

Mes Notes de Lecture

Introduction à la Probabilité

LOU BRUNET

13 octobre 2025

Table des matières

1	Préface	2
2	Probabilités et Dénombrement	3
2.1	Concepts fondamentaux	3
2.2	Définition Naïve de la Probabilité	3
2.3	Permutations (Arrangements)	4
2.4	Le Coefficient Binomial	5
2.5	Identité de Vandermonde	6
2.6	Bose-Einstein (Étoiles et Bâtons)	7
2.7	Principe d'Inclusion-Exclusion	7
2.8	Exercices	10
3	Probabilité conditionnelle	15
3.1	Définition de la Probabilité Conditionnelle	15
3.2	Règle du Produit (Intersection de deux événements)	15
3.3	Règle de la Chaîne (Intersection de n événements)	16
3.4	Règle de Bayes	17
3.5	Formule des Probabilités Totales	17
3.6	Règle de Bayes avec Conditionnement Additionnel	19
3.7	Formule des Probabilités Totales avec Conditionnement Additionnel	19
3.8	Indépendance de Deux Événements	21
3.9	Indépendance Conditionnelle	21
3.10	Le Problème de Monty Hall	22
3.11	Exercices	23
4	Variables Aléatoires Discrètes	28
4.1	Variable Aléatoire	28
4.2	Variable Aléatoire Discrète	28
4.3	Fonction de Masse (PMF)	29
4.4	Distribution de Bernoulli	29
4.5	Variable Aléatoire Indicatrice	30
4.6	Distribution Binomiale	30
4.7	Distribution Hypergéométrique	31
4.8	Fonction de Répartition (CDF)	32
4.9	Exercices	32
5	Espérance, Variance et Distributions Discrètes Usuelles	37
5.1	Espérance d'une variable aléatoire discrète	37
5.2	Linéarité de l'espérance	37
5.3	Espérance de la loi binomiale	38
5.4	La loi géométrique	39
5.5	Loi du statisticien inconscient (LOTUS)	41
5.6	Variance	41
5.7	La loi de Poisson	42
5.8	Exercices	44
6	Appendice A : Séries de Taylor et Maclaurin	54
6.1	Construction pas à pas d'une série de Taylor	54
6.2	Intuition de la série de Taylor en un point quelconque a	56
6.3	La Fonction Exponentielle (e^x)	57
6.4	La Fonction Sinus ($\sin(x)$)	58
6.5	La Fonction Cosinus ($\cos(x)$)	59
6.6	Le Logarithme Népérien ($\ln(1+x)$)	60
6.7	La Série Géométrique ($\frac{1}{1-x}$)	62
6.8	Exercices	62

1 Préface

En bien

2 Probabilités et Dénombrement

2.1 Concepts fondamentaux

Intuition : Nécessité d'un Cadre Formel

Avant de calculer des probabilités, il est crucial de définir les règles du jeu :

Qu'est-ce qui peut arriver ?

On définit l'ensemble de tous les résultats possibles de l'expérience.

À quoi s'intéresse-t-on ?

On identifie les sous-ensembles de résultats spécifiques qui nous intéressent.

Ces deux idées nous conduisent aux notions d'Univers et d'Événement, qui sont les piliers de toute théorie des probabilités.

Définition : Concepts Fondamentaux

Univers (ou Espace Échantillon), S :

L'ensemble de tous les résultats possibles d'une expérience aléatoire.

Événement, A :

Un sous-ensemble de l'univers ($A \subseteq S$). C'est un ensemble de résultats auxquels on s'intéresse.

Exemple : Univers et Événement

Pour l'expérience du "lancer d'un dé à six faces" :

L'**univers** est $S = \{1, 2, 3, 4, 5, 6\}$. "Obtenir un nombre impair" est un événement, représenté par le sous-ensemble $A = \{1, 3, 5\}$.

2.2 Définition Naïve de la Probabilité

Définition : Probabilité Naïve

Pour une expérience où chaque issue dans un espace échantillon fini S est équiprobable, la probabilité d'un événement A est le rapport du nombre d'issues favorables à A sur le nombre total d'issues :

$$P(A) = \frac{\text{Nombre d'issues favorables}}{\text{Nombre total d'issues}} = \frac{|A|}{|S|}$$

Exemple : Applications de la définition naïve

1. **Lancer une pièce équilibrée** : L'espace échantillon est $S = \{\text{Pile}, \text{Face}\}$, donc $|S| = 2$. Si l'événement A est "obtenir Pile", alors $A = \{\text{Pile}\}$ et $|A| = 1$. La probabilité est $P(A) = \frac{1}{2}$.
2. **Lancer un dé à six faces non pipé** : L'espace échantillon est $S = \{1, 2, 3, 4, 5, 6\}$, donc $|S| = 6$. Si l'événement B est "obtenir un nombre pair", alors $B = \{2, 4, 6\}$ et $|B| = 3$. La probabilité est $P(B) = \frac{3}{6} = \frac{1}{2}$.
3. **Tirer une carte d'un jeu de 52 cartes** : L'espace échantillon S contient 52 cartes, donc $|S| = 52$. Si l'événement C est "tirer un Roi", il y a 4 Rois dans le jeu, donc $|C| = 4$. La probabilité est $P(C) = \frac{4}{52} = \frac{1}{13}$.

2.3 Permutations (Arrangements)

Définition : Permutation de k objets parmi n

Le nombre de façons d'arranger k objets choisis parmi n objets distincts (où l'ordre compte et il n'y a pas de répétition) est noté $P(n, k)$ ou A_n^k et est défini par :

$$P(n, k) = \frac{n!}{(n - k)!}$$

où $n!$ est la factorielle de n , et par convention $0! = 1$.

Intuition : Permutations de k parmi n

Pour placer k objets dans un ordre spécifique en les choisissant parmi n objets disponibles, on a n choix pour la première position, $(n - 1)$ choix pour la deuxième, ..., et $(n - k + 1)$ choix pour la k -ième position. Cela donne $n \times (n - 1) \times \cdots \times (n - k + 1)$ arrangements. Ce produit contient k termes. Il est égal à $\frac{n!}{(n - k)!}$, car cela revient à diviser la suite complète $n!$ par les facteurs non utilisés $(n - k) \times (n - k - 1) \times \cdots \times 1$.

Exemple : Permutations de k parmi n

Podium d'une course : Une course réunit 8 coureurs. Combien y a-t-il de podiums (1er, 2e, 3e) possibles ?

On cherche le nombre de façons d'ordonner 3 coureurs parmi 8 : $P(8, 3)$.

$$P(8, 3) = \frac{8!}{(8 - 3)!} = \frac{8!}{5!} = 8 \times 7 \times 6 = 336$$

Il y a 336 podiums possibles.

2.4 Le Coefficient Binomial

Théorème : Formule du Coefficient Binomial

Le nombre de façons de choisir k objets parmi un ensemble de n objets distincts (sans remise et sans ordre) est donné par le coefficient binomial :

$$\binom{n}{k} = \frac{n!}{k!(n-k)!}$$

Intuition

L'idée est de relier $\binom{n}{k}$ à quelque chose de plus facile à compter : les **permutations** de k objets parmi n , c'est-à-dire les listes ordonnées. On sait qu'il y a :

$$P(n, k) = \frac{n!}{(n-k)!}.$$

D'un autre côté, on peut construire chaque permutation en deux étapes :

1. Choisir un **sous-ensemble** de k objets (sans ordre), il y a $\binom{n}{k}$ façons de le faire.
2. Ordonner ces k objets, il y a $k!$ façons de le faire.

Donc, le nombre total de permutations est aussi $\binom{n}{k} \cdot k!$.

En égalisant les deux expressions :

$$\binom{n}{k} \cdot k! = \frac{n!}{(n-k)!} \implies \binom{n}{k} = \frac{n!}{k!(n-k)!}.$$

Pour rendre cela concret, voici le cas $\binom{5}{3}$. Il y a 10 sous-ensembles de 3 éléments parmi $\{a, b, c, d, e\}$. Chacun donne lieu à $3! = 6$ permutations. Le tableau ci-dessous montre **toutes les 60 permutations**, regroupées par sous-ensemble :

$\{a, b, c\}$	$\{a, b, d\}$	$\{a, b, e\}$	$\{a, c, d\}$	$\{a, c, e\}$	$\{a, d, e\}$	$\{b, c, d\}$	$\{b, c, e\}$	$\{b, d, e\}$	$\{c, d, e\}$
abc	abd	abe	acd	ace	ade	bcd	bce	bde	cde
acb	adb	aeb	adc	aec	aed	bdc	bec	bed	ced
bac	bad	bae	cad	cae	dae	cbd	ceb	dbe	dce
bca	bda	bea	cda	cea	dea	cdb	ceb	deb	dec
cab	dab	eab	dac	eac	ead	dbc	ebc	edb	ecd
cba	dba	eba	dca	eca	eda	dcb	ebc	edb	edc

Chaque colonne correspond à **un seul et même choix non ordonné** (par exemple $\{a, b, c\}$), mais à 6 listes différentes selon l'ordre. Ainsi, pour obtenir le nombre de *choix non ordonnés*, on divise le nombre total de listes (60) par le nombre d'ordres par groupe (6) :

$$\binom{5}{3} = \frac{60}{6} = 10.$$

C'est exactement ce que fait la formule :

$$\binom{n}{k} = \frac{\text{nombre de permutations de } k \text{ parmi } n}{k!} = \frac{n!}{k!(n-k)!}.$$

Exemple : Utilisation du Coefficient Binomial

Comité d'étudiants : De combien de manières peut-on former un comité de 3 étudiants à partir d'une classe de 10 ? L'ordre ne compte pas.

$$\binom{10}{3} = \frac{10!}{3!(10-3)!} = \frac{10 \times 9 \times 8}{3 \times 2 \times 1} = 120 \text{ comités possibles.}$$

2.5 Identité de Vandermonde

Théorème : Identité de Vandermonde

Cette identité offre une relation remarquable entre les coefficients binomiaux. Pour des entiers non négatifs m, n et k , on a :

$$\binom{m+n}{k} = \sum_{j=0}^k \binom{m}{j} \binom{n}{k-j}$$

Intuition

C'est le "principe du diviser pour régner". Imaginez que vous devez choisir un comité de k personnes à partir d'un groupe contenant m hommes et n femmes. Le côté gauche, $\binom{m+n}{k}$, compte directement le nombre total de comités possibles. Le côté droit arrive au même résultat en additionnant toutes les compositions possibles du comité : choisir 0 homme et k femmes, PLUS 1 homme et $k-1$ femmes, PLUS 2 hommes et $k-2$ femmes, etc., jusqu'à choisir k hommes et 0 femme. La somme de toutes ces possibilités doit être égale au total.

Exemple : Application de l'Identité de Vandermonde

On veut former un comité de 3 personnes ($k=3$) à partir d'un groupe de 5 hommes ($m=5$) et 4 femmes ($n=4$). **Méthode directe (côté gauche) :**

On choisit 3 personnes parmi les $5+4=9$ au total.

$$\binom{9}{3} = \frac{9 \times 8 \times 7}{3 \times 2 \times 1} = 84$$

Méthode par cas (côté droit) :

La somme est $\binom{5}{0}\binom{4}{3} + \binom{5}{1}\binom{4}{2} + \binom{5}{2}\binom{4}{1} + \binom{5}{3}\binom{4}{0} = 84$. Les deux méthodes donnent bien le même résultat.

2.6 Bose-Einstein (Étoiles et Bâtons)

Théorème : Combinaisons avec répétition

Le nombre de façons de distribuer k objets indiscernables dans n boîtes discernables (ou de choisir k objets parmi n avec remise, où l'ordre ne compte pas) est donné par la formule :

$$\binom{n+k-1}{k} = \binom{n+k-1}{n-1}$$

Intuition : Étoiles et Bâtons

Imaginez que les k objets sont des étoiles (\star) et que nous avons besoin de $n-1$ bâtons ($|$) pour les séparer en n groupes. Par exemple, pour distribuer $k = 7$ étoiles dans $n = 4$ boîtes, une configuration possible serait :

$$\star \star \star | \star || \star \star \star$$

Cela correspond à 3 objets dans la première boîte, 1 dans la deuxième, 0 dans la troisième et 3 dans la quatrième. Le problème revient à trouver le nombre de façons d'arranger ces k étoiles et $n-1$ bâtons. Nous avons un total de $n+k-1$ positions, et nous devons choisir les k positions pour les étoiles (ou les $n-1$ positions pour les bâtons). Le nombre de manières de le faire est précisément $\binom{n+k-1}{k}$.

Exemple : Distribution de biens identiques

De combien de manières peut-on distribuer 10 croissants identiques à 4 enfants ? Ici, $k = 10$ (les croissants, objets indiscernables) et $n = 4$ (les enfants, boîtes discernables). Le nombre de distributions possibles est :

$$\binom{4+10-1}{10} = \binom{13}{10} = \binom{13}{3} = \frac{13 \times 12 \times 11}{3 \times 2 \times 1} = 13 \times 2 \times 11 = 286$$

Il y a 286 façons de distribuer les croissants.

2.7 Principe d'Inclusion-Exclusion

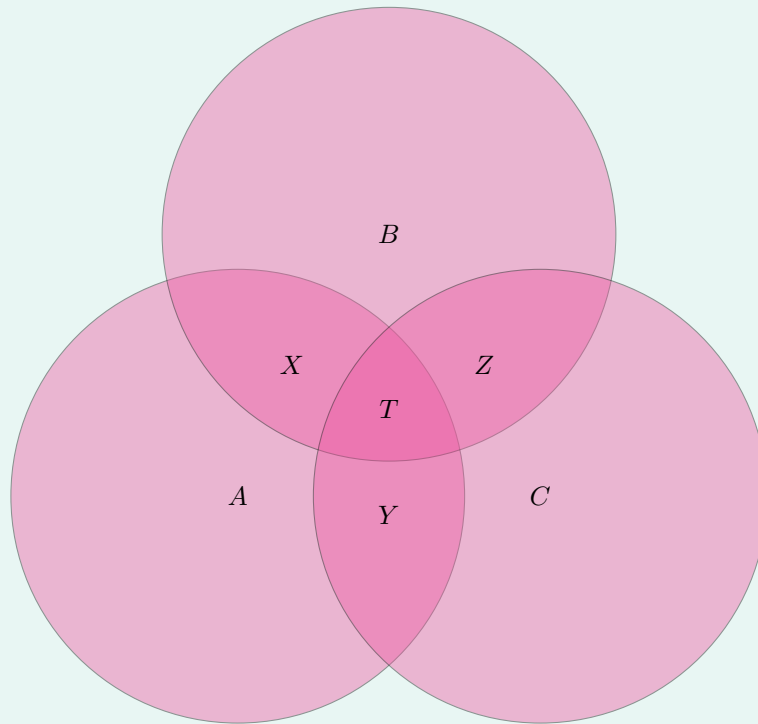
Théorème : Principe d'Inclusion-Exclusion pour 3 ensembles

Pour trois ensembles finis A , B et C , le nombre d'éléments dans leur union est donné par :

$$|A \cup B \cup C| = |A| + |B| + |C| - |A \cap B| - |A \cap C| - |B \cap C| + |A \cap B \cap C|$$

Intuition : Visualisation avec 3 ensembles

Le principe d'inclusion-exclusion permet de compter le nombre d'éléments dans une union d'ensembles sans double-comptage. Pour comprendre intuitivement pourquoi on ajoute et soustrait alternativement, considérons trois ensembles A , B et C :



Le problème : Si on additionne simplement $|A| + |B| + |C|$, on compte certaines zones plusieurs fois :

- Les intersections deux à deux (X , Y , Z) sont comptées **deux fois**
- L'intersection triple (T) est comptée **trois fois**

La solution : On corrige en soustrayant les intersections deux à deux, mais alors l'intersection triple est comptée :

- +3 fois dans la somme initiale
- -3 fois dans la soustraction des intersections deux à deux (car elle appartient à chacune)
- Donc 0 fois au total ! Il faut la rajouter.

D'où la formule : $|A \cup B \cup C| = |A| + |B| + |C| - |A \cap B| - |A \cap C| - |B \cap C| + |A \cap B \cap C|$

Théorème : Principe d'Inclusion-Exclusion généralisé

Pour n ensembles finis A_1, A_2, \dots, A_n , on a :

$$\begin{aligned}
 |A_1 \cup A_2 \cup \dots \cup A_n| &= \sum_{i=1}^n |A_i| \\
 &\quad - \sum_{1 \leq i < j \leq n} |A_i \cap A_j| \\
 &\quad + \sum_{1 \leq i < j < k \leq n} |A_i \cap A_j \cap A_k| \\
 &\quad - \dots \\
 &\quad + (-1)^{n+1} |A_1 \cap A_2 \cap \dots \cap A_n|
 \end{aligned}$$

Ce qui s'écrit plus compactement :

$$\left| \bigcup_{i=1}^n A_i \right| = \sum_{k=1}^n (-1)^{k+1} \sum_{1 \leq i_1 < i_2 < \dots < i_k \leq n} |A_{i_1} \cap A_{i_2} \cap \dots \cap A_{i_k}|$$

Intuition : Généralisation

La logique reste la même que pour trois ensembles, mais l'argument clé est de prouver que chaque élément est compté **exactement une fois**, peu importe le nombre d'ensembles auxquels il appartient.

