

Sauf mention contraire, tout est à savoir.

Variables aléatoires

Inégalités de concentration, variance et covariance

- Inégalité de Markov.
- Si X^2 est d'espérance finie, alors X aussi et donc la variance de X est : $V(X) = E((X - E(X))^2) = E(X^2) - (E(X))^2$, écart type, interprétation, variance des lois usuelles, opérations sur la variance.
- Covariance, si deux variables aléatoires sont indépendantes, alors leur covariance est nulle (réciproque fausse), variance d'une finie somme et cas de variables aléatoires deux à deux indépendantes.
- Inégalité de Bienaymé-Tchebychev. Loi faible des grands nombres : soit $(X_n)_{n \in \mathbb{N}}$ une suite de variables aléatoires discrètes admettant une variance et de même loi. On suppose que ces variables aléatoires sont deux à deux indépendantes. On pose $\bar{X}_n = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i$ et on note m l'espérance commune de X_1, \dots, X_n ($m = E(X_1)$) et σ leur écart-type commun ($\sigma = \sigma(X_1)$). On a : $\forall \varepsilon \in \mathbb{R}_+^* \forall n \in \mathbb{N}^*, P(|\bar{X}_n - m| \geq \varepsilon) \leq \frac{\sigma^2}{n\varepsilon^2}$, puis $\forall \varepsilon \in \mathbb{R}_+^*, \lim_{n \rightarrow +\infty} P(|\bar{X}_n - m| \geq \varepsilon) = 0$.

Série génératrice

- Série génératrice G_X , pour une variable aléatoire à valeurs dans \mathbb{N} , rayon de CV au moins égal à 1, caractérise la loi, série génératrice des lois classiques.
- X admet une espérance si et seulement si G_X est dérivable en 1 et dans ce cas : $E(X) = G'_X(1)$.
- X admet une variance si et seulement si G_X est deux fois dérivable en 1.
- Série génératrice d'une somme finie de variables aléatoires indépendantes, application somme de deux variables aléatoires indépendantes suivant une même loi binomiale ou de Poisson.

Intégrales à paramètre

- Théorème de continuité, adaptation de l'hypothèse de domination sur tout segment inclus dans I , extension à une fonction à valeurs dans un EVN de dimension finie.
- Théorème de dérivabilité, adaptation de l'hypothèse de domination sur tout segment inclus dans I .
- Théorème de convergence dominé à paramètre continu.
- Extension au cas \mathcal{C}^k et \mathcal{C}^∞ .
- Compléments : fonction Gamma et produit de convolution.

BANQUE CCP