

corrigé

Date : NOM :
Université de Nice
Département de Mathématiques

Prénom :

Groupe :
Année 2011-2012
Licence MASS 2e année

Probabilités et Statistique
Contrôle Continu Final
Mercredi 14 décembre 2011
13 :00 - 15 :00

Calculatrice autorisée. Document autorisé : une feuille A4 (recto-verso) écrite de votre main

Exercice 1 (7 points) On pose $f(x) := cx^\theta \mathbb{I}_{[0,1]}(x)$, où $c \in \mathbb{R}$ est une constante et $\theta > 0$ un paramètre.

1. La fonction f est une densité de probabilité. Que vaut c ?

$$1 = \mathbb{P}(\Omega) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x) dx = c \int_0^1 x^\theta dx = c \left[\frac{1}{\theta+1} x^{\theta+1} \right]_{x=0}^1 = \frac{c}{\theta+1}$$

donc $c = \theta+1$

$c = \theta+1$

2. Soit X de densité f . Calculer $\mathbb{E}(X)$.

$$\mathbb{E}(X) = \int_{-\infty}^{+\infty} x f(x) dx = (\theta+1) \int_0^1 x x^\theta dx = (\theta+1) \left[\frac{1}{\theta+2} x^{\theta+2} \right]_{x=0}^1 = \frac{\theta+1}{\theta+2}$$

$\mathbb{E}(X) = \frac{\theta+1}{\theta+2}$

3. Calculer $\text{Var}(X)$. $\text{Var}(X) = \mathbb{E}(X^2) - (\mathbb{E}X)^2$ (Huygens)

$$\mathbb{E}(X^2) = \int_{-\infty}^{+\infty} x^2 f(x) dx = (\theta+1) \int_0^1 x^{\theta+2} dx = (\theta+1) \left[\frac{1}{\theta+3} x^{\theta+3} \right]_{x=0}^1 = \frac{\theta+1}{\theta+3}$$

$$\text{Donc } \text{Var}(X) = \frac{\theta+1}{\theta+3} - \frac{(\theta+1)^2}{(\theta+2)^2} = \frac{(\theta+1)((\theta+2)^2 - (\theta+1)(\theta+3))}{(\theta+3)(\theta+2)^2} = \frac{(\theta+1)(\theta^2+4\theta+4 - \theta^2-\theta-3\theta-3)}{(\theta+3)(\theta+2)^2}$$

$\text{Var}(X) = \frac{\theta+1}{(\theta+3)(\theta+2)^2}$

4. Calculer la valeur $F_X(x_0) := \mathbb{P}(\{X \leq x_0\})$ de la fonction de répartition de X au point x_0 , si $x_0 \in [0, 1]$.

$$\text{Si } x_0 \in [0, 1] \quad F_X(x_0) = \mathbb{P}(\{X \leq x_0\}) = \int_{-\infty}^{x_0} f(x) dx \stackrel{x_0 \in [0,1]}{=} \int_0^{x_0} (\theta+1) x^\theta dx = (\theta+1) \left[\frac{x^{\theta+1}}{\theta+1} \right]_{x=0}^{x=x_0} \\ = x_0^{\theta+1}$$

Si $x_0 \in [0, 1]$, $F_X(x_0) = x_0^{\theta+1}$

5. On dit que x_0 est la médiane de la v.a. X si et seulement si $\mathbb{P}\{X \leq x_0\} = \frac{1}{2}$. Calculer la médiane x_0 de X .

Si $x_0 \leq 0$ $\mathbb{P}\{X \leq x_0\} = 0 \neq \frac{1}{2}$; si $x_0 \geq 1$ $\mathbb{P}\{X \leq x_0\} = 1 \neq \frac{1}{2}$
 Donc $x_0 \in [0, 1]$; donc $\frac{1}{2} = \mathbb{P}\{X \leq x_0\} = F_X(x_0) = x_0^{\theta+1} \Leftrightarrow x_0 = \left(\frac{1}{2}\right)^{\frac{1}{\theta+1}}$

$$x_0 = \frac{1}{2^{\frac{1}{\theta+1}}}$$

6. On pose $Y = \frac{1}{X}$. Calculer sa fonction de répartition $F_Y(y_0) := \mathbb{P}\{\frac{1}{X} \leq y_0\}$; commencer par le cas $y_0 < 1$ puis traiter le cas $y_0 \geq 1$.

