



HAL
open science

Introduction aux lois de probabilité avec R

Christophe Chesneau

► **To cite this version:**

Christophe Chesneau. Introduction aux lois de probabilité avec R. Licence. France. 2016. cel-01389942

HAL Id: cel-01389942

<https://cel.hal.science/cel-01389942v1>

Submitted on 30 Oct 2016

HAL is a multi-disciplinary open access archive for the deposit and dissemination of scientific research documents, whether they are published or not. The documents may come from teaching and research institutions in France or abroad, or from public or private research centers.

L'archive ouverte pluridisciplinaire **HAL**, est destinée au dépôt et à la diffusion de documents scientifiques de niveau recherche, publiés ou non, émanant des établissements d'enseignement et de recherche français ou étrangers, des laboratoires publics ou privés.

Introduction aux lois de probabilité avec

Christophe Chesneau

<http://www.math.unicaen.fr/~chesneau/>

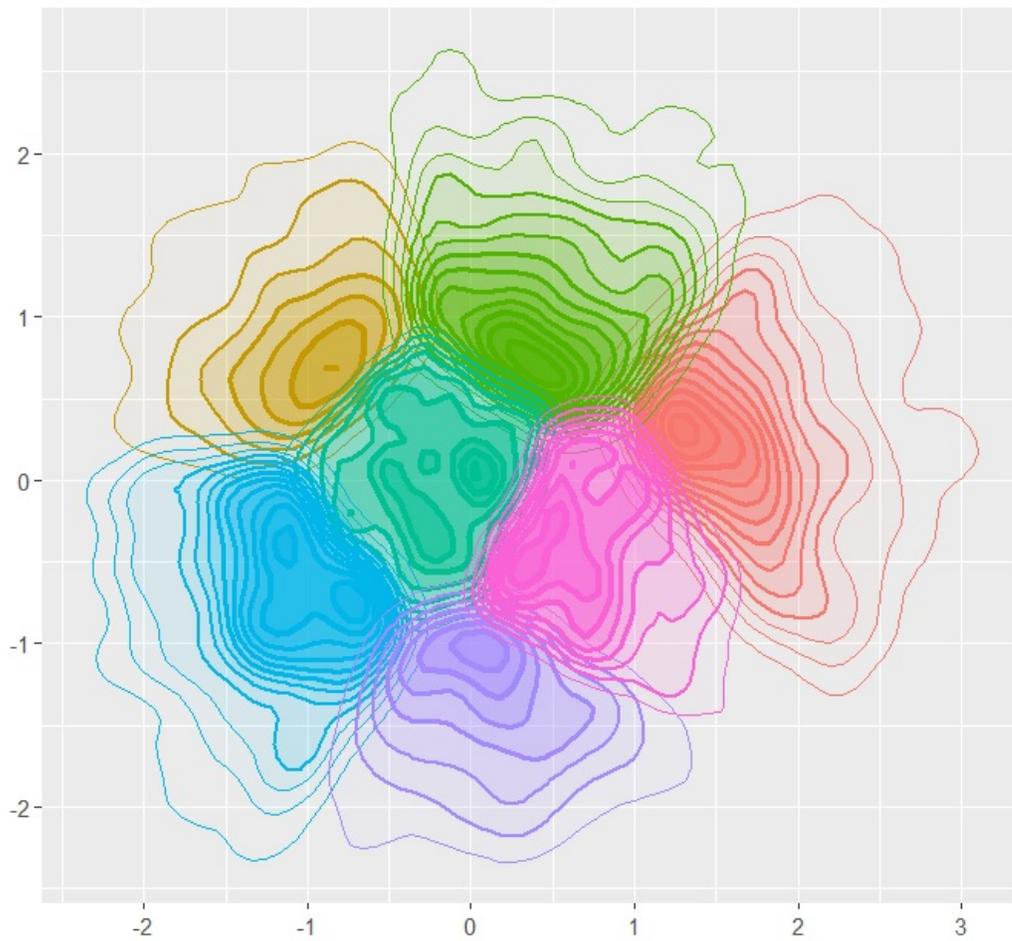


Table des matières

1	Syntaxe générale	5
2	Densité	7
3	Fonction de répartition	11
4	Quantiles	15
5	Simulation	17
5.1	La commande <code>sample</code>	17
5.2	Simulation par des lois préprogrammées	19
6	Exercices	21
7	Solutions	31

~ **Note** ~

L'objectif de ce document est de présenter les principales commandes R associées aux lois de probabilités et simulations de variables aléatoires réelles (*var*). Quelques éléments théoriques sont consultables ici : <http://www.math.unicaen.fr/~chesneau/form-prob-MATHS.pdf>

Contact : christophe.chesneau@gmail.com

Bonne lecture !

1 Syntaxe générale

Pour une *var* X suivant une loi notée `loi` dans R , la syntaxe générale est la suivante :

- pour obtenir "la densité" de X , la commande est : `dloi` ; on ajoute la lettre **d** devant `loi`,
- pour obtenir la fonction de répartition de X , la commande est : `ploi` ; on ajoute la lettre **p** devant `loi`,
- pour obtenir le quantile de X , la commande est : `qloi` ; on ajoute la lettre **q** devant `loi`,
- pour simuler des réalisations de *var* suivant la même loi que X , la commande est : `rloi` ; on ajoute la lettre **r** devant `loi`.

Ci-dessous, un tableau grossier récapitulatif :

Loi : <code>loi</code>	densité	fonction de répartition	quantile	simulation
notations	$f(x); \mathbb{P}(X = x)$	$F(x)$	valeur liée à $F(x)$	x_1, \dots, x_n
commandes	<code>dloi</code>	<code>ploi</code>	<code>qloi</code>	<code>rloi</code>

Les noms `loi` les plus célèbres sont : `norm` (pour la loi normale), `binom` (pour la loi binomiale), `unif` (pour la loi uniforme), `geom` (pour la loi géométrique), `pois` (pour la loi de Poisson), `t` (pour la loi de Student), `chisq` (pour la loi du Chi-deux), `exp` (pour la loi exponentielle), `f` (pour la loi de Fisher)...

La suite de ce document apporte des détails, des exemples et des illustrations à ces commandes.

2 Densité

Définition

- Pour une *var* X discrète, on appelle "la densité" de X en x la probabilité $\mathbb{P}(X = x)$.
- Pour une *var* X à densité de densité f_X , on appelle "la densité" de X en x la fonction $f_X(x)$.

Dans les deux cas, la densité ainsi définie caractérise la loi de X .

Commandes

Si la loi de X dépend d'un ou de plusieurs paramètres, disons `par1` et `par2`, alors la densité de X en x est donnée par les commandes :

`dloi(x, par1, par2)`

Quelques exemples sont décrits ci-dessous :

Loi	binomiale	géométrique	Poisson
paramètres	$n \in \mathbb{N}^*, p \in]0, 1[$	$p \in]0, 1[$	$\lambda > 0$
$X \sim$	$\mathcal{B}(n, p)$	$\mathcal{G}(p)$	$\mathcal{P}(\lambda)$
$X(\Omega)$	$\{0, \dots, n\}$	\mathbb{N}	\mathbb{N}
$\mathbb{P}(X = x)$	$\binom{n}{x} p^x (1-p)^{n-x}$	$p(1-p)^x$	$e^{-\lambda} \frac{\lambda^x}{x!}$
commandes	<code>dbinom(x, n, p)</code>	<code>dgeom(x, p)</code>	<code>dpois(x, lambda)</code>

Loi	uniforme	exponentielle	normale
paramètres	$(a, b) \in \mathbb{R}^2, a < b$	$\lambda > 0$	$\mu \in \mathbb{R}, \sigma > 0$
$X \sim$	$\mathcal{U}([a, b])$	$\mathcal{E}(\lambda)$	$\mathcal{N}(\mu, \sigma^2)$
$X(\Omega)$	$[a, b]$	$[0, \infty[$	\mathbb{R}
$f_X(x)$	$\frac{1}{b-a}$	$\lambda e^{-\lambda x}$	$\frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma^2}} e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}$
commandes	<code>dunif(x, a, b)</code>	<code>dexp(x, lambda)</code>	<code>dnorm(x, mu, sigma)</code>

Pour compléter, voir : `help("dgamma")`, `help("dt")`, `help("dchisq")` et `help("df")`.

Calculs

On fait :

```
dbinom(4, 8, 0.3)
```

Cela renvoie : [1] 0.1361

Ainsi, on a calculé la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{B}(8, 0.3)$ en $x = 4$:

$$\mathbb{P}(X = 4) = \binom{8}{4} 0.3^4 (1 - 0.3)^{8-4}.$$

On peut vérifier cela en faisant :

```
choose(8, 4) * 0.3^4 * (1 - 0.3)^(8 - 4)
```

Cela renvoie : [1] 0.1361

On fait :

```
dnorm(1.7, 2, 0.12)
```

Cela renvoie : [1] 0.1460692

Ainsi, on a calculé la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{N}(2, 0.12^2)$ en $x = 1.7$:

$$f_X(1.7) = \frac{1}{\sqrt{2\pi \times 0.12^2}} e^{-\frac{(1.7-2)^2}{2 \times 0.12^2}}$$

On peut vérifier cela en faisant :

```
(1 / sqrt(2 * pi * 0.12^2)) * exp(- (1.7 - 2)^2 / (2 * 0.12^2))
```

Cela renvoie : [1] 0.1460692

Pour calculer la densité en plusieurs valeurs, on prend pour x le vecteur ayant pour éléments ces valeurs. On peut faire de même avec un ensemble de paramètres et les arguments correspondants.

On fait :

```
dbinom(c(4, 6), 8, 0.3)
```

Cela renvoie : [1] 0.13613670 0.01000188

On a ainsi calculé la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{B}(8, 0.3)$ pour $x \in \{4, 6\}$.

On fait :

```
dexp(2, c(1, 2, 3))
```

Cela renvoie : [1] 0.135335283 0.036631278 0.007436257

Ainsi, on a calculé la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{E}(\lambda)$ en $x = 2$, avec $\lambda = 1$, $\lambda = 2$ et $\lambda = 3$.

On peut aussi mettre ces résultats dans un vecteur pour le réutiliser ultérieurement.

On fait :

```
vec = dexp(2, c(1, 2, 3))  
vec
```

Cela renvoie : [1] 0.135335283 0.036631278 0.007436257

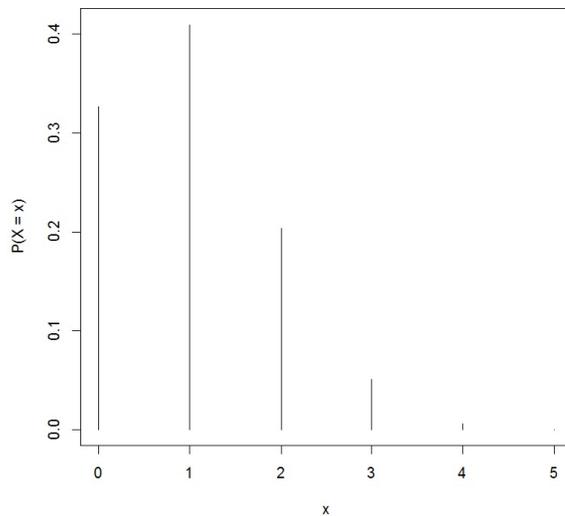
Représentation graphique

On peut représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X$ discrète avec la commande `plot` et l'option `type = h`.

