

Couple de variables aléatoires

GASMI Abdelkader

December 11, 2024

Couple de variables aléatoires réelles discrètes

Soient X et Y deux variables aléatoires, réelles et discrètes sur un espace probabilisé $(\Omega, \mathcal{P}(\Omega), P)$ telles que:

$$X(\Omega) = \{x_i / i \in I\} \text{ et } Y(\Omega) = \{y_j / j \in J\}$$

Lois associées à un couple (X, Y)

Loi conjointe

La loi de probabilité conjointe du couple (X, Y) , est donnée par la probabilité

$$p_{ij} = P(X = x_i \text{ et } Y = y_j)$$

Lois marginales

Les lois de probabilités marginales sont données par

$$P_{\text{marg}}(X = x_i) = \sum_{j \in J} p_{ij} \quad (1)$$

et

$$P_{\text{marg}}(Y = y_j) = \sum_{i \in I} p_{ij} \quad (3)$$

Lois conditionnelles

Lois conditionnelles de X si $Y = y_j$ et $P(Y = y_j) > 0$

$$P(X = x_i | Y = y_j) = \frac{P(X = x_i \text{ et } Y = y_j)}{P(Y = y_j)} = \frac{p_{ij}}{P_{\text{marg}}(Y = y_j)} \quad (4)$$

Lois conditionnelles de Y si $X = x_i$ et $P(X = x_i) > 0$

$$P(Y = y_j | X = x_i) = \frac{P(X = x_i \text{ et } Y = y_j)}{P(X = x_i)} = \frac{p_{ij}}{P_{\text{marg}}(X = x_i)} \quad (5)$$

Remarque

$$\sum_{(i,j) \in I \times J} p_{ij} = 1$$

Moments conditionnels

Espérance mathématique conditionnelle

L'espérance mathématique conditionnelle de la variable aléatoire X sachant que $Y = y_j$ est défini par:

$$E[X|Y = y_j] = \sum_{i \in I} x_i P(X = x_i | Y = y_j) = \frac{\sum_{i \in I} x_i P_{ij}}{\sum_k P_{kj}} \quad (6)$$

Variance conditionnelle

La variance conditionnelle de la variable aléatoire X sachant que $Y = y_j$ est défini par:

$$Var[X|Y = y_j] = E[(X - E(X|Y = y_j))^2 | Y = y_j] \quad (7)$$

Fonctions de répartition

Fonction de répartition conjointe du couple

Soit un couple (X, Y) de variables aléatoires réelles discrètes. On appelle fonction de répartition conjointe du couple la fonction définie par:

$$\forall (x, y) \in \mathbf{R}^2, F_{X,Y}(x, y) = P(X \leq x \text{ et } Y \leq y) \quad (8)$$

Fonctions de répartition marginales

On appelle fonction de répartition marginale de X , la fonction définie par :

$$\forall x \in \mathbf{R}, F_X(x) = \sum_{x_i \leq x} P(X = x_i) \quad (9)$$

De même, pour Y :

$$\forall y \in \mathbf{R}, F_Y(y) = \sum_{y_j \leq y} P(Y = y_j) \quad (10)$$

Covariance et coefficient de corrélation linéaire

Soit X et Y deux variables aléatoires réelles discrètes définies sur le même espace probabilisé $(\Omega, \mathcal{P}(\Omega), P)$ et admettant chacune une espérance mathématique. On appelle covariance de X et de Y le nombre :

$$\text{cov}(X, Y) = E[(X - E[X])(Y - E[Y])] = E[XY] - E[X]E[Y] \quad (11)$$

Définition

On dit que les variables aléatoires X et Y ne sont pas corrélées si $\text{cov}(X, Y) = 0$.

Définition

Soient X et Y deux variables aléatoires admettant une covariance, et des variances non nulles. Leur coefficient de corrélation linéaire est alors défini par:

$$\rho(X, Y) = \frac{\text{cov}(X, Y)}{\sigma_X \sigma_Y} \quad (12)$$

Définition

(Indépendance) On dit que les deux variables aléatoires discrètes X et Y définies sur le même espace probabilisé, sont indépendantes si:

$$\forall x_i \in X(\Omega) \text{ et } \forall y_j \in Y(\Omega), P(X = x_i \text{ et } Y = y_j) = P(X = x_i) \cdot P(Y = y_j) \quad (13)$$

Remarque

Si les deux variables aléatoires X et Y sont indépendantes on a alors:

$$F_{XY}(x, y) = F_X(x) \cdot F_Y(y)$$

Propriété

Si X et Y sont deux variables aléatoires réelles discrètes à valeurs dans $\mathbf{N}$ ($X(\Omega) \in \mathbf{N}$ et $Y(\Omega) \in \mathbf{N}$), alors la somme $X + Y$ est une variable à valeurs dans $\mathbf{N}$ dont la loi est donnée par :

$$\forall n \in \mathbf{N}, P(X + Y = n) = \sum_{i+j=n} P(X = i \text{ et } Y = j) \quad (14)$$

Si de plus, les variables X et Y sont indépendantes, on obtient la loi de $X + Y$ à partir des lois marginales de X et de Y :

$$\forall n \in \mathbf{N}, P(X + Y = n) = \sum_{i+j=n} P(X = i) \cdot P(Y = j) \quad (15)$$

Remarque

Si les deux variables aléatoires X et Y sont indépendantes, alors, elles ne sont pas corrélées (la réciproque est en général fausse).

