↓
paradoxe.

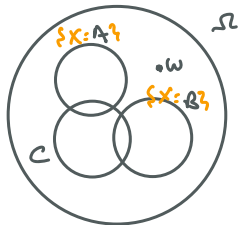


paradoxe de Simpson.

Faut pas savoir si Y est une cause de X,
Y peut être ~~debut~~ de X.

et oui si Y indep de X ou Y cause de X.

Exo 6. conseillé.



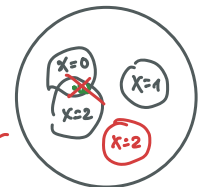
$\omega \in \Omega$ objet de Ω

$A \subset \Omega$ $\{ \text{ev} \} \rightarrow$ ens de sous ens qui nous intéressent

$X \in \{A, B\}$

$\forall \omega \in \Omega, \exists ! x, \omega \in \{X=x\}$ famille d'evr propriété de partition.

tous les sous-ens = tribu. ?



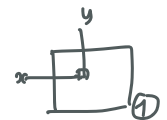
$IP(X)$: distribution de proba
en discret = vecteur

$x=0$	$x=1$	$x=2$	$x=3$
0.5	0.1	0	0.4

$x \in \{0, 3\}, IP(x) = P(\{X=x\}) \in [0, 1]$

$IP(X, Y)$

$x \in \{0, 1, 3\}, y \in \{T, F\}, IP(x, y) = P(X=x, Y=y)$
 $= P(\{X=x\} \cap \{Y=y\})$



$IP(X|Y)$ $\begin{matrix} x \\ y \end{matrix}$ $\begin{matrix} \text{---} \\ \text{---} \\ \text{---} \end{matrix}$ $\begin{matrix} \text{---} \\ \text{---} \\ \text{---} \end{matrix}$ $\begin{matrix} \text{---} \\ \text{---} \\ \text{---} \end{matrix}$

$IP(X, Z|Y, U) \rightarrow$ 40 avec plein de matrices qui $\Sigma = 1$.

(avec $IP(Y) > 0$) $IP(X|Y) = \frac{IP(X, Y)}{IP(Y)} \Leftrightarrow IP(X, Y) = IP(Y) IP(X|Y)$,
 $\forall x, \forall y, IP(X=x, Y=y) = IP(X=x|Y=y) IP(Y=y)$

$X \perp Y \Leftrightarrow IP(X, Y) = IP(X) \times IP(Y)$.

$X \perp Y | Z \Leftrightarrow IP(X, Y | Z) = IP(X | Z) \times IP(Y | Z)$.

Exercice 8 – Indépendance et conjonction

Soit trois variables aléatoires X, Y, Z . Montrer que si X est indépendante du couple (Y, Z) , et Y est indépendante de Z , alors Z est indépendante du couple (X, Y) .

$$X \perp (Y, Z) \Leftrightarrow P(X, (Y, Z)) = P(X) \cdot P(Y, Z)$$

$$\text{et } Y \perp Z \Leftrightarrow P(Y, Z) = P(Y) \cdot P(Z)$$

$$\Rightarrow P(X, (Y, Z)) = P(X) \cdot P(Y) \cdot P(Z)$$

$$\Rightarrow P(X, (Y, Z)) = P(X, Y|Z) P(Z) \text{ fjr vraie.}$$

$$\Rightarrow P(X) P(Y) = P(X, Y|Z)$$

$$\Rightarrow X, Y \perp Z$$

Exercice 9 – Indépendances conditionnelles

La loi de probabilité jointe de 3 variables aléatoires X, Y et Z , est donnée par le tableau suivant dans lequel, par exemple, la case $1/12$ représente la probabilité $P(X = x_2, Y = y_1, Z = z_1)$:

		$Y = y_1$	$Y = y_2$	$Y = y_3$
$Z = z_1$	$X = x_1$	$1/24$	$1/15$	$1/8$
	$X = x_2$	$1/12$	$7/120$	$1/8$
$Z = z_2$	$X = x_1$	$3/40$	$1/20$	$13/120$
	$X = x_2$	$1/20$	$3/40$	$17/120$

On note respectivement $X \perp Y$ et $X \perp Y|Z$ l'indépendance probabiliste entre X et Y , et l'indépendance probabiliste entre X et Y conditionnellement à Z .

Q 9.1 D'un point de vue probabiliste, a-t-on $X \perp Y$, $X \perp Z$, $Z \perp Y$? Rappel : si A et B sont indépendants, $P(A, B) = P(A) \times P(B)$.

Q 9.2 A-t-on $X \perp Y|Z$, $X \perp Z|Y$, $Z \perp Y|X$?

$P(X, Y) = \sum_z P(X, Y, Z)$ $P(X, Y)$

proportionnalité

	y_1	y_2	y_3
x_1	$\frac{1}{24} + \frac{3}{40} = \frac{7}{60}$	$\frac{7}{60}$	$\frac{7}{30}$
x_2	$\frac{1}{12}$	$\frac{1}{15}$	$\frac{11}{15}$
$P(X)$	$\frac{15}{60}$	$\frac{15}{60}$	$\frac{15}{30}$

①

$X \perp Y \Leftrightarrow P(X, Y) = P(X) \cdot P(Y)$

$\frac{15}{60} \cdot \frac{28}{60} = \frac{7}{60}$
 \vdots
 $\frac{15}{30} \cdot \frac{22}{60} = \frac{11}{15}$