Supposons qu'un élément x est membre d'exactement k ensembles parmi les n ensembles A_1, \dots, A_n . Analysons combien de fois x est compté dans la formule :

- **Première somme** ($\sum |A_i|$) : x est dans k ensembles, donc il est ajouté k fois. Le nombre de fois est $\binom{k}{1}$.
- **Deuxième somme** ($-\sum |A_i \cap A_j|$) : On soustrait x pour chaque paire d'ensembles auxquels il appartient. Il y a $\binom{k}{2}$ telles paires.
- **Troisième somme** ($+\sum |A_i \cap A_j \cap A_k|$) : On ajoute de nouveau x pour chaque triplet d'ensembles auxquels il appartient. Il y en a $\binom{k}{3}$.
- **Et ainsi de suite...**

Au total, l'élément x est compté :

$$\binom{k}{1} - \binom{k}{2} + \binom{k}{3} - \dots + (-1)^{k-1} \binom{k}{k} \text{ fois.}$$

Pour voir que cette somme vaut exactement 1, rappelons une identité fondamentale issue du binôme de Newton :

$$(1-1)^k = \sum_{j=0}^k (-1)^j \binom{k}{j} = \binom{k}{0} - \binom{k}{1} + \binom{k}{2} - \dots + (-1)^k \binom{k}{k} = 0$$

En réarrangeant cette équation, sachant que $\binom{k}{0} = 1$:

$$\binom{k}{0} = \binom{k}{1} - \binom{k}{2} + \binom{k}{3} - \dots - (-1)^k \binom{k}{k}$$

$$1 = \binom{k}{1} - \binom{k}{2} + \binom{k}{3} - \dots + (-1)^{k-1} \binom{k}{k}$$

Cela prouve que n'importe quel élément, qu'il soit dans un seul ensemble ($k = 1$) ou dans plusieurs ($k > 1$), contribue précisément pour 1 au décompte final. Le principe d'inclusion-exclusion est donc une méthode infaillible pour corriger les comptages multiples de manière systématique.

Exemple : Application probabiliste

On lance trois dés équilibrés. Quelle est la probabilité d'obtenir au moins un 6 ?

Solution avec inclusion-exclusion :

Soit A = "le premier dé montre 6", B = "le deuxième dé montre 6", C = "le troisième dé montre 6".

On veut $P(A \cup B \cup C)$.

$$\begin{aligned} P(A \cup B \cup C) &= P(A) + P(B) + P(C) \\ &\quad - P(A \cap B) - P(A \cap C) - P(B \cap C) \\ &\quad + P(A \cap B \cap C) \\ &= \frac{1}{6} + \frac{1}{6} + \frac{1}{6} - \frac{1}{36} - \frac{1}{36} - \frac{1}{36} + \frac{1}{216} \\ &= \frac{3}{6} - \frac{3}{36} + \frac{1}{216} = \frac{1}{2} - \frac{1}{12} + \frac{1}{216} \\ &= \frac{108 - 18 + 1}{216} = \frac{91}{216} \approx 0.421 \end{aligned}$$

Vérification par la méthode complémentaire : La probabilité de n'obtenir aucun 6 est $\left(\frac{5}{6}\right)^3 = \frac{125}{216}$, donc la probabilité d'au moins un 6 est $1 - \frac{125}{216} = \frac{91}{216}$.

2.8 Exercices

Exercice : Définition naïve de la probabilité

On tire une carte d'un jeu de 52 cartes bien battu. Quelle est la probabilité de tirer une carte qui est soit un cœur, soit un Roi ?

Correction

Soit C l'événement "tirer un cœur" et R l'événement "tirer un Roi". Il y a 13 cœurs et 4 Rois. Cependant, le Roi de cœur est compté dans les deux ensembles. On utilise le principe d'inclusion-exclusion pour les probabilités : $P(C \cup R) = P(C) + P(R) - P(C \cap R)$. $P(C) = \frac{13}{52}$. $P(R) = \frac{4}{52}$. $P(C \cap R)$ (probabilité de tirer le Roi de cœur) =

$$\frac{1}{52} \cdot P(C \cup R) = \frac{13}{52} + \frac{4}{52} - \frac{1}{52} = \frac{16}{52} = \frac{4}{13}.$$

Exercice : Permutations

Cinq livres différents (A, B, C, D, E) doivent être rangés sur une étagère.

1. Combien de rangements différents sont possibles ?
2. Si les livres A et B doivent être côte à côte, combien de rangements sont possibles ?

Correction

1. Le nombre de façons de ranger 5 objets distincts est une permutation de 5, soit $5!$.
 $5! = 5 \times 4 \times 3 \times 2 \times 1 = 120$. Il y a 120 rangements possibles.
2. On peut traiter les livres A et B comme un seul "bloc". Nous avons donc 4 "objets" à ranger : (AB), C, D, E. Il y a $4!$ façons de les ranger. De plus, à l'intérieur du bloc (AB), les livres peuvent être dans l'ordre AB ou BA, soit $2!$ façons. Le nombre total de rangements est donc $4! \times 2! = 24 \times 2 = 48$.

Exercice : Coefficient Binomial

Une pizzeria propose 12 garnitures différentes. Un client souhaite commander une pizza avec exactement 3 garnitures. Combien de pizzas différentes peut-il composer ?

Correction

L'ordre des garnitures ne compte pas, il s'agit donc de choisir 3 garnitures parmi 12. On utilise le coefficient binomial :

$$\binom{12}{3} = \frac{12!}{3!(12-3)!} = \frac{12 \times 11 \times 10}{3 \times 2 \times 1} = 2 \times 11 \times 10 = 220$$

Il peut composer 220 pizzas différentes.

Exercice : Principe d'Inclusion-Exclusion

Dans une classe de 30 élèves, 15 étudient l'espagnol, 12 l'allemand et 5 étudient les deux langues. Combien d'élèves n'étudient aucune de ces deux langues ?

Correction

Soit E le nombre d'élèves étudiant l'espagnol et A le nombre d'élèves étudiant l'allemand. On cherche le nombre d'élèves qui étudient au moins une langue : $|E \cup A| = |E| + |A| - |E \cap A|$. $|E \cup A| = 15 + 12 - 5 = 22$. 22 élèves étudient au moins une des deux langues. Le nombre d'élèves qui n'en étudient aucune est le total moins ce nombre : $30 - 22 = 8$.

Exercice : Étoiles et Bâtons

Un investisseur souhaite répartir 8 milliers d'euros (indiscernables) dans 4 fonds d'investissement différents. De combien de manières peut-il le faire ?

Correction

C'est un problème de combinaisons avec répétition. On distribue $k = 8$ objets (milliers d'euros) dans $n = 4$ boîtes (fonds). On utilise la formule "étoiles et bâtons" :

$$\binom{n+k-1}{k} = \binom{4+8-1}{8} = \binom{11}{8} = \binom{11}{3}$$
$$\binom{11}{3} = \frac{11 \times 10 \times 9}{3 \times 2 \times 1} = 11 \times 5 \times 3 = 165$$

Il y a 165 manières de répartir l'investissement.

Exercice : Identité de Vandermonde

Une équipe de 4 personnes doit être formée à partir d'un groupe de 6 physiciens et 5 chimistes. De combien de manières peut-on former l'équipe si elle doit contenir exactement 2 physiciens et 2 chimistes ? Vérifiez le résultat en utilisant l'identité de Vandermonde comme raisonnement.

Correction

On doit choisir 2 physiciens parmi 6 ET 2 chimistes parmi 5. Le nombre de manières est le produit des combinaisons :

$$\binom{6}{2} \binom{5}{2} = \binom{6 \times 5}{2} \times \binom{5 \times 4}{2} = 15 \times 10 = 150$$

Ceci est un terme de la somme de l'identité de Vandermonde. Le nombre total de comités de 4 personnes parmi 11 ($m = 6, n = 5, k = 4$) serait $\binom{11}{4}$. La somme

$\sum_{j=0}^4 \binom{6}{j} \binom{5}{4-j}$ décompose ce total selon le nombre de physiciens (j). Notre calcul correspond au cas $j = 2$.

Exercice : Dénombrement et Probabilité

On forme un mot de 3 lettres en utilisant les lettres A, B, C, D, E, sans répétition.

1. Combien de mots peut-on former ?
2. Si on choisit un de ces mots au hasard, quelle est la probabilité qu'il contienne la lettre A ?

Correction

1. On arrange 3 lettres parmi 5, l'ordre compte. C'est une permutation de 3 parmi 5 : $P(5, 3) = \frac{5!}{(5-3)!} = 5 \times 4 \times 3 = 60$ mots.
2. Pour calculer la probabilité, on compte le nombre de mots favorables. Un mot contenant A peut avoir A en 1ère, 2ème ou 3ème position. Si A est en 1ère position, il reste 2 positions à remplir avec 4 lettres : $P(4, 2) = 4 \times 3 = 12$ mots. C'est la même chose si A est en 2ème ou 3ème position. Nombre de mots avec A = $3 \times 12 = 36$. Probabilité = $\frac{\text{Favorables}}{\text{Total}} = \frac{36}{60} = \frac{3}{5}$.

Exercice : Principe d'Inclusion-Exclusion à 3 ensembles

Sur 100 étudiants, 40 suivent le cours de maths, 30 celui de physique et 25 celui de chimie. 10 suivent maths et physique, 8 physique et chimie, 7 chimie et maths. Enfin, 3 suivent les trois cours. Combien d'étudiants ne suivent aucun de ces trois cours ?

Correction

Soit M, P, C les ensembles d'étudiants. On cherche le nombre d'étudiants suivant au moins un cours, $|M \cup P \cup C|$: $|M \cup P \cup C| = |M| + |P| + |C| - (|M \cap P| + |P \cap C| + |C \cap M|) + |M \cap P \cap C|$ $|M \cup P \cup C| = 40 + 30 + 25 - (10 + 8 + 7) + 3 = 95 - 25 + 3 = 73$. 73 étudiants suivent au moins un cours. Le nombre d'étudiants n'en suivant aucun est $100 - 73 = 27$.

Exercice : Coefficients binomiaux et chemins

Sur une grille, combien de chemins mènent du point (0,0) au point (4,3) en se déplaçant uniquement vers la droite (D) ou vers le haut (H) ?

Correction

Pour aller de $(0,0)$ à $(4,3)$, tout chemin doit être composé d'exactly 4 déplacements vers la droite (D) et 3 déplacements vers le haut (H). La longueur totale du chemin est de $4 + 3 = 7$ pas. Le problème revient à trouver le nombre de séquences de 7 lettres contenant 4 'D' et 3 'H'. C'est équivalent à choisir les 4 positions pour les 'D' parmi les 7 positions totales :

$$\binom{7}{4} = \frac{7!}{4!3!} = \frac{7 \times 6 \times 5}{3 \times 2 \times 1} = 35$$

Il y a 35 chemins possibles.

Exercice : Probabilité et Permutations circulaires

Six personnes, dont Alice et Bob, s'assoient au hasard autour d'une table ronde. Quelle est la probabilité qu'Alice et Bob soient assis l'un à côté de l'autre ?

Correction

Le nombre total d'arrangements de n personnes autour d'une table ronde est $(n-1)!$. Ici, $(6-1)! = 5! = 120$ arrangements. Pour les cas favorables, on traite Alice et Bob comme un seul bloc. On a donc 5 "entités" à placer, ce qui donne $(5-1)! = 4! = 24$ arrangements. À l'intérieur du bloc, Alice et Bob peuvent être assis de 2 façons (Alice à gauche de Bob, ou Bob à gauche d'Alice). Nombre de cas favorables = $24 \times 2 = 48$. Probabilité = $\frac{\text{Favorables}}{\text{Total}} = \frac{48}{120} = \frac{2}{5}$.

3 Probabilité conditionnelle

Intuition : Question Fondamentale

La probabilité conditionnelle est le concept qui répond à la question fondamentale : comment devons-nous mettre à jour nos croyances à la lumière des nouvelles informations que nous observons ?

3.1 Définition de la Probabilité Conditionnelle

Définition : Probabilité Conditionnelle

Si A et B sont deux événements avec $P(B) > 0$, alors la probabilité conditionnelle de A sachant B , notée $P(A|B)$, est définie comme :

$$P(A|B) = \frac{P(A \cap B)}{P(B)}$$

Intuition

Imaginez que l'ensemble de tous les résultats possibles est un grand terrain. Savoir que l'événement B s'est produit, c'est comme si on vous disait que le résultat se trouve dans une zone spécifique de ce terrain. La probabilité conditionnelle $P(A|B)$ ne s'intéresse plus au terrain entier, mais seulement à la proportion de la zone B qui est également occupée par A . On "zoome" sur le monde où B est vrai, et on recalcule les probabilités dans ce nouveau monde plus petit.

3.2 Règle du Produit (Intersection de deux événements)

Théorème : Probabilité de l'intersection de deux événements

Pour tous événements A et B avec des probabilités positives, nous avons :

$$P(A \cap B) = P(A)P(B|A) = P(B)P(A|B)$$

Cela découle directement de la définition de la probabilité conditionnelle.

Intuition

Pour que deux événements se produisent, le premier doit se produire, PUIS le second doit se produire, sachant que le premier a eu lieu. Cette formule exprime mathématiquement cette idée séquentielle.

Exemple

Quelle est la probabilité de tirer deux As d'un jeu de 52 cartes sans remise? Soit A l'événement "le premier tirage est un As", avec $P(A) = \frac{4}{52}$. Soit B l'événement "le deuxième tirage est un As". Nous cherchons $P(A \cap B)$, que l'on calcule avec la formule $P(A \cap B) = P(A) \times P(B|A)$. La probabilité $P(B|A)$ correspond à tirer un As sachant que la première carte était un As. Il reste alors 51 cartes, dont 3 As. Donc, $P(B|A) = \frac{3}{51}$. Finalement, la probabilité de l'intersection est $P(A \cap B) = \frac{4}{52} \times \frac{3}{51} = \frac{12}{2652} \approx 0.0045$.

3.3 Règle de la Chaîne (Intersection de n événements)

Théorème : Probabilité de l'intersection de n événements

Pour tous événements A_1, \dots, A_n avec $P(A_1 \cap A_2 \cap \dots \cap A_{n-1}) > 0$, nous avons :

$$P(A_1 \cap \dots \cap A_n) = P(A_1)P(A_2|A_1)P(A_3|A_1 \cap A_2) \dots P(A_n|A_1 \cap \dots \cap A_{n-1})$$

Intuition

Ceci est une généralisation de l'idée précédente, souvent appelée "règle de la chaîne" (chain rule). Pour qu'une séquence d'événements se produise, chaque événement doit se réaliser tour à tour, en tenant compte de tous les événements précédents qui se sont déjà produits.

Exemple

On tire 3 cartes sans remise. Quelle est la probabilité d'obtenir la séquence Roi, Dame, Valet? La probabilité de tirer un Roi en premier (A_1) est $P(A_1) = \frac{4}{52}$. Ensuite, la probabilité de tirer une Dame (A_2) sachant qu'un Roi a été tiré est $P(A_2|A_1) = \frac{4}{51}$. Enfin, la probabilité de tirer un Valet (A_3) sachant qu'un Roi et une Dame ont été tirés est $P(A_3|A_1 \cap A_2) = \frac{4}{50}$. La probabilité totale de la séquence est donc le produit de ces probabilités : $P(A_1 \cap A_2 \cap A_3) = \frac{4}{52} \times \frac{4}{51} \times \frac{4}{50} \approx 0.00048$.

3.4 Règle de Bayes

Théorème : Règle de Bayes

$$P(A|B) = \frac{P(B|A)P(A)}{P(B)}$$

Intuition

La règle de Bayes est la formule pour "inverser" une probabilité conditionnelle. Souvent, il est facile de connaître la probabilité d'un effet étant donné une cause ($P(\text{symptôme}|\text{maladie})$), mais ce qui nous intéresse vraiment, c'est la probabilité de la cause étant donné l'effet observé ($P(\text{maladie}|\text{symptôme})$). La règle de Bayes nous permet de faire ce retournement en utilisant notre connaissance initiale de la probabilité de la cause ($P(\text{maladie})$). C'est le fondement mathématique de la mise à jour de nos croyances.

Exemple : Dépistage médical

Une maladie touche 1% de la population ($P(M) = 0.01$). Un test de dépistage est fiable à 95% : il est positif pour 95% des malades ($P(T|M) = 0.95$) et négatif pour 95% des non-malades, ce qui implique un taux de faux positifs de $P(T|\neg M) = 0.05$. Une personne est testée positive. Quelle est la probabilité qu'elle soit réellement malade, $P(M|T)$? On cherche $P(M|T) = \frac{P(T|M)P(M)}{P(T)}$. D'abord, on calcule $P(T)$ avec la formule des probabilités totales : $P(T) = P(T|M)P(M) + P(T|\neg M)P(\neg M) = (0.95 \times 0.01) + (0.05 \times 0.99) = 0.0095 + 0.0495 = 0.059$. Ensuite, on applique la règle de Bayes : $P(M|T) = \frac{0.95 \times 0.01}{0.059} \approx 0.161$. Malgré un test positif, il n'y a que 16.1% de chance que la personne soit malade.

3.5 Formule des Probabilités Totales

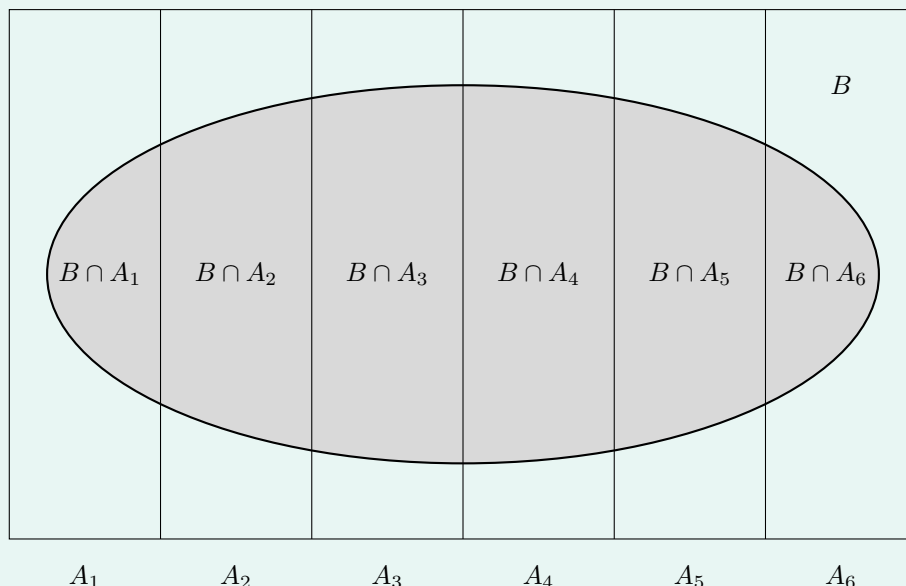
Théorème : Formule des probabilités totales

Soit A_1, \dots, A_n une partition de l'espace échantillon S (c'est-à-dire que les A_i sont des événements disjoints et leur union est S), avec $P(A_i) > 0$ pour tout i . Alors pour tout événement B :

$$P(B) = \sum_{i=1}^n P(B|A_i)P(A_i)$$

Intuition

C'est une stratégie de "diviser pour régner". Pour calculer la probabilité totale d'un événement B , on peut décomposer le monde en plusieurs scénarios mutuellement exclusifs (la partition A_i). On calcule ensuite la probabilité de B dans chacun de ces scénarios ($P(B|A_i)$), on pondère chaque résultat par la probabilité du scénario en question ($P(A_i)$), et on additionne le tout.



