



PLAN DU COURS

I. ENSEMBLE DÉNOMBRABLES	1
II. ESPACES PROBABILISÉS	2
II. 1. Tribu	2
II. 2. Probabilité	3
II. 3. Probabilités sur un univers au plus dénombrable	5
III. CONDITIONNEMENT	6
III. 1. Probabilité conditionnelle	6
III. 2. Formule des probabilités composées	6
III. 3. Formule des probabilités totales	7
IV. INDÉPENDANCE	8

I. ENSEMBLE DÉNOMBRABLES

DÉFINITION 1 – Ensemble dénombrable

Un ensemble est dit *dénombrable* s'il est en bijection avec \mathbb{N} , c'est-à-dire s'il existe une bijection entre cet ensemble et \mathbb{N} .

EXEMPLE 1

Prouver que \mathbb{N} et \mathbb{N}^* sont des ensembles dénombrables.

REMARQUES

- Par définition, un ensemble dénombrable est donc infini. En revanche, la réciproque est fautive puisque l'on existe des ensembles infinis non dénombrables.
- De façon plus concrète, un ensemble dénombrable E est un ensemble dont on peut énumérer les éléments de façon exhaustive à l'aide des entiers naturels de \mathbb{N} , c'est-à-dire que l'on peut écrire $E = \{x_n, n \in \mathbb{N}\}$ où les $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ sont deux à deux distincts. En effet, si $\varphi : \mathbb{N} \rightarrow E$ est une bijection de \mathbb{N} sur E alors $E = \{\varphi(n), n \in \mathbb{N}\}$ par surjectivité de φ et les $(\varphi(n))_{n \in \mathbb{N}}$ sont distincts deux à deux par injectivité de φ .

DÉFINITION 2 – Ensemble au plus dénombrable

Un ensemble est dit *au plus dénombrable* s'il est fini ou dénombrable.

PROPOSITION 1 – \mathbb{Z} est dénombrable

L'ensemble \mathbb{Z} est dénombrable.

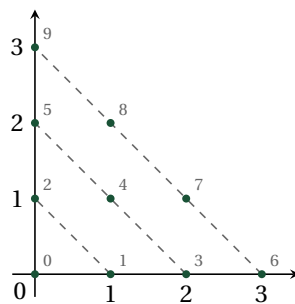
REMARQUE On peut visualiser la situation sur l'axe réel :



PROPOSITION 2 – \mathbb{N}^2 est dénombrable

L'ensemble \mathbb{N}^2 est dénombrable.

REMARQUE Encore une fois, visuellement, on observe qu'il est possible d'énumérer les couples de \mathbb{N}^2 à l'aide de \mathbb{N} :



EXEMPLE – Des ensembles infinis non dénombrables

La droite réelle \mathbb{R} n'est pas un ensemble dénombrable : l'infinité des éléments de \mathbb{R} est « trop grande » pour que l'on puisse énumérer tous les réels à l'aide de l'ensemble des entiers naturels \mathbb{N} .

Il en est de même du segment $[0, 1]$ ou plus généralement de tout intervalle d'intérieur non vide de \mathbb{R} .

II. ESPACES PROBABILISÉS

Le but principal du programme de deuxième année en matière de probabilités est de pouvoir considérer des univers Ω d'expériences aléatoires *infinis*, ce qui permet de s'intéresser à des cas plus riches. Cette généralisation va néanmoins nécessiter quelques adaptations.

EXEMPLE On peut s'intéresser à une suite infinie de lancers d'une pièce de monnaie. L'univers Ω associé à cette expérience, c'est-à-dire l'ensemble des résultats possibles, est tout naturellement $\Omega = \{P, F\}^{\mathbb{N}^*}$, l'ensemble des suites indexées par \mathbb{N}^* et à valeurs dans $\{P, F\}$; il est infini (non dénombrable). Cette expérience n'est pas artificielle, elle permet par exemple de s'intéresser au nombre de lancers nécessaires avant d'obtenir le premier *Pile*; en particulier, on peut s'intéresser à la probabilité de ne jamais obtenir de *Pile*.

