

Rappels de probabilités

Olivier FAUGERAS

18 Novembre 2009

Plan

Définitions

Valeurs moyennes, variances

Fonctions de distribution, densités

Indépendance

Le lemme de Borel-Cantelli

Fonctions caractéristiques

Espérances conditionnelles

Fluctuations

Plan

Définitions

Valeurs moyennes, variances

Fonctions de distribution, densités

Indépendance

Le lemme de Borel-Cantelli

Fonctions caractéristiques

Espérances conditionnelles

Fluctuations

Plan

Définitions

Valeurs moyennes, variances

Fonctions de distribution, densités

Indépendance

Le lemme de Borel-Cantelli

Fonctions caractéristiques

Espérances conditionnelles

Fluctuations

Plan

Définitions

Valeurs moyennes, variances

Fonctions de distribution, densités

Indépendance

Le lemme de Borel-Cantelli

Fonctions caractéristiques

Espérances conditionnelles

Fluctuations

Plan

Définitions

Valeurs moyennes, variances

Fonctions de distribution, densités

Indépendance

Le lemme de Borel-Cantelli

Fonctions caractéristiques

Espérances conditionnelles

Fluctuations

Plan

Définitions

Valeurs moyennes, variances

Fonctions de distribution, densités

Indépendance

Le lemme de Borel-Cantelli

Fonctions caractéristiques

Espérances conditionnelles

Fluctuations

Plan

Définitions

Valeurs moyennes, variances

Fonctions de distribution, densités

Indépendance

Le lemme de Borel-Cantelli

Fonctions caractéristiques

Espérances conditionnelles

Fluctuations

Plan

Définitions

Valeurs moyennes, variances

Fonctions de distribution, densités

Indépendance

Le lemme de Borel-Cantelli

Fonctions caractéristiques

Espérances conditionnelles

Fluctuations

Espace de probabilités

Soit Ω un ensemble non vide.

Définition

Une tribu ou σ -algèbre est un ensemble \mathcal{A} de sous-ensembles de Ω avec les propriétés suivantes

1. $\emptyset, \Omega \in \mathcal{A}$,
2. Si $A \in \mathcal{A}$ alors $A^c \in \mathcal{A}$,
3. Si $A_1, A_2, \dots \in \mathcal{A}$, alors $\bigcup_{k=1}^{\infty} A_k, \bigcap_{k=1}^{\infty} A_k \in \mathcal{A}$.

Espace de probabilités

Définition

Soit \mathcal{A} une σ -algèbre de Ω . Une application $P : \mathcal{A} \rightarrow [0, 1]$ est une mesure de probabilité sur (Ω, \mathcal{A}) si

1. $P(\emptyset) = 0, P(\Omega) = 1,$
2. Si $A_1, A_2, \dots \in \mathcal{A}$, alors

$$P\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} A_k\right) \leq \sum_{k=1}^{\infty} P(A_k)$$

3. Si $A_1, A_2, \dots \in \mathcal{A}$ sont disjoints alors

$$P\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} A_k\right) = \sum_{k=1}^{\infty} P(A_k)$$

Espace de probabilités

- ▶ Un élément A de \mathcal{A} est un *événement*.
- ▶ $P(A)$ est la probabilité de l'événement A .
- ▶ Une propriété vraie sauf pour un événement de probabilité nulle est dite vraie presque sûrement (p.s.).
- ▶ Si $\Omega = \mathbb{R}^n$, la plus petite σ -algèbre, notée \mathbb{B} , contenant tous les ouverts de \mathbb{R}^n s'appelle la tribu des boréliens.

Variables aléatoires

Définition

Soit (Ω, \mathcal{A}, P) un espace de probabilité. Une application

$$\mathbf{X} : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^n$$

est une variable aléatoire (v.a.) de dimension n si pour tout borélien $B \in \mathbb{B}$, $\mathbf{X}^{-1}(B) \in \mathcal{A}$. On dit aussi que \mathbf{X} est \mathcal{A} -mesurable.

Lemme

Soit $\mathbf{X} : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^n$ une variable aléatoire. Alors

$$\mathcal{A}(\mathbf{X}) = \{\mathbf{X}^{-1}(B) \mid B \in \mathbb{B}\}$$

est une σ -algèbre, dite engendrée par \mathbf{X} .

Variables aléatoires

- ▶ Soit $A \in \mathcal{A}$, la fonction indicatrice de A

$$\chi_A(\omega) = \begin{cases} 1 & \text{si } \omega \in A \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}$$

est une v.a.

