

PROBABILITES

1) PROBABILITES CONDITIONNELLES

Définition

Soit A et B deux événements tels que $P(B) \neq 0$.

On appelle « **probabilité conditionnelle de A par rapport à B** » ou « **probabilité de A sachant B** » le réel, noté

$P(A/B)$ ou $P_B(A)$ défini par :

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

Exemple :

Un lycée a présenté 356 candidats au bac, dont 96 en série S. 256 élèves ont été admis à l'examen ; parmi eux 64 provenaient de la série S. Un élève étant choisi au hasard parmi les candidats présentés par le lycée, on note A l'événement : « l'élève provient de la série S » et B l'événement : « l'élève a été reçu au bac ».

Chaque élève a la même chance d'être choisi ; par équiprobabilité, on a donc :

$$P(A) = \frac{96}{356}, P(B) = \frac{256}{356} \text{ et } P(A \cap B) = \frac{64}{356}$$

$$\text{On en déduit que } P(A/B) = \frac{P(A \cap B)}{P(B)} = \frac{64}{256} = \frac{1}{4} = 0,25$$

La probabilité que l'élève provienne de la série S **sachant qu'il est reçu au bac**, est donc égale à 0,25.

En général :
 $P(A/B) \neq P(B/A)$

$$\text{On a aussi } P(B/A) = \frac{P(B \cap A)}{P(A)} = \frac{P(A \cap B)}{P(A)} = \frac{64}{96} = \frac{2}{3}$$

Ainsi la probabilité que l'élève soit reçu au bac **sachant qu'il provient de la série S** est $\frac{2}{3}$.

Remarques :

- Si $A \subset B$, alors $A \cap B = A$ et $P(A/B) = \frac{P(A)}{P(B)}$
- Si $B \subset A$, alors $A \cap B = B$ et $P(A/B) = \frac{P(B)}{P(B)} = 1$
- On a $A \cap B \subset B$, donc $0 \leq P(A \cap B) \leq P(B)$ et en divisant les trois membres de cette inégalité par le nombre strictement positif $P(B)$, on obtient : $0 \leq \frac{P(A \cap B)}{P(B)} \leq 1 \Leftrightarrow 0 \leq P(A/B) \leq 1$
- $P(\bar{A}/B) = 1 - P(A/B)$

2) PROBABILITE D'UNE INTERSECTION

Propriété

Soit A et B deux événements tels que $P(B) \neq 0$ et $P(A) \neq 0$. On a :
 $P(A \cap B) = P(A) \times P(B/A)$ et $P(A \cap B) = P(B) \times P(A/B)$

Ces égalités se déduisent de la définition précédente.

Ces deux égalités se retiennent assez facilement : pour que l'événement A et B soit réalisé, il faut d'abord que l'événement A le soit, et sachant que l'événement A est réalisé, il faut ensuite que l'événement B le soit aussi ...

Exemple :

Une urne contient trois boules bleues et cinq rouges, indiscernables au toucher.

On tire au hasard une première boule de l'urne. Si elle est bleue, on la remet dans l'urne et on rajoute une autre boule bleue ; si elle est rouge, on ne la remet pas dans l'urne. On tire ensuite, au hasard, une seconde boule de l'urne.

On s'intéresse à la probabilité pour que les deux boules extraites soient bleues.

B_1 est l'événement : « la première boule extraite est bleue » ; B_2 est l'événement : « la seconde boule extraite est bleue ».

L'événement « les deux boules extraites sont bleues » est alors $B_1 \cap B_2$.

$$\text{On a } P(B_1 \cap B_2) = P(B_2/B_1) \times P(B_1)$$

Les boules ont la même chance d'être tirées ; par équiprobabilité, on a donc : $P(B_1) = \frac{3}{8}$

B_1 étant réalisé, on rajoute une boule bleue, si bien qu'au moment du second tirage il y a 4 boules bleues sur 9 boules dans l'urne. Ce qui permet d'écrire $P(B_2/B_1) = \frac{4}{9}$

On en déduit : $P(B_1 \cap B_2) = \frac{4}{9} \times \frac{3}{8} = \frac{1}{6}$. La probabilité que les deux boules extraites soient bleues est donc égale à $\frac{1}{6}$

3) EVENEMENTS INDEPENDANTS

Deux événements A et B de probabilités non nulles sont dits **indépendants** si le fait que l'un d'entre eux soit réalisé ou non n'influe pas la probabilité que l'autre soit réalisé, c'est à dire :

si $P(A/B) = P(A)$ ou si $P(B/A) = P(B)$

En utilisant la propriété précédente, on constate que l'indépendance de A et B se traduit par la relation $P(A \cap B) = P(A) \times P(B)$

Définition

Soit A et B deux événements de probabilités non nulles.