Seuls les événements incluant des $X \in [0, 1]$ ont de probabilité non nulle ;
 mais si $X \in [0, 1]$ $Y = \frac{1}{X} \geq 1$. Donc, si $y_0 < 1$, $F_Y(y_0) = \mathbb{P}\{\frac{1}{X} \leq y_0\} = 0$

Supposons $y_0 \geq 1$; alors $\{Y \leq y_0\} = \{\frac{1}{X} \leq y_0\} = \{X < 0\} \cup \{\frac{1}{y_0} \leq X\}$, c/à d
 $F_Y(y_0) = \mathbb{P}\{Y \leq y_0\} = \mathbb{P}\{X < 0\} + \mathbb{P}\{\frac{1}{y_0} \leq X\} = 0 + 1 - F_X(\frac{1}{y_0})$ avec $\frac{1}{y_0} \in [0, 1]$
 $= 1 - \frac{1}{y_0^{\theta+1}}$

$$F_Y(y_0) = \left(1 - \frac{1}{y_0^{\theta+1}}\right) \mathbb{1}_{\{y_0 \geq 1\}}(y_0).$$

7. En déduire sa densité $f_Y(y)$.

On a $\left(1 - \frac{1}{y^{\theta+1}}\right)' = 0 - \left(y^{-(\theta+1)}\right)' = +(\theta+1)y^{-\theta-1} = \frac{\theta+1}{y^{\theta+2}}$

$$f_Y(y) = \frac{\theta+1}{y^{\theta+2}} \mathbb{1}_{\{y \geq 1\}}(y).$$

Exercice 2 (6 points) On pose $f(x) := \frac{1}{\theta} e^{-x/\theta} \mathbb{I}_{\mathbb{R}^+}(x)$, où $\theta > 0$ est un paramètre inconnu.

1. Soit X de densité f . Calculer $\mathbb{E}(X)$.

$$\mathbb{E}(X) = \frac{1}{\theta} \int_0^{+\infty} x e^{-\frac{x}{\theta}} dx \stackrel{\text{IPP}}{=} \frac{1}{\theta} \left\{ \left[x(-\theta e^{-\frac{x}{\theta}}) \right]_{x=0}^{+\infty} + \theta \int_0^{+\infty} e^{-\frac{x}{\theta}} dx \right\} = \int_0^{+\infty} e^{-\frac{x}{\theta}} dx = \left[-\theta e^{-\frac{x}{\theta}} \right]_{x=0}^{+\infty}$$

Enfinement $\mathbb{E}(X) = +\theta e^{-\frac{0}{\theta}} = \theta$

$$\mathbb{E}(X) = \theta$$

2. Soit x_1, \dots, x_n le résultat de n tirages indépendants de loi de densité f . Quelle est la vraisemblance $L(\theta)$ de cet échantillon ?

$$L(x_1, \dots, x_n; \theta) = f(x_1) \dots f(x_n) = \frac{1}{\theta^n} e^{-\frac{x_1}{\theta}} \dots e^{-\frac{x_n}{\theta}} = \frac{1}{\theta^n} e^{-\frac{x_1 + \dots + x_n}{\theta}}$$

$$L(\theta) = \frac{1}{\theta^n} e^{-\frac{x_1 + \dots + x_n}{\theta}}$$

3. Calculer la log-vraisemblance $l(\theta)$ de cet échantillon.

$$l(x_1, \dots, x_n; \theta) = \log(L(x_1, \dots, x_n; \theta)) = \log\left(\frac{1}{\theta^n} e^{-\frac{x_1 + \dots + x_n}{\theta}}\right) \\ = -n \log(\theta) - \frac{x_1 + \dots + x_n}{\theta} = -n \log \theta - \frac{\Delta}{\theta} \text{ avec } \Delta = x_1 + \dots + x_n.$$

$$l(\theta) = -n \log \theta - \frac{\Delta}{\theta}, \text{ avec } \Delta = x_1 + \dots + x_n. \quad \square$$

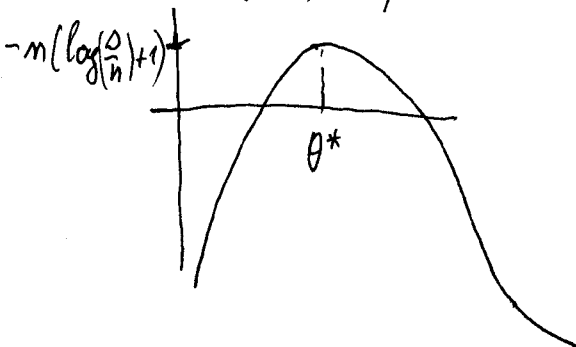
4. Calculer la valeur θ^* de θ où la log-vraisemblance de cet échantillon est maximale.