II. 1. TRIBU

DÉFINITION 3 – Tribu

Soit Ω un ensemble. Une *tribu* sur Ω est une partie \mathcal{A} de $\mathcal{P}(\Omega)$ vérifiant :

- (1) $\Omega \in \mathcal{A}$;
- (2) Pour tout $A \in \mathcal{A}$, on a $\Omega \setminus A = \bar{A} \in \mathcal{A}$;
- (3) Pour toute suite $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ d'éléments de \mathcal{A} , on a $\bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n \in \mathcal{A}$.

REMARQUES

- Autrement dit, une tribu est une partie de $\mathcal{P}(\Omega)$ contenant Ω et stable par passage au complémentaire et par réunion dénombrable.
- Une tribu peut aussi être appelée une σ -algèbre, d'où la notation \mathcal{A} choisie.
- L'intérêt de cette nouvelle définition sera mise en valeur lorsque la notion de probabilité sera abordée.

VOCABULAIRE

- Lorsqu'un ensemble Ω est muni d'une tribu \mathcal{A} , le couple (Ω, \mathcal{A}) est appelé *espace probabilisable*. L'ensemble Ω est appelé *univers* et les éléments de la tribu \mathcal{A} sont appelés les *événements*.
- Si $A \in \mathcal{A}$ est un événement, $\bar{A} \in \mathcal{A}$ est l'*événement contraire* de A .
- Deux événements A et B de \mathcal{A} sont dits *incompatibles* s'ils sont disjoints, c'est-à-dire si $A \cap B = \emptyset$.

EXEMPLES 2

Soit Ω un ensemble. Montrer que les ensembles \mathcal{A} suivants sont des tribus sur Ω :

(1) $\mathcal{A} = \{\emptyset, \Omega\}$ (tribu grossière).

(2) $\mathcal{A} = \mathcal{P}(\Omega)$ (tribu complète).

(3) Si $A \subset \Omega$, $\mathcal{A} = \{\emptyset, A, \bar{A}, \Omega\}$.

Prouver que c'est la plus petite (au sens de l'inclusion) tribu sur Ω contenant A .

PROPOSITION 3 – Propriétés de stabilité d'une tribu

Soient Ω un ensemble et \mathcal{A} une tribu sur Ω . Alors :

- **Appartenance de l'ensemble vide :** $\emptyset \in \mathcal{A}$
- **Stabilité par intersection dénombrable :** Pour toute suite $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ d'événements de \mathcal{A} , on a :

$$\bigcap_{n \in \mathbb{N}} A_n \in \mathcal{A}$$

- **Stabilité par réunion et intersection finies :** Pour tous événements A_1, \dots, A_n de \mathcal{A} , on a :

$$A_1 \cup \dots \cup A_n \in \mathcal{A} \quad \text{et} \quad A_1 \cap \dots \cap A_n \in \mathcal{A}$$

- **Stabilité par différence :** Pour tous événements A et B de \mathcal{A} , on a $B \setminus A \in \mathcal{A}$.

II. 2. PROBABILITÉ

DÉFINITION 4 – Probabilité

Soit (Ω, \mathcal{A}) un espace probabilisable.

On appelle *probabilité* sur (Ω, \mathcal{A}) toute application $P : \mathcal{A} \rightarrow [0, 1]$ telle que :

(1) $P(\Omega) = 1$;

(2) Pour toute suite $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ d'éléments de \mathcal{A} deux à deux incompatibles, la série $\sum P(A_n)$ converge et :

$$P\left(\bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n\right) = \sum_{n=0}^{+\infty} P(A_n) \quad (\sigma\text{-additivité ou additivité dénombrable})$$

Le triplet (Ω, \mathcal{A}, P) est alors appelé *espace probabilisé*.