A et B sont dits **indépendants** s'ils vérifient l'une des trois conditions équivalentes suivantes :

- $P(A/B) = P(A)$
- $P(B/A) = P(B)$
- $P(A \cap B) = P(A) \times P(B)$

Exemple :

Une urne contient quatre boules bleues numérotées b1 , b1 , b2 et b3 , et six boules rouges numérotées r1 , r1 , r1 , r2 , r3 et r4 .

On suppose toutes ces boules indiscernables au toucher, et on en tire une au hasard.

On considère les événements :

B : « la boule tirée est bleue » ; R : « la boule tirée est rouge » ; Q : « la boule tirée porte le numéro 4 » ; U : « la boule tirée porte le numéro 1 ».

Les boules ont la même chance d'être tirées ; par équiprobabilité, on a donc :

$$P(U) = \frac{5}{10} = \frac{1}{2} ; P(B) = \frac{4}{10} = \frac{2}{5} \text{ et } P(B \cap U) = \frac{2}{10} = \frac{1}{5}$$

On a : $P(B \cap U) = P(B) \times P(U)$

Les événements B et U sont donc indépendants . Ce résultat s'explique en remarquant que la proportion des boules bleues portant le numéro 1 parmi les boules portant le numéro 1 est la même que celle des boules bleues parmi les boules de l'urne.

On a aussi $P(Q) = \frac{1}{10}$, $P(B) = \frac{2}{5}$ et $P(Q \cap B) = 0$

On a : $P(B \cap Q) \neq P(B) \times P(Q)$

Les événements B et Q ne sont donc pas indépendants .

Remarque :

Ne pas confondre événements **incompatibles** et événements **indépendants**.

Deux événements A et B sont incompatibles si et seulement si $A \cap B = \emptyset$. On a alors : $P(A \cup B) = P(A) + P(B)$

Dans l'exemple précédent, les événements B et U sont indépendants, mais non incompatibles ; les événements B et Q sont incompatibles et non indépendants.

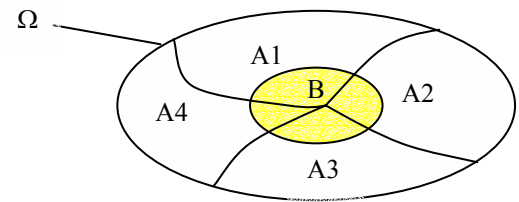
4) FORMULE DES PROBABILITES TOTALES

Ω est l'univers des événements élémentaires d'une expérience aléatoire. A_1, A_2, \dots, A_n désignent des événements de Ω .

Définition

Dire que A_1, A_2, \dots, A_n réalisent **une partition** de l'univers Ω , signifie que :

- les événements A_1, A_2, \dots, A_n sont deux à deux disjoints
- $A_1 \cup A_2 \cup \dots \cup A_n = \Omega$



Tout événement B est alors la réunion **disjointe** des événements $B \cap A_1, B \cap A_2, \dots, B \cap A_n$

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

De plus pour tout i tel que $1 \leq i \leq n$, on a $P(B \cap A_i) = P(B/A_i) \times P(A_i)$

Propriété : Formule des probabilités totales

Dans les conditions précédentes on a :

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

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

La deuxième formule permet de calculer la probabilité d'un événement B dans le cas (fréquent) où l'on connaît les probabilités $P(A_i)$ d'une famille d'événements A_i constituant une partition de l'univers Ω , ainsi que les probabilités conditionnelles de l'événement B par rapport à chaque événement A_i .

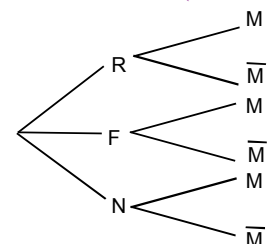
Exemple :

Un test d'une maladie est effectué sur la totalité d'une population.

Une étude statistique établit que 70 % de la population réagit négativement au test (événement N) , 20 % réagit faiblement au test (événement F) et 10 % réagit fortement au test (événement R) .

La probabilité pour une personne de cette population d'être atteinte de la maladie (événement M) est :

- 0,9 lorsque le test est fortement positif
- 0,6 lorsque le test est faiblement positif
- 0,05 lorsque le test est négatif



Par hypothèse, on a donc :

$$P(R) = 0,1 \text{ , } P(F) = 0,2 \text{ , } P(N) = 0,7 \text{ , } P(M/R) = 0,9 \text{ , } P(M/F) = 0,6 \text{ et } P(M/N) = 0,05$$

Les événements R , F et N constituent une partition de la population.