Exemple

Une usine possède trois machines, M1, M2, et M3, qui produisent respectivement 50%, 30% et 20% des articles. Leurs taux de production défectueuse sont de 4%, 2% et 5%. Quelle est la probabilité qu'un article choisi au hasard soit défectueux ? Soit D l'événement "l'article est défectueux". Les machines forment une partition avec $P(M1) = 0.5$, $P(M2) = 0.3$, et $P(M3) = 0.2$. Les probabilités conditionnelles de défaut sont $P(D|M1) = 0.04$, $P(D|M2) = 0.02$, et $P(D|M3) = 0.05$. En appliquant la formule, on obtient : $P(D) = P(D|M1)P(M1) + P(D|M2)P(M2) + P(D|M3)P(M3) = (0.04 \times 0.5) + (0.02 \times 0.3) + (0.05 \times 0.2) = 0.02 + 0.006 + 0.01 = 0.036$. La probabilité qu'un article soit défectueux est de 3.6%.

Preuve : Démonstration de la formule des probabilités totales

Puisque les A_i forment une partition de S , on peut décomposer B comme :

$$B = (B \cap A_1) \cup (B \cap A_2) \cup \dots \cup (B \cap A_n)$$

Comme les A_i sont disjoints, les événements $(B \cap A_i)$ le sont aussi. On peut donc sommer leurs probabilités :

$$P(B) = P(B \cap A_1) + P(B \cap A_2) + \dots + P(B \cap A_n)$$

En appliquant le théorème de l'intersection des probabilités à chaque terme, on obtient :

$$P(B) = P(B|A_1)P(A_1) + P(B|A_2)P(A_2) + \cdots + P(B|A_n)P(A_n) = \sum_{i=1}^n P(B|A_i)P(A_i)$$

3.6 Règle de Bayes avec Conditionnement Additionnel

Théorème : Règle de Bayes avec conditionnement additionnel

À condition que $P(A \cap E) > 0$ et $P(B \cap E) > 0$, nous avons :

$$P(A|B, E) = \frac{P(B|A, E)P(A|E)}{P(B|E)}$$

Intuition

Cette formule est simplement la règle de Bayes standard, mais appliquée à l'intérieur d'un univers que l'on a déjà "rétréci".

Imaginez que vous recevez une information **E** qui élimine une grande partie des possibilités. C'est votre nouveau point de départ, votre monde est plus petit. Toutes les probabilités que vous calculez désormais sont relatives à ce monde restreint.

Dans ce nouveau monde, vous recevez une autre information, l'évidence **B**. La règle de Bayes conditionnelle vous permet alors de mettre à jour votre croyance sur un événement **A**, en utilisant exactement la même logique que la règle de Bayes classique, mais en vous assurant que chaque calcul reste confiné à l'intérieur des frontières de l'univers défini par **E**.

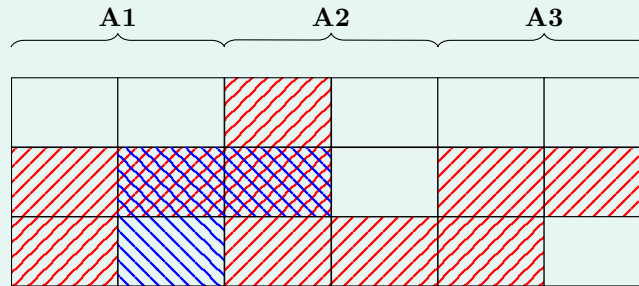
3.7 Formule des Probabilités Totales avec Conditionnement Additionnel

Théorème : Formule des probabilités totales avec conditionnement additionnel

Soit A_1, \dots, A_n une partition de S . À condition que $P(A_i \cap E) > 0$ pour tout i , nous avons :

$$P(B|E) = \sum_{i=1}^n P(B|A_i, E)P(A_i|E)$$

Intuition



Imaginez que le graphique ci-dessus représente la carte d'un trésor. La carte est partitionnée en trois grandes régions : **A1**, **A2**, et **A3**. Sur cette carte, on a identifié deux types de terrains : une **zone marécageuse** (événement E, hachures rouges) qui s'étend sur **10 parcelles**, et une **zone près d'un vieux chêne** (événement B, hachures bleues) qui couvre **3 parcelles**.

On vous donne un premier indice : "Le trésor est dans la zone marécageuse (E)". Votre univers de recherche se réduit instantanément à ces 10 parcelles rouges. Puis, on vous donne un second indice : "Le trésor est aussi près d'un chêne (B)". Votre recherche se concentre alors sur les parcelles qui sont à la fois marécageuses et proches d'un chêne (les cases violettes, $B \cap E$).

La question est : "Sachant que le trésor est dans une parcelle violette, quelle est la probabilité qu'il se trouve dans la région A2?". On cherche donc $P(A_2|B, E)$. La règle de Bayes nous permet de le calculer.

Calcul des termes nécessaires : D'abord, nous devons évaluer les probabilités à l'intérieur du "monde marécageux" (sachant E).

La **vraisemblance** est $P(B|A_2, E)$. En se limitant aux 4 parcelles marécageuses de la région A2, une seule est aussi près d'un chêne. Donc, $P(B|A_2, E) = 1/4$.

La **probabilité a priori** est $P(A_2|E)$. Sur les 10 parcelles marécageuses, 4 sont dans la région A2. Donc, $P(A_2|E) = 4/10$.

L'**évidence**, $P(B|E)$, est la probabilité de trouver un chêne dans l'ensemble de la zone marécageuse. On peut la calculer avec la formule des probabilités totales :

$$P(B|E) = P(B|A_1, E)P(A_1|E) + P(B|A_2, E)P(A_2|E) + P(B|A_3, E)P(A_3|E)$$

$$P(B|E) = \left(\frac{1}{3} \times \frac{3}{10}\right) + \left(\frac{1}{4} \times \frac{4}{10}\right) + \left(0 \times \frac{3}{10}\right) = \frac{1}{10} + \frac{1}{10} = \frac{2}{10}$$

Application de la règle de Bayes : Maintenant, nous assemblons le tout.

$$P(A_2|B, E) = \frac{P(B|A_2, E)P(A_2|E)}{P(B|E)} = \frac{(1/4) \times (4/10)}{2/10} = \frac{1/10}{2/10} = \frac{1}{2}$$

L'intuition confirme le calcul : sachant que le trésor est sur une parcelle violette, et qu'il n'y en a que deux (une en A1, une en A2), il y a bien une chance sur deux qu'il se trouve dans la région A2.

3.8 Indépendance de Deux Événements

Définition : Indépendance de deux événements

Les événements A et B sont indépendants si :

$$P(A \cap B) = P(A)P(B)$$

Si $P(A) > 0$ et $P(B) > 0$, cela est équivalent à :

$$P(A|B) = P(A)$$

Intuition

L'indépendance est l'absence d'information. Si deux événements sont indépendants, apprendre que l'un s'est produit ne change absolument rien à la probabilité de l'autre. Savoir qu'il pleut à Tokyo (B) ne modifie pas la probabilité que vous obteniez pile en lançant une pièce (A).

3.9 Indépendance Conditionnelle

Définition : Indépendance Conditionnelle

Les événements A et B sont dits conditionnellement indépendants étant donné E si :

$$P(A \cap B|E) = P(A|E)P(B|E)$$

Intuition

L'indépendance peut apparaître ou disparaître quand on observe un autre événement. Par exemple, vos notes en maths (A) et en physique (B) ne sont probablement pas indépendantes. Mais si l'on sait que vous avez beaucoup travaillé (E), alors vos notes en maths et en physique pourraient devenir indépendantes. L'information "vous avez beaucoup travaillé" explique la corrélation ; une fois qu'on la connaît, connaître votre note en maths n'apporte plus d'information sur votre note en physique.

3.10 Le Problème de Monty Hall

Interlude : Le problème de Monty Hall

Imaginez que vous êtes à un jeu télévisé. Face à vous se trouvent trois portes fermées. Derrière l'une d'elles se trouve une voiture, et derrière les deux autres, des chèvres.

1. Vous choisissez une porte (disons, la porte n°1).
2. L'animateur, qui sait où se trouve la voiture, ouvre une autre porte (par exemple, la n°3) derrière laquelle se trouve une chèvre.
3. Il vous demande alors : "Voulez-vous conserver votre choix initial (porte n°1) ou changer pour l'autre porte restante (la n°2) ?"

Question : Avez-vous intérêt à changer de porte ? Votre probabilité de gagner la voiture est-elle plus grande si vous changez, si vous ne changez pas, ou est-elle la même dans les deux cas ?

Correction : Solution du problème de Monty Hall

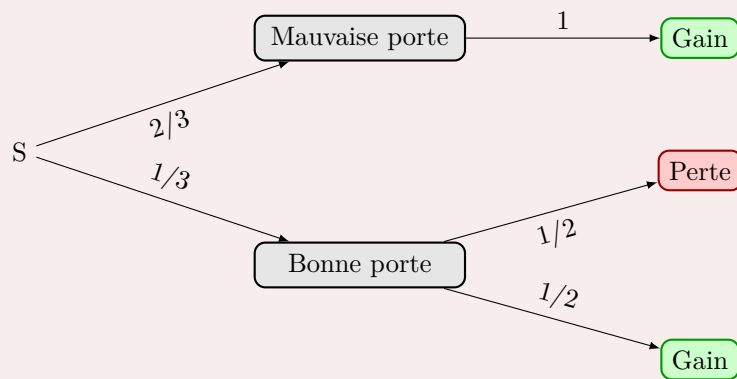
La réponse est sans équivoque : il faut **toujours changer de porte**. Cette stratégie fait passer la probabilité de gagner de $1/3$ à $2/3$. L'intuition et la preuve ci-dessous détaillent ce résultat surprenant.

Intuition : Le secret : l'information de l'animateur

L'erreur commune est de supposer qu'il reste deux portes avec une chance égale de $1/2$. Cela ignore une information capitale : le choix de l'animateur n'est **pas aléatoire**. Il sait où se trouve la voiture et ouvrira toujours une porte perdante. Le raisonnement correct se déroule en deux temps. D'abord, votre choix initial a $1/3$ de chance d'être correct. Cela implique qu'il y a $2/3$ de chance que la voiture soit derrière l'une des *deux autres portes*. Ensuite, lorsque l'animateur ouvre l'une de ces deux portes, il ne fait que vous montrer où la voiture n'est *pas* dans cet ensemble. La probabilité de $2/3$ se **concentre** alors entièrement sur la seule porte qu'il a laissée fermée. Changer de porte revient à miser sur cette probabilité de $2/3$.

Preuve : Preuve par l'arbre de décision

L'analyse de la meilleure stratégie peut être visualisée à l'aide de l'arbre de décision ci-dessous. Il décompose le problème en deux scénarios initiaux : avoir choisi la bonne porte (probabilité $1/3$) ou une mauvaise porte (probabilité $2/3$).



Analyse de l'arbre :

Branche du bas (cas le plus probable) :

Avec une probabilité de $\frac{2}{3}$, votre choix initial se porte sur une "Mauvaise porte". L'animateur est alors obligé de révéler l'autre porte perdante. La seule porte restante est donc la bonne. L'arbre montre que cela mène à un "Gain" avec une probabilité de 1. Ce chemin correspond au résultat de la stratégie "**Changer**".

Branche du haut (cas le moins probable) :

Avec une probabilité de $\frac{1}{3}$, vous avez choisi la "Bonne porte" du premier coup. L'arbre se divise alors en deux issues équiprobables ($\frac{1}{2}$ chacune). L'issue "Gain" correspond à la stratégie "**Garder**" votre choix initial, tandis que l'issue "Perte" correspond à la stratégie "**Changer**" pour la porte perdante restante.

Conclusion :

Pour évaluer la meilleure stratégie, il suffit de sommer les probabilités de gain. La **probabilité de gain en changeant** est de $\frac{2}{3}$, car vous gagnez uniquement si votre choix initial était mauvais (branche du bas). La **probabilité de gain en gardant** est de $\frac{1}{3}$, car vous gagnez uniquement si votre choix initial était bon (branche "Gain" du haut). La stratégie optimale est donc bien de toujours changer de porte.

3.11 Exercices

Exercice : Probabilité conditionnelle simple

On lance deux dés équilibrés. Sachant que la somme des faces est supérieure ou égale à 10, quelle est la probabilité que l'un des dés montre un 6 ?

Correction

Soit A l'événement "l'un des dés montre un 6" et B l'événement "la somme est ≥ 10 ". L'univers a 36 issues. Les issues pour B sont : $(4, 6), (5, 5), (5, 6), (6, 4), (6, 5), (6, 6)$. Donc $|B| = 6$. Les issues pour $A \cap B$ (celles de B qui contiennent un 6) sont : $(4, 6), (5, 6), (6, 4), (6, 5), (6, 6)$. Donc $|A \cap B| = 5$. La probabilité cherchée est

$$P(A|B) = \frac{|A \cap B|}{|B|} = \frac{5}{6}.$$

Exercice : Règle du produit

On tire deux cartes d'un jeu de 52 cartes, sans remise. Quelle est la probabilité de tirer une Dame puis un Roi ?

Correction

Soit D_1 l'événement "tirer une Dame en premier" et R_2 "tirer un Roi en second". On cherche $P(D_1 \cap R_2) = P(D_1) \times P(R_2|D_1)$. $P(D_1) = \frac{4}{52} = \frac{1}{13}$. Après avoir tiré une Dame, il reste 51 cartes dont 4 Rois. Donc $P(R_2|D_1) = \frac{4}{51}$. $P(D_1 \cap R_2) = \frac{4}{52} \times \frac{4}{51} = \frac{16}{2652} \approx 0.006$.

Exercice : Formule des probabilités totales

Une compagnie d'assurance classe les gens en deux groupes : ceux qui sont sujets aux accidents et les autres. Un individu sujet aux accidents a une probabilité de 0.4 d'en avoir un dans l'année. Un individu non sujet a une probabilité de 0.2. On suppose que 30% de la population est sujette aux accidents. Quelle est la probabilité qu'un nouvel assuré ait un accident dans l'année ?

Correction

Soit S l'événement "l'assuré est sujet aux accidents" et A l'événement "avoir un accident". On a $P(S) = 0.30$, donc $P(S^c) = 0.70$. On a aussi $P(A|S) = 0.4$ et $P(A|S^c) = 0.2$. Par la formule des probabilités totales : $P(A) = P(A|S)P(S) + P(A|S^c)P(S^c) = (0.4 \times 0.3) + (0.2 \times 0.7) = 0.12 + 0.14 = 0.26$. La probabilité est de 26%.

Exercice : Règle de Bayes

En reprenant l'exercice précédent, supposons qu'un assuré ait eu un accident. Quelle est la probabilité qu'il soit classé comme "sujet aux accidents" ?

Correction

On cherche $P(S|A)$. En utilisant la règle de Bayes et le résultat précédent ($P(A) = 0.26$) :

$$P(S|A) = \frac{P(A|S)P(S)}{P(A)} = \frac{0.4 \times 0.3}{0.26} = \frac{0.12}{0.26} \approx 0.4615$$

La probabilité est d'environ 46.15%.

Exercice : Indépendance

On lance un dé rouge et un dé bleu. Soit A l'événement "le dé rouge donne un nombre pair" et B l'événement "la somme des dés est 7". Ces événements sont-ils indépendants ?

Correction

$P(A) = \frac{3}{6} = \frac{1}{2}$. Les paires donnant une somme de 7 sont (1,6), (2,5), (3,4), (4,3), (5,2), (6,1). Donc $P(B) = \frac{6}{36} = \frac{1}{6}$. L'événement $A \cap B$ correspond aux paires de B où le premier dé (rouge) est pair : (2,5), (4,3), (6,1). Donc $P(A \cap B) = \frac{3}{36} = \frac{1}{12}$. On vérifie si $P(A \cap B) = P(A)P(B)$. $P(A)P(B) = \frac{1}{2} \times \frac{1}{6} = \frac{1}{12}$. Comme l'égalité est vérifiée, les événements sont indépendants.

Exercice : Chaîne de production

Trois ingénieurs (Alex, Ben, Chloé) examinent des puces électroniques. Alex examine 50% des puces, Ben 30% et Chloé 20%. Alex a un taux d'erreur de 1%, Ben de 3% et Chloé de 2%. Si une puce est déclarée défectueuse par erreur, quelle est la probabilité que l'erreur vienne de Ben ?

Correction

Soit E l'événement "une puce est déclarée défectueuse par erreur". Soit A, B, C les événements "la puce a été examinée par Alex, Ben, Chloé". $P(A) = 0.5, P(B) = 0.3, P(C) = 0.2$. $P(E|A) = 0.01, P(E|B) = 0.03, P(E|C) = 0.02$. On cherche $P(B|E)$. D'abord, calculons $P(E)$ par la formule des probabilités totales : $P(E) = (0.01 \times 0.5) + (0.03 \times 0.3) + (0.02 \times 0.2) = 0.005 + 0.009 + 0.004 = 0.018$. Maintenant, avec la règle de Bayes :

$$P(B|E) = \frac{P(E|B)P(B)}{P(E)} = \frac{0.03 \times 0.3}{0.018} = \frac{0.009}{0.018} = 0.5$$

La probabilité que l'erreur vienne de Ben est de 50%.

Exercice : Famille avec deux enfants

Une famille a deux enfants. On sait que l'aîné est une fille. Quelle est la probabilité que les deux enfants soient des filles ? Comparez cela à la probabilité que les deux enfants soient des filles, sachant qu'au moins un des enfants est une fille.