- ▶ Si $A_1, \dots, A_m \in \mathcal{A}$ satisfont $\bigcup_{k=1}^m A_k = \Omega$ et a_1, \dots, a_m sont des réels, $X = \sum_{k=1}^m a_k \chi_{A_k}$ est une v.a. appelée simple.

Processus stochastiques

Définition

1. *Un processus stochastique est une famille $\{\mathbf{X}(t) \mid t \geq 0\}$ de variables aléatoires indexée par le réel positif t .*
2. *Pour chaque point ω de Ω , la fonction $t \rightarrow \mathbf{X}(t, \omega)$ s'appelle une trajectoire.*

Processus stochastiques

Définition

Un processus $Y(\cdot)$ est une modification du processus $X(\cdot)$ si $P(Y_t = X_t) = 1$ pour tout $t \geq 0$.

Les processus X et Y sont aussi dits indiscernables.

Intégration

- ▶ Pour toute v.a. simple $X = \sum_{k=1}^m a_k \chi_{A_k}$ on définit

$$\int_{\Omega} X dP = \sum_{k=1}^m a_k P(A_k)$$

- ▶ Si X est une v.a. réelle non négative on définit

$$\int_{\Omega} X dP = \sup_{Y \leq X, Y \text{ simple}} \int_{\Omega} Y dP$$

- ▶ Si X est une v.a. réelle on définit

$$\int_{\Omega} X dP = \int_{\Omega} X^+ dP - \int_{\Omega} X^- dP, \quad X^+ = \max(X, 0)$$

$$X^- = \max(-X, 0)$$

- ▶ Si \mathbf{X} est une variable aléatoire de dimension n on définit

$$\int_{\Omega} \mathbf{X} dP = (\int_{\Omega} X_1 dP, \dots, \int_{\Omega} X_n dP)$$

Intégration

Définition

L'espérance ou la valeur moyenne $\mathbb{E}(\mathbf{X})$ d'une v.a. est l'intégrale $\int_{\Omega} \mathbf{X} dP$.

Définition

La variance $V(\mathbf{X})$ d'une v.a. est l'intégrale $\int_{\Omega} |\mathbf{X} - \mathbb{E}(\mathbf{X})|^2 dP$.
On remarque que $V(\mathbf{X}) = \mathbb{E}(|\mathbf{X}|^2) - |\mathbb{E}(\mathbf{X})|^2$.

Lemme (inégalité de Chebyshev)

Soit \mathbf{X} une v.a. réelle et p un réel tel que $1 \leq p < \infty$, alors

$$P(|\mathbf{X}| \geq \lambda) \leq \frac{1}{\lambda^p} \mathbb{E}(|\mathbf{X}|^p) \quad \forall \lambda > 0$$

Fonctions de distribution

Définition

1. Soit \mathbf{X} une v.a. de dimension n . La fonction de distribution de \mathbf{X} est la fonction $F_{\mathbf{X}} : \mathbb{R}^n \rightarrow [0, 1]$

$$F_{\mathbf{X}}(x) = P(\mathbf{X} \leq x) \forall x \in \mathbb{R}^n$$

2. Soient X_1, \dots, X_m m v.a. réelles de dimension n . Leur fonction de répartition jointe est la fonction $F_{\mathbf{X}_1, \dots, \mathbf{X}_m} : (\mathbb{R}^n)^m \rightarrow [0, 1]$

$$F_{\mathbf{X}_1, \dots, \mathbf{X}_m}(x_1, \dots, x_m) = P(\mathbf{X}_1 \leq x_1, \dots, \mathbf{X}_m \leq x_m)$$

Fonctions de densité

Définition

Soit \mathbf{X} une v.a. de dimension n et F sa fonction de distribution. S'il existe une fonction intégrable positive $f : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ telle que

$$F(x) = F(x_1, \dots, x_n) = \int_{-\infty}^{x_1} \cdots \int_{-\infty}^{x_n} f(y_1, \dots, y_n) dy_n \cdots dy_1$$

on dit que f est la fonction de densité de \mathbf{X} (par rapport à la mesure de Lebesgue sur \mathbb{R}^n).