$P(Y) = \sum_x P(X, Y)$
 $P(Y) = \sum_x P(X, Y)$

$\frac{1}{24} + \frac{1}{12} + \frac{1}{8} = \frac{7}{30}$

$P(X, Z)$

	z_1	z_2
x_1	$7/30$	$7/30$
x_2	$4/15$	$4/15$
$P(Z)$	$\frac{15}{30}$	$\frac{15}{30}$

$P(X, Z=z_1)$ et $P(X, Z=z_2)$ sont proportionnels
 $\Rightarrow X \perp Z$

$\frac{15}{30} \cdot \frac{14}{30} = \frac{7}{30}$
 $\frac{15}{30} \cdot \frac{14}{30} = \frac{7}{30}$
 $\frac{15}{30} \cdot \frac{16}{30} = 4/15$
 $\frac{15}{30} \cdot \frac{16}{30} = 4/15$

② $X \not\perp Y | Z$?

✓ pas de 0 dans la table de probas.

$$P(X, Y | Z) = \frac{P(X, Y, Z)}{P(Z)}$$

so $P(X, Y | Z) = P(X | Z) P(Y | Z)$

$P(X, Y | Z = z_1)$ $Z = z_1$ $P(X | Z = z_2)$

$\frac{1}{24} \frac{15}{30}$	$\frac{1}{15} \frac{15}{30}$	$\frac{1}{8} \frac{15}{30}$	$\left[\begin{array}{c} \\ \\ \end{array} \right]$
$\frac{1}{12} \frac{15}{30}$	$\frac{2}{120} \frac{15}{30}$	$\frac{1}{8} \frac{15}{30}$	
$\left[\begin{array}{cc} & \end{array} \right]$			

$\frac{15}{30} = P(Z = z_1)$
 $\frac{15}{30} / \frac{15}{30} = ①$

$P(X, Y | Z = z_2)$ $Z = z_2$ $P(X | Z = z_2)$

$\frac{3}{40}$	$\frac{1}{20}$	$\frac{13}{120}$	$\left[\begin{array}{c} \\ \\ \end{array} \right]$
$\frac{1}{20}$	$\frac{2}{40}$	$\frac{17}{120}$	
$\left[\begin{array}{cc} & \end{array} \right]$			

$\frac{15}{30} = P(Z = z_2)$

Quand $Z = z_1$, il n'y a pas de proportionnalité entre les lignes

$\Rightarrow X \not\perp Y | Z = z_1.$

$\Rightarrow X \not\perp Y | Z.$

Exercice 13 – Modélisation

Nous nous intéressons à la modélisation de phénomène réels par des lois de probabilités standard.

Q 13.1 Soit une base d'images $X = \{x^{(i)}\}$. Dans une image x , nous avons 256 pixels x_j noirs ou blancs.

Q 13.1.1 Quelle loi utiliser pour modéliser un pixel j ? Que signifient le (ou les) paramètre(s) de cette loi ?

Q 13.1.2 Nous voulons calculer $p(x_j)$ en fonction de la valeur de x_j (0 ou 1) et du (ou des) paramètre(s) de la loi précédente. Comment factoriser l'écriture du calcul pour tenir compte des deux possibilités de valeur du pixel ?

①.1 On modélise le pixel j par une v.a. binaire suivant une Bernoulli de paramètre p_j

$$X_j \sim \mathcal{B}(p_j) \quad P(X_j = 1) = p_j.$$

$\mathcal{I} = X_1, \dots, X_{256}$. Il a 256 paramètres à fixer. si tous les pixels sont indépendants

si pas indépendance, on aurait 2^{256} paramètres

$$p(X_j = x_j) = p_j \text{ si } x_j = 1 \text{ et } 1 - p_j \text{ sinon} = p_j^{x_j} (1 - p_j)^{1 - x_j}$$

$$Y = \text{image} = (x_1, \dots, x_{256}).$$

Q 13.2 Imaginons que nous sommes dans un problème bi-classe, impliquant des chiens et des chats et que nous disposons de 2 modèles optimisés pour chaque classe. Ces modèles font l'hypothèse que tous les pixels sont indépendants dans une image.

Q 13.2.1 Pour fournir ces modèles optimisés, combien de valeurs numériques faut-il donner ? A quoi correspondent-elles ?

Q 13.2.2 Une nouvelle image arrive dont le seul pixel visible exploitable, x_{18} , est allumé : comment déterminer s'il s'agit d'un chien ou d'un chat ?

Q 13.2.3 Pour une image entière $\mathbf{x} \in \{0, 1\}^{256}$, comment déterminer la classe associée au sens de la vraisemblance ?

(1.2) En supp. les pixels \perp , avoir 2 classes d'images I, A correspond à avoir 2 jeux de 256 paramètres $(p_i^I), (p_i^A)$ $i, j \in \{1, \dots, 256\}$.



$$x_{18} = 1.$$

Si $p_{18}^I > p_{18}^A$ alors I sinon A .

$$\begin{aligned} P(Y|I) &= P(x_1 \dots x_{256} | Y) \\ &= \prod_{i=1}^{256} P(x_i | I) \\ &= \prod_{i=1}^{256} p_i^I x_i (1-p_i^I)^{1-x_i} \end{aligned}$$

Or $\forall i \neq j, x_i \perp x_j | I$.

↗ c'est 2 probas soles dans 2 mondes diff.

$$P(Y|A) = \prod_{i=1}^{256} p_i^A x_i (1-p_i^A)^{1-x_i}$$

Si $P(Y|A) > P(Y|I)$ Alors x est de type A

0,0192, .0,1728