Correction

L'univers est $S = \{FF, FG, GF, GG\}$. **Cas 1 :** Sachant que l'aîné est une fille (événement $A = \{FF, FG\}$). La probabilité que les deux soient des filles (événement $B = \{FF\}$) est $P(B|A) = \frac{|B \cap A|}{|A|} = \frac{|\{FF\}|}{|\{FF, FG\}|} = \frac{1}{2}$.

Cas 2 : Sachant qu'au moins un enfant est une fille (événement $C = \{FF, FG, GF\}$). La probabilité que les deux soient des filles (événement $B = \{FF\}$) est $P(B|C) = \frac{|B \cap C|}{|C|} = \frac{|\{FF\}|}{|\{FF, FG, GF\}|} = \frac{1}{3}$.

Exercice : Indépendance conditionnelle

On lance deux pièces de monnaie. Soit A l'événement "la première pièce donne Face", B "la seconde pièce donne Face", et C "les deux pièces donnent le même résultat". Montrez que A et B sont indépendants, mais ne sont pas conditionnellement indépendants étant donné C .

Correction

$P(A) = 1/2$, $P(B) = 1/2$, $P(A \cap B) = 1/4$. $P(A)P(B) = 1/4$, donc A et B sont indépendants. Maintenant, conditionnellement à $C = \{FF, PP\}$. L'univers est réduit à ces deux issues. $P(A|C) = \frac{P(A \cap C)}{P(C)} = \frac{P(\{FF\})}{P(\{FF, PP\})} = \frac{1/4}{2/4} = 1/2$. $P(B|C) = \frac{P(B \cap C)}{P(C)} = \frac{P(\{FF\})}{P(\{FF, PP\})} = \frac{1/4}{2/4} = 1/2$. $P(A \cap B|C) = \frac{P(A \cap B \cap C)}{P(C)} = \frac{P(\{FF\})}{P(C)} = \frac{1/4}{2/4} = 1/2$. On compare $P(A \cap B|C)$ avec $P(A|C)P(B|C)$. $1/2 \neq (1/2) \times (1/2) = 1/4$. Les événements ne sont donc pas conditionnellement indépendants étant donné C . (Savoir que C est vrai et que la première est Face force la seconde à être Face aussi).

Exercice : Test médical

Un test sanguin a une fiabilité de 95% pour détecter une maladie (il est positif si la personne est malade). Il a un taux de "faux positifs" de 1% (il est positif alors que la personne n'est pas malade). Si 0.5% de la population a la maladie, quelle est la probabilité qu'une personne ayant un test positif soit réellement malade ?

Correction

Soit M "être malade" et T "test positif". $P(M) = 0.005$, $P(M^c) = 0.995$. $P(T|M) = 0.95$, $P(T|M^c) = 0.01$. On cherche $P(M|T)$. D'abord $P(T) = P(T|M)P(M) + P(T|M^c)P(M^c) = (0.95 \times 0.005) + (0.01 \times 0.995) = 0.00475 + 0.00995 = 0.0147$. Ensuite, par la règle de Bayes :

$$P(M|T) = \frac{P(T|M)P(M)}{P(T)} = \frac{0.00475}{0.0147} \approx 0.3231$$

Même avec un test positif, la probabilité d'être malade n'est que d'environ 32.3%.

Exercice : Urnes et boules

L'urne 1 contient 3 boules rouges et 7 noires. L'urne 2 contient 6 boules rouges et 4 noires. On choisit une urne au hasard, puis on tire une boule. La boule est rouge. Quelle est la probabilité qu'elle provienne de l'urne 1 ?

Correction

Soit U_1 et U_2 les événements "choisir l'urne 1" et "choisir l'urne 2". $P(U_1) = P(U_2) = 0.5$. Soit R l'événement "tirer une boule rouge". $P(R|U_1) = 3/10 = 0.3$. $P(R|U_2) = 6/10 = 0.6$. On cherche $P(U_1|R)$. D'abord, $P(R) = P(R|U_1)P(U_1) + P(R|U_2)P(U_2) = (0.3 \times 0.5) + (0.6 \times 0.5) = 0.15 + 0.30 = 0.45$. Par la règle de Bayes :

$$P(U_1|R) = \frac{P(R|U_1)P(U_1)}{P(R)} = \frac{0.3 \times 0.5}{0.45} = \frac{0.15}{0.45} = \frac{1}{3}$$

La probabilité qu'elle provienne de l'urne 1 est de $1/3$.

4 Variables Aléatoires Discrètes

4.1 Variable Aléatoire

Définition : Variable Aléatoire

Étant donné une expérience avec un univers S , une variable aléatoire est une fonction de l'univers S vers les nombres réels \mathbb{R} .

Intuition

Une variable aléatoire est une manière de traduire les résultats d'une expérience en nombres. Au lieu de travailler avec des concepts comme "Pile" ou "Face", on leur assigne des valeurs numériques (par exemple, 1 pour Pile, 0 pour Face). Cela nous permet d'utiliser toute la puissance des outils mathématiques (fonctions, calculs, etc.) pour analyser le hasard. C'est un pont entre le monde concret des événements et le monde abstrait des nombres.

Exemple

On lance deux dés. L'univers S est l'ensemble des 36 paires de résultats, comme $(1, 1), (1, 2), \dots, (6, 6)$. On peut définir une variable aléatoire X comme étant la **somme des deux dés**. Pour le résultat $(2, 5)$, la valeur de la variable aléatoire est $X(2, 5) = 2 + 5 = 7$.

4.2 Variable Aléatoire Discrète

Définition : Variable Aléatoire Discrète

Une variable aléatoire X est dite discrète s'il existe une liste finie ou infinie dénombrable de valeurs a_1, a_2, \dots telle que $P(X = a_j \text{ pour un certain } j) = 1$.

Intuition

Une variable aléatoire est "discrète" si on peut lister (compter) toutes les valeurs qu'elle peut prendre, même si cette liste est infinie. Pensez aux "sauts" d'une valeur à l'autre, sans possibilité de prendre une valeur intermédiaire. C'est comme monter un escalier : on peut être sur la marche 1, 2 ou 3, mais jamais sur la marche 2.5. Le nombre de têtes en 10 lancers, le résultat d'un dé, le nombre d'emails que vous recevez en une heure sont des exemples. À l'opposé, une variable continue pourrait

être la taille exacte d'une personne, qui peut prendre n'importe quelle valeur dans un intervalle.

4.3 Fonction de Masse (PMF)

Définition : Probability Mass Function (PMF)

La fonction de masse (PMF) d'une variable aléatoire discrète X est la fonction P_X donnée par $P_X(x) = P(X = x)$.

Intuition

La PMF est la "carte d'identité" probabiliste d'une variable aléatoire discrète. Pour chaque valeur que la variable peut prendre, la PMF nous donne la probabilité exacte associée à cette valeur. C'est comme si chaque résultat possible avait une "étiquette de prix" qui indique sa chance de se produire. La somme de toutes ces probabilités doit bien sûr valoir 1.

Exemple

Soit X le résultat d'un lancer de dé équilibré. La variable X peut prendre les valeurs $\{1, 2, 3, 4, 5, 6\}$. La PMF de X est la fonction qui assigne $1/6$ à chaque valeur : $P(X = 1) = 1/6$, $P(X = 2) = 1/6$, ..., $P(X = 6) = 1/6$. Pour toute autre valeur x (par exemple $x = 2.5$ ou $x = 7$), $P(X = x) = 0$.

4.4 Distribution de Bernoulli

Définition : Distribution de Bernoulli

Une variable aléatoire X suit la distribution de Bernoulli avec paramètre p si $P(X = 1) = p$ et $P(X = 0) = 1 - p$, où $0 < p < 1$. On note cela $X \sim \text{Bern}(p)$.

Intuition

La distribution de Bernoulli est le modèle le plus simple pour une expérience aléatoire avec seulement deux issues : "succès" (codé par 1) et "échec" (codé par 0). C'est la brique de base de nombreuses autres distributions. Pensez à un unique lancer de pièce

(Pile/Face), un unique tir au but (Marqué/Manqué), ou la réponse à une question par oui/non. Le paramètre p est simplement la probabilité du "succès".

4.5 Variable Aléatoire Indicatrice

Définition : Variable Aléatoire Indicatrice

La variable aléatoire indicatrice d'un événement A est la variable aléatoire qui vaut 1 si A se produit et 0 sinon. Nous la noterons I_A . Notez que $I_A \sim \text{Bern}(p)$ avec $p = P(A)$.

Intuition

Une variable indicatrice est un interrupteur. Elle est sur "ON" (valeur 1) si un événement qui nous intéresse se produit, et sur "OFF" (valeur 0) sinon. C'est un outil extrêmement puissant car il transforme les questions sur les probabilités des événements en questions sur les espérances des variables aléatoires, ce qui simplifie souvent les calculs.

4.6 Distribution Binomiale

Théorème : PMF Binomiale

Si $X \sim \text{Bin}(n, p)$, alors la PMF de X est :

$$P(X = k) = \binom{n}{k} p^k (1 - p)^{n-k}$$

pour $k = 0, 1, \dots, n$.

Intuition

La distribution binomiale répond à la question : "Si je répète n fois la même expérience de Bernoulli (qui a une probabilité de succès p), quelle est la probabilité d'obtenir exactement k succès ?" La formule est construite logiquement en multipliant trois composantes. D'abord, p^k représente la probabilité d'obtenir k succès. Ensuite, $(1 - p)^{n-k}$ est la probabilité que les $n - k$ échecs restants se produisent. Finalement, comme les k succès peuvent apparaître n'importe où parmi les n essais, on multiplie par $\binom{n}{k}$, qui compte le nombre de manières distinctes de placer ces succès.

Exemple

On lance une pièce équilibrée 10 fois ($n = 10$, $p = 0.5$). Quelle est la probabilité d'obtenir exactement 6 Piles ($k = 6$) ?

$$P(X = 6) = \binom{10}{6} (0.5)^6 (1 - 0.5)^{10-6} = \frac{10!}{6!4!} (0.5)^{10} = 210 \times (0.5)^{10} \approx 0.205$$

Il y a environ 20.5% de chance d'obtenir exactement 6 Piles.

4.7 Distribution Hypergéométrique

Théorème : PMF Hypergéométrique

Si $X \sim \text{HG}(w, b, m)$, alors la PMF de X est :

$$P(X = k) = \frac{\binom{w}{k} \binom{b}{m-k}}{\binom{w+b}{m}}$$

Intuition

La distribution hypergéométrique est la "cousine" de la binomiale pour les tirages **sans remise**. Imaginez une urne avec des boules de deux couleurs (par exemple, w blanches et b noires). Vous tirez m boules d'un coup. Quelle est la probabilité que vous ayez exactement k boules blanches ? La formule est un simple ratio issu du dénombrement. Le **dénominateur**, $\binom{w+b}{m}$, compte le nombre total de façons de tirer m boules parmi toutes celles disponibles. Le **numérateur** compte les issues favorables : c'est le produit du nombre de façons de choisir k blanches parmi les w ($\binom{w}{k}$) ET de choisir les $m - k$ boules restantes parmi les noires ($\binom{b}{m-k}$). La différence clé avec la loi binomiale est que les tirages ne sont pas indépendants.

Exemple

Un comité de 5 personnes est choisi au hasard parmi un groupe de 8 hommes et 10 femmes. Quelle est la probabilité que le comité soit composé de 2 hommes et 3 femmes ? Ici, on tire 5 personnes ($m = 5$) d'une population de 18 personnes. On s'intéresse au nombre d'hommes ($k = 2$) parmi les 8 disponibles ($w = 8$). Le reste du comité sera composé de femmes ($b = 10$).

$$P(X = 2) = \frac{\binom{8}{2} \binom{10}{3}}{\binom{18}{5}} = \frac{28 \times 120}{8568} \approx 0.392$$

Il y a environ 39.2% de chance que le comité ait exactement cette composition.

4.8 Fonction de Répartition (CDF)

Définition : Cumulative Distribution Function (CDF)

La fonction de répartition (CDF) d'une variable aléatoire X est la fonction F_X donnée par $F_X(x) = P(X \leq x)$.

Intuition

Alors que la PMF répond à la question "Quelle est la probabilité d'obtenir *exactement* x ?", la CDF répond à la question "Quelle est la probabilité d'obtenir *au plus* x ?". C'est une fonction cumulative : pour une valeur x donnée, elle additionne les probabilités de tous les résultats inférieurs ou égaux à x . La CDF a toujours une forme d'escalier pour les variables discrètes. Elle commence à 0 (très loin à gauche) et monte par "sauts" à chaque valeur possible de la variable, pour finalement atteindre 1 (très loin à droite). La hauteur de chaque saut correspond à la valeur de la PMF à ce point.

Exemple

Reprenons le lancer d'un dé équilibré (X). Calculons quelques valeurs de la CDF, notée $F(x)$.

$$F(0.5) = P(X \leq 0.5) = 0$$

$$F(1) = P(X \leq 1) = P(X = 1) = 1/6$$

$$F(1.5) = P(X \leq 1.5) = P(X = 1) = 1/6$$

$$F(2) = P(X \leq 2) = P(X = 1) + P(X = 2) = 2/6$$

$$F(5.9) = P(X \leq 5.9) = P(X = 1) + \dots + P(X = 5) = 5/6$$

$$F(6) = P(X \leq 6) = 1$$

$$F(100) = P(X \leq 100) = 1$$

4.9 Exercices

Exercice : PMF d'un dé spécial

Un dé à 4 faces (tétraèdre) est truqué. La probabilité d'obtenir un certain nombre est proportionnelle à ce nombre. Soit X la variable aléatoire du résultat d'un lancer.

1. Déterminez la fonction de masse (PMF) de X .
2. Calculez $P(X \geq 3)$.

Correction

1. Les résultats possibles sont $\{1, 2, 3, 4\}$. La probabilité est proportionnelle au résultat, donc $P(X = k) = c \cdot k$ pour une constante c . La somme des probabilités doit valoir 1 :

$$\sum_{k=1}^4 P(X = k) = c \cdot 1 + c \cdot 2 + c \cdot 3 + c \cdot 4 = 10c = 1 \implies c = \frac{1}{10}$$

La PMF est donc : $P(X = 1) = 1/10$, $P(X = 2) = 2/10$, $P(X = 3) = 3/10$, $P(X = 4) = 4/10$.

2. On calcule $P(X \geq 3) = P(X = 3) + P(X = 4) = \frac{3}{10} + \frac{4}{10} = \frac{7}{10}$.

Exercice : Loi Binomiale : Tirs au but

Un footballeur a une probabilité de 0.8 de marquer un penalty. Il tire 5 penaltys. Soit X le nombre de penaltys marqués.

1. Quelle est la distribution de X ?
2. Quelle est la probabilité qu'il marque exactement 4 penaltys ?

Correction

1. Les tirs sont des épreuves de Bernoulli indépendantes et répétées avec la même probabilité de succès. X suit donc une loi binomiale : $X \sim \text{Bin}(n = 5, p = 0.8)$.
2. On cherche $P(X = 4)$. On applique la formule de la PMF binomiale :

$$P(X = 4) = \binom{5}{4} (0.8)^4 (1 - 0.8)^{5-4} = 5 \times (0.8)^4 \times (0.2)^1 = 5 \times 0.4096 \times 0.2 = 0.4096$$

La probabilité est de 40.96%.

Exercice : Loi Hypergéométrique : Contrôle qualité

Une boîte contient 20 ampoules, dont 5 sont défectueuses. On prélève 4 ampoules au hasard sans remise pour les tester. Soit X le nombre d'ampoules défectueuses dans l'échantillon.

1. Quelle est la distribution de X ?
2. Quelle est la probabilité de ne trouver aucune ampoule défectueuse ?

Correction

1. Il s'agit d'un tirage sans remise d'une population finie contenant deux types d'objets. X suit donc une loi hypergéométrique : $X \sim \text{HG}(w = 5, b = 15, m = 4)$.
2. On cherche $P(X = 0)$. On applique la formule de la PMF hypergéométrique :

$$P(X = 0) = \frac{\binom{5}{0} \binom{15}{4}}{\binom{20}{4}} = \frac{1 \times \frac{15 \times 14 \times 13 \times 12}{4 \times 3 \times 2 \times 1}}{\frac{20 \times 19 \times 18 \times 17}{4 \times 3 \times 2 \times 1}} = \frac{1365}{4845} \approx 0.2817$$

La probabilité est d'environ 28.17%.

Exercice : CDF

En utilisant la PMF du dé truqué de l'exercice 1, déterminez et tracez la fonction de répartition (CDF) de X .

Correction

La PMF était $P(X = 1) = 0.1$, $P(X = 2) = 0.2$, $P(X = 3) = 0.3$, $P(X = 4) = 0.4$. La CDF, $F(x) = P(X \leq x)$, se calcule par accumulation :

- Pour $x < 1$, $F(x) = 0$.
- Pour $1 \leq x < 2$, $F(x) = P(X = 1) = 0.1$.
- Pour $2 \leq x < 3$, $F(x) = P(X \leq 2) = 0.1 + 0.2 = 0.3$.
- Pour $3 \leq x < 4$, $F(x) = P(X \leq 3) = 0.3 + 0.3 = 0.6$.
- Pour $x \geq 4$, $F(x) = P(X \leq 4) = 0.6 + 0.4 = 1$.

C'est une fonction en escalier qui saute aux points 1, 2, 3 et 4.

Exercice : Binomiale : "Au moins un"

Un système de sécurité a 4 composants identiques. Chaque composant a une probabilité de 0.05 de tomber en panne dans l'année. Les pannes sont indépendantes. Quelle est la probabilité qu'au moins un composant tombe en panne dans l'année ?

Correction

Soit X le nombre de composants en panne. $X \sim \text{Bin}(n = 4, p = 0.05)$. Calculer $P(X \geq 1)$ directement serait long ($P(X = 1) + P(X = 2) + \dots$). Il est plus simple de passer par l'événement complémentaire : "aucun composant ne tombe en panne".

$$P(X \geq 1) = 1 - P(X = 0)$$

$$P(X = 0) = \binom{4}{0} (0.05)^0 (0.95)^4 = 1 \times 1 \times (0.95)^4 \approx 0.8145$$

$$P(X \geq 1) = 1 - 0.8145 = 0.1855$$

La probabilité est d'environ 18.55%.