Couple de variables aléatoires continues

Soient X et Y deux variables aléatoires continues, et soit F_{XY} la fonction de répartition conjointe du couple (X, Y) définie par:

$$F_{XY}(x, y) = P(X \leq x, Y \leq y)$$

Lois associées à un couple (X, Y)

Loi conjointe

Si la fonction de répartition conjointe F_{XY} d'un couple de variables aléatoires continues (X, Y) est dérivable par rapport à x et y , la loi du couple (X, Y) est définie par la densité:

$$f(x, y) = \frac{\partial F_{XY}(x, y)}{\partial x \partial y}$$

Lois marginales

Soit (X, Y) un couple de variables aléatoires réelles absolument continu, de densité f Alors Les densités marginales de probabilités sont données par:

$$f_{\text{marg}X}(x) = \int_{-\infty}^{+\infty} f_{XY}(x, y) dy \quad (16)$$

et

$$f_{\text{marg}Y}(y) = \int_{-\infty}^{+\infty} f_{XY}(x, y) dx \quad (17)$$

Lois conditionnelles

Lois conditionnelles de X si $Y = y$ est donnée par la fonction densité suivante:

$$f_{\text{marg}X}(x|Y = y) = \frac{f(x, y)}{f_Y(y)} \quad (18)$$

Lois conditionnelles de Y si $X = x$ est donnée par la fonction densité suivante:

$$f_{\text{marg}X}(x|Y = y) = \frac{f(x, y)}{f_X(y)} \quad (19)$$

Espérance mathématique conditionnelle

L'espérance mathématique conditionnelle de la variable aléatoire X sachant que $Y = y$ est défini par:

$$E[X|Y = y] = \int_{-\infty}^{+\infty} x f_{\text{marg}X}(x|Y = y) dx \quad (20)$$

L'espérance mathématique conditionnelle de la variable aléatoire Y sachant que $X = x$ est défini par:

$$E[Y|X = x] = \int_{-\infty}^{+\infty} y f_{\text{marg}Y}(y|X = x) dy \quad (21)$$

L'espérance conditionnelle de X sachant Y est la variable aléatoire réelle:

$$E[X|Y] = \varphi(Y), \quad (22)$$

avec $\varphi : \mathbf{R} \rightarrow \mathbf{R}$ la fonction définie par $\varphi(y) = E[X|Y = y]$

Fonctions de répartition

Fonction de répartition conjointe du couple

Soit un couple (X, Y) de variables aléatoires réelles discrètes. On appelle fonction de répartition conjointe du couple la fonction définie par:

$$\forall (x, y) \in \mathbf{R}^2, F_{X,Y}(x, y) = P(X \leq x \text{ et } Y \leq y) \quad (23)$$

Fonctions de répartition marginales

On appelle fonction de répartition marginale de X , la fonction définie par :

$$\forall x \in \mathbf{R}, F_X(x) = P(X \leq x) \quad (24)$$

De même, pour Y :

$$\forall y \in \mathbf{R}, F_Y(y) = P(Y \leq y) \quad (25)$$

Définition

(Indépendance) Soit (X, Y) un couple de variables aléatoires réelles absolument continue de densité f_{XY} , on dit que les deux variables X et Y sont indépendantes si:

$$f_{XY}(x, y) = f_{\text{marg}X}(x) \cdot f_{\text{marg}Y}(y)$$

$$\forall x_i \in X(\Omega) \text{ et } \forall y_j \in Y(\Omega), P(X = x_i \text{ et } Y = y_j) = P(X = x_i) \cdot P(Y = y_j)$$

Remarque

Si les deux variables aléatoires X et Y sont indépendantes on a alors:

$$F_{XY}(x, y) = F_X(x) \cdot F_Y(y)$$

Propriété

Soit (X, Y) un couple de variables aléatoires réelles absolument continue de densité f_{XY} , alors la somme $X + Y$ est une variable à valeurs dans $\mathbf{N}$ dont la fonction densité sst donnée par :

$$f_{X+Y}(s) = \int_{-\infty}^{+\infty} f_{XY}(s-t, t) dt = \int_{-\infty}^{+\infty} f_{XY}(t, s-t) dt \quad (27)$$

Si de plus, les variables X et Y sont indépendantes, on obtient la loi de $X + Y$ à partir des densités marginales de X et de Y :

$$f_{X+Y}(s) = \int_{-\infty}^{+\infty} f_{\text{marg}X}(s-t) f_{\text{marg}Y}(t) dt \quad (28)$$