D'après la formule des probabilités totales, on en déduit que :

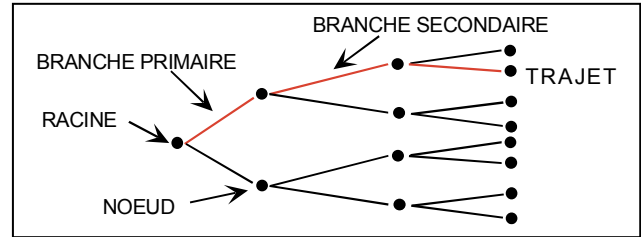
$$P(M) = P(M/R) \times P(R) + P(M/F) \times P(F) + P(M/N) \times P(N) = 0,9 \times 0,1 + 0,6 \times 0,2 + 0,05 \times 0,7 = 0,245$$

La probabilité pour qu'une personne de cette population soit atteinte de la maladie est donc égale à 0,245

5) REGLES DE CONSTRUCTION D'UN ARBRE PONDERE (ou arbre de probabilités)

Pour déterminer des probabilités, on peut être amené à construire des arbres dont les branches sont affectées de probabilités.

- Un arbre pondéré se construit et se lit de gauche à droite.
- L'origine de l'arbre est la **racine** de l'arbre.
- Les traits partant de la racine sont appelés **branches primaires** de l'arbre. Elles mènent à des **nœuds**.
- Les branches joignant deux nœuds sont dites **secondaires**.
- Tout chemin menant de la racine à un nœud est appelé **trajet**.



Règles

1. Les événements qui se trouvent aux extrémités des branches primaires forment une **partition** de l'univers Ω .
2. Le **poids** d'une branche primaire est la **probabilité** de l'événement qui se trouve à son extrémité.
3. Le poids d'une branche secondaire est la **probabilité conditionnelle** de l'événement qui se trouve à son extrémité sachant que le trajet menant à son origine a été réalisé.
4. Le poids ou la probabilité d'un trajet est le **produit** des poids des branches le constituant.
5. La probabilité d'un événement associé à plusieurs trajets complets est la **somme** des probabilités de ces trajets

Remarques :

- La somme des poids des branches primaires vaut 1.
- La somme des poids des branches secondaires issues d'un même nœud vaut 1.

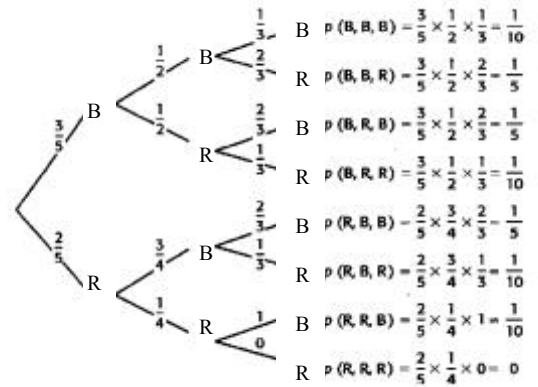
Exemple :

Une urne contient trois boules bleues et deux boules rouges.

On tire successivement et sans remise trois boules de l'urne.

L'expérience aléatoire peut être décrite par l'arbre pondéré suivant :

- La probabilité que la troisième boule soit rouge sachant que les deux premières étaient bleues est $\frac{2}{3}$. (**règle 3**)
- La probabilité de l'événement (B , B , B) est $\frac{1}{10}$ (**règle 4**)
- Soit A l'événement : « tirer une seule boule rouge » .
A est associé aux trajets (R , B , B) , (B , R , B) et (B , B , R) . On a :
 $P (A) = P (R , B , B) + P (B , R , B) + P (B , B , R) = \frac{1}{5} + \frac{1}{5} + \frac{1}{5}$ (**règle 5**)



Remarques :

- Pour des expériences indépendantes, la probabilité de la liste des résultats est le produit des probabilités de chaque résultat.
- Au chapitre suivant, nous développerons, le cas d'expériences, constituées d'une succession de p expériences identiques et indépendantes.

6) INDEPENDANCE DE DEUX VARIABLES ALEATOIRES

Définition

Soit X et Y deux variables aléatoires sur Ω . On note $X(\Omega) = \{x_1 ; x_2 ; \dots ; x_k\}$ et $Y(\Omega) = \{y_1 ; y_2 ; \dots ; y_n\}$.

On dit que les variables aléatoires X et Y sont indépendantes, si pour tout $i \in \{1 ; 2 ; \dots ; k\}$ et pour tout $j \in \{1 ; 2 ; \dots ; n\}$ les événements $(X = x_i)$ et $(Y = y_j)$ sont indépendants.

Propriété

Soit X et Y deux variables aléatoires sur Ω . On note $X(\Omega) = \{x_1 ; x_2 ; \dots ; x_k\}$ et $Y(\Omega) = \{y_1 ; y_2 ; \dots ; y_n\}$.

X et Y sont indépendantes si, et seulement si, pour tout $i \in \{1 ; 2 ; \dots ; k\}$ et pour tout $j \in \{1 ; 2 ; \dots ; n\}$

$$P ((X = x_i) \cap (Y = y_j)) = P (X = x_i) \times P (Y = y_j)$$

Remarque :

Dire que deux variables aléatoires sont indépendantes revient à dire que la valeur de l'une n'influe pas sur les probabilités de réalisation de l'autre.