REMARQUES

- Cette définition prolonge bien celle donnée en première année.
- La série $\sum P(A_n)$ dépend *a priori* de l'ordre dans lequel ont été énumérés les événements $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ de \mathcal{A} . En fait, de façon plus générale, si une série $\sum_{i \in I} a_i$ est absolument convergente (on dit que la famille $(a_i)_{i \in I}$ est *sommable*), l'ordre dans lequel on effectue la sommation n'a d'influence ni sur la nature de la série ni sur la valeur de la somme en cas de convergence. Pour la série $\sum P(A_n)$, étant donné qu'elle converge et qu'elle est à termes positifs, la valeur de sa somme est donc bien indépendante de l'ordre de sommation choisi.
- En première année, l'ensemble Ω étant fini, l'ensemble des événements était toujours pris égal à $\mathcal{P}(\Omega)$. Dans le cadre plus général de deuxième année où l'ensemble Ω peut être infini, on ne peut plus prendre systématiquement $\mathcal{P}(\Omega)$ comme ensemble des événements. Le souci réside dans le fait qu'il n'est pas toujours possible de définir une application P de $\mathcal{P}(\Omega)$ tout entier dans $[0, 1]$ vérifiant les propriétés précédentes. Pour contourner ce problème, on s'autorise à définir P sur un sous-ensemble \mathcal{A} plus petit que $\mathcal{P}(\Omega)$ ayant néanmoins les bonnes propriétés d'une tribu énoncées plus haut.

Dans la suite, on précisera rarement la tribu \mathcal{A} apposée sur l'ensemble Ω , on partira du principe que tous les événements considérés sont toujours bien dans la tribu \mathcal{A} .

VOCABULAIRE

Dans un espace probabilisé (Ω, \mathcal{A}, P) , on se donne $A \in \mathcal{A}$ un événement.

- Si $P(A) = 1$, on dit que l'événement A est *presque sûr* ou *presque certain*.
- Si $P(A) = 0$, on dit que l'événement A est *négligeable* ou *presque impossible*.

EXEMPLE 3

On lance une infinité de fois une pièce équilibrée. Pour $n \geq 1$, on introduit les événements B_n : « Le premier *Pile* apparaît au n -ème lancer ». Calculer la probabilité des événements $(B_n)_{n \in \mathbb{N}^*}$ et en déduire la probabilité d'obtenir au moins un *Pile* durant les lancers.

PROPOSITION 4 – Propriétés du calcul des probabilités

Soit (Ω, \mathcal{A}, P) un espace probabilisé. On a les propriétés suivantes :

- **Probabilité de l'ensemble vide :** $P(\emptyset) = 0$.
- **σ -additivité finie :** Pour tous événements A_1, \dots, A_n de \mathcal{A} deux à deux incompatibles, on a :

$$P(A_1 \cup \dots \cup A_n) = P(A_1) + \dots + P(A_n)$$

- **Probabilité de la différence :** Pour tous événements A et B de \mathcal{A} vérifiant $A \subset B$, on a :

$$P(B \setminus A) = P(B) - P(A)$$

- **Croissance :** Pour tous événements A et B de \mathcal{A} vérifiant $A \subset B$, on a : $P(A) \leq P(B)$.
- **Probabilité de l'événement contraire :** Pour tout événement A de \mathcal{A} , on a : $P(\bar{A}) = 1 - P(A)$.
- **Probabilité de l'union de deux événements :** Pour tous événements A et B de \mathcal{A} , on a :

$$P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A \cap B)$$

PROPOSITION 5 – Continuité monotone

Soit (Ω, \mathcal{A}, P) un espace probabilisé. On a les propriétés suivantes :

- **Continuité croissante :** Pour toute suite croissante d'événements $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ de \mathcal{A} , c'est-à-dire pour toute suite d'événements $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ vérifiant $A_n \subset A_{n+1}$ pour tout $n \in \mathbb{N}$, on a :

$$P\left(\bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n\right) = \lim_{n \rightarrow +\infty} P(A_n)$$

- **Continuité décroissante:** Pour toute suite décroissante d'événements $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ de \mathcal{A} , c'est-à-dire pour toute suite d'événements $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ vérifiant $A_{n+1} \subset A_n$ pour tout $n \in \mathbb{N}$, on a :

$$P\left(\bigcap_{n \in \mathbb{N}} A_n\right) = \lim_{n \rightarrow +\infty} P(A_n)$$

✎ EXEMPLE 4

On lance une infinité de fois une pièce équilibrée et on considère les événements A : « On obtient au moins un *Pile* durant les lancers » et B : « On obtient une infinité de *Pile* durant les lancers ». Calculer les probabilités de A et B.