Exercice : Hypergéométrie : Main de poker

Quelle est la probabilité de recevoir exactement 2 Rois dans une main de 5 cartes tirées d'un jeu standard de 52 cartes ?

Correction

Soit X le nombre de Rois dans la main. C'est un tirage sans remise. Il y a 4 Rois et 48 autres cartes dans le jeu. $X \sim \text{HG}(w = 4, b = 48, m = 5)$. On cherche $P(X = 2)$:

$$P(X = 2) = \frac{\binom{4}{2} \binom{48}{3}}{\binom{52}{5}} = \frac{6 \times 17296}{2598960} = \frac{103776}{2598960} \approx 0.0399$$

La probabilité est d'environ 3.99%.

Exercice : Identifier la distribution 1

Une usine produit des vis. 2% des vis sont défectueuses. Vous achetez une boîte de 100 vis. Modélisez le nombre de vis défectueuses dans votre boîte.

Correction

Chaque vis peut être vue comme une épreuve de Bernoulli (défectueuse ou non). Puisque le nombre total de vis produites par l'usine est très grand par rapport à la taille de l'échantillon (100), on peut considérer les tirages comme étant indépendants et avec remise. La situation est donc modélisée par une loi binomiale : $X \sim \text{Bin}(n = 100, p = 0.02)$.

Exercice : Identifier la distribution 2

Une classe contient 12 filles et 10 garçons. On choisit une équipe de 4 élèves au hasard pour un projet. Modélisez le nombre de filles dans l'équipe.

Correction

Le choix se fait sans remise à partir d'une petite population finie (22 élèves). Les choix ne sont pas indépendants. La situation est donc modélisée par une loi hypergéométrique : $X \sim \text{HG}(w = 12, b = 10, m = 4)$.

Exercice : Variable Indicatrice

On lance deux dés. Soit A l'événement "la somme des dés est 7". Définissez la variable aléatoire indicatrice I_A et donnez sa distribution.

Correction

La variable indicatrice I_A est définie comme : $I_A = 1$ si la somme est 7. $I_A = 0$ si la somme n'est pas 7.

Pour trouver sa distribution, il faut calculer $p = P(A)$. Les paires qui donnent une somme de 7 sont (1,6), (2,5), (3,4), (4,3), (5,2), (6,1). Il y en a 6 sur 36 résultats possibles. Donc, $p = P(A) = 6/36 = 1/6$.

La distribution de I_A est une distribution de Bernoulli : $I_A \sim \text{Bern}(p = 1/6)$.

Exercice : Binomiale : Quiz

Un étudiant répond au hasard à un QCM de 10 questions. Chaque question a 4 choix de réponse, dont un seul est correct. Quelle est la probabilité qu'il ait au moins 3 bonnes réponses ?

Correction

Soit X le nombre de bonnes réponses. Chaque question est une épreuve de Bernoulli avec une probabilité de succès $p = 1/4 = 0.25$. Donc, $X \sim \text{Bin}(n = 10, p = 0.25)$. On cherche $P(X \geq 3)$. On utilise le complémentaire : $P(X \geq 3) = 1 - P(X < 3) = 1 - (P(X = 0) + P(X = 1) + P(X = 2))$.

$P(X = 0) = \binom{10}{0}(0.25)^0(0.75)^{10} \approx 0.0563$ $P(X = 1) = \binom{10}{1}(0.25)^1(0.75)^9 \approx 0.1877$

$P(X = 2) = \binom{10}{2}(0.25)^2(0.75)^8 \approx 0.2816$

$P(X < 3) \approx 0.0563 + 0.1877 + 0.2816 = 0.5256$ $P(X \geq 3) \approx 1 - 0.5256 = 0.4744$

La probabilité d'avoir au moins 3 bonnes réponses est d'environ 47.44%.

5 Espérance, Variance et Distributions Discrètes Usuelles

5.1 Espérance d'une variable aléatoire discrète

Définition : Espérance

L'espérance (ou valeur attendue) d'une variable aléatoire discrète X , qui prend les valeurs distinctes x_1, x_2, \dots , est définie par :

$$E(X) = \sum_j x_j P(X = x_j)$$

Intuition

L'espérance représente la valeur moyenne que l'on obtiendrait si l'on répétait l'expérience un très grand nombre de fois. C'est le **centre de gravité** de la distribution de probabilité. Si les probabilités étaient des masses placées sur une tige aux positions x_j , l'espérance serait le point d'équilibre.

Exemple : Lancer d'un dé

Soit X le résultat d'un lancer de dé équilibré. Chaque face a une probabilité de $1/6$. L'espérance est :

$$E(X) = 1 \left(\frac{1}{6} \right) + 2 \left(\frac{1}{6} \right) + 3 \left(\frac{1}{6} \right) + 4 \left(\frac{1}{6} \right) + 5 \left(\frac{1}{6} \right) + 6 \left(\frac{1}{6} \right) = \frac{21}{6} = 3.5$$

Même si 3.5 n'est pas un résultat possible, c'est la valeur moyenne sur un grand nombre de lancers.

5.2 Linéarité de l'espérance

Théorème : Linéarité de l'espérance

Pour toutes variables aléatoires X et Y , et pour toute constante c , on a :

$$\begin{aligned} E(X + Y) &= E(X) + E(Y) \\ E(cX) &= cE(X) \end{aligned}$$

Cette propriété est extrêmement puissante car elle ne requiert pas que X et Y soient indépendantes.

Intuition

Cette propriété formalise une idée très simple : "la moyenne d'une somme est la somme des moyennes". Si vous jouez à deux jeux de hasard, votre gain moyen total est simplement la somme de ce que vous gagnez en moyenne à chaque jeu, que les jeux soient liés ou non.

Exemple : Somme de deux dés

Soit X_1 le résultat du premier dé et X_2 celui du second. On sait que $E(X_1) = 3.5$ et $E(X_2) = 3.5$. Soit $S = X_1 + X_2$ la somme des deux dés. Grâce à la linéarité, on peut calculer l'espérance de la somme sans avoir à lister les 36 résultats possibles :

$$E(S) = E(X_1 + X_2) = E(X_1) + E(X_2) = 3.5 + 3.5 = 7$$

5.3 Espérance de la loi binomiale

Théorème : Espérance de la loi binomiale

Si $X \sim \text{Bin}(n, p)$, alors son espérance est $E(X) = np$.

Intuition

Ce résultat est très naturel. Si vous lancez une pièce 100 fois ($n = 100$) avec une probabilité de 50% d'obtenir Pile ($p = 0.5$), vous vous attendez en moyenne à obtenir $100 \times 0.5 = 50$ Piles. La formule np généralise cette idée.

Preuve

Le calcul direct de l'espérance avec la PMF binomiale est possible, mais long. En utilisant la linéarité de l'espérance, on obtient une preuve beaucoup plus courte et élégante.

On peut voir une variable binomiale X comme la somme de n variables de Bernoulli indépendantes, $X = I_1 + I_2 + \dots + I_n$, où chaque I_j représente le succès (1) ou l'échec (0) du j -ième essai.

Chaque I_j a pour espérance $E(I_j) = 1 \cdot p + 0 \cdot (1 - p) = p$.

Par linéarité de l'espérance, on a :

$$E(X) = E(I_1) + E(I_2) + \dots + E(I_n) = \underbrace{p + p + \dots + p}_{n \text{ fois}} = np$$

5.4 La loi géométrique

Théorème : PMF de la loi géométrique

Une variable aléatoire X suit la loi géométrique de paramètre p , notée $X \sim \text{Geom}(p)$, si elle modélise le nombre d'échecs avant le premier succès dans une série d'épreuves de Bernoulli indépendantes. Sa fonction de masse (PMF) est :

$$P(X = k) = (1 - p)^k p \quad \text{pour } k = 0, 1, 2, \dots$$

où $q = 1 - p$ est la probabilité d'échec.

Intuition

La formule $P(X = k) = q^k p$ décrit la probabilité d'une séquence très spécifique : k échecs consécutifs (chacun avec une probabilité q , donc q^k pour la série), suivis immédiatement d'un succès (avec une probabilité p). C'est la loi de "l'attente du premier succès".

Exemple : Premier 6 au lancer de dé

On lance un dé jusqu'à obtenir un 6. La probabilité de succès est $p = 1/6$, et celle d'échec est $q = 5/6$. Quelle est la probabilité que l'on ait besoin de 3 lancers (donc 2 échecs avant le premier succès) ? Ici, $k = 2$. La probabilité est :

$$P(X = 2) = (5/6)^2 \cdot (1/6) = \frac{25}{216} \approx 0.116$$

Théorème : Espérance de la loi géométrique

L'espérance d'une variable aléatoire $X \sim \text{Geom}(p)$ (comptant le nombre d'échecs) est :

$$E(X) = \frac{1 - p}{p} = \frac{q}{p}$$

Intuition

Si un événement a 1 chance sur 10 de se produire ($p = 0.1$), il est logique de penser qu'il faudra en moyenne 9 échecs ($q/p = 0.9/0.1 = 9$) avant qu'il ne se produise. L'espérance du nombre total d'essais (échecs + 1 succès) serait alors $1/p$.

Preuve : Démonstration de l'espérance géométrique via les séries entières

Soit $X \sim \text{Geom}(p)$, où X compte le nombre d'échecs avant le premier succès. La PMF est $P(X = k) = q^k p$ pour $k = 0, 1, 2, \dots$, avec $q = 1 - p$.

Par définition, l'espérance est :

$$E(X) = \sum_{k=0}^{\infty} k \cdot P(X = k) = \sum_{k=0}^{\infty} k q^k p$$

Le terme pour $k = 0$ est nul, on peut donc commencer la somme à $k = 1$:

$$E(X) = p \sum_{k=1}^{\infty} k q^k$$

L'astuce consiste à reconnaître que la somme ressemble à la dérivée d'une série géométrique. Rappelons la formule de la série géométrique pour $|q| < 1$:

$$\sum_{k=0}^{\infty} q^k = \frac{1}{1 - q}$$

En dérivant les deux côtés par rapport à q , on obtient :

$$\frac{d}{dq} \left(\sum_{k=0}^{\infty} q^k \right) = \frac{d}{dq} \left(\frac{1}{1 - q} \right)$$

$$\sum_{k=1}^{\infty} k q^{k-1} = \frac{1}{(1 - q)^2}$$

Pour faire apparaître ce terme dans notre formule d'espérance, on factorise q dans la somme :

$$E(X) = p \cdot q \sum_{k=1}^{\infty} k q^{k-1}$$

On peut maintenant remplacer la somme par son expression analytique :

$$E(X) = p \cdot q \cdot \frac{1}{(1 - q)^2}$$

Puisque $p = 1 - q$, on a :

$$E(X) = p \cdot q \cdot \frac{1}{p^2} = \frac{q}{p}$$

Ce qui démontre que l'espérance du nombre d'échecs avant le premier succès est $\frac{q}{p}$.

5.5 Loi du statisticien inconscient (LOTUS)

Théorème : Théorème de Transfert (LOTUS)

Si X est une variable aléatoire discrète et $g(x)$ est une fonction de \mathbb{R} dans \mathbb{R} , alors l'espérance de la variable aléatoire $g(X)$ est donnée par :

$$E[g(X)] = \sum_x g(x)P(X = x)$$

La somme porte sur toutes les valeurs possibles de X . Ce théorème est utile car il évite d'avoir à trouver la PMF de $g(X)$.

Intuition

Pour trouver la valeur moyenne d'une fonction d'une variable aléatoire (par exemple, le carré du résultat d'un dé), vous n'avez pas besoin de déterminer d'abord la distribution de ce carré. Vous pouvez simplement prendre chaque valeur possible du résultat original, lui appliquer la fonction, et pondérer ce nouveau résultat par la probabilité du résultat original.

Exemple : Calcul de $E(X^2)$ pour un dé

Soit X le résultat d'un lancer de dé. Calculons l'espérance de $Y = X^2$. La fonction est $g(x) = x^2$.

$$\begin{aligned} E(X^2) &= \sum_{k=1}^6 k^2 P(X = k) \\ &= 1^2 \left(\frac{1}{6}\right) + 2^2 \left(\frac{1}{6}\right) + 3^2 \left(\frac{1}{6}\right) + 4^2 \left(\frac{1}{6}\right) + 5^2 \left(\frac{1}{6}\right) + 6^2 \left(\frac{1}{6}\right) \\ &= \frac{1 + 4 + 9 + 16 + 25 + 36}{6} = \frac{91}{6} \approx 15.17 \end{aligned}$$

5.6 Variance

Définition : Variance et écart-type

La **variance** d'une variable aléatoire X mesure la dispersion de sa distribution autour de son espérance. Elle est définie par :

$$\text{Var}(X) = E[(X - E(X))^2]$$

La racine carrée de la variance est appelée l' **écart-type** :

$$SD(X) = \sqrt{\text{Var}(X)}$$

Intuition

La variance est la "distance carrée moyenne à la moyenne". On prend l'écart de chaque valeur par rapport à la moyenne, on le met au carré (pour que les écarts positifs et négatifs ne s'annulent pas), puis on en calcule la moyenne. L'écart-type est souvent plus interprétable car il ramène cette mesure de dispersion dans les mêmes unités que la variable aléatoire elle-même.

Théorème : Formule de calcul de la variance

Pour toute variable aléatoire X , une formule plus pratique pour le calcul de la variance est :

$$\text{Var}(X) = E(X^2) - [E(X)]^2$$

Exemple : Variance d'un lancer de dé

Nous avons déjà calculé pour un dé que $E(X) = 3.5$ et $E(X^2) = 91/6$. On peut maintenant trouver la variance facilement :

$$\text{Var}(X) = E(X^2) - [E(X)]^2 = \frac{91}{6} - (3.5)^2 = \frac{91}{6} - 12.25 = 15.166... - 12.25 \approx 2.917$$

L'écart-type est $SD(X) = \sqrt{2.917} \approx 1.708$.

5.7 La loi de Poisson

Définition : Distribution de Poisson

Une variable aléatoire X suit la loi de Poisson de paramètre $\lambda > 0$ si sa PMF est donnée par :

$$P(X = k) = \frac{e^{-\lambda} \lambda^k}{k!} \quad \text{pour } k = 0, 1, 2, \dots$$

Elle modélise typiquement le nombre d'événements se produisant dans un intervalle de temps ou d'espace fixe.

Intuition

La loi de Poisson est la loi des événements rares. Imaginez que vous comptez le nombre d'appels arrivant à un standard téléphonique en une minute. Il y a de nombreux instants où un appel pourrait arriver, mais la probabilité à chaque instant est infime. La loi de Poisson modélise ce type de scénario, où l'on connaît seulement le taux moyen d'arrivée des événements (λ).

Exemple : Appels à un centre de service

Un centre de service reçoit en moyenne $\lambda = 3$ appels par minute. La probabilité de recevoir exactement 2 appels dans une minute donnée est :

$$P(X = 2) = \frac{e^{-3}3^2}{2!} = \frac{9e^{-3}}{2} \approx 0.224$$

Il y a environ 22.4% de chance de recevoir exactement 2 appels.

Théorème : La loi de Poisson comme limite de la loi binomiale

Soit $X_n \sim \text{Bin}(n, p_n)$, où $\lambda = np_n$ est une constante positive fixée. Alors, pour tout $k \in \{0, 1, 2, \dots\}$, nous avons :

$$\lim_{n \rightarrow \infty} P(X_n = k) = \frac{e^{-\lambda} \lambda^k}{k!}$$

En pratique, la loi de Poisson est une excellente approximation de la loi binomiale quand n est grand et p est petit.

Intuition

Cette relation est la raison pour laquelle la loi de Poisson est si utile. Pensez au nombre de fautes de frappe sur une page de livre. Il y a un grand nombre de caractères (n est grand), et la probabilité qu'un caractère donné soit une faute de frappe est très faible (p est petit). Calculer avec la loi binomiale serait fastidieux. La loi de Poisson, avec $\lambda = np$, offre une approximation simple et très précise.

Preuve : Dérivation de la loi de Poisson à partir de la binomiale

On part de la PMF de la loi binomiale $X_n \sim \text{Bin}(n, p)$ avec $p = \lambda/n$.

$$\begin{aligned}\lim_{n \rightarrow \infty} P(X_n = k) &= \lim_{n \rightarrow \infty} \binom{n}{k} p^k (1-p)^{n-k} \\ &= \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{n!}{k!(n-k)!} \left(\frac{\lambda}{n}\right)^k \left(1 - \frac{\lambda}{n}\right)^{n-k} \\ &= \frac{\lambda^k}{k!} \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{n(n-1) \cdots (n-k+1)}{n^k} \left(1 - \frac{\lambda}{n}\right)^n \left(1 - \frac{\lambda}{n}\right)^{-k}\end{aligned}$$

Analysons chaque terme de la limite :

1. $\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{n(n-1) \cdots (n-k+1)}{n^k} = \lim_{n \rightarrow \infty} \left(\frac{n}{n}\right) \left(\frac{n-1}{n}\right) \cdots \left(\frac{n-k+1}{n}\right) = 1$
2. $\lim_{n \rightarrow \infty} \left(1 - \frac{\lambda}{n}\right)^n = e^{-\lambda}$
3. $\lim_{n \rightarrow \infty} \left(1 - \frac{\lambda}{n}\right)^{-k} = 1$

En rassemblant ces résultats, on obtient :

$$\lim_{n \rightarrow \infty} P(X_n = k) = \frac{\lambda^k}{k!} \cdot 1 \cdot e^{-\lambda} \cdot 1 = \frac{e^{-\lambda} \lambda^k}{k!}$$

5.8 Exercices

Exercice : Espérance d'un jeu

Un jeu consiste à lancer un dé à six faces. Si vous obtenez un 6, vous gagnez 10€. Si vous obtenez un 4 ou un 5, vous gagnez 1€. Sinon, vous ne gagnez rien. Quelle est l'espérance de gain pour une partie ?