Pour que la log-vraisemblance (et donc la vraisemblance) soient maximales, il faut que $l'(\theta) = 0$; or

$$0 = l'(\theta) = -\frac{n}{\theta} + \frac{\Delta}{\theta^2} = \frac{1}{\theta} \left(-n + \frac{\Delta}{\theta}\right) \Leftrightarrow -n + \frac{\Delta}{\theta} = 0 \quad (\text{puisque } \frac{1}{\theta} \neq 0)$$

Enfinement, on voit qu'il faut que $\frac{\Delta}{\theta} = n \Leftrightarrow \theta = \frac{\Delta}{n} = \frac{x_1 + \dots + x_n}{n}$.

On s'assure que θ^* est bien un maximum en observant que $l'(\theta) > 0$ pour $\theta < \theta^*$ et $l'(\theta) < 0$ pour $\theta > \theta^*$



$$\theta^* = \frac{x_1 + \dots + x_n}{n} \quad \square$$

5. Quel est l'estimateur au maximum de vraisemblance $\hat{\theta}$ du paramètre θ ?

Par définition $\hat{\theta} = \frac{x_1 + \dots + x_n}{n}$, où x_1, \dots, x_n est un échantillon de cette loi.

$$\hat{\theta} = \frac{x_1 + \dots + x_n}{n} \quad \square$$

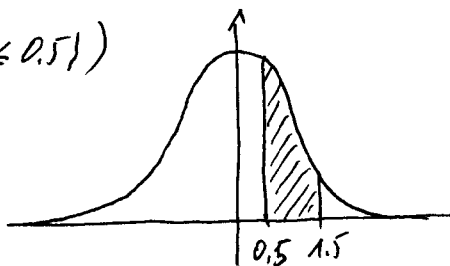
6. Cet estimateur est-il convergent? (Justifiez votre réponse)

Par la Loi des Grands Nombres (LGN) on sait que $\hat{\theta} := \frac{x_1 + \dots + x_n}{n} \xrightarrow{P} E(X) = \theta$

L'estimateur est-il convergent? Oui, cet estimateur converge vers θ □

Exercice 3 (7 points) 1. Soit Z une v.a. normale centrée réduite. Déterminer au moyen de la table ci-dessous la probabilité de l'évènement $\{Z \in [0.5, 1.5]\}$.

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(\{Z \in [0.5, 1.5]\}) &= \mathbb{P}(\{Z \leq 1.5\}) - \mathbb{P}(\{Z \leq 0.5\}) \\ \text{lecture dans la table} &\rightarrow = 0,9331928 - 0,6914625 \\ &= 0,2417303.. \end{aligned}$$



$$\mathbb{P}(\{Z \in [0.5, 1.5]\}) = 0,2417303.. \quad \square$$

2. Soit X une v.a. normale, d'espérance 80 et écart-type 10. Quelle est la probabilité de l'évènement $\{X \geq 95\}$

$$\begin{aligned} \text{Posons } Z &= \frac{X-80}{10} = \frac{X-E_X}{\sqrt{\text{Var} X}}, \text{ ainsi } Z \sim \mathcal{N}(0,1) \text{ et} \\ \mathbb{P}(\{X \geq 95\}) &= \mathbb{P}\left(\left\{\frac{X-80}{10} \geq \frac{95-80}{10}\right\}\right) = \mathbb{P}(\{Z \geq 1.5\}) \\ &= 1 - \mathbb{P}(\{Z < 1.5\}) = 1 - \mathbb{P}(\{Z \leq 1.5\}) = 1 - 0,9331928 \\ &= 0,0668072 \end{aligned}$$

$$\mathbb{P}(\{X \geq 95\}) = 0,0668072 \quad \square$$

3. Quelle est la probabilité de l'évènement $\{X \in [65, 75]\}$?

$$\begin{aligned} \text{On pose à nouveau } Z &= \frac{X-80}{10} \sim \mathcal{N}(0,1) \quad X \in [65, 75] \Leftrightarrow Z \in \left[\frac{65-80}{10}, \frac{75-80}{10}\right] \\ \text{Alors } \mathbb{P}(\{X \in [65, 75]\}) &= \mathbb{P}(\{Z \in [-1.5, -0.5]\}) = \mathbb{P}(\{Z \in [0.5, 1.5]\}) \\ &= 0,2417303.. \quad (3.1) \end{aligned}$$