PROPOSITION 6 – Sous-additivité

Soit (Ω, \mathcal{A}, P) un espace probabilisé.

- **Cas fini:** Pour tous événements A_1, \dots, A_n de \mathcal{A} , on a :

$$P(A_1 \cup \dots \cup A_n) \leq P(A_1) + \dots + P(A_n)$$

- **Cas dénombrable:** Pour toute suite d'événements $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ de \mathcal{A} telle que $\sum P(A_n)$ converge, on a :

$$P\left(\bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n\right) \leq \sum_{n=0}^{+\infty} P(A_n)$$

II. 3. PROBABILITÉS SUR UN UNIVERS AU PLUS DÉNOMBRABLE

Dans cette sous-partie, on se place dans le cas où Ω est au plus dénombrable. On le munit généralement dans ce cas de la tribu complète $\mathcal{P}(\Omega)$.

Dans ce contexte, une probabilité P sur $(\Omega, \mathcal{P}(\Omega))$ est entièrement déterminée par son comportement sur les événements dits *élémentaires*, c'est-à-dire les singletons. En effet, si A est une partie de Ω , on peut écrire A sous la forme d'une réunion au plus dénombrable d'événements élémentaires deux à deux incompatibles :

$$A = \bigcup_{a \in A} \{a\}$$

de sorte que la propriété de σ -additivité de P implique :

$$P(A) = \sum_{a \in A} P(\{a\})$$

PROPOSITION 7 – Construction d'une probabilité dans le cas Ω au plus dénombrable

Soit Ω un ensemble au plus dénombrable.

- **Cas où Ω est fini:** On écrit $\Omega = \{\omega_1, \dots, \omega_N\}$ avec $N = \text{Card}(\Omega)$. Si (p_1, \dots, p_N) est une famille de N réels positifs vérifiant la relation $\sum_{n=1}^N p_n = 1$, alors il existe une unique probabilité P sur $(\Omega, \mathcal{P}(\Omega))$ telle que :

$$\forall n \in \llbracket 1, N \rrbracket, \quad P(\{\omega_n\}) = p_n$$

- **Cas où Ω est dénombrable:** On écrit $\Omega = \{\omega_n, n \in \mathbb{N}\}$. Si $(p_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est une suite de réels positifs vérifiant la relation $\sum_{n=0}^{+\infty} p_n = 1$, alors il existe une unique probabilité P sur $(\Omega, \mathcal{P}(\Omega))$ telle que :

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad P(\{\omega_n\}) = p_n$$

EXEMPLE 5

Montrer que l'on peut définir une unique probabilité P sur $(\mathbb{N}, \mathcal{P}(\mathbb{N}))$ telle que $P(\{n\}) = 1/2^{n+1}$ pour tout $n \in \mathbb{N}$. Calculer la probabilité de l'événement formé des nombres pairs non divisibles par 3.

III. CONDITIONNEMENT

III. 1. PROBABILITÉ CONDITIONNELLE

DÉFINITION 5 – Probabilité conditionnelle de A sachant B

Soient (Ω, \mathcal{A}, P) un espace probabilisé et A et B deux événements de \mathcal{A} tels que $P(B) \neq 0$. On appelle *probabilité conditionnelle de A sachant B* et l'on note $P_B(A)$ le réel :

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

NOTATION La probabilité conditionnelle de A sachant B peut également être notée $P(A|B)$.

REMARQUE La probabilité conditionnelle de A sachant B « porte bien son nom », c'est-à-dire qu'elle correspond à la probabilité que l'événement A se réalise en prenant pour hypothèse que l'événement B est réalisé. Cela revient à considérer que l'univers n'est plus Ω mais $\Omega \cap B$.