Correction

Soit X la variable aléatoire représentant le gain. Les valeurs possibles de X sont 10, 1, et 0. Les probabilités associées sont : $P(X = 10) = P(\text{obtenir un 6}) = 1/6$. $P(X = 1) = P(\text{obtenir un 4 ou 5}) = 2/6 = 1/3$. $P(X = 0) = P(\text{obtenir 1, 2 ou 3}) = 3/6 = 1/2$.

L'espérance de gain est :

$$E(X) = 10 \cdot P(X = 10) + 1 \cdot P(X = 1) + 0 \cdot P(X = 0)$$

$$E(X) = 10 \cdot \frac{1}{6} + 1 \cdot \frac{2}{6} + 0 \cdot \frac{3}{6} = \frac{10+2}{6} = \frac{12}{6} = 2$$

L'espérance de gain est de 2€ par partie.

Exercice : Linéarité de l'espérance

On lance deux dés non truqués. Soit X la somme des résultats. Calculez $E(X)$ en utilisant la linéarité de l'espérance.

Correction

Soit D_1 le résultat du premier dé et D_2 le résultat du second dé. On a $X = D_1 + D_2$. L'espérance du résultat d'un seul dé est $E(D_1) = E(D_2) = 3.5$. Par linéarité de l'espérance :

$$E(X) = E(D_1 + D_2) = E(D_1) + E(D_2) = 3.5 + 3.5 = 7$$

L'espérance de la somme est 7.

Exercice : Espérance binomiale

Un étudiant répond au hasard à un QCM de 20 questions, chaque question ayant 4 options de réponse (une seule correcte). Quelle est l'espérance du nombre de bonnes réponses ?

Correction

Soit X le nombre de bonnes réponses. Chaque question est une épreuve de Bernoulli avec une probabilité de succès $p = 1/4$. Le nombre total d'épreuves est $n = 20$. X suit donc une loi binomiale $X \sim \text{Bin}(n = 20, p = 0.25)$. L'espérance d'une loi binomiale est $E(X) = np$.

$$E(X) = 20 \times 0.25 = 5$$

L'étudiant peut s'attendre à avoir 5 bonnes réponses en moyenne.

Exercice : Loi Géométrique

On lance une pièce de monnaie jusqu'à obtenir "Pile" pour la première fois. La probabilité d'obtenir "Pile" est $p = 0.5$.

1. Quelle est la probabilité que le premier "Pile" apparaisse au 4ème lancer (c'est-à-dire après 3 "Face") ?
2. Quel est le nombre moyen d'échecs ("Face") attendu avant le premier succès ?

Correction

Soit X le nombre d'échecs avant le premier succès. $X \sim \text{Geom}(p = 0.5)$. 1. On cherche $P(X = 3)$. La PMF est $P(X = k) = (1 - p)^k p$.

$$P(X = 3) = (0.5)^3 \times 0.5 = 0.125 \times 0.5 = 0.0625$$

La probabilité est de 6.25%.

2. On cherche l'espérance $E(X)$.

$$E(X) = \frac{1 - p}{p} = \frac{0.5}{0.5} = 1$$

On s'attend en moyenne à 1 échec ("Face") avant le premier "Pile".

Exercice : Variance d'un dé

Calculez la variance du résultat X d'un lancer de dé équilibré.

Correction

On utilise la formule $\text{Var}(X) = E(X^2) - [E(X)]^2$. On sait déjà que $E(X) = 3.5$. Calculons $E(X^2)$ avec LOTUS :

$$E(X^2) = \sum_{k=1}^6 k^2 P(X = k) = \frac{1}{6}(1^2 + 2^2 + 3^2 + 4^2 + 5^2 + 6^2)$$

$$E(X^2) = \frac{1}{6}(1 + 4 + 9 + 16 + 25 + 36) = \frac{91}{6} \approx 15.167$$

Maintenant, la variance :

$$\text{Var}(X) = \frac{91}{6} - (3.5)^2 = \frac{91}{6} - 12.25 = \frac{91 - 73.5}{6} = \frac{17.5}{6} \approx 2.917$$

Exercice : Loi de Poisson

Un livre de 500 pages contient 250 fautes de frappe distribuées au hasard.

1. Quel est le nombre moyen de fautes par page ?
2. Quelle est la probabilité qu'une page choisie au hasard contienne exactement 2 fautes ?

Correction

1. Le taux moyen d'erreurs est $\lambda = \frac{250 \text{ fautes}}{500 \text{ pages}} = 0.5$ fautes par page. Le nombre de fautes par page, X , suit une loi de Poisson $X \sim \text{Poisson}(\lambda = 0.5)$.
2. On cherche $P(X = 2)$. La PMF de Poisson est $P(X = k) = \frac{e^{-\lambda} \lambda^k}{k!}$.

$$P(X = 2) = \frac{e^{-0.5} (0.5)^2}{2!} = \frac{0.6065 \times 0.25}{2} \approx 0.0758$$

La probabilité est d'environ 7.58%.

Exercice : Variance et constante

Soit X une variable aléatoire avec $E(X) = 10$ et $\text{Var}(X) = 2$. Calculez l'espérance et la variance de $Y = 3X + 5$.

Correction

On utilise les propriétés de l'espérance et de la variance. Pour l'espérance : $E(Y) = E(3X + 5) = E(3X) + E(5) = 3E(X) + 5$.

$$E(Y) = 3(10) + 5 = 35$$

Pour la variance : $\text{Var}(Y) = \text{Var}(3X + 5) = \text{Var}(3X) = 3^2 \text{Var}(X)$.

$$\text{Var}(Y) = 9 \times 2 = 18$$

Exercice : Variable indicatrice

On lance une pièce deux fois. Soit A l'événement "obtenir au moins un Pile". Soit I_A la variable indicatrice de cet événement. Donnez la PMF, l'espérance et la variance de I_A .

Correction

L'univers est $\{PP, PF, FP, FF\}$. L'événement A est $\{PP, PF, FP\}$. La probabilité de A est $P(A) = 3/4$. La variable I_A vaut 1 si A se produit, 0 sinon. C'est une loi de Bernoulli. $I_A \sim \text{Bern}(p = 3/4)$.

PMF : $P(I_A = 1) = 3/4$ et $P(I_A = 0) = 1/4$. Espérance : $E(I_A) = p = 3/4$. Variance : $\text{Var}(I_A) = p(1 - p) = \frac{3}{4} \left(1 - \frac{3}{4}\right) = \frac{3}{4} \cdot \frac{1}{4} = \frac{3}{16}$.

Exercice : Poisson comme approximation

Une compagnie aérienne observe que 0.2% des passagers qui réservent un vol ne se présentent pas. Si un avion a 200 sièges et que la compagnie vend 200 billets, quelle est la probabilité qu'exactement 3 passagers ne se présentent pas? Utilisez l'approximation de Poisson.

Correction

C'est une situation binomiale avec $n = 200$ (grand) et $p = 0.002$ (petit). On peut l'approximer par une loi de Poisson. Le paramètre λ est $\lambda = np = 200 \times 0.002 = 0.4$. Soit X le nombre de passagers absents, $X \sim \text{Poisson}(0.4)$. On cherche $P(X = 3)$.

$$P(X = 3) = \frac{e^{-0.4}(0.4)^3}{3!} = \frac{0.6703 \times 0.064}{6} \approx 0.00715$$

La probabilité est d'environ 0.715%.

Exercice : LOTUS

Une variable aléatoire discrète X a la PMF suivante : $P(X = -1) = 0.2$, $P(X = 0) = 0.5$, $P(X = 1) = 0.3$. Calculez $E[(X + 1)^2]$.

Correction

On utilise le théorème de transfert (LOTUS) avec la fonction $g(x) = (x + 1)^2$.

$$E[g(X)] = \sum_x g(x)P(X = x)$$

$$E[(X + 1)^2] = (-1 + 1)^2 P(X = -1) + (0 + 1)^2 P(X = 0) + (1 + 1)^2 P(X = 1)$$

$$E[(X + 1)^2] = (0)^2 \cdot (0.2) + (1)^2 \cdot (0.5) + (2)^2 \cdot (0.3)$$

$$E[(X + 1)^2] = 0 + 1 \cdot 0.5 + 4 \cdot 0.3 = 0.5 + 1.2 = 1.7$$

Exercice : Espérance d'une fonction

Soit X une variable aléatoire représentant le résultat d'un lancer d'un dé équilibré à 4 faces (valeurs 1, 2, 3, 4). Calculez l'espérance de $Y = 1/X$.

Correction

Chaque face a une probabilité de $1/4$. On utilise le théorème de transfert (LOTUS) avec $g(x) = 1/x$.

$$E(Y) = E(1/X) = \sum_{k=1}^4 \frac{1}{k} P(X = k)$$

$$E(1/X) = \frac{1}{1} \left(\frac{1}{4}\right) + \frac{1}{2} \left(\frac{1}{4}\right) + \frac{1}{3} \left(\frac{1}{4}\right) + \frac{1}{4} \left(\frac{1}{4}\right)$$

$$E(1/X) = \frac{1}{4} \left(1 + \frac{1}{2} + \frac{1}{3} + \frac{1}{4}\right) = \frac{1}{4} \left(\frac{12 + 6 + 4 + 3}{12}\right) = \frac{1}{4} \cdot \frac{25}{12} = \frac{25}{48} \approx 0.521$$

Exercice : Loi Géométrique : "Sans mémoire"

Un archer touche sa cible avec une probabilité $p = 1/3$. Sachant qu'il a déjà manqué ses 5 premiers tirs, quelle est la probabilité qu'il touche la cible au 8ème tir (c'est-à-dire après 2 échecs supplémentaires) ?

Correction

La loi géométrique est "sans mémoire". Le fait qu'il ait déjà manqué 5 tirs ne change pas les probabilités pour les tirs futurs. Le problème revient à se demander la probabilité qu'il lui faille 3 tirs supplémentaires pour réussir, ce qui équivaut à 2 échecs suivis d'un succès. Soit X le nombre d'échecs avant le premier succès. On cherche $P(X = 2)$.

$$P(X = 2) = (1 - p)^2 p = \left(\frac{2}{3}\right)^2 \left(\frac{1}{3}\right) = \frac{4}{9} \cdot \frac{1}{3} = \frac{4}{27}$$

Exercice : Loi de Poisson : Événements rares

Dans une grande forêt, on observe en moyenne 0.8 ours par kilomètre carré. On étudie une zone de 5 km².

1. Quel est le nombre moyen d'ours attendu dans cette zone ?
2. Quelle est la probabilité de n'observer aucun ours dans cette zone ?

Correction

1. Le taux d'ours est de 0.8 par km^2 . Pour une zone de 5 km^2 , le paramètre λ de la loi de Poisson est :

$$\lambda = 0.8 \text{ ours}/\text{km}^2 \times 5 \text{ km}^2 = 4$$

On s'attend donc à observer 4 ours en moyenne dans cette zone.

2. Soit X le nombre d'ours observés, $X \sim \text{Poisson}(\lambda = 4)$. On cherche $P(X = 0)$.

$$P(X = 0) = \frac{e^{-4} 4^0}{0!} = e^{-4} \approx 0.0183$$

La probabilité de n'observer aucun ours est d'environ 1.83%.

Exercice : Variance d'une loi de Bernoulli

Soit $X \sim \text{Bern}(p)$. Montrez en utilisant la formule $\text{Var}(X) = E(X^2) - [E(X)]^2$ que $\text{Var}(X) = p(1 - p)$.

Correction

Pour une variable de Bernoulli, X ne peut prendre que les valeurs 0 et 1. L'espérance est $E(X) = 1 \cdot p + 0 \cdot (1 - p) = p$. Pour calculer $E(X^2)$, on utilise LOTUS. Comme X ne prend que les valeurs 0 et 1, X^2 est identique à X . En effet, $0^2 = 0$ et $1^2 = 1$. Donc $X^2 = X$. Par conséquent, $E(X^2) = E(X) = p$. On applique la formule de la variance :

$$\text{Var}(X) = E(X^2) - [E(X)]^2 = p - p^2 = p(1 - p)$$

Exercice : Loi Hypergéométrique

Dans un groupe de 10 amis (6 hommes et 4 femmes), on tire au sort 3 personnes pour organiser une fête. Quelle est la probabilité que le groupe tiré au sort soit composé exclusivement de femmes ?

Correction

Il s'agit d'un tirage sans remise. Soit X le nombre de femmes tirées. $X \sim \text{HG}(w = 4 \text{ femmes}, b = 6 \text{ hommes}, m = 3 \text{ tirages})$. On cherche $P(X = 3)$.

$$P(X = 3) = \frac{\binom{\text{femmes}}{3} \binom{\text{hommes}}{0}}{\binom{\text{total}}{3}} = \frac{\binom{4}{3} \binom{6}{0}}{\binom{10}{3}}$$

$$\binom{4}{3} = 4 \quad ; \quad \binom{6}{0} = 1 \quad ; \quad \binom{10}{3} = \frac{10 \cdot 9 \cdot 8}{3 \cdot 2 \cdot 1} = 120$$

$$P(X = 3) = \frac{4 \times 1}{120} = \frac{4}{120} = \frac{1}{30} \approx 0.0333$$

La probabilité est d'environ 3.33%.

Exercice : Loi Binomiale : "Au moins"

Un test de dépistage rapide a une probabilité de 0.1 de donner un faux positif. Si 10 personnes saines passent ce test, quelle est la probabilité qu'au moins deux d'entre elles reçoivent un faux positif?

Correction

Soit X le nombre de faux positifs. $X \sim \text{Bin}(n = 10, p = 0.1)$. On cherche $P(X \geq 2)$. Il est plus simple de calculer le complémentaire : $1 - P(X < 2)$. $P(X < 2) = P(X = 0) + P(X = 1)$.

$$P(X = 0) = \binom{10}{0} (0.1)^0 (0.9)^{10} = (0.9)^{10} \approx 0.3487$$

$$P(X = 1) = \binom{10}{1} (0.1)^1 (0.9)^9 = 10 \cdot 0.1 \cdot (0.9)^9 \approx 0.3874$$

$$P(X < 2) \approx 0.3487 + 0.3874 = 0.7361.$$

$$P(X \geq 2) = 1 - 0.7361 = 0.2639$$

La probabilité d'avoir au moins deux faux positifs est d'environ 26.39%.

Exercice : Écart-type

Une machine distribue des boissons. La quantité versée X (en cL) a pour espérance $E(X) = 20$ et on a $E(X^2) = 404$. Quel est l'écart-type de la quantité versée?

Correction

L'écart-type est la racine carrée de la variance. Calculons d'abord la variance.

$$\text{Var}(X) = E(X^2) - [E(X)]^2 = 404 - (20)^2 = 404 - 400 = 4$$

La variance est de 4 cL^2 . L'écart-type est :

$$\text{SD}(X) = \sqrt{\text{Var}(X)} = \sqrt{4} = 2$$

L'écart-type est de 2 cL .

Exercice : Espérance et prise de décision

Vous avez le choix entre deux loteries. Loterie A : Vous gagnez 100€ avec une probabilité de 0.1, sinon rien. Loterie B : Vous gagnez 20€ avec une probabilité de 0.4, sinon rien. Quelle loterie est la plus avantageuse en termes d'espérance de gain ?

Correction

Calculons l'espérance de gain pour chaque loterie. Soit G_A le gain de la loterie A.

$$E(G_A) = 100 \cdot P(G_A = 100) + 0 \cdot P(G_A = 0) = 100 \cdot 0.1 = 10\text{€}$$

Soit G_B le gain de la loterie B.

$$E(G_B) = 20 \cdot P(G_B = 20) + 0 \cdot P(G_B = 0) = 20 \cdot 0.4 = 8\text{€}$$

L'espérance de gain de la loterie A (10€) est supérieure à celle de la loterie B (8€). La loterie A est donc plus avantageuse en moyenne.

Exercice : Poisson : Somme de variables

Deux sources radioactives émettent des particules indépendamment. La source 1 émet des particules selon une loi de Poisson de paramètre $\lambda_1 = 2$ par minute. La source 2 suit une loi de Poisson de paramètre $\lambda_2 = 3$ par minute. Quelle est la probabilité qu'un total de 4 particules soit émis en une minute ?

Correction

Une propriété importante de la loi de Poisson est que la somme de deux variables de Poisson indépendantes est aussi une variable de Poisson dont le paramètre est la somme des paramètres. Soit $X_1 \sim \text{Poisson}(2)$ et $X_2 \sim \text{Poisson}(3)$. Le nombre total de particules $Y = X_1 + X_2$ suit une loi de Poisson de paramètre $\lambda = \lambda_1 + \lambda_2 = 2 + 3 = 5$. Donc, $Y \sim \text{Poisson}(5)$. On cherche $P(Y = 4)$.

$$P(Y = 4) = \frac{e^{-5} 5^4}{4!} = \frac{e^{-5} \cdot 625}{24} \approx 0.1755$$

La probabilité est d'environ 17.55%.

Exercice : Contexte et choix du modèle

Une petite ville compte 5000 habitants. En moyenne, 1 personne sur 1000 est allergique à une substance X.

1. Quel modèle (Binomial ou Poisson) utiliseriez-vous pour estimer la probabilité qu'il y ait exactement 5 personnes allergiques dans cette ville ? Justifiez.
2. Calculez cette probabilité.

Correction

1. Le modèle exact est une loi binomiale avec $n = 5000$ et $p = 1/1000 = 0.001$. Cependant, comme n est très grand et p est très petit, la loi de Poisson est une excellente approximation et bien plus simple à calculer. On utilisera donc une loi de Poisson.

2. Le paramètre de la loi de Poisson est $\lambda = np = 5000 \times 0.001 = 5$. Soit X le nombre de personnes allergiques, $X \sim \text{Poisson}(5)$. On cherche $P(X = 5)$.

$$P(X = 5) = \frac{e^{-5} 5^5}{5!} = \frac{e^{-5} \cdot 3125}{120} \approx 0.1755$$

La probabilité est d'environ 17.55%.