Indépendance

Définition

Soient A_1, \dots, A_n, \dots des événements. Ils sont dits indépendants si pour tous $1 \leq k_1 \leq \dots \leq k_m$ on a

$$P(A_{k_1} \cap \dots \cap A_{k_m}) = P(A_{k_1}) \dots P(A_{k_m})$$

Indépendance

Définition

Soient $\mathcal{A}_i \subset \mathcal{A}$, $i = 1, \dots$ des σ -algèbres. On dit qu'elles sont indépendantes si pour tous $1 \leq k_1 \leq \dots \leq k_m$ pour tous événements $A_{k_i} \in \mathcal{A}_{k_i}$

$$P(A_{k_1} \cap \dots \cap A_{k_m}) = P(A_{k_1}) \dots P(A_{k_m})$$

Indépendance

Définition

Soient \mathbf{X}_i , $i = 1, \dots$ des v.a. de dimension n . Elles sont indépendantes si pour tout entier $k \geq 2$ et quels que soient les boréliens B_1, \dots, B_k de \mathbb{R}^n on a

$$P(\mathbf{X}_1 \in B_1, \dots, \mathbf{X}_k \in B_k) = P(\mathbf{X}_1 \in B_1) \cdots P(\mathbf{X}_k \in B_k)$$

Indépendance

Les variables aléatoires $\mathbf{X}_1, \dots, \mathbf{X}_m$ de dimension n sont indépendantes si et seulement si

$$F_{\mathbf{X}_1, \dots, \mathbf{X}_m}(x_1, \dots, x_m) = F_{\mathbf{X}_1}(x_1) \cdots F_{\mathbf{X}_m}(x_m) \forall x_i \in \mathbb{R}^n, i = 1, \dots, m$$

Si elles ont des densités on a l'équivalence

$$f_{\mathbf{X}_1, \dots, \mathbf{X}_m}(x_1, \dots, x_m) = f_{\mathbf{X}_1}(x_1) \cdots f_{\mathbf{X}_m}(x_m) \forall x_i \in \mathbb{R}^n, i = 1, \dots, m$$

Indépendance

Théorème

Si X_1, \dots, X_m sont des v.a. réelles indépendantes telles que $\mathbb{E}(|X_i|) < \infty, i = 1, \dots, m$ alors $\mathbb{E}(|X_1 \cdots X_m|) < \infty$ et

$$\mathbb{E}(X_1 \cdots X_m) = \mathbb{E}(X_1) \cdots \mathbb{E}(X_m)$$

Théorème

Si X_1, \dots, X_m sont des v.a. réelles indépendantes telles que $V(|X_i|) < \infty, i = 1, \dots, m$ alors

$$V(X_1 + \cdots + X_m) = V(X_1) + \cdots + V(X_m)$$

Le lemme de Borel-Cantelli

Définition

Soit A_n , $n \geq 1$ une suite d'événements d'un espace de probabilité. L'événement

$$\bigcap_{n=1}^{\infty} \bigcup_{m=n}^{\infty} A_m = \{\omega \in \Omega \mid \omega \in \text{un nombre infini de } A_n\}$$

s'appelle " A_n infiniment souvent", en abrégé " A_n i.s."

Lemme

Si $\sum_{n=1}^{\infty} P(A_n) < \infty$ alors $P(A_n \text{ i.s.}) = 0$.

Le lemme de Borel-Cantelli

Application : une suite de v.a. $\{X_k\}_{k=1}^{\infty}$ converge en probabilité vers une v.a. X si

$$\lim_{k \rightarrow \infty} P(|X_k - X| > \varepsilon) = 0$$

Théorème

Si $X_k \rightarrow X$ en probabilité, alors il existe une sous-suite $\{X_{k_j}\}_{j=1}^{\infty} \subset \{X_k\}_{k=1}^{\infty}$ telle que

$$X_{k_j}(\omega) \rightarrow X(\omega) \text{ presque partout}$$

Le lemme de Borel-Cantelli

Preuve :

Pour chaque j on choisit $k_j > k_{j-1}$ suffisamment grand pour que $P(|X_{k_j} - X| > \frac{1}{j}) \leq \frac{1}{j^2}$. On considère la suite d'événements $A_j = \{|X_{k_j} - X| > \frac{1}{j}\}$ et $k_{j-1} < k_j < \dots$. Puisque $\sum \frac{1}{j^2} < \infty$, le lemme de Borel-Cantelli implique $P(A_j \text{ i.s.}) = 0$. Pour presque tous les échantillons ω on a donc $|X_{k_j}(\omega) - X(\omega)| \leq 1/j$ si $j \geq J$ pour un certain $J(\omega)$.

Fonctions caractéristiques

Définition

Soit X une v.a. à valeurs dans \mathbb{R}^n

$$\Phi_X(\lambda) = \mathbb{E} \left(e^{i\lambda \cdot X} \right) \quad \lambda \in \mathbb{R}^n$$

est la fonction caractéristique de X .