PROPOSITION 8 – Probabilité conditionnelle

Soient (Ω, \mathcal{A}, P) un espace probabilisé et B un événement de \mathcal{A} tel que $P(B) \neq 0$.

L'application

$$\begin{aligned} P_B : \mathcal{A} &\longrightarrow [0, 1] \\ A &\longmapsto P_B(A) \end{aligned}$$

est une probabilité sur (Ω, \mathcal{A}) . On l'appelle la *probabilité conditionnelle à l'événement B*.

REMARQUE La probabilité P_B vérifie toutes les propriétés de calcul des probabilités énoncées précédemment.

THÉORÈME 1 – Formule de Bayes

Soient (Ω, \mathcal{A}, P) un espace probabilisé et A et B deux événements de \mathcal{A} tels que $P(A) \neq 0$ et $P(B) \neq 0$. Alors :

$$P_B(A) = P_A(B) \frac{P(A)}{P(B)}$$

REMARQUE La formule de Bayes permet d'« inverser » un conditionnement, c'est-à-dire de passer de $P_B(A)$ à $P_A(B)$.

III. 2. FORMULE DES PROBABILITÉS COMPOSÉES

THÉORÈME 2 – Formule des probabilités composées

Soient (Ω, \mathcal{A}, P) un espace probabilisé et, pour $n \geq 2$, A_1, \dots, A_n des événements de \mathcal{A} vérifiant la condition $P(A_1 \cap \dots \cap A_{n-1}) \neq 0$. Alors on a :

$$P(A_1 \cap \dots \cap A_n) = P(A_1) P_{A_1}(A_2) P_{A_1 \cap A_2}(A_3) \cdots P_{A_1 \cap \dots \cap A_{n-1}}(A_n)$$

REMARQUE L'hypothèse $P(A_1 \cap \dots \cap A_{n-1}) \neq 0$ assure l'existence de toutes les probabilités conditionnelles de la formule des probabilités composées. En effet, pour $i \in \llbracket 1, n-1 \rrbracket$, on a $A_1 \cap \dots \cap A_{n-1} \subset A_1 \cap \dots \cap A_i$ de sorte que $P(A_1 \cap \dots \cap A_i) \geq P(A_1 \cap \dots \cap A_{n-1}) > 0$ et donc $P(A_1 \cap \dots \cap A_i) \neq 0$.

 **EXEMPLE 6**

On considère une urne contenant n boules rouges et n boules vertes. On effectue dans cette urne n tirages sans remise. Donner la probabilité de n'obtenir que des boules vertes.

III. 3. FORMULE DES PROBABILITÉS TOTALES

DÉFINITION 6 – *Système complet d'événements*

Soit (Ω, \mathcal{A}) un espace probabilisable. On appelle *système complet d'événements* toute suite $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ d'événements de \mathcal{A} deux à deux incompatibles dont la réunion vaut Ω , c'est-à-dire que :

$$\forall (i, j) \in \mathbb{N}^2 \text{ avec } i \neq j, \quad A_i \cap A_j = \emptyset \quad \text{et} \quad \bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n = \Omega$$

REMARQUE Autrement, une suite $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ d'événements est un système complet d'événements si elle forme une partition de l'univers Ω .

 **EXEMPLES 7**

- (1) Sur un espace probabilisable (Ω, \mathcal{A}) , on se donne $A \in \mathcal{A}$ est un événement. Montrer que $\{A, \bar{A}\}$ est un système complet d'événements.
- (2) On reprend le cadre d'une suite infinie de lancers d'une pièce. On pose A_0 : « On n'obtient aucun *Pile* » et, pour $n \in \mathbb{N}^*$, A_n : « On obtient le premier *Pile* au n -ème lancer. Montrer que la famille $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est un système complet d'événements.

THÉORÈME 3 – *Formule des probabilités totales*

Soient (Ω, \mathcal{A}, P) un espace probabilisé et $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ un système complet d'événements.