6 Appendice A : Séries de Taylor et Maclaurin

Définition : Séries de Taylor et Maclaurin

Si une fonction f est indéfiniment dérivable au voisinage d'un point a , sa **série de Taylor** centrée en a est définie par :

$$f(x) = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{f^{(k)}(a)}{k!} (x-a)^k$$

où $f^{(k)}(a)$ est la k -ième dérivée de f évaluée en a .

Dans le cas particulier où $a = 0$, la série est appelée une **série de Maclaurin**. C'est la forme la plus courante, car elle approxime les fonctions autour de l'origine.

6.1 Construction pas à pas d'une série de Taylor

Intuition : La logique de la correspondance des dérivées

L'objectif fondamental d'une série de Taylor est de construire un polynôme, $P(x)$, qui soit une "copie conforme" d'une fonction $f(x)$ autour d'un point a . Pour ce faire, on force le polynôme à avoir exactement les mêmes propriétés locales que la fonction : même valeur, même pente, même courbure, etc. Cela se traduit mathématiquement par une exigence : **la n -ième dérivée du polynôme en a doit être égale à la n -ième dérivée de la fonction en a** , et ce pour tous les ordres n .

Prenons l'exemple de $f(x) = e^x$ et construisons sa série de Maclaurin (centrée en $a = 0$), où $f^{(k)}(0) = 1$ pour tout k .

1. Ordre 0 : Faire correspondre la valeur

Objectif : Le polynôme $P_0(x)$ doit avoir la même valeur que $f(x)$ en $x = 0$. On veut $P_0(0) = f(0)$.

Solution : On choisit le polynôme le plus simple, une constante : $P_0(x) = f(0)$. Pour e^x , $f(0) = 1$, donc $P_0(x) = 1$.

Vérification : $P_0(0) = 1$. L'objectif est atteint.

2. Ordre 1 : Faire correspondre la première dérivée

Objectif : On veut un nouveau polynôme $P_1(x)$ qui préserve la correspondance précédente ($P_1(0) = f(0)$) ET qui a la même pente, c'est-à-dire $P_1'(0) = f'(0)$.

Solution : On ajoute un terme en x à notre polynôme précédent : $P_1(x) = P_0(x) + c_1x = 1 + c_1x$.

Vérification :

· $P_1(0) = 1 + c_1(0) = 1$. La valeur correspond toujours, car le nouveau terme s'annule en 0.

· On dérive : $P_1'(x) = c_1$. Pour que les pentes correspondent en 0, il faut $P_1'(0) = c_1 = f'(0)$. Comme $f'(0) = 1$, on doit choisir $c_1 = 1$.

Notre polynôme est maintenant $P_1(x) = 1 + x$.

3. Ordre 2 : Faire correspondre la deuxième dérivée

Objectif : On veut $P_2(x)$ tel que $P_2(0) = f(0)$, $P_2'(0) = f'(0)$ ET $P_2''(0) = f''(0)$.

Solution : On ajoute un terme en x^2 : $P_2(x) = P_1(x) + c_2x^2 = 1 + x + c_2x^2$.

Vérification :

- Les dérivées d'ordre 0 et 1 en $x = 0$ ne sont pas affectées, car la dérivée de c_2x^2 (soit $2c_2x$) et le terme lui-même s'annulent en 0. Les objectifs précédents sont préservés.
- On dérive deux fois : $P_2'(x) = 1 + 2c_2x$ et $P_2''(x) = 2c_2$.
- Pour que les courbures correspondent, il faut $P_2''(0) = 2c_2 = f''(0)$. Comme $f''(0) = 1$, on doit choisir $c_2 = 1/2$.

Notre polynôme est $P_2(x) = 1 + x + \frac{1}{2}x^2$.

4. Le schéma général : L'importance de la factorielle

Pour faire correspondre la k -ième dérivée, on ajoute un terme c_kx^k .

Quand on dérive c_kx^k exactement k fois, on obtient $c_k \times k!$.

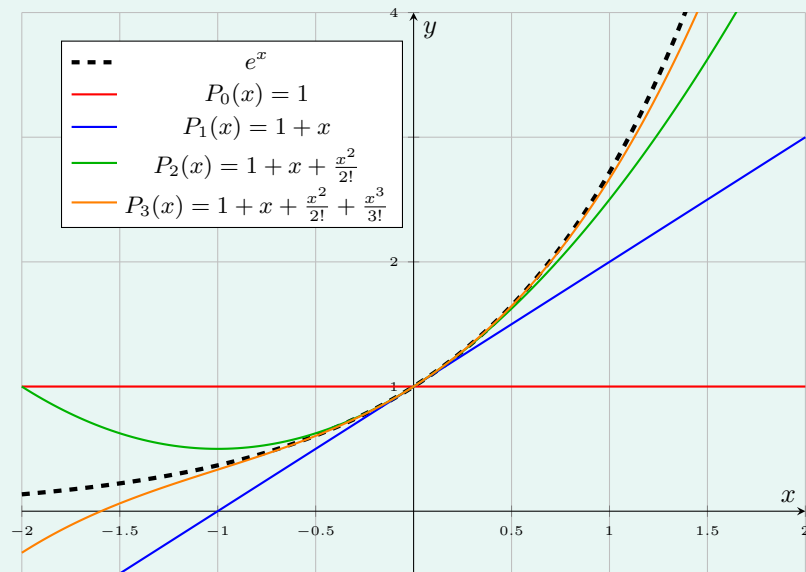
Toutes les dérivées d'ordre inférieur s'annulent en $x = 0$. On doit donc avoir :

$$P_k^{(k)}(0) = c_k \cdot k! = f^{(k)}(0)$$

Cela nous donne la règle pour trouver chaque coefficient :

$$c_k = \frac{f^{(k)}(0)}{k!}$$

C'est précisément le coefficient qui apparaît dans la formule de Taylor, et il est choisi pour cette unique raison : forcer la k -ième dérivée du polynôme à correspondre parfaitement à celle de la fonction au point de développement.



Visualisation de la construction progressive de la série de Maclaurin pour e^x .

6.2 Intuition de la série de Taylor en un point quelconque a

Intuition : Construire une approximation loin de l'origine

La série de Maclaurin est puissante, mais elle nous contraint à approximer une fonction uniquement autour de $x = 0$. Que faire si l'on s'intéresse au comportement d'une fonction ailleurs, par exemple $f(x) = \ln(x)$ autour de $x = 1$ (puisque $\ln(0)$ n'est pas défini) ? C'est là qu'intervient la série de Taylor générale.

L'objectif reste le même : construire un polynôme $P(x)$ qui est une "copie conforme" de $f(x)$ au point a . Pour cela, on force les dérivées du polynôme à correspondre à celles de la fonction en ce point a . La seule différence est que notre "variable" de base n'est plus x , mais l'écart par rapport au centre, c'est-à-dire $(x - a)$.

Prenons l'exemple de $f(x) = \ln(x)$ et construisons sa série centrée en $a = 1$.

1. Ordre 0 : Faire correspondre la valeur

Objectif : $P_0(a) = f(a)$.

Solution : On calcule $f(1) = \ln(1) = 0$. Le polynôme est la constante $P_0(x) = 0$.

2. Ordre 1 : Faire correspondre la pente

Objectif : $P_1(a) = f(a)$ et $P'_1(a) = f'(a)$.

Solution : On ajoute un terme proportionnel à l'écart $(x - a)$: $P_1(x) = f(a) + c_1(x - a)$.

Vérification :

- $P_1(1) = 0 + c_1(1 - 1) = 0$. La valeur correspond.
- On dérive : $P'_1(x) = c_1$. On veut $P'_1(1) = c_1 = f'(1)$.
- La dérivée de $f(x) = \ln(x)$ est $f'(x) = 1/x$, donc $f'(1) = 1$. On doit choisir $c_1 = 1$.

Notre polynôme est $P_1(x) = (x - 1)$. C'est la tangente à $\ln(x)$ en $x = 1$.

3. Ordre 2 : Faire correspondre la courbure

Objectif : Les dérivées jusqu'à l'ordre 2 doivent correspondre en $a = 1$.

Solution : On ajoute un terme en $(x - a)^2$: $P_2(x) = (x - 1) + c_2(x - 1)^2$.

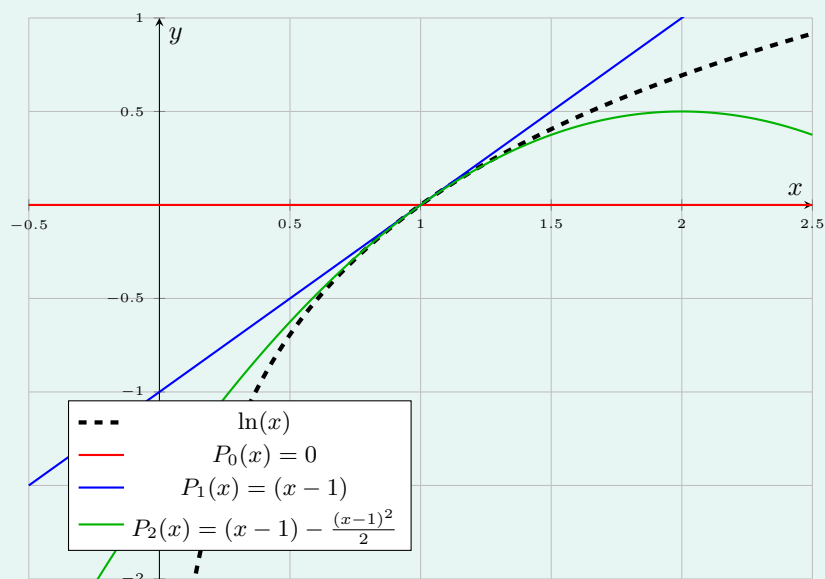
Vérification :

- Les correspondances d'ordre 0 et 1 sont préservées.
- On dérive deux fois : $P'_2(x) = 1 + 2c_2(x - 1)$ et $P''_2(x) = 2c_2$.
- On veut $P''_2(1) = 2c_2 = f''(1)$.
- La dérivée seconde de $f(x)$ est $f''(x) = -1/x^2$, donc $f''(1) = -1$. On choisit $c_2 = -1/2$.

Notre polynôme est $P_2(x) = (x - 1) - \frac{1}{2}(x - 1)^2$.

4. Le schéma général

Le coefficient c_k du terme $(x - a)^k$ est choisi pour faire correspondre la k -ième dérivée. La dérivation de $c_k(x - a)^k$ k fois donne $c_k \cdot k!$. On impose donc $c_k \cdot k! = f^{(k)}(a)$, ce qui mène directement à la formule générale $c_k = \frac{f^{(k)}(a)}{k!}$.



Approximation de $\ln(x)$ autour de $a = 1$. Le polynôme "colle" à la fonction près de $x = 1$.

6.3 La Fonction Exponentielle (e^x)

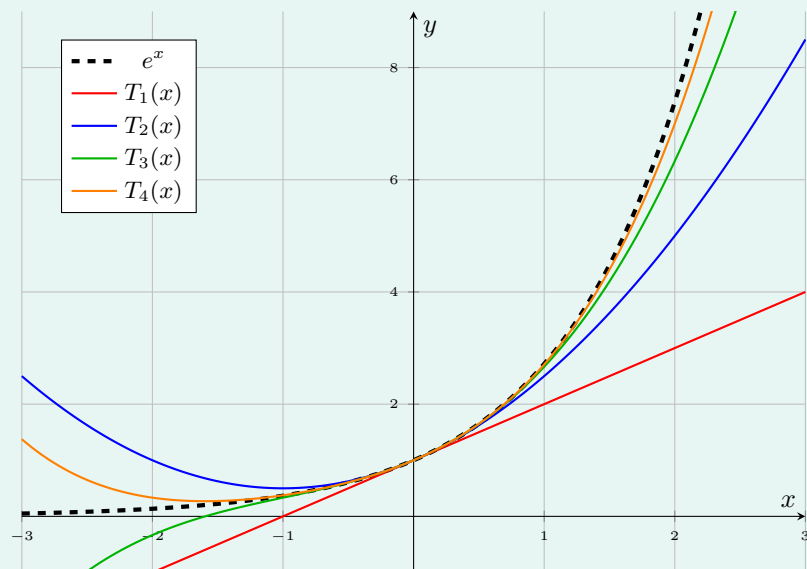
Théorème : Série de Maclaurin pour e^x

Pour tout nombre réel x , la fonction exponentielle peut s'écrire :

$$e^x = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{x^k}{k!} = 1 + x + \frac{x^2}{2!} + \frac{x^3}{3!} + \frac{x^4}{4!} + \dots$$

Intuition : Visualiser la Croissance Exponentielle

La fonction exponentielle est unique car elle est sa propre dérivée. Cela signifie que toutes ses informations locales (valeur, pente, courbure) en $a = 0$ sont égales à **1**. La série pour e^x est donc le polynôme le plus « pur », où chaque terme x^k est simplement normalisé par $k!$. Le graphique ci-dessous montre comment les polynômes de Taylor convergent rapidement vers la véritable courbe exponentielle, illustrant sa croissance puissante.



Approximation de e^x par ses polynômes de Maclaurin.

Preuve

Soit $f(x) = e^x$. Pour tout entier $k \geq 0$, la k -ième dérivée est $f^{(k)}(x) = e^x$. En évaluant en $a = 0$, on obtient $f^{(k)}(0) = e^0 = 1$ pour tout k . En appliquant la formule de Maclaurin :

$$e^x = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{f^{(k)}(0)}{k!} x^k = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{k!} x^k = 1 + x + \frac{x^2}{2} + \frac{x^3}{6} + \dots$$

6.4 La Fonction Sinus ($\sin(x)$)

Théorème : Série de Maclaurin pour $\sin(x)$

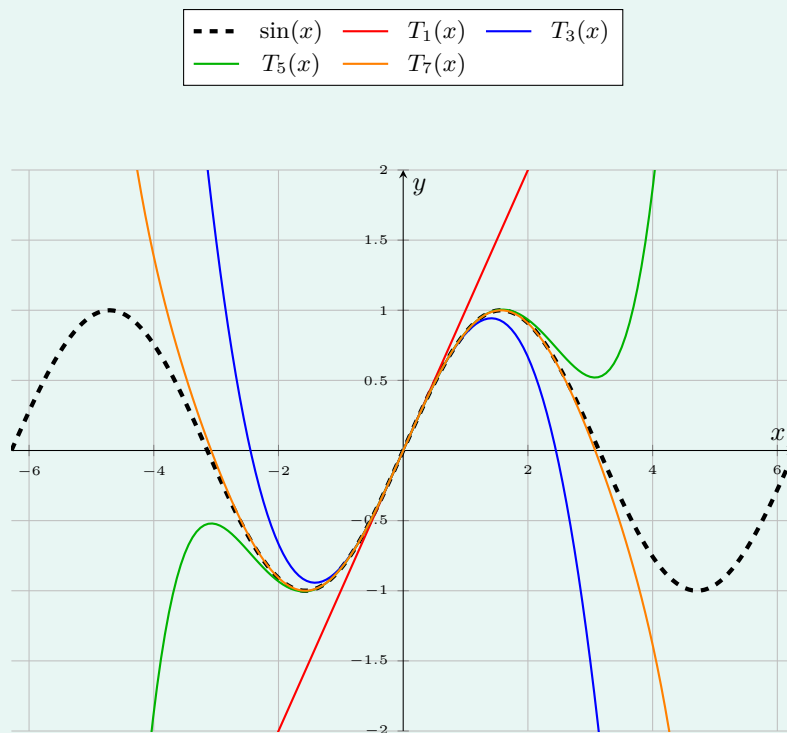
Pour tout nombre réel x :

$$\sin(x) = \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k \frac{x^{2k+1}}{(2k+1)!} = x - \frac{x^3}{3!} + \frac{x^5}{5!} - \frac{x^7}{7!} + \dots$$

Intuition : Visualiser l'Oscillation du Sinus

La série du sinus reflète ses propriétés fondamentales. En tant que fonction **impair** ($\sin(-x) = -\sin(x)$), son développement ne contient que des puissances **impaires** de

x . Les signes alternés capturent sa nature oscillatoire. Le graphique ci-dessous montre comment l'ajout de termes permet au polynôme d'« épouser » la courbe du sinus sur un plus grand nombre de périodes.



Approximation de $\sin(x)$ par ses polynômes de Maclaurin.

Preuve

Soit $f(x) = \sin(x)$. Les dérivées en $a = 0$ suivent un cycle $(0, 1, 0, -1, \dots)$. Seuls les termes d'ordre impair $(2k+1)$ sont non nuls, avec des valeurs de $(-1)^k$, ce qui donne la formule.

6.5 La Fonction Cosinus ($\cos(x)$)

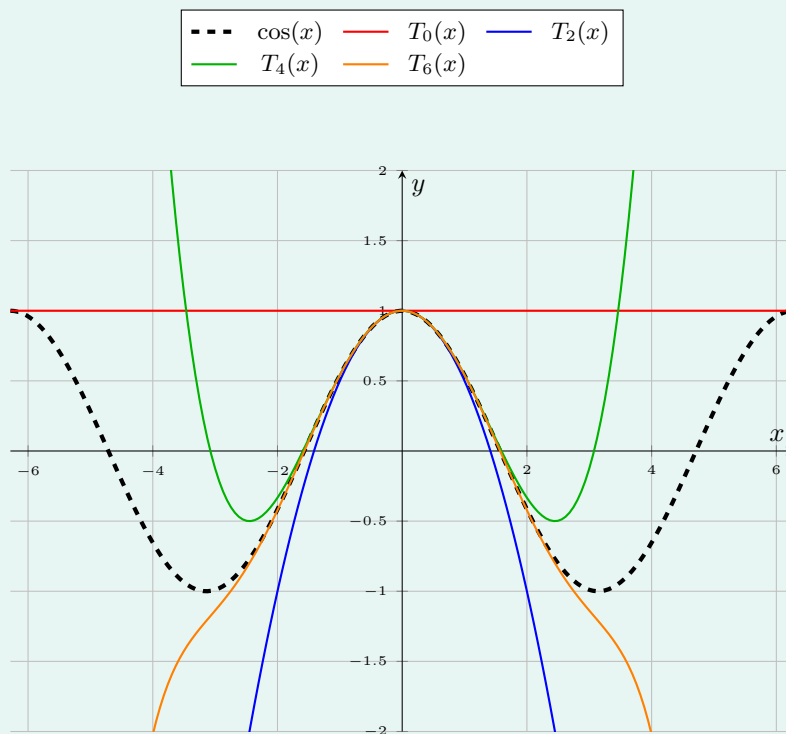
Théorème : Série de Maclaurin pour $\cos(x)$

Pour tout nombre réel x :

$$\cos(x) = \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k \frac{x^{2k}}{(2k)!} = 1 - \frac{x^2}{2!} + \frac{x^4}{4!} - \frac{x^6}{6!} + \dots$$

Intuition : Visualiser la Symétrie du Cosinus

En tant que fonction **paire** ($\cos(-x) = \cos(x)$), la série du cosinus ne contient, de manière appropriée, que des puissances **paire**s de x . Elle commence à 1 (son maximum) puis oscille, un comportement capturé par les signes alternés.