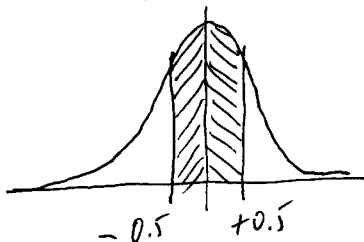


partie de la gaussienne

$$\mathbb{P}(\{X \in [65, 75]\}) = 0,2417303.. \quad \square$$

4. Quelle est la probabilité de l'évènement $\{X \in [75, 85]\}$?

$$\begin{aligned} \text{Toujours avec } Z &= \frac{X-80}{10} \sim \mathcal{N}(0,1) \quad \{X \in [75, 85]\} = \{Z \in [-0.5, 0.5]\} \\ \text{d'où } \mathbb{P}(\{X \in [75, 85]\}) &= \mathbb{P}(\{Z \in [-0.5, 0.5]\}) = 2 \mathbb{P}(\{Z \in [0, 0.5]\}) \\ &= 2 \cdot (0,6914625 - 0,5) \\ &= 0,382925 \end{aligned}$$



partie de la gaussienne

$$\mathbb{P}(\{X \in [75, 85]\}) = 0,382925.. \quad \square$$

5. On considère un échantillon de 1000 tirages normaux indépendants d'espérance 80 et écart-type 10. Quels sont les effectifs théoriques t_i des classes suivantes $\mathcal{V}_1 =]-\infty, 65]$, $\mathcal{V}_2 =]65, 75]$, $\mathcal{V}_3 =]75, 85]$, $\mathcal{V}_4 =]85, 95]$, $\mathcal{V}_5 =]95, +\infty[$?

L'échantillon étant de taille 1000, chaque effectif théorique est égal à $t_i = 1000 \cdot \mathbb{P}(X \in \mathcal{V}_i)$. Or, par symétrie de la loi gaussienne on voit que $\mathbb{P}(X \in \mathcal{V}_1) = \mathbb{P}(X \in \mathcal{V}_5) = \mathbb{P}(X \in [95, +\infty[) = 0,0668072$
 $\mathbb{P}(X \in \mathcal{V}_4) = \mathbb{P}(X \in \mathcal{V}_2) = \mathbb{P}(X \in [65, 75]) = 0,2417303$ d'après 3.2
 $\mathbb{P}(X \in \mathcal{V}_3) = \mathbb{P}(X \in [75, 85]) = 0,382925$ d'après 3.4

Ainsi, on obtient les valeurs suivantes

$t_1 = 66,8072..$	$t_2 = 241,7303..$	$t_3 = 382,925..$	$t_4 = 241,7303..$	$t_5 = 66,8072..$	<input type="checkbox"/>
-------------------	--------------------	-------------------	--------------------	-------------------	--------------------------

6. Un échantillonnage d'une grandeur supposée suivre une loi $\mathcal{N}(80, 10)$ a produit, pour ces mêmes classes, les effectifs respectifs suivants : 73, 235, 391, 233, 68. Calculer le χ^2 de cet échantillon sous cette hypothèse (dite hypothèse nulle H_0).

Notons $O_1 = 73$, $O_2 = 235$, $O_3 = 391$, $O_4 = 233$, et $O_5 = 68$ les effectifs observés. Par définition, la statistique du χ^2 vaut $\chi^2 = \sum_{i=1}^5 \frac{(O_i - t_i)^2}{t_i}$

$$\chi^2 = \frac{(73 - 66,8072)^2}{66,8072} + \frac{(235 - 241,7303)^2}{241,7303} + \frac{(391 - 382,925)^2}{382,925} + \frac{(233 - 241,7303)^2}{241,7303} + \frac{(68 - 66,8072)^2}{66,8072}$$

$$= 1,26831982$$

$\chi^2 = 1,2683..$	<input type="checkbox"/>
---------------------	--------------------------

7. Confirmez ou infirmez cette supposition au moyen d'un test du χ^2 au seuil $\alpha = 5\%$?

Comme nous avons 5 classes, nous avons $k = 4$ degrés de liberté. Dans la table nous voyons que $\mathbb{P}(X^2 \geq 9,4877285) \approx 5\% = \alpha$. Or $\chi^2 = 1,2683 \ll 9,4877..$

Acceptation ou rejet de $H_0 = "X_i \sim \mathcal{N}(80, 10)"$	<input type="checkbox"/>
On accepte l'hypothèse nulle $H_0 = "X_i \sim \mathcal{N}(80, 10)"$	