On fait :

```
plot(0:5, dbinom(0:5, 5, 0.2), type = "h", ylab = "P(X = x)")
```

Cela renvoie :



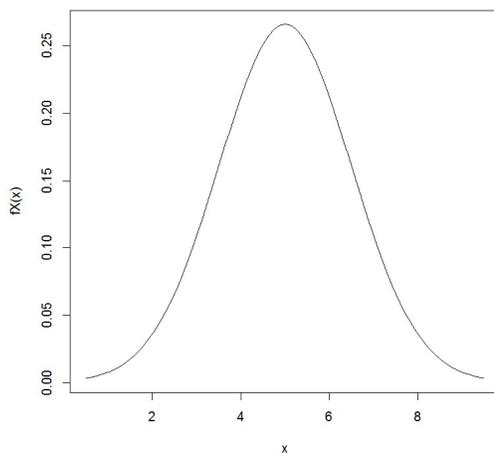
On a ainsi représenté le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{B}(5, 0.2)$.

On peut représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X$ à densité avec la commande `curve`.

On fait :

```
curve(dnorm(x, 5, 1.5), 0.5, 9.5, ylab = "fX(x)")
```

Cela renvoie :



On a ainsi représenté le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{N}(5, 1.5^2)$.

3 Fonction de répartition

Définition

On appelle fonction de répartition d'une *var* X en x la fonction $F_X(x) = \mathbb{P}(X \leq x)$.

◦ Si X est discrète, on a

$$F_X(x) = \sum_{k \in X(\Omega) \cap]-\infty, x]} \mathbb{P}(X = k).$$

◦ Si X est à densité, on a

$$F_X(x) = \int_{-\infty}^x f_X(t) dt.$$

Commandes

Si la loi de X dépend d'un ou de plusieurs paramètres, disons **par1** et **par2**, alors la fonction de répartition de X en x est donnée par les commandes :

```
ploi(x, par1, par2)
```

On peut calculer : $\mathbb{P}(X > x) = 1 - F_X(x)$, en faisant :

```
ploi(x, par1, par2, lower.tail = FALSE)
```

Calculs

On fait :

```
pbinom(4, 8, 0.3)
```

Cela renvoie : [1] 0.9420324

Ainsi, on a calculé la fonction de répartition d'une *var* $X \sim \mathcal{B}(8, 0.3)$ en $x = 4$:

$$F_X(4) = \mathbb{P}(X \leq 4) = \sum_{k=0}^4 \mathbb{P}(X = k).$$

On peut vérifier le calcul précédent en faisant :

```
sum(dbinom(0:4, 8, 0.3))
```

Cela renvoie : [1] 0.9420324

On fait :

```
pnorm(12, 9, 2)
```

Cela renvoie : [1] 0.9331928

Ainsi, on a calculé la fonction de répartition d'une $\text{var } X \sim \mathcal{N}(9, 2^2)$ en $x = 12$:

$$F_X(12) = \mathbb{P}(X \leq 12) = \int_{-\infty}^{12} \frac{1}{\sqrt{2\pi \times 2^2}} e^{-\frac{(t-9)^2}{2 \times 2^2}} dt.$$

On fait :

```
pexp(2, 3, lower.tail = FALSE)
```

Cela renvoie : [1] 0.002478752

Ainsi, on a calculé : $\mathbb{P}(X > 2)$, $X \sim \mathcal{E}(3)$:

$$\mathbb{P}(X > 2) = \int_2^{\infty} f_X(x) dx = \int_2^{\infty} 3e^{-3x} dx = [-e^{-3x}]_2^{\infty} = e^{-3 \times 2} = e^{-6}.$$

On peut vérifier le calcul précédent en faisant :

```
exp(-6)
```

Cela renvoie : [1] 0.002478752

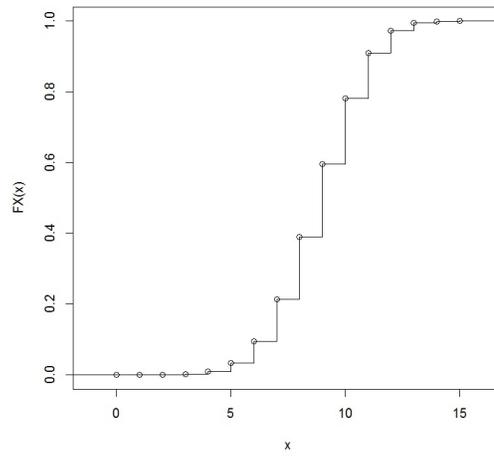
Représentation graphique

On peut représenter le graphe de la fonction de répartition d'une $\text{var } X$ discrète avec la commande `stepfun`.

On fait :

```
plot(stepfun(0:15, c(0, pbinom(0:15, 15, 0.6))), ylab = "FX(x)", main = "")
```

Cela renvoie :



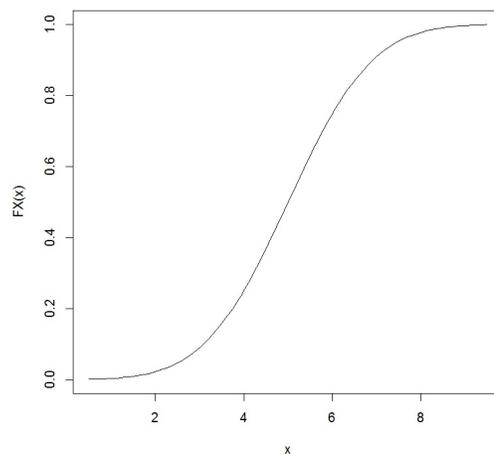
On a ainsi représenté le graphe de la fonction de répartition d'une $var X \sim \mathcal{B}(15, 0.6)$.

On peut représenter le graphe de la fonction de répartition d'une $var X$ à densité avec la commande `curve`.

On fait :

```
curve(pnorm(x, 5, 1.5), 0.5, 9.5, ylab = "FX(x)")
```

Cela renvoie :



On a ainsi représenté le graphe de la fonction de répartition d'une $var X \sim \mathcal{N}(5, 1.5^2)$.

4 Quantiles

Définition

Soit $p \in]0, 1[$ et X une *var*.

- Si X est discrète, on appelle p -ème quantile de X l'entier x_p défini par

$$x_p = \inf\{k \in \mathbb{Z}; F_X(k) \geq p\}.$$

- Si X est à densité, on appelle p -ème quantile de X le réel x_p tel que $F_X(x_p) = p$.

Commandes

Si la loi de X dépend d'un ou de plusieurs paramètres, disons `par1` et `par2`, alors le p -ème quantile de X est donné par les commandes :

`qloi(p, par1, par2)`

Calculs

On fait :

```
qbinom(0.25, 5, 0.6)
```

Cela renvoie : `[1] 2`

Ainsi, on a calculé le p -ème quantile avec $p = 0.25$ d'une *var* $X \sim \mathcal{B}(5, 0.6)$:

$$x_{0.25} = \inf\{k \in \mathbb{Z}; F_X(k) \geq 0.25\}.$$

On peut vérifier ce résultat en cherchant toutes les valeurs de $F_X(x)$ pour $x \in \{0, 1, 2, 3, 4, 5\}$:

```
pbinom(0:5, 5, 0.6)
```

Cela renvoie : `[1] 0.01024 0.08704 0.31744 0.66304 0.92224 1.00000`

On constate alors que $F_X(1) = 0.08704 < 0.25 \leq 0.31744 = F_X(2)$, donc $x_{0.25} = 2$.

On fait :

```
qnorm(0.975, 0, 1)
```

Cela renvoie : `[1] 1.96`

Ainsi, on a calculé le p -ème quantile avec $p = 0.975$ d'une $var X \sim \mathcal{N}(0, 1)$: le réel $x_{0.975}$ tel que $F_X(x_{0.975}) = 0.975$.

On peut vérifier cela en faisant :

```
pnorm(1.96, 0, 1)
```

Cela renvoie : [1] 0.975

On aurait aussi pu considérer les commandes : `pnorm(1.96)`, sans spécifier $\mu = 0$ et $\sigma = 1$; la commande prend par défaut les paramètres de la loi centrée et réduite.

5 Simulation

5.1 La commande `sample`

Utilisation de base

L'utilisation de base est : `sample(x)`, où `x` est un vecteur numérique, logique ou chaîne de caractères.

Cela renvoie un vecteur dont les éléments correspondent au tirage d'un élément de `x` sans remise.

Cela revient à permuter aléatoirement les éléments de `x`.

On fait :

```
x = 1:7
sample(x)
```

Cela renvoie : [1] 2 4 1 7 5 6 3

On refait la même commande :

```
sample(x)
```

Cela renvoie : [1] 1 7 6 2 3 4 5

On obtient des résultats différents ; l'ordre de la permutation est due au hasard à chaque fois.

On peut conserver le résultat d'une permutation aléatoire dans un vecteur pour le réutiliser ultérieurement :

```
y = sample(c("rouge", "vert", "bleu", "blanc", "noir"))
y
```

Cela renvoie : [1] "noir" "blanc" "vert" "rouge" "bleu"

Options

Il existe des options dans `sample` permettant de modifier le type de tirage. On les active en rajoutant une ou plusieurs commandes dans `sample`.

Par exemple, on fait :

```
sample(1:3, size = 2, replace = TRUE, prob = c(25 / 100, 20 / 100,
55 / 100))
```

Quelques options sont présentées ci-dessous.

Option : size. Les commandes : `size = "n"`, où `n` est un entier, précise le nombre de fois `n` que l'on effectuera le tirage. Par défaut, le nombre de tirage est égal à la longueur de `x`.

On fait :

```
sample(1:10, size = 3)
```

Cela renvoie : `[1] 10 7 3`

Dans la syntaxe de `sample`, l'argument `size` est en deuxième position. On peut donc se contenter de : `sample(1:10, 3)`.

Option : replace. Les commandes : `replace = L`, où `L` est `TRUE` ou `FALSE`, dont que les tirages sont avec remise si `L = TRUE` et sans remise sinon.

On fait :

```
sample(1:5, size = 9, replace = TRUE)
```

Cela renvoie : `[1] 5 1 4 1 3 1 2 1 3`

Option : prob. La commande `prob` permet la simulation de *var* dont le support est l'ensemble des éléments de `x`, que l'on suppose au nombre de `k`. Ainsi, la loi commune de ces *var* est :

$$\mathbb{P}(X = j\text{-ème élément de } \mathbf{x}) = p_j, \text{ avec } j \in \{1, \dots, k\}, p_j \in [0, 1] \text{ et } \sum_{j=1}^k p_j = 1.$$

On ajoute donc `prob = vec`, où `vec` est le vecteur des probabilités (p_1, \dots, p_k) .

Si `prob` n'est pas indiqué, par défaut $p_j = 1/k$ (tirage équiprobable).

On fait :

```
y = c("rouge", "vert", "bleu", "blanc", "noir")
sample(y, 2, prob = c(10 / 100, 30 / 100, 10 / 100, 30 / 100, 20 / 100))
```

Cela renvoie : `[1] "rouge" "vert"`

5.2 Simulation par des lois préprogrammées

Commandes

Si la loi de X dépend d'un ou de plusieurs paramètres, disons `par1` et `par2`, alors on simule des réalisations de n *var* indépendantes suivant la même que X par les commandes :

```
rloi(n, par1, par2)
```

Calculs

On fait :

```
rpois(10, 2)
```

Cela renvoie : [1] 0 2 2 3 3 5 1 3 1 2

Ainsi, on a simulé des réalisations de 10 *var* indépendantes suivant chacune la loi de Poisson $\mathcal{P}(2)$.