Alors, pour tout événement $B \in \mathcal{A}$, la série $\sum P(B \cap A_n)$ converge et :

$$P(B) = \sum_{n=0}^{+\infty} P(B \cap A_n) = \sum_{n=0}^{+\infty} P_{A_n}(B)P(A_n)$$

REMARQUE La seconde égalité est appelée la *forme conditionnelle* de la formule des probabilités totales. À noter que l'on convient que $P_{A_n}(B)P(A_n) = 0$ dès que $P(A_n) = 0$, ce qui est cohérent puisque dans ce cas $P(A_n \cap B) = 0$. En effet, étant donné que $B \cap A_n \subset A_n$, il vient $0 \leq P(B \cap A_n) \leq P(A_n) = 0$ par croissance et positivité de la probabilité.

 **EXEMPLE 8**

On considère des urnes U_n pour $n \geq 1$. Pour chaque $n \geq 1$, l'urne U_n contient n boules dont une seule est blanche. Un joueur choisit une urne au hasard, l'urne n étant choisie avec probabilité $1/2^n$, puis tire une boule dans cette urne. Donner la probabilité que le joueur tire une boule blanche.

IV. INDÉPENDANCE

DÉFINITION 7 – Événements indépendants

Soient (Ω, \mathcal{A}, P) un espace probabilisé et A, B deux événements de \mathcal{A} .
Les événements A et B sont dits *indépendants* si :

$$P(A \cap B) = P(A)P(B)$$

PROPOSITION 9 – Caractérisation par les probabilités conditionnelles

Soient (Ω, \mathcal{A}, P) un espace probabilisé et A, B deux événements de \mathcal{A} tels que $P(B) \neq 0$.
Les événements A et B sont indépendants si et seulement si $P_B(A) = P(A)$.

DÉFINITION 8 – Événements mutuellement indépendants, cas fini

Soient (Ω, \mathcal{A}, P) un espace probabilisé et A_1, \dots, A_n des événements de \mathcal{A} .
Les événements A_1, \dots, A_n sont dits *mutuellement indépendants* si pour toute partie non vide $I \subset \llbracket 1, n \rrbracket$:

$$P\left(\bigcap_{i \in I} A_i\right) = \prod_{i \in I} P(A_i)$$

REMARQUES

- Lorsqu'il n'y pas d'ambiguïté, on se contentera souvent de dire que les événements sont indépendants et non *mutuellement* indépendants.
- La seule relation $P(\bigcap_{i=1}^n A_i) = \prod_{i=1}^n P(A_i)$ ne permet pas de conclure que les événements A_1, \dots, A_n sont mutuellement indépendants, il faut le vérifier pour toute partie non vide I de $\llbracket 1, n \rrbracket$.
- Si des événements A_1, \dots, A_n sont mutuellement indépendants, ils sont deux à deux indépendants mais la réciproque est fautive.

EXEMPLE 9

Sur une suite de deux lancers d'une pièce équilibrée, on introduit les événements A : « Le premier lancer donne *Pile* », B : « Le second lancer donne *Pile* » et C : « Les deux lancers donnent le même résultat ».
Prouver que ces événements sont indépendants deux à deux mais pas mutuellement.

DÉFINITION 9 – Événements mutuellement indépendants, cas dénombrable

Soient (Ω, \mathcal{A}, P) un espace probabilisé et $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ une suite d'événements de \mathcal{A} .
Les événements $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ sont dits *mutuellement indépendants* si pour toute partie finie non vide $I \subset \mathbb{N}$ les événements $(A_i)_{i \in I}$ sont mutuellement indépendants.

REMARQUE En pratique, il est assez rare de devoir vérifier que des événements $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ sont mutuellement indépendants. Ce sont plutôt les conditions de réalisation de l'expérience aléatoire étudiée qui donnent l'indépendance.

EXEMPLE 10

On étudie une suite infinie de lancers d'une pièce. Pour $n \geq 1$, on introduit les événements P_n : « Le n -ème lancer donne *Pile* ». Justifier que les événements $(P_n)_{n \in \mathbb{N}^*}$ sont mutuellement indépendants.