Fonctions caractéristiques

Lemme

1. Si X_1, \dots, X_m sont des v.a. indépendantes à valeurs dans \mathbb{R}^n alors

$$\Phi_{X_1 + \dots + X_m}(\lambda) = \Phi_{X_1}(\lambda) \cdots \Phi_{X_m}(\lambda)$$

2. Soit X une v.a.r.

$$\Phi^{(k)}(0) = i^k \mathbb{E}(X^k) \quad k = 0, 1, \dots$$

3. Si X et Y sont des v.a. telles que

$$\Phi_X(\lambda) = \Phi_Y(\lambda) \quad \forall \lambda$$

Alors

$$F_X(x) = F_Y(x) \quad \forall x$$

Motivation

Trouver une définition “raisonnable” de

$$\mathbb{E}(X | Y)$$

Si le “hasard” sélectionne un événement ω tel que la seule chose que nous connaissons à propos de ω soit $Y(\omega)$, quel est notre meilleure estimation de $X(\omega)$?

Un exemple

On se donne (Ω, \mathcal{A}, P) et une v.a. simple $Y = \sum_{i=1}^m a_i \chi_{A_i}$, les A_i ayant des probabilités positives et formant une partition de Ω . On définit alors

$$\mathbb{E}(X | Y) = \frac{1}{P(A_i)} \int_{A_i} X dP \text{ dans } A_i, i = 1, \dots, m$$

On a donc

- ▶ $\mathbb{E}(X | Y)$ est une v.a.
- ▶ $\mathbb{E}(X | Y)$ est mesurable par rapport à $\mathcal{A}(Y)$
- ▶ $\int_A X dP = \int_A \mathbb{E}(X | Y) dP$ pour tout $A \in \mathcal{A}(Y)$

Définition

L'exemple précédent motive la définition

Définition

Soit Y une v.a.. $\mathbb{E}(X | Y)$ est définie comme toute v.a. mesurable par rapport à $\mathcal{A}(Y)$ telle que

$$\int_A X dP = \int_A \mathbb{E}(X | Y) dP \quad \forall A \in \mathcal{A}(Y)$$

Définition

Puisque seule $\mathcal{A}(Y)$ intervient dans la définition, on définit

Définition

Soit (Ω, \mathcal{A}, P) un espace de probabilité et \mathcal{V} une tribu, $\mathcal{V} \subset \mathcal{A}$.

Soit $X : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^n$ une v.a. intégrable, $\mathbb{E}(X | \mathcal{V})$ est définie comme toute v.a. sur Ω telle que

1. $\mathbb{E}(X | \mathcal{V})$ est mesurable par rapport à \mathcal{V} , et
- 2.

$$\int_A X dP = \int_A \mathbb{E}(X | \mathcal{V}) dP \quad \forall A \in \mathcal{V}$$

On démontre que $\mathbb{E}(X | \mathcal{V})$ est unique modulo des ensembles \mathcal{V} -mesurable de mesure nulle.

Propriétés

1. $\mathbb{E}(X | Y) = \mathbb{E}(X | \mathcal{A}(Y))$
2. $\mathbb{E}(\mathbb{E}(X | \mathcal{V})) = \mathbb{E}(X)$
3. $\mathbb{E}(X) = \mathbb{E}(X | \mathcal{W})$ avec $\mathcal{W} = \{\emptyset, \Omega\}$.

Loi des grands nombres

Théorème

Soit X_n , $n \geq 1$ une suite de v.a.r. indépendantes, identiquement distribuées (i.i.d.) et intégrables de moyenne m .

$$P\left(\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{X_1 + \cdots + X_n}{n} = m\right) = 1$$

Théorème de Laplace-De Moivre

Lemme

Si les $X_i, i \geq 1$ sont i.i.d. à valeur dans $\{0, 1\}$ et telles que $P(X_1 = 1) = p \geq 0, P(X_1 = 0) = q \geq 0, p + q = 1$, alors

$$\mathbb{E}(X_1 + \cdots X_n) = np$$

et

$$V(X_1 + \cdots X_n) = npq$$

Théorème de Laplace-De Moivre

Théorème

Soient $X_i, i \geq 1$ des v.a.r. comme dans le lemme précédent et

$$S_n = X_1 + \cdots + X_n$$

Pour tout $-\infty < a < b < \infty$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} P \left(a \leq \frac{S_n - np}{\sqrt{npq}} \leq b \right) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_a^b e^{-\frac{x^2}{2}} dx$$