On fait :

```
sum(rbinom(80, 1, 0.02))
```

Cela renvoie : [1] 3

On a alors simulé une réalisation de la *var* $\sum_{i=1}^{80} X_i$, où X_1, \dots, X_{80} sont des *var* indépendantes suivant chacune la loi binomiale $\mathcal{B}(1, 0.02)$, (ainsi, la loi commune est la loi de Bernoulli $\mathcal{B}(0.02)$: $\mathbb{P}(X_1 = 0) = 1 - 0.02 = 0.98$, $\mathbb{P}(X_1 = 1) = 0.02$). Comme $\sum_{i=1}^{80} X_i \sim \mathcal{B}(80, 0.02)$, cela revient à simulé une réalisation d'une *var* $Y \sim \mathcal{B}(80, 0.02)$: `rbinom(1, 80, 0.02)`.

On fait :

```
x = rnorm(15, 22, 2)
```

```
x
```

Cela renvoie :

```
[1] 16.29346 20.03768 23.64521 19.80074 21.79431 23.40846 20.32446 25.50194  
[9] 23.25963 21.64157 21.97450 23.91137 21.44780 23.14619 22.82958
```

Ainsi, on a construit un vecteur dont les éléments sont des réalisations de 15 *var* indépendantes suivant chacune la loi normale $\mathcal{N}(22, 2^2)$.

6 Exercices

Exercice 1. Représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{P}(1)$ pour $x \in \{0, \dots, 8\}$.

Exercice 2. Représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \chi^2(3)$ pour $x \in [0, 10]$.

Exercice 3. Diviser la fenêtre de l'écran en deux fenêtres lignes.

- Représenter, dans la première fenêtre, le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{B}(50, 0.08)$ en prenant `ylim = c(0, 0.25)`.
- Représenter dans la deuxième fenêtre, au-dessous de la première, le graphe de la densité d'une $\text{var } Y \sim \mathcal{P}(4)$ pour $x \in \{0, \dots, 50\}$ avec la même option : `ylim = c(0, 0.25)`.

(Ceci illustrera le fait que lorsque $n \geq 31$ et $np \leq 10$ on peut approcher la loi binomiale $\mathcal{B}(n, p)$ par la loi de Poisson $\mathcal{P}(np)$).

Exercice 4. Séparer l'écran graphique en 3 (1 ligne, 3 colonnes).

- Dans la première fenêtre, représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{N}(4, 1)$, puis ajouter dans la même fenêtre, avec une autre couleur, celui de la densité d'une $\text{var } Y \sim \mathcal{N}(5, 1)$.
- Dans la deuxième fenêtre, représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{N}(4, 1)$ puis ajouter dans la même fenêtre, avec une autre couleur, celui de la densité d'une $\text{var } Y \sim \mathcal{N}(4, 4)$.
- Dans la troisième fenêtre, représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{N}(4, 1)$ puis ajouter dans la même fenêtre, avec une autre couleur, celui de la densité d'une $\text{var } Y \sim \mathcal{N}(5, 4)$.

Exercice 5. Représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{B}(50, 0.4)$, puis ajouter par dessus ce graphe celui de la densité d'une $\text{var } Y \sim \mathcal{N}(20, 12)$ *(cela illustrera le fait que, lorsque $n \geq 31$, $np \geq 5$ et $n(1 - p) \geq 5$, on peut approcher la loi binomiale $\mathcal{B}(n, p)$ par la loi normale $\mathcal{N}(np, np(1 - p))$).*

Exercice 6. Représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{B}(n, p)$ pour $x \in \{0, \dots, 10\}$ avec $n = 100$ et $p = 0.01$, puis ajouter dans la même fenêtre le graphe de la densité d'une var

$Y \sim \mathcal{N}(np, np(1 - p))$. Que constatez-vous ?

Exercice 7. Soit $X \sim \mathcal{N}(0, 1)$. Calculer les probabilités : $\mathbb{P}(X < -0.5)$, $\mathbb{P}(X > 1.5)$, $\mathbb{P}(X > -1)$, $\mathbb{P}(|X| \leq 1.96)$, $\mathbb{P}(|X| \leq 2.58)$ et $\mathbb{P}(|X| \geq 3)$.

Exercice 8. Soit $X \sim \mathcal{N}(15, 9)$.

1. Calculer les probabilités : $\mathbb{P}(16 \leq X \leq 20)$, $\mathbb{P}(X > 18)$, $\mathbb{P}(X < 6)$ et $\mathbb{P}(|X - 15| > 5.88)$.
2. Représenter le graphe de la fonction de répartition de X pour $x \in [6, 24]$.

Exercice 9. Représenter, sur une même figure, la fonction de répartition d'une $\text{var } X \sim \mathcal{B}(50, 0.4)$ et celle d'une $\text{var } Y \sim \mathcal{N}(20, 12)$.

Exercice 10.

1. Soit $X \sim \mathcal{N}(0, 1)$. Calculer les quantiles : $x_{0.00135}$, $x_{0.025}$, $x_{0.95}$, $x_{0.999}$, $x_{0.995}$ et $x_{0.99865}$.
2. Soit $Y \sim \mathcal{N}(19, 3)$. Calculer les quantiles : $y_{0.975}$ et $y_{0.025}$. Vérifier que $y_{0.975} = 19 + \sqrt{3} x_{0.975}$.

Exercice 11. Construire un vecteur `simul1` composé de 1000 éléments dont les valeurs sont des réalisations d'une $\text{var } X \sim \mathcal{N}(15, 3)$. Faire l'histogramme des fréquences de `simul1` et superposer la densité de X . Faire le boxplot de `simul1`.

Exercice 12.

1. Construire un vecteur `simul2` qui est composé de 1000 éléments dont les valeurs sont des réalisations d'une $\text{var } X \sim \mathcal{P}(1)$.
2. Construire un vecteur dont le premier élément sera le nombre de réalisations qui vaudront 0, le deuxième élément sera le nombre de réalisations qui vaudront 1... (*On pourra utiliser la fonction `compter` décrite ci-dessous.*)

```
compter = fonction(a, b) {  
  d = numeric()  
  for(i in 1:(length(a))) {  
    d[i] = sum(b == a[i])  
  }  
  names(d) = as.character(a)  
  d  
}
```

3. Faire un `barplot` et superposer la densité de X .

Exercice 13. Construire dans R une fonction `péage` qui a 4 arguments : `mu1`, `mu2`, `sigma` et `n`. À l'intérieur de cette fonction :

- on définit un vecteur numérique `attente` de longueur n ,
- on construit un objet `cabines` constitué des cabines `C1` et `C2`,
- on ouvre une boucle qui va de 1 à n . Pour chaque i avec $i \in \{1, \dots, n\}$, à l'intérieur de cette boucle, on tire au hasard une cabine dans l'objet `cabines`.
 - Si la cabine `C1` a été choisie, on simule le tirage d'une `var` d'espérance `mu1` et d'écart-type `sigma` et on affecte le résultat à la i -ème composante de `attente`.
 - Si la cabine `C2` a été choisie, on simule le tirage d'une `var` de moyenne `mu2` et d'écart-type `sigma` et on affecte le résultat à la i -ème composante de `attente`,
- après avoir constitué le vecteur `attente`, on construit l'histogramme des fréquences du vecteur `attente`,
- on calcule `moy` qui est la moyenne du vecteur `attente`,
- on calcule `ecart` qui est l'écart-type corrigé des valeurs des éléments du vecteur `attente` en utilisant la fonction `sd`,
- on ajoute à l'histogramme la courbe de la densité associée à la loi normale de moyenne `moy` et d'écart-type `ecart`,
- on ajoute à la figure un texte comportant l'indication de la valeur de `moy` et l'indication de la valeur de `ecart` (garder deux décimales seulement),

- on ajoute à l'histogramme le graphe de la fonction suivante :

$$f(x) = 0.5(f_1(x) + f_2(x)),$$

où $f_1(x)$ est la densité associée à la loi $\mathcal{N}(\mu_1, \sigma^2)$ et $f_2(x)$ celle associée à la loi $\mathcal{N}(\mu_2, \sigma^2)$.

On exécute ensuite cette fonction sur deux fenêtres :

- pour la première prendre `mu1 = 50`, `mu2 = 51`, `sigma = 2` et `n = 1000`,
- pour la seconde prendre `mu1 = 50`, `mu2 = 60`, `sigma = 2` et `n = 1000`.

L'objectif est de montrer qu'un mélange de lois normales n'est pas obligatoirement une loi normale.

Exercice 14. Diviser l'écran en 4 fenêtres.

- Dans la première fenêtre, représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{N}(0, 1)$ pour $x \in [-3, 3]$, puis ajouter celui de la densité d'une $\text{var } Y \sim \mathcal{T}(2)$.
- Dans la deuxième fenêtre, représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{N}(0, 1)$ pour $x \in [-3, 3]$, puis ajouter celui de la densité d'une $\text{var } Y \sim \mathcal{T}(3)$.
- Dans la troisième fenêtre, représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{N}(0, 1)$ pour $x \in [-3, 3]$, puis ajouter celui de la densité d'une $\text{var } Y \sim \mathcal{T}(10)$.
- Dans la quatrième fenêtre, représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{N}(0, 1)$ pour $x \in [-3, 3]$, puis ajouter celui de la densité d'une $\text{var } Y \sim \mathcal{T}(30)$.

Exercice 15. Construire dans R une fonction `stu1` qui a 4 arguments : `n`, `nb`, `mu` et `sigma`.

À l'intérieur de cette fonction, on définit un vecteur `vec` de longueur `nb`.

On construit les composantes du vecteur par une boucle allant de 1 à `nb`.

La i -ème composante de `vec` est calculée ainsi :

- On simule un vecteur `simul` qui est composé de `n` réalisations d'une $\text{var } X \sim \mathcal{N}(\text{mu}, \text{sigma}^2)$.
- On calcule la moyenne \bar{x} et l'écart-type corrigé s des valeurs des éléments de `simul`.
La i -ème composante de `vec` est égale à $\sqrt{n} \left(\frac{\bar{x} - \text{mu}}{s} \right)$.
- Diviser l'écran en 2 fenêtres superposées.

- Dans la première fenêtre, construire l’histogramme des fréquences de `vec`. Superposer le graphe de la densité associée à loi $\mathcal{N}(0, 1)$ et, avec une autre couleur, le graphe de la densité associée à la loi $\mathcal{T}(n - 1)$.
- Dans la deuxième fenêtre, représenter la fonction de répartition empirique de `vec` avec les commandes : `plot(ecdf(vec))`. Ajouter en rouge le graphe de la fonction de répartition associée à la loi $\mathcal{T}(n - 1)$. Ajouter en jaune le graphe de la fonction de répartition associée à la loi $\mathcal{N}(0, 1)$.

Essayer cette fonction avec `n=3`, `nb = 1000`, `mu = 10` et `sigma = 2`, puis avec `n=30`, `nb = 1000`, `mu = 10` et `sigma = 2`.

Rappel : La fonction de répartition empirique associée à un n -échantillon (X_1, \dots, X_n) d’une var X de fonction de répartition F_X est $\hat{F}(x) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \mathbf{1}_{\{X_i \leq x\}}$. Le théorème de Glivenko-Cantelli nous assure que : $\max_{-\infty < x < +\infty} |\hat{F}(x) - F_X(x)| \rightarrow 0$ (presque sûrement) quand $n \rightarrow +\infty$.

Exercice 16. Diviser l’écran en 6 fenêtres.

- Dans la fenêtre 1, représenter le graphe de la densité d’une var $X \sim \chi^2(1)$ pour $x \in [0.01, 10]$.
- Dans la fenêtre 2, représenter le graphe de la densité d’une var $X \sim \chi^2(2)$ pour $x \in [0.01, 10]$.
- Dans la fenêtre 3, représenter le graphe de la densité d’une var $X \sim \chi^2(3)$ pour $x \in [0.01, 10]$.
- Dans la fenêtre 4, représenter le graphe de la densité d’une var $X \sim \chi^2(5)$ pour $x \in [0.01, 10]$.
- Dans la fenêtre 5, représenter le graphe de la densité d’une var $X \sim \chi^2(10)$ pour $x \in [0.01, 20]$.
- Dans la fenêtre 6, représenter le graphe de la densité d’une var $X \sim \chi^2(20)$ pour $x \in [0.01, 60]$.