Approximation de $\cos(x)$ par ses polynômes de Maclaurin.

Preuve

Soit $g(x) = \cos(x)$. Les dérivées en $a = 0$ suivent un cycle $(1, 0, -1, 0, \dots)$. Seuls les termes d'ordre pair $(2k)$ sont non nuls, avec des valeurs de $(-1)^k$, ce qui donne la formule.

6.6 Le Logarithme Népérien ($\ln(1+x)$)

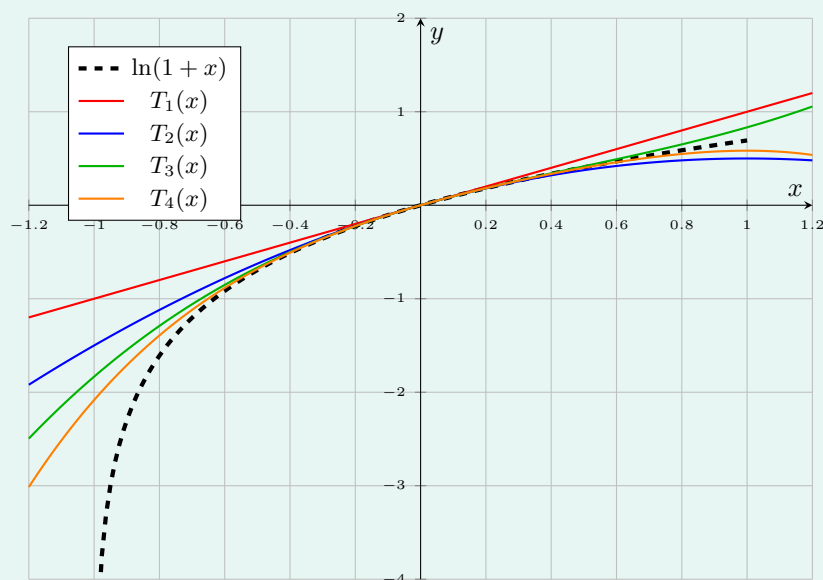
Théorème : Série de Maclaurin pour $\ln(1+x)$

Pour $|x| < 1$:

$$\ln(1+x) = \sum_{k=1}^{\infty} (-1)^{k-1} \frac{x^k}{k} = x - \frac{x^2}{2} + \frac{x^3}{3} - \frac{x^4}{4} + \dots$$

Intuition : Visualiser l'Approximation Logarithmique

Cette série est essentielle pour approximer les logarithmes près de 1. Contrairement aux fonctions précédentes, elle ne converge que pour $|x| < 1$. Le graphique montre que l'approximation est excellente près de $x = 0$ mais diverge rapidement lorsque x s'approche de la frontière de convergence à $x = 1$.



Approximation de $\ln(1+x)$ par ses polynômes de Maclaurin.

Preuve

Soit $f(x) = \ln(1+x)$. Pour $k \geq 1$, la k -ième dérivée en $a = 0$ est $f^{(k)}(0) = (-1)^{k-1}(k-1)!$. En substituant cela dans la formule de Maclaurin, le $(k-1)!$ au numérateur annule partiellement le $k!$ au dénominateur, laissant un k en bas.

6.7 La Série Géométrique ($\frac{1}{1-x}$)

Théorème : Série de Maclaurin pour $\frac{1}{1-x}$

Pour $|x| < 1$:

$$\frac{1}{1-x} = \sum_{k=0}^{\infty} x^k = 1 + x + x^2 + x^3 + \dots$$

Intuition : Le Fondement de Nombreuses Séries

Cette série, connue sous le nom de série géométrique, est l'un des développements en série de puissances les plus fondamentaux. Elle converge uniquement lorsque la valeur absolue de x est inférieure à 1. Chaque coefficient est simplement 1, ce qui en fait la série de Maclaurin la plus simple. De nombreuses autres séries, comme celle de $\ln(1+x)$ ou de $\arctan(x)$, peuvent être dérivées de celle-ci par intégration ou substitution.

Preuve

Soit $f(x) = (1-x)^{-1}$. Les dérivées successives sont $f'(x) = 1(1-x)^{-2}$, $f''(x) = 2(1-x)^{-3}$, $f'''(x) = 6(1-x)^{-4}$, et ainsi de suite. La formule générale pour la k -ième dérivée est $f^{(k)}(x) = k!(1-x)^{-(k+1)}$. En évaluant en $a = 0$, on obtient $f^{(k)}(0) = k!$. En substituant dans la formule de Maclaurin :

$$\frac{1}{1-x} = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{f^{(k)}(0)}{k!} x^k = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{k!}{k!} x^k = \sum_{k=0}^{\infty} x^k$$

6.8 Exercices

Exercice : Termes de base

Trouvez les quatre premiers termes non nuls de la série de Maclaurin pour $f(x) = \cos(2x)$.

Correction

On utilise la série connue de $\cos(u) = 1 - \frac{u^2}{2!} + \frac{u^4}{4!} - \frac{u^6}{6!} + \dots$. En substituant $u = 2x$, on obtient :

$$\cos(2x) = 1 - \frac{(2x)^2}{2!} + \frac{(2x)^4}{4!} - \frac{(2x)^6}{6!} + \dots$$

$$\cos(2x) = 1 - \frac{4x^2}{2} + \frac{16x^4}{24} - \frac{64x^6}{5040} + \dots$$

$$\cos(2x) = 1 - 2x^2 + \frac{2}{3}x^4 - \frac{4}{315}x^6 + \dots$$

Les quatre premiers termes sont $1, -2x^2, \frac{2}{3}x^4$ et $-\frac{4}{315}x^6$.

Exercice : Dérivation de séries

Utilisez la série de Maclaurin de $\sin(x)$ pour trouver la série de Maclaurin de $\cos(x)$.

Correction

On sait que $\frac{d}{dx}(\sin(x)) = \cos(x)$. On peut dériver la série de $\sin(x)$ terme à terme :

$$\sin(x) = x - \frac{x^3}{3!} + \frac{x^5}{5!} - \frac{x^7}{7!} + \dots$$

$$\frac{d}{dx} \sin(x) = \frac{d}{dx} \left(x - \frac{x^3}{6} + \frac{x^5}{120} - \dots \right)$$

$$\cos(x) = 1 - \frac{3x^2}{6} + \frac{5x^4}{120} - \dots = 1 - \frac{x^2}{2} + \frac{x^4}{24} - \dots = 1 - \frac{x^2}{2!} + \frac{x^4}{4!} - \dots$$

On retrouve bien la série de Maclaurin pour $\cos(x)$.

Exercice : Intégration de séries

Trouvez la série de Maclaurin pour $\arctan(x)$ en intégrant la série de $\frac{1}{1+x^2}$.

Correction

On part de la série géométrique $\frac{1}{1-u} = \sum_{k=0}^{\infty} u^k$. En posant $u = -x^2$, on obtient :

$$\frac{1}{1+x^2} = \sum_{k=0}^{\infty} (-x^2)^k = \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k x^{2k} = 1 - x^2 + x^4 - x^6 + \dots$$

Puisque $\int \frac{1}{1+x^2} dx = \arctan(x)$, on intègre la série terme à terme :

$$\arctan(x) = \int (1 - x^2 + x^4 - \dots) dx = C + x - \frac{x^3}{3} + \frac{x^5}{5} - \dots$$

Comme $\arctan(0) = 0$, la constante d'intégration C est nulle.

$$\arctan(x) = \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k \frac{x^{2k+1}}{2k+1}$$

Exercice : Approximation de valeur

Utilisez les trois premiers termes non nuls de la série de Maclaurin de e^x pour approximer la valeur de \sqrt{e} .

Correction

On veut approximer $\sqrt{e} = e^{0.5}$. La série est $e^x \approx 1 + x + \frac{x^2}{2!}$. En posant $x = 0.5$:

$$e^{0.5} \approx 1 + 0.5 + \frac{(0.5)^2}{2} = 1 + 0.5 + \frac{0.25}{2} = 1.5 + 0.125 = 1.625$$

La valeur réelle est $e^{0.5} \approx 1.6487$. L'approximation est raisonnablement proche.

Exercice : Série de Taylor non centrée en 0

Trouvez la série de Taylor pour $f(x) = \ln(x)$ centrée en $a = 1$.

Correction

On calcule les dérivées de $f(x) = \ln(x)$ et on les évalue en $a = 1$. $f(x) = \ln(x) \implies f(1) = 0$ $f'(x) = 1/x \implies f'(1) = 1$ $f''(x) = -1/x^2 \implies f''(1) = -1$ $f'''(x) = 2/x^3 \implies f'''(1) = 2$ $f^{(k)}(x) = (-1)^{k-1}(k-1)!/x^k \implies f^{(k)}(1) = (-1)^{k-1}(k-1)!$ pour $k \geq 1$. La série de Taylor est :

$$\ln(x) = \sum_{k=1}^{\infty} \frac{(-1)^{k-1}(k-1)!}{k!} (x-1)^k = \sum_{k=1}^{\infty} \frac{(-1)^{k-1}}{k} (x-1)^k$$

Exercice : Identifier une fonction

Quelle fonction est représentée par la série de Maclaurin $\sum_{k=0}^{\infty} \frac{(-1)^k x^{2k}}{(2k)!}$?

Correction

Cette série est $1 - \frac{x^2}{2!} + \frac{x^4}{4!} - \frac{x^6}{6!} + \dots$. Il s'agit de la série de Maclaurin de la fonction $\cos(x)$.

Exercice : Série binomiale

Trouvez les trois premiers termes de la série de Maclaurin pour $f(x) = \sqrt{1+x}$.

Correction

On utilise la série binomiale $(1+x)^\alpha$ avec $\alpha = 1/2$.

$$(1+x)^{1/2} = 1 + \alpha x + \frac{\alpha(\alpha-1)}{2!}x^2 + \dots$$

$$(1+x)^{1/2} = 1 + \frac{1}{2}x + \frac{\frac{1}{2}(\frac{1}{2}-1)}{2}x^2 + \dots$$

$$(1+x)^{1/2} = 1 + \frac{1}{2}x + \frac{\frac{1}{2}(-\frac{1}{2})}{2}x^2 + \dots = 1 + \frac{1}{2}x - \frac{1}{8}x^2 + \dots$$

Exercice : Multiplication de séries

Trouvez les termes jusqu'à x^3 pour la série de Maclaurin de $f(x) = e^x \sin(x)$.

Correction

On multiplie les développements de e^x et $\sin(x)$:

$$e^x \sin(x) = \left(1 + x + \frac{x^2}{2} + \frac{x^3}{6} + \dots\right) \left(x - \frac{x^3}{6} + \dots\right)$$

On collecte les termes par puissance croissante :

· Terme en x : $1 \cdot x = x$

- Terme en x^2 : $x \cdot x = x^2$
- Terme en x^3 : $1 \cdot \left(-\frac{x^3}{6}\right) + \frac{x^2}{2} \cdot x = -\frac{x^3}{6} + \frac{x^3}{2} = \frac{2x^3}{6} = \frac{x^3}{3}$

Donc, $e^x \sin(x) = x + x^2 + \frac{x^3}{3} + \dots$.

Exercice : Calcul de limite

Évaluez la limite suivante en utilisant les séries de Maclaurin : $\lim_{x \rightarrow 0} \frac{\sin(x) - x}{x^3}$.

Correction

On remplace $\sin(x)$ par son développement :

$$\begin{aligned} \lim_{x \rightarrow 0} \frac{\left(x - \frac{x^3}{3!} + \frac{x^5}{5!} - \dots\right) - x}{x^3} \\ = \lim_{x \rightarrow 0} \frac{-\frac{x^3}{6} + \frac{x^5}{120} - \dots}{x^3} \\ = \lim_{x \rightarrow 0} \left(-\frac{1}{6} + \frac{x^2}{120} - \dots\right) = -\frac{1}{6} \end{aligned}$$

Exercice : Fonction hyperbolique

Trouvez la série de Maclaurin pour le cosinus hyperbolique, $\cosh(x) = \frac{e^x + e^{-x}}{2}$.

Correction

On utilise les séries de e^x et e^{-x} : $e^x = 1 + x + \frac{x^2}{2!} + \frac{x^3}{3!} + \dots$ $e^{-x} = 1 - x + \frac{x^2}{2!} - \frac{x^3}{3!} + \dots$
 En les additionnant, les termes de puissance impaire s'annulent : $e^x + e^{-x} = 2 + 2\frac{x^2}{2!} + 2\frac{x^4}{4!} + \dots$ En divisant par 2 :

$$\cosh(x) = 1 + \frac{x^2}{2!} + \frac{x^4}{4!} + \frac{x^6}{6!} + \dots = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{x^{2k}}{(2k)!}$$

Exercice : Coefficient de Taylor

Soit $f(x) = \frac{x^2}{1+x^3}$. Trouvez la valeur de la 8ème dérivée en zéro, $f^{(8)}(0)$.

Correction

On sait que le coefficient du terme x^k dans une série de Maclaurin est $\frac{f^{(k)}(0)}{k!}$. On développe $f(x)$:

$$f(x) = x^2 \cdot \frac{1}{1 - (-x^3)} = x^2 \sum_{n=0}^{\infty} (-x^3)^n = x^2 \sum_{n=0}^{\infty} (-1)^n x^{3n} = \sum_{n=0}^{\infty} (-1)^n x^{3n+2}$$

On cherche le terme en x^8 . On doit avoir $3n + 2 = 8$, ce qui donne $3n = 6$, soit $n = 2$. Le coefficient de x^8 est donc $(-1)^2 = 1$. On a alors $\frac{f^{(8)}(0)}{8!} = 1$, ce qui implique $f^{(8)}(0) = 8! = 40320$.

Exercice : Approximation d'intégrale

Estimez la valeur de $\int_0^1 \sin(x^2) dx$ en utilisant les deux premiers termes non nuls de la série de Maclaurin de la fonction à intégrer.

Correction

On part de $\sin(u) = u - \frac{u^3}{6} + \dots$. On pose $u = x^2$:

$$\sin(x^2) = x^2 - \frac{(x^2)^3}{6} + \dots = x^2 - \frac{x^6}{6} + \dots$$

On intègre ce polynôme de 0 à 1 :

$$\begin{aligned} \int_0^1 \left(x^2 - \frac{x^6}{6} \right) dx &= \left[\frac{x^3}{3} - \frac{x^7}{42} \right]_0^1 \\ &= \left(\frac{1}{3} - \frac{1}{42} \right) - 0 = \frac{14-1}{42} = \frac{13}{42} \approx 0.3095 \end{aligned}$$

Exercice : Un autre centre

Trouvez les trois premiers termes de la série de Taylor pour $f(x) = \frac{1}{x}$ centrée en $a = 2$.

Correction

On calcule les dérivées et on les évalue en $a = 2$. $f(x) = x^{-1} \implies f(2) = 1/2$
 $f'(x) = -x^{-2} \implies f'(2) = -1/4$ $f''(x) = 2x^{-3} \implies f''(2) = 2/8 = 1/4$ La série commence par :

$$f(x) \approx f(2) + f'(2)(x-2) + \frac{f''(2)}{2!}(x-2)^2$$
$$f(x) \approx \frac{1}{2} - \frac{1}{4}(x-2) + \frac{1/4}{2}(x-2)^2 = \frac{1}{2} - \frac{1}{4}(x-2) + \frac{1}{8}(x-2)^2$$

Exercice : Combinaison de séries

Trouvez le terme en x^4 du développement de Maclaurin de $f(x) = \ln(1-x^2)$.

Correction

On utilise la série de $\ln(1+u) = u - \frac{u^2}{2} + \frac{u^3}{3} - \frac{u^4}{4} + \dots$. On substitue $u = -x^2$:

$$\begin{aligned}\ln(1-x^2) &= (-x^2) - \frac{(-x^2)^2}{2} + \frac{(-x^2)^3}{3} - \frac{(-x^2)^4}{4} + \dots \\ &= -x^2 - \frac{x^4}{2} - \frac{x^6}{3} - \frac{x^8}{4} - \dots\end{aligned}$$

Le terme en x^4 est $-\frac{x^4}{2}$.

Exercice : Application en physique

En relativité restreinte, l'énergie cinétique d'une particule est $K = mc^2(\gamma - 1)$, où $\gamma = (1 - v^2/c^2)^{-1/2}$. Montrez que pour des vitesses faibles ($v \ll c$), cette formule se réduit à la formule classique $K \approx \frac{1}{2}mv^2$.

Correction

On utilise le développement binomial $(1+x)^\alpha$ avec $x = -v^2/c^2$ et $\alpha = -1/2$.

$$\gamma = \left(1 - \frac{v^2}{c^2}\right)^{-1/2} \approx 1 + \alpha x = 1 + \left(-\frac{1}{2}\right) \left(-\frac{v^2}{c^2}\right) = 1 + \frac{1}{2} \frac{v^2}{c^2}$$

On substitue ce résultat dans la formule de l'énergie :

$$K = mc^2(\gamma - 1) \approx mc^2 \left(\left(1 + \frac{1}{2} \frac{v^2}{c^2} \right) - 1 \right)$$

$$K \approx mc^2 \left(\frac{1}{2} \frac{v^2}{c^2} \right) = \frac{1}{2} mv^2$$

On retrouve bien l'énergie cinétique classique comme approximation de premier ordre.