Exercice 17. Construire dans R une fonction `khi2` qui a 4 arguments : `n`, `nb`, `mu` et `sigma`.

À l’intérieur de cette fonction, on définit un vecteur `vec` de longueur `nb`.

On construit les composantes de ce vecteur par une boucle allant de 1 à `nb`.

La i -ème composante de `vec` est calculée ainsi :

- On simule un vecteur `simul` qui est composé de `n` réalisations d’une var $X \sim \mathcal{N}(\text{mu}, \text{sigma}^2)$.
- On calcule la variance corrigée s^2 de la série des `n` composantes de `simul`.

La i -ème composante de `vec` est égale à $\frac{(n - 1)s^2}{\text{sigma}^2}$.

Une fois ce vecteur construit, on ne garde que les composantes comprises entre 0.01 et 10 et on construit l'histogramme des fréquences.

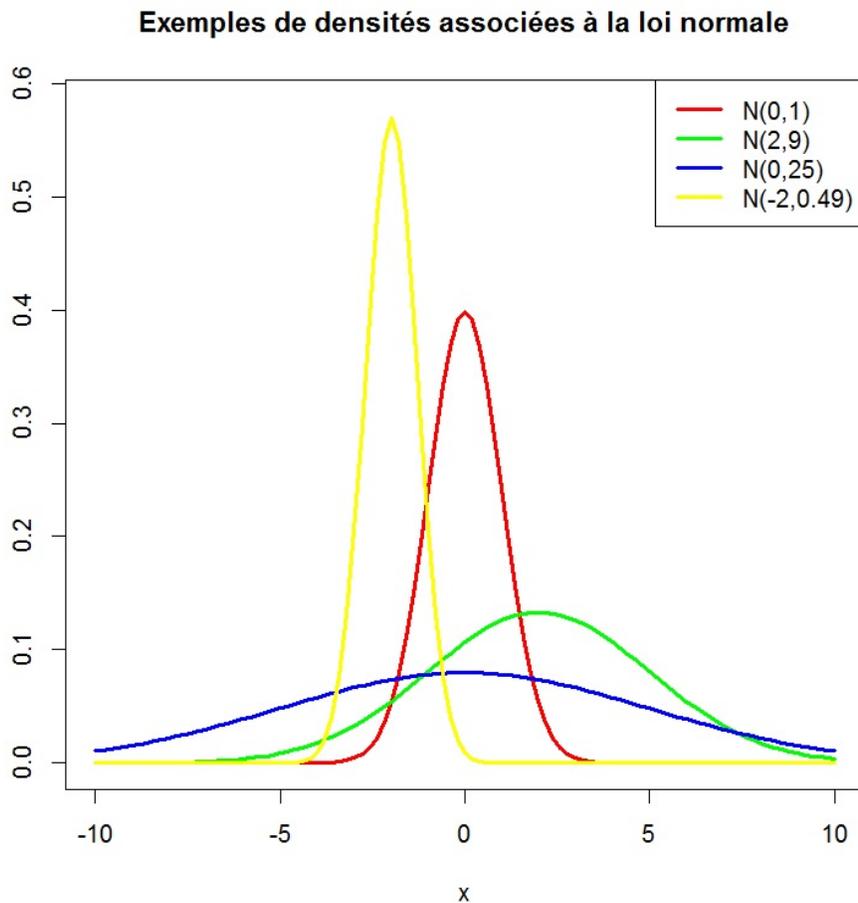
On superpose le graphe de la densité associée à la loi $\chi^2(n-1)$.

Essayer cette fonction avec $n = 4$, $nb = 10000$, $\mu = 10$ et $\sigma = 2$.

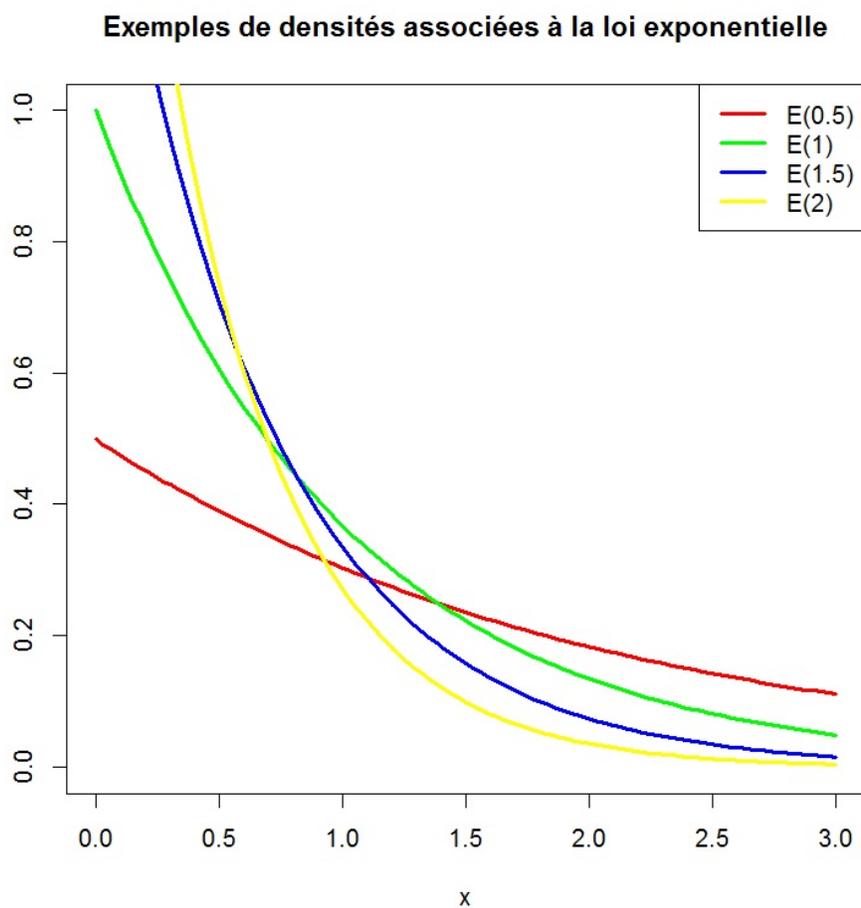
Exercice 18. Diviser l'écran en 4 fenêtres.

- Dans la fenêtre 1, représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{E}(1)$ pour $x \in [0, 3]$.
- Dans la fenêtre 2, , représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{E}(2)$ pour $x \in [0, 3]$.
- Dans la fenêtre 3, représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{E}(0.5)$ pour $x \in [0, 20]$.
- Dans la fenêtre 4, représenter le graphe de la densité d'une $\text{var } X \sim \mathcal{E}(0.1)$ pour $x \in [0, 60]$.

Exercice 19. Proposer des commandes R permettant d'obtenir le graphique suivant :



Exercice 20. Proposer des commandes R permettant d'obtenir le graphique suivant :



Exercice 21. On s'intéresse à la durée de vie d'un certain type de voiture. Soit X la *var* égale à la durée de vie en années d'une de ces voitures. On suppose que X suit la loi exponentielle $\mathcal{E}(\frac{1}{10})$, *i.e.* de densité

$$f(x) = \begin{cases} \frac{1}{10} e^{-\frac{x}{10}} & \text{si } x \geq 0, \\ 0 & \text{sinon.} \end{cases}$$

1. Écrire une nouvelle fonction R équivalente à `dexp` (on pourra utiliser une structure de contrôle `if ... else` pour que celle-ci vaille 0 quand $x < 0$).
2. Vérifier numériquement que $\int_0^{100} f(x) dx \simeq 1$ avec la commande `integrate`.

- Séparer l'écran graphique en 2 : dans la fenêtre 1, représenter le graphe de la densité f et, dans la fenêtre 2, celui de la fonction de répartition de X .
- Calculer la probabilité que la durée de vie d'une voiture dépasse 10.2 ans.

Exercice 22. Soit X une *var* suivant la loi gamma $\Gamma(5, 1)$, *i.e.* de densité

$$f(x) = \begin{cases} \frac{1}{24}x^4e^{-x} & \text{si } x \geq 0, \\ 0 & \text{sinon.} \end{cases}$$

- Écrire une nouvelle fonction R équivalente à `dgamma`.
- Vérifier numériquement que $\int_0^{100} f(x)dx \simeq 1$.
- Évaluer la fonction de répartition de X pour $x \in \{2, \dots, 10\}$.
- Déterminer le réel x vérifiant $\mathbb{P}(X \leq x) = 0.92$.

Exercice 23. Soit X une *var* suivant la loi normale $\mathcal{N}(0, 1)$, *i.e.* de densité

$$f(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}}e^{-\frac{x^2}{2}}, \quad x \in \mathbb{R}.$$

- Écrire une nouvelle fonction R équivalente à la fonction `dnorm`.
- Vérifier numériquement que $\int_{-100}^{100} f(x)dx \simeq 1$.
- Séparer l'écran graphique en 2 : dans la fenêtre 1, représenter le graphe de la densité f et, dans la fenêtre 2, celui de la fonction de répartition de X .
- Calculer $\mathbb{P}(X \leq 2.2)$, $\mathbb{P}(X \geq 1.7)$, $\mathbb{P}(0.2 \leq X < 1.4)$ et $\mathbb{P}(|X| \leq 1.96)$.
- Déterminer le réel x vérifiant $\mathbb{P}(X \leq x) = 0.98$.

Exercice 24. On suppose que le poids d'un foie gras peut être modélisé par une *var* X suivant la loi normale $\mathcal{N}(550, 100^2)$, l'unité étant le gramme. Quelle est la probabilité qu'un foie gras pèse

- moins de 650 grammes ?
- plus de 746 grammes ?
- entre 550 grammes et 600 grammes ?

Exercice 25. Soit X une *var* suivant la loi normale $\mathcal{N}(0, 1)$. La fonction de répartition de X , *i.e.* $F_X(x) = \mathbb{P}(X \leq x)$, avec $x \geq 0$, peut s'écrire comme

$$F_X(x) = \frac{1}{2} + \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{x^2}{2}} \sum_{n=0}^{\infty} \frac{x^{2n+1}}{\prod_{m=0}^n (2m+1)}.$$

Utiliser cette expression pour écrire une nouvelle fonction R équivalente à la fonction `pnorm` (*on tronquera la somme infinie à la valeur 50*).

Exercice 26. Soit X une *var* dont la loi est donnée par

$$\mathbb{P}(X = 0) = 0.2, \quad \mathbb{P}(X = 2) = 0.5, \quad \mathbb{P}(X = 5) = 0.3.$$

Simuler 1000 réalisations de X et préciser les effectifs associés aux valeurs de X .

Exercice 27. Une urne contient $p + q$ boules, dont p rouges et q noires. Construire dans R une fonction `Urne` qui a 3 arguments : `k`, `p` et `q`. L'enjeu de celle-ci est de modéliser le résultat de `k` tirages sans remise d'une boule de l'urne. Par exemple, la commande `Urne(6, 8, 5)` renvoie : `[1] "Rouge" "Noire" "Noire" "Rouge" "Noire" "Rouge"`.

Exercice 28. Lorsqu'on effectue n tirages indépendants d'une même expérience aléatoire, on appelle fréquence du résultat k le rapport entre le nombre de fois où k est tiré, et n .

Par exemple, si on jette 7 fois un dé cubique équilibré, avec pour résultats : 1 ; 1 ; 5 ; 2 ; 6 ; 5 ; 3, alors la fréquence de 5 est 2/7, celle de 4 est 0.

Construire dans R une fonction `Freq` qui a un argument : `n`. L'enjeu de celle-ci est de renvoyer la fréquence de 5 lors de `n` tirages indépendants d'un dé cubique équilibré. Comparer les fréquences pour $n \in \{10, 100, 1000\}$, avec la probabilité (théorique) d'obtenir un 5 lorsqu'on lance un dé.

Exercice 29. Une urne contient 15 boules, dont 5 blanches et 10 noires. On considère les deux expériences suivantes :

- E1 : On tire successivement 10 boules dans l'urne, avec remise,
- E2 : On tire successivement 10 boules dans l'urne, sans remise.

1. Simuler une réalisation de chacune des deux expériences avec la fonction `sample`. On représentera une boule blanche par le chiffre 1 et une boule noire par le chiffre 0.
2. On s'intéresse à la *var* X égale au nombre de boules blanches tirées lors l'expérience E1, et à la *var* Y , l'analogue mais avec l'expérience E2.
 - (a) Simuler 500 réalisations de chacune de ces *var* en utilisant la fonction `sample`.
 - (b) Comparer, suivant le type d'épreuve, le diagramme en barre des fréquences observées avec la distribution des lois binomiales et hypergéométriques correspondantes.

Exercice 30. On considère la marche aléatoire suivante : un mobile est positionné à l'origine d'un axe. À chaque étape, il se déplace d'une distance de longueur 1 vers la droite ou la gauche avec la probabilité 0.5 pour chaque direction. Il effectue n étapes au total. Soit X_i la position du mobile à l'étape i (on pose $X_0 = 0$).

Simuler une réalisation du vecteur de *var* (X_0, X_1, \dots, X_n) (on pourra utiliser la fonction `cumsum` qui donne la somme cumulée d'un vecteur. Par exemple, la commande `cumsum(c(2, 2, 2, 3))` renvoie :
[1] 2 4 6 9).

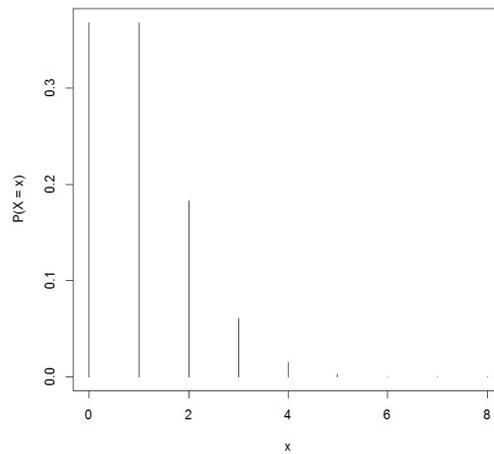
Exercice 31. On lance 5 dés cubiques équilibrés, puis on relance ceux qui n'ont pas fait 6, et ainsi de suite jusqu'à ce que les 5 dés affichent 6.

Simuler une réalisation de cette expérience aléatoire en affichant les chiffres obtenus après chaque lancers et le nombre de lancers total (on pourra utiliser une boucle `while` et la commande `sum(x != 6)` qui calcule le nombre de composantes d'un vecteur \mathbf{x} différentes de 6).

7 Solutions

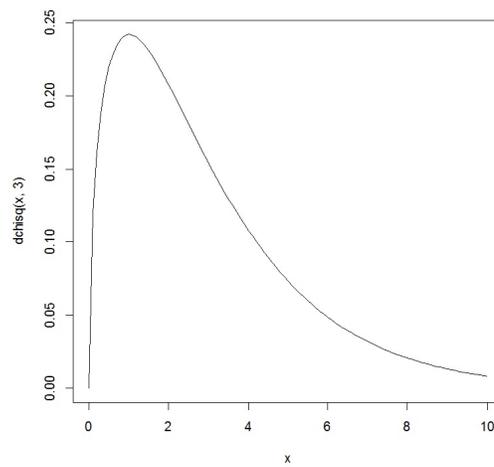
Solution 1. On fait : `plot(0:8, dpois(0:8, 1), type = "h", xlab = "x", ylab = "P(X = x)")`

Cela renvoie :



Solution 2. On considère les commandes : `curve(dchisq(x, 3), 0, 10, xlab = "x")`

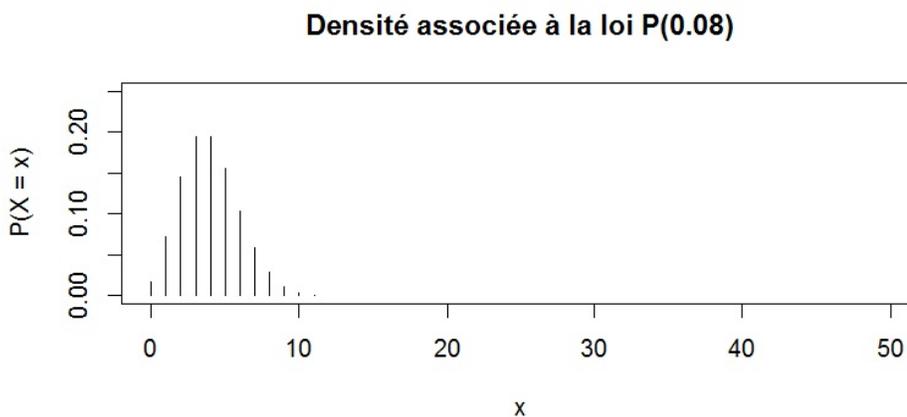
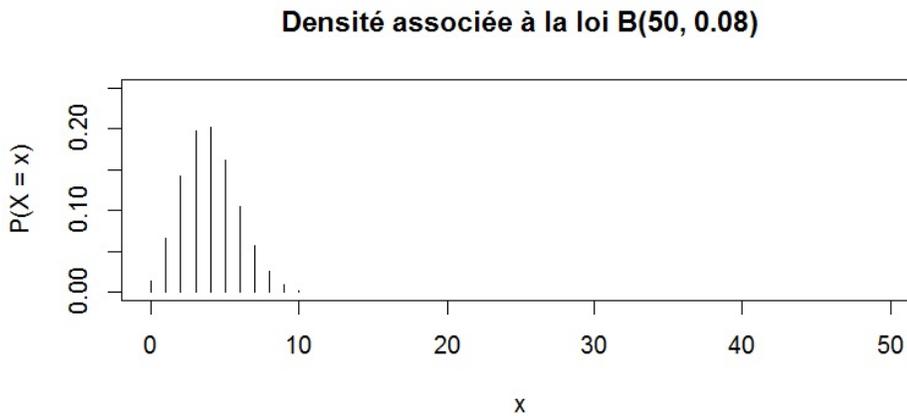
Cela renvoie :



Solution 3. On fait :

```
par(mfrow = c(2,1))
plot(0:50, dbinom(0:50, 50, 0.08), type = "h", xlab = "x", ylab = "P(X = x)",
     ylim=c(0, 0.25), main = "Densité associée à la loi B(50, 0.08)")
plot(0:50, dpois(0:50, 4), type = "h", xlab = "x", ylab = "P(X = x)",
     ylim = c(0, 0.25), main = "Densité associée à la loi P(0.08)")
par(mfrow = c(1,1))
```

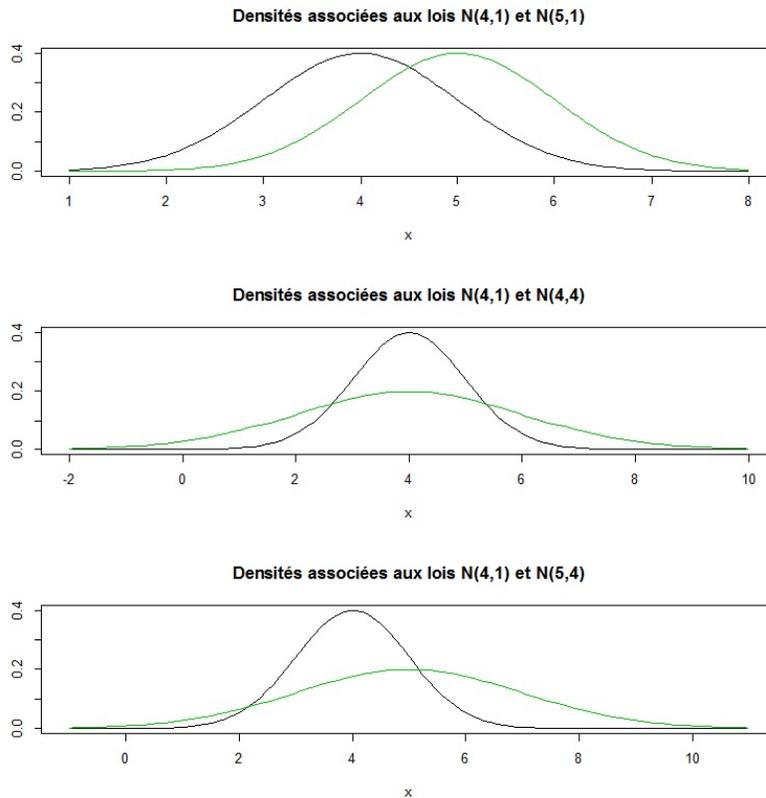
Cela renvoie :



Solution 4. On fait :

```
par(mfrow = c(3, 1))
curve(dnorm(x, 4, 1), 1, 8, ylab = "",
main = "Densités associées aux lois N(4,1) et N(5,1)")
curve(dnorm(x, 5, 1), 1, 8, col = 3, ylab = "", add = TRUE)
curve(dnorm(x, 4, 1), -2, 10, ylab = "",
main = "Densités associées aux lois N(4,1) et N(4,4)")
curve(dnorm(x, 4, 2), -2, 10, col = 3, ylab = "", add = TRUE)
curve(dnorm(x, 4, 1), -1, 11, ylab = "",
main = "Densités associées aux lois N(4,1) et N(5,4)")
curve(dnorm(x, 5, 2), -1, 11, col = 3, ylab = "", add = TRUE)
par(mfrow = c(1,1))
```

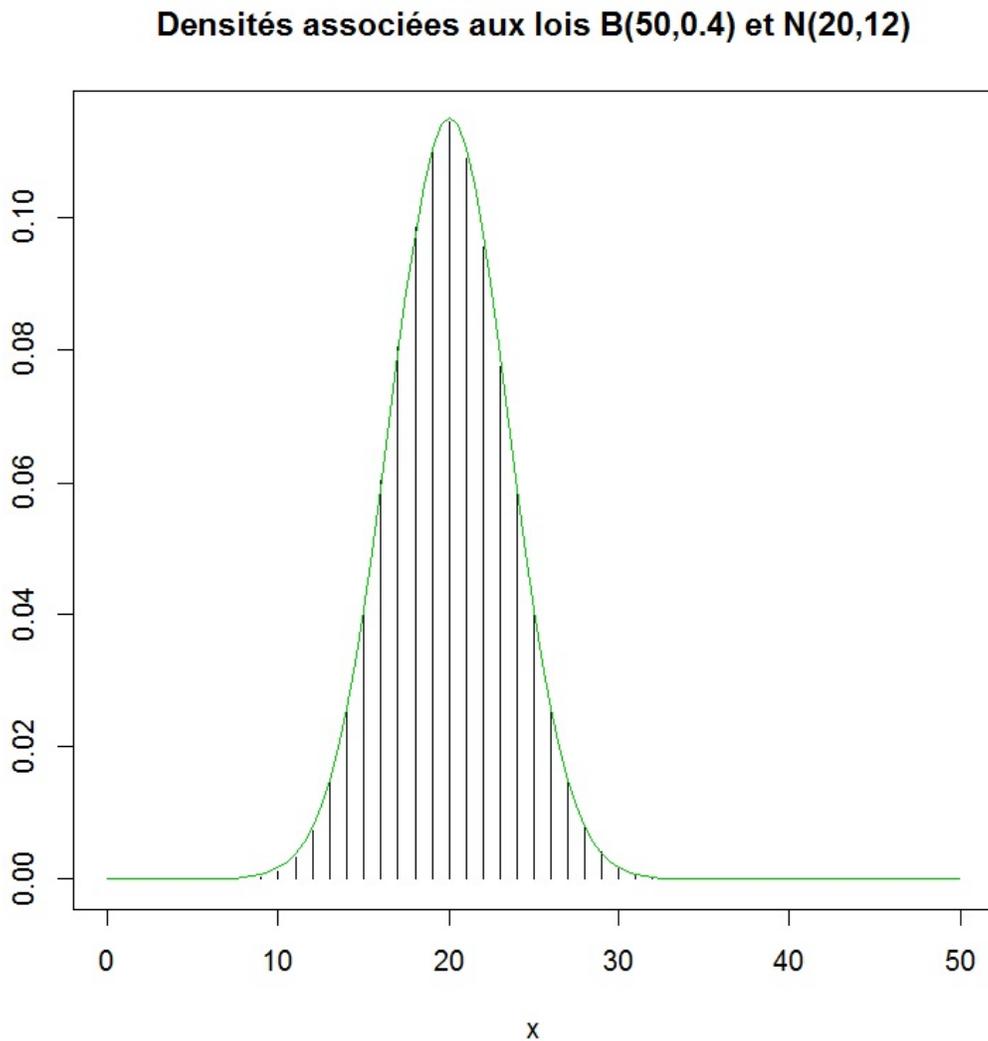
Cela renvoie :



Solution 5. On fait :

```
plot(0:50, dbinom(0:50, 50, 0.4), type = "h", xlab = "x", ylab = "",  
main = "Densités associées aux lois B(50,0.4) et N(20,12)")  
curve(dnorm(x, 20, sqrt(12)), 0, 50, col = 3, ylab = "", add = TRUE)
```

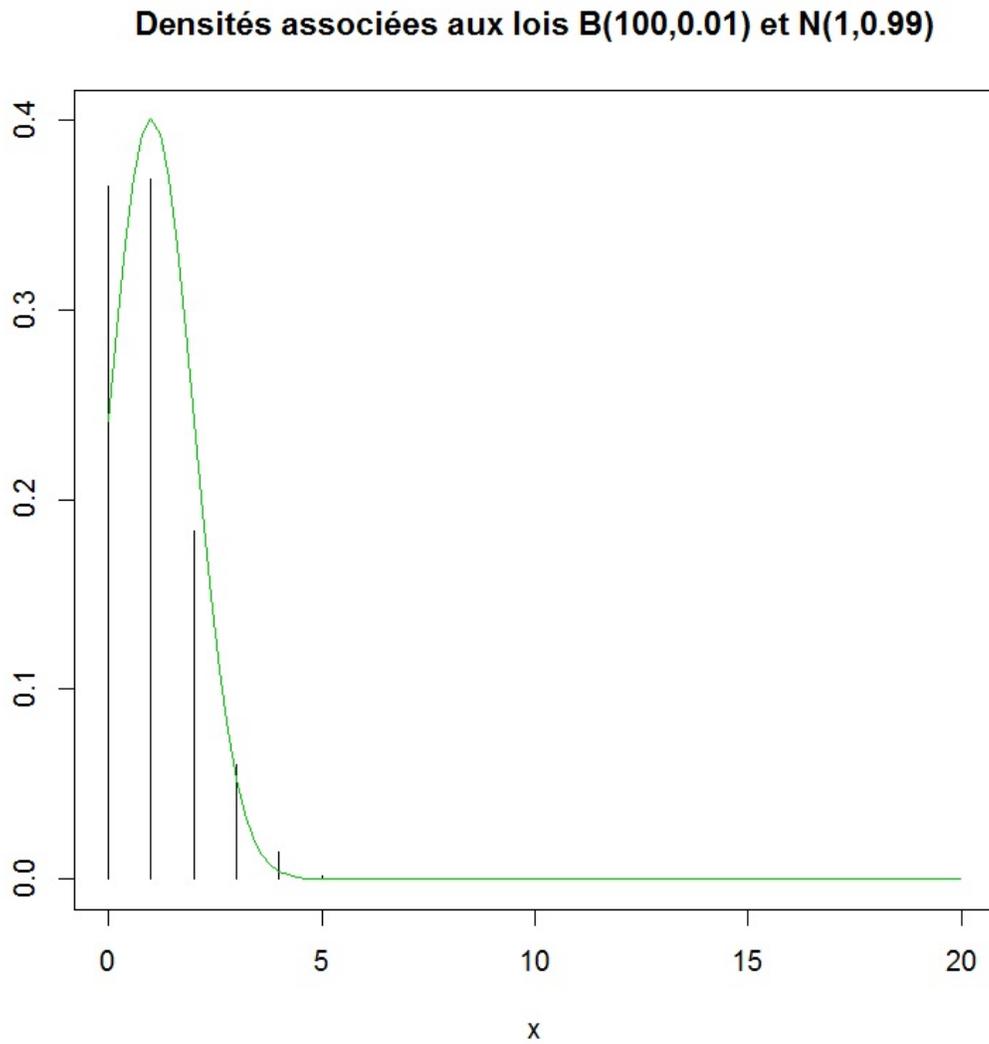
Cela renvoie :



Solution 6. On considère les commandes :

```
plot(0:20, dbinom(0:20, 100, 0.01), type = "h", xlab = "x", ylab = "",  
ylim = c(0, 0.4), main = "Densités associées aux lois B(100,0.01) et N(1,0.99)")  
curve(dnorm(x, 1, sqrt(0.99)), 0, 20, col = 3, ylab = "", add = TRUE)
```

Cela renvoie :



Solution 7. Pour $X \sim \mathcal{N}(0, 1)$, on a :

$\mathbb{P}(X < -0.5)$	$\mathbb{P}(X > 1.5)$	$\mathbb{P}(X > -1)$
<code>pnorm(-0.5, 0, 1)</code>	<code>1 - pnorm(1.5, 0, 1)</code>	<code>1 - pnorm(-1, 0, 1)</code>
[1] 0.3085375	[1] 0.0668072	[1] 0.8413447

$\mathbb{P}(X \leq 1.96)$	$\mathbb{P}(X \leq 2.58)$
<code>pnorm(1.96, 0, 1) - pnorm(-1.96, 0, 1)</code>	<code>pnorm(2.58, 0, 1) - pnorm(-2.58, 0, 1)</code>
[1] 0.9500042	[1] 0.99012

$\mathbb{P}(X \geq 3)$
<code>1 - (pnorm(3, 0, 1) - pnorm(-3, 0, 1))</code>
[1] 0.002699796

On aurait pu utiliser d'autres commandes. Par exemple, pour $\mathbb{P}(X > 1.5)$:

`pnorm(1.5, 0, 1, lower.tail = FALSE)`

Solution 8.

1. Pour $X \sim \mathcal{N}(15, 9)$, on a :

$\mathbb{P}(16 < X < 20)$	$\mathbb{P}(X > 18)$	$\mathbb{P}(X < 6)$
<code>pnorm(20, 15, 3) - pnorm(16, 15, 3)</code>	<code>1 - pnorm(18, 15, 3)</code>	<code>pnorm(6, 15, 3)</code>
[1] 0.321651	[1] 0.1586553	[1] 0.001349898

$$\mathbb{P}(|X - 15| > 5.88)$$

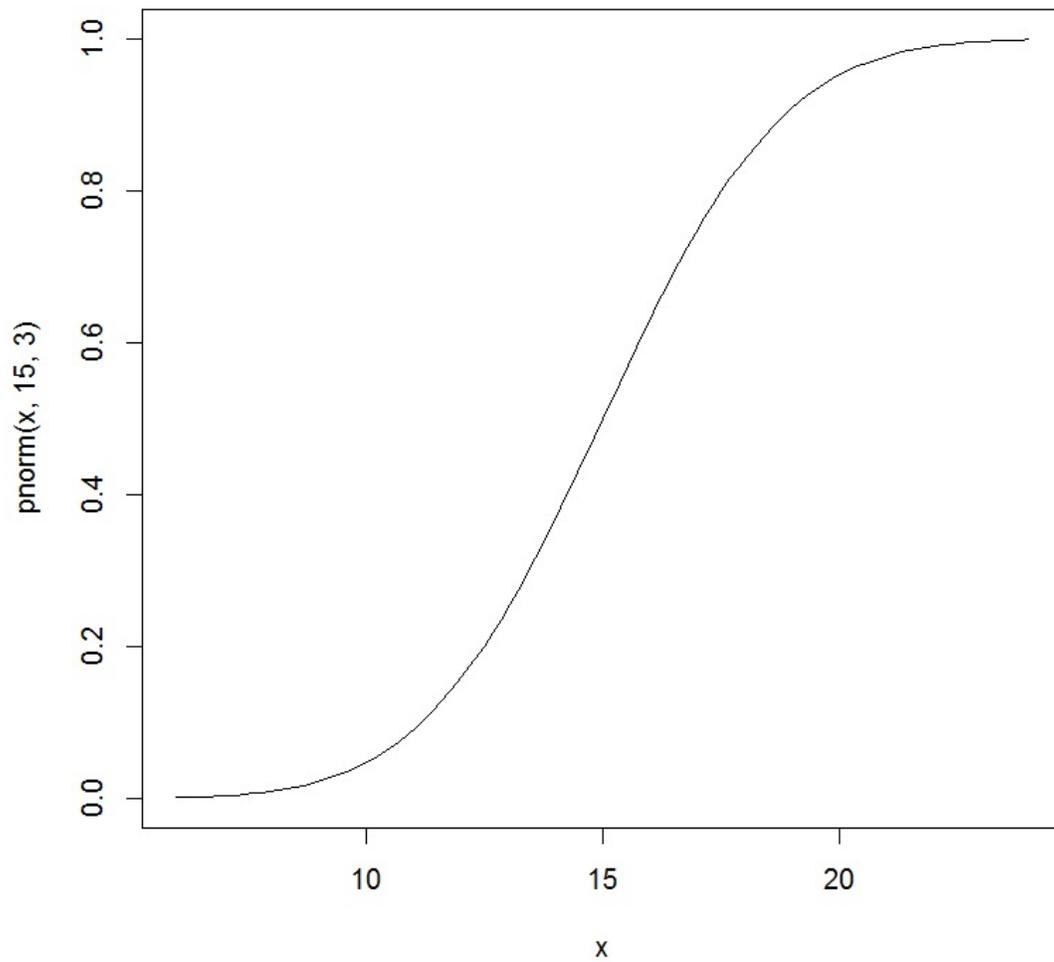
$$1 - (\text{pnorm}(15 + 5.88, 15, 3) - \text{pnorm}(15 - 5.88, 15, 3))$$

```
[1] 0.04999579
```

2. On fait :

```
curve(pnorm(x, 15, 3), 6, 24)
```

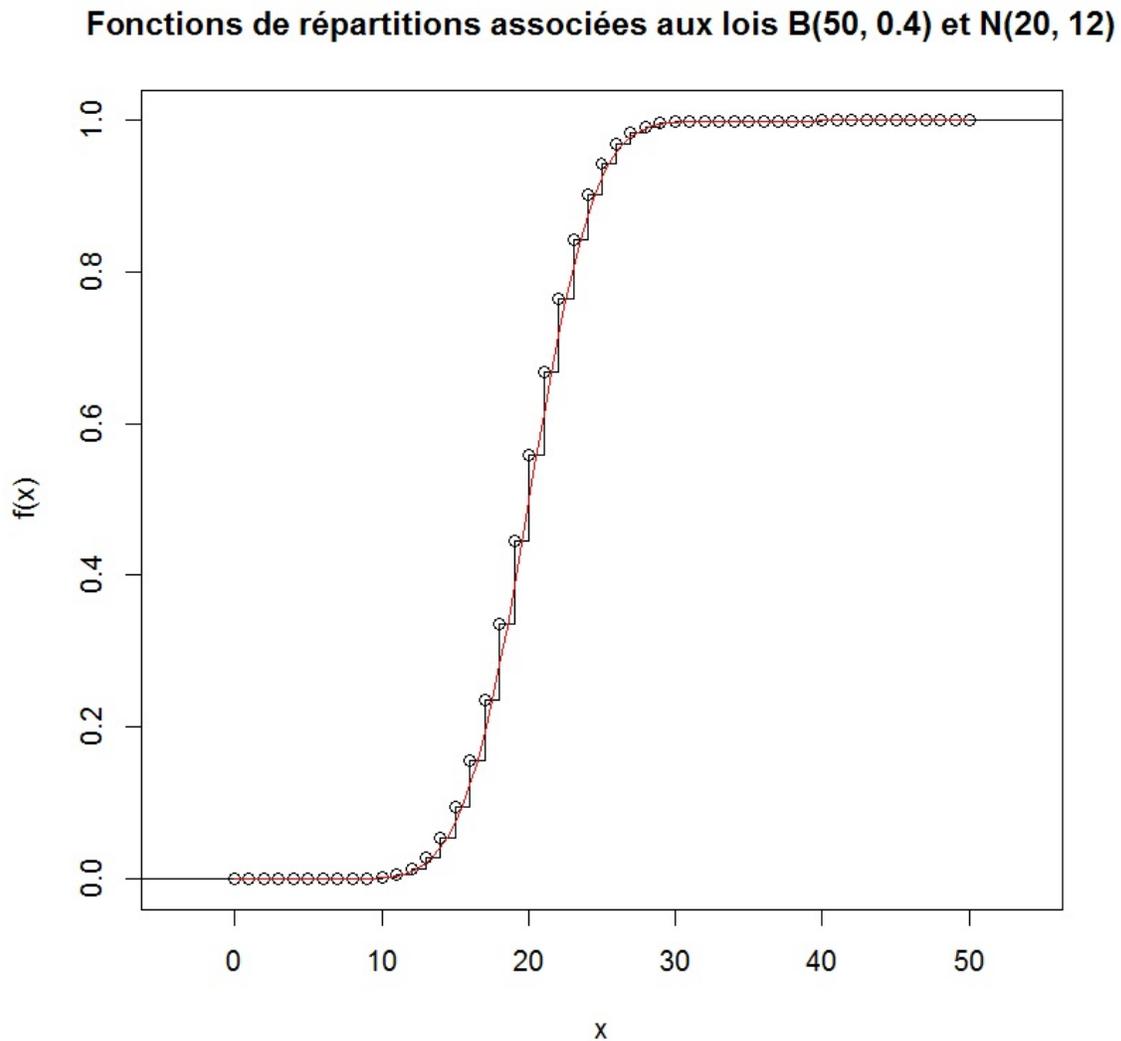
Cela renvoie :



Solution 9. On fait :

```
plot(stepfun(0:50, c(0, pbinom(0:50, 50, 0.4))),  
main = "Fonctions de répartitions associées aux lois B(50, 0.4) et N(20, 12)")  
curve(pnorm(x, 20, sqrt(12)), 0, 50, col = "red", add = TRUE)
```

Cela renvoie :



Solution 10.

1. On fait :

```
p = c(0.00135, 0.025, 0.95, 0.999, 0.995, 0.99865)
x = qnorm(p)
cbind(p, x)
```

On obtient les quantiles demandés dans la colonne `x` :

```
      p      x
[1,] 0.00135 -2.999977
[2,] 0.02500 -1.959964
[3,] 0.95000  1.644854
[4,] 0.99900  3.090232
[5,] 0.99500  2.575829
[6,] 0.99865  2.999977
```

2. On fait :

```
p = c(0.975, 0.025)
y = qnorm(p, 19, sqrt(3))
cbind(p, y)
```

On obtient les quantiles demandés dans la colonne `y` :

```
      p      y
[1,] 0.975 22.39476
[2,] 0.025 15.60524
```

On a

```
y[1] - 19 - sqrt(3) * qnorm(0.975)
```

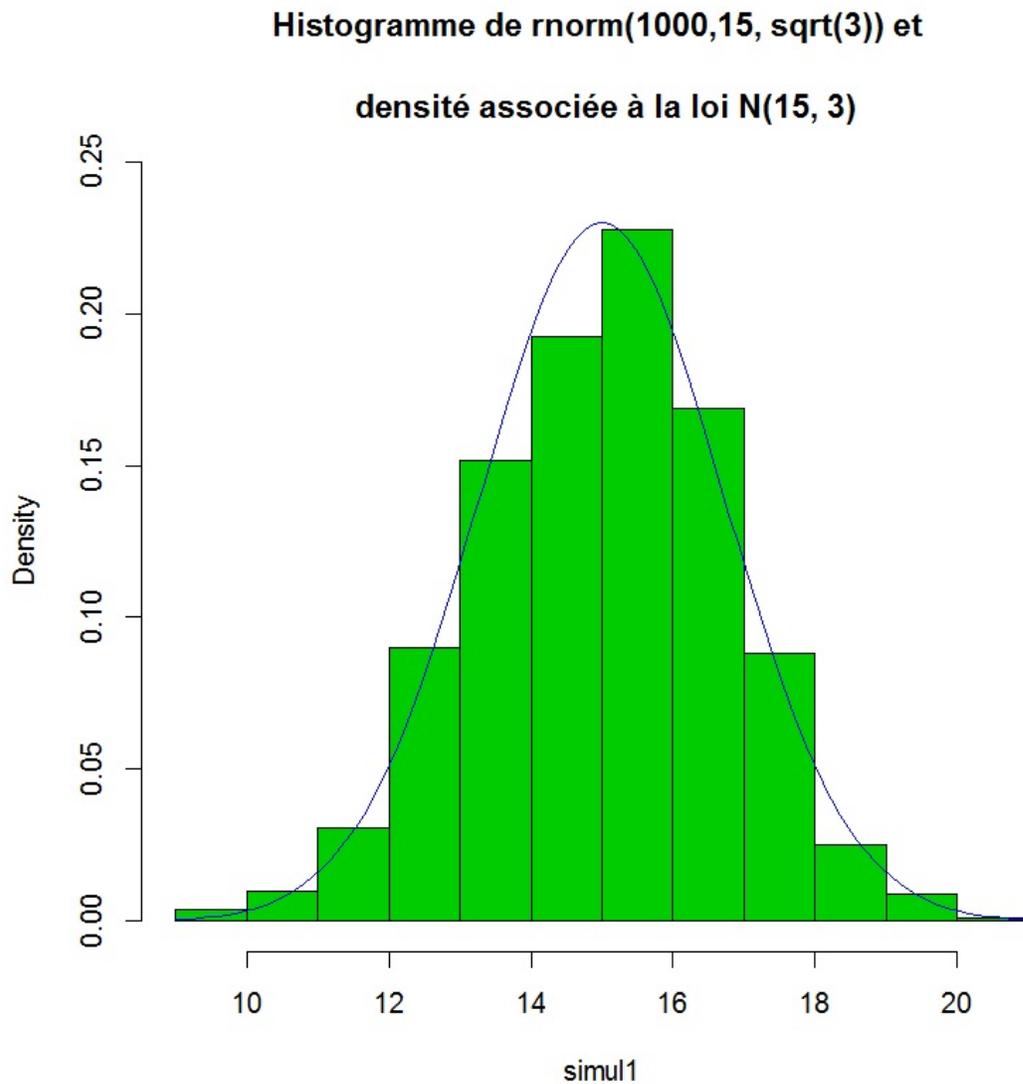
Cela renvoie : [1] 8.881784e-16

On arrondit cela à 0.

Solution 11. On fait :

```
simul1 = rnorm(1000, 15, sqrt(3))
hist(simul1, col = 3, prob = TRUE, ylim = c(0, 0.25),
     main = "Histogramme de rnorm(1000,15, sqrt(3)) et
     \n densité associée à la loi N(15, 3)")
curve(dnorm(x, 15, sqrt(3)), col = 4, add = TRUE)
boxplot(simul1, main = "Boxplot de rnorm(1000, 15, sqrt(3))")
```

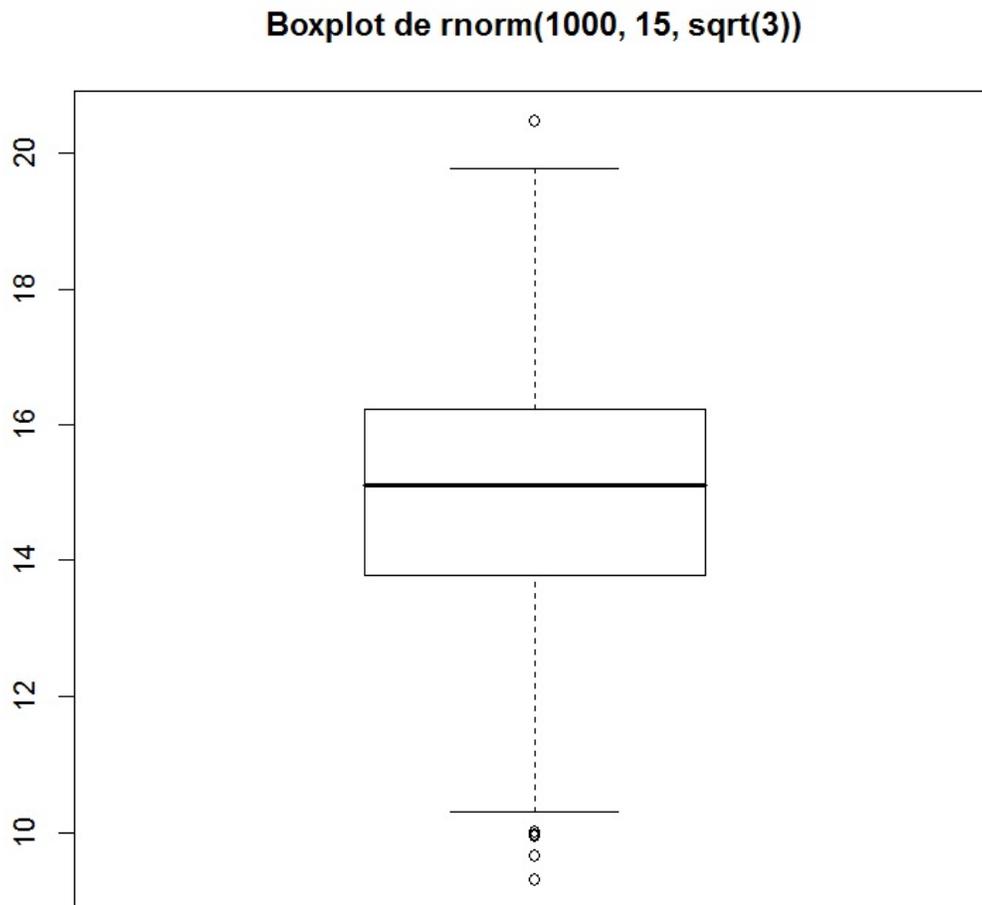
Cela renvoie :



On fait :

```
boxplot(simul1, main = "Boxplot de rnorm(1000, 15, sqrt(3))")
```

Cela renvoie :



Solution 12.

1. On fait :

```
simul2 = rpois(1000, 1)
```

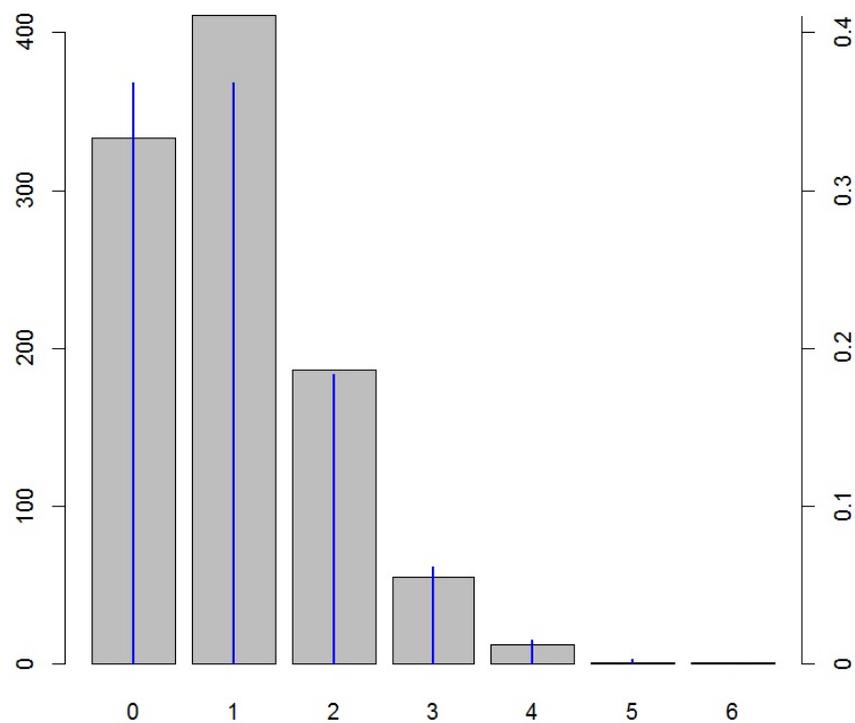
2. En utilisant la fonction `compter`, on fait :

```
maxi = max(simul2)
nbsimul2 = compter(0:maxi, simul2)
```

3. On fait :

```
bppois = barplot(nbsimul2)
points(bppois, dpois(0:maxi,1) * 1000, type = "h",
       col = "blue", lwd = 2)
axis(4, at = seq(0, 1000, by = 100), labels = seq(0, 1, by = 0.1))
```

Cela renvoie :

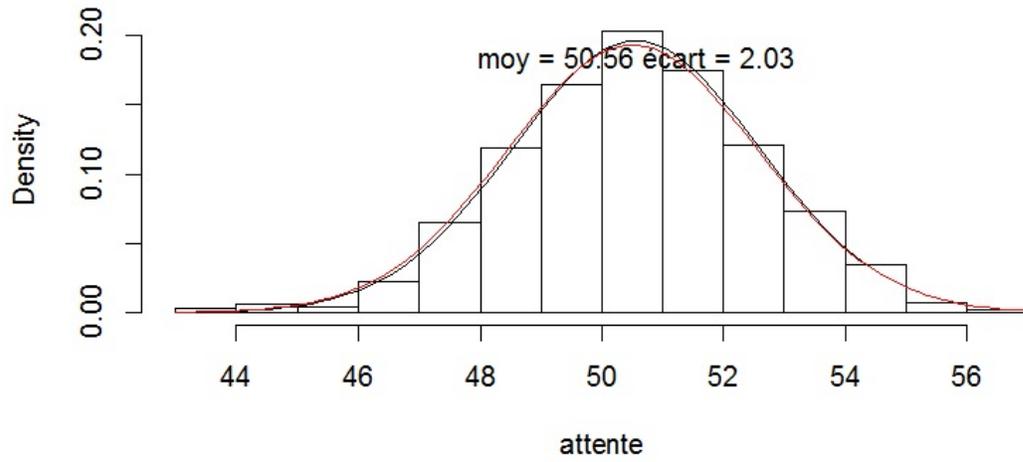


Solution 13. On considère les commandes :

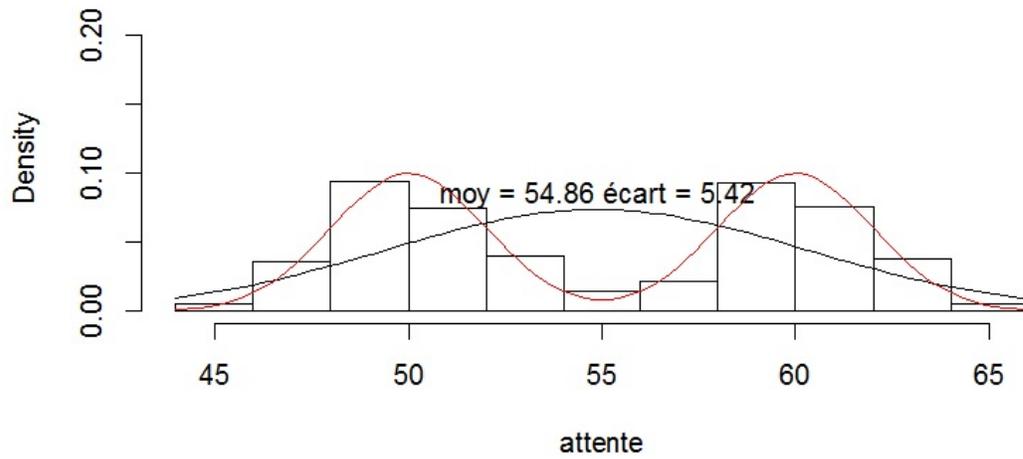
```
peage = function(mu1, mu2, sigma, n) {
  attente = numeric(n)
  cabines = c("C1", "C2")
  for(i in 1 : n) {
    tirage = sample(cabines, 1)
    if(tirage == "C1") {
      attente[i] = rnorm(1, mu1, sigma)
    } else {
      attente[i] = rnorm(1, mu2, sigma)
    }
  }
  a = 0.9 * max(hist(attente, prob = TRUE, ylim = c(0, 0.22), xlab = "attente",
    main = "Histogramme de attente")$density)
  moy = mean(attente)
  ecart = sd(attente)
  curve(dnorm(x, moy, ecart), add = TRUE)
  text(moy, a, paste("moy =", round(moy, 2), "écart =", round(ecart, 2)))
  curve(0.5 * (dnorm(x, mu1, sigma) + dnorm(x, mu2, sigma)), col = "red", add = TRUE)
}
par(mfrow = c(2, 1))
peage(50, 51, 2, 1000)
peage(50, 60, 2, 1000)
par(mfrow = c(1, 1))
```

Cela renvoie :

Histogramme de attente



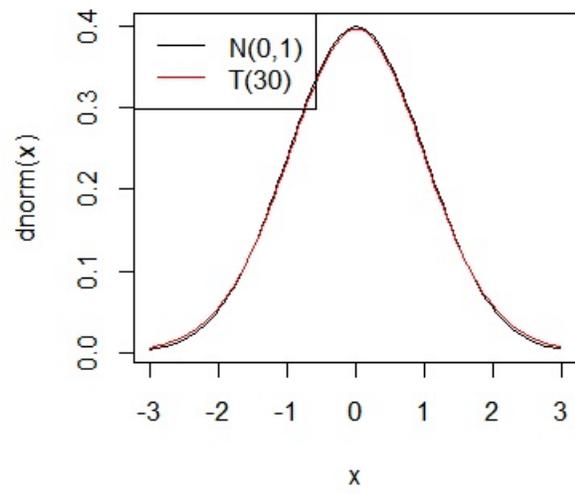
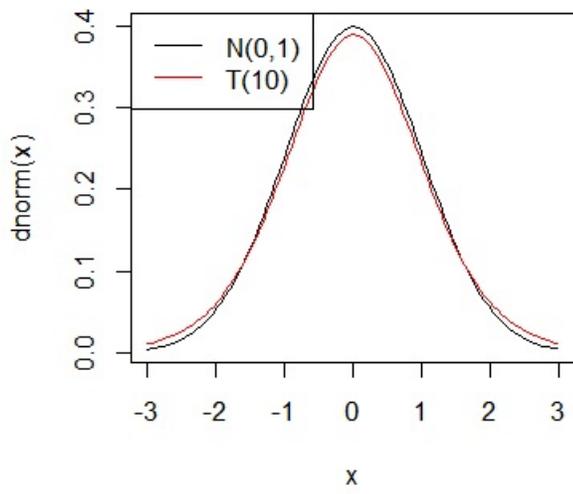
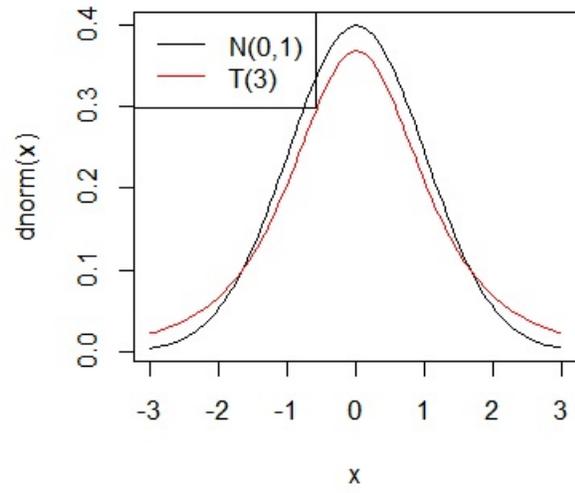
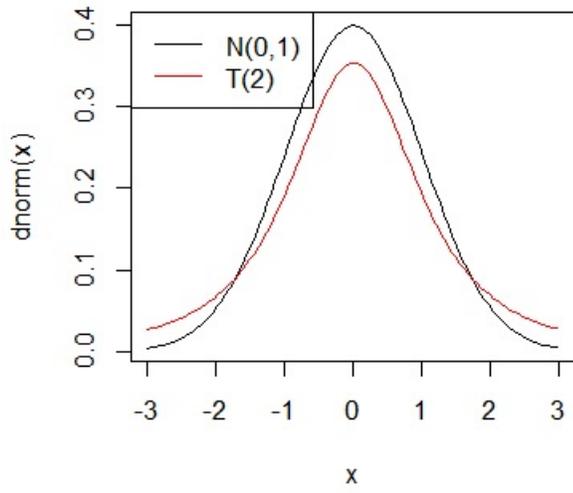
Histogramme de attente



Solution 14. On fait :

```
par(mfrow = c(2, 2))
curve(dnorm(x), -3, 3)
curve(dt(x, 2), -3, 3, col = "red", add = TRUE)
legend("topleft", legend = c("N(0,1)", "T(2)"), col = c("black", "red"), lwd=1)
curve(dnorm(x), -3, 3)
curve(dt(x,3), -3, 3, col = "red", add = TRUE)
legend("topleft", legend = c("N(0,1)", "T(3)"), col = c("black", "red"), lwd = 1)
curve(dnorm(x), -3, 3)
curve(dt(x, 10), -3, 3, col = "red", add = TRUE)
legend("topleft", legend = c("N(0,1)", "T(10)"), col = c("black", "red"), lwd = 1)
curve(dnorm(x), -3, 3)
curve(dt(x, 30), -3, 3, col = "red", add = TRUE)
legend("topleft", legend = c("N(0,1)", "T(30)"), col = c("black", "red"), lwd = 1)
par(mfrow = c(1, 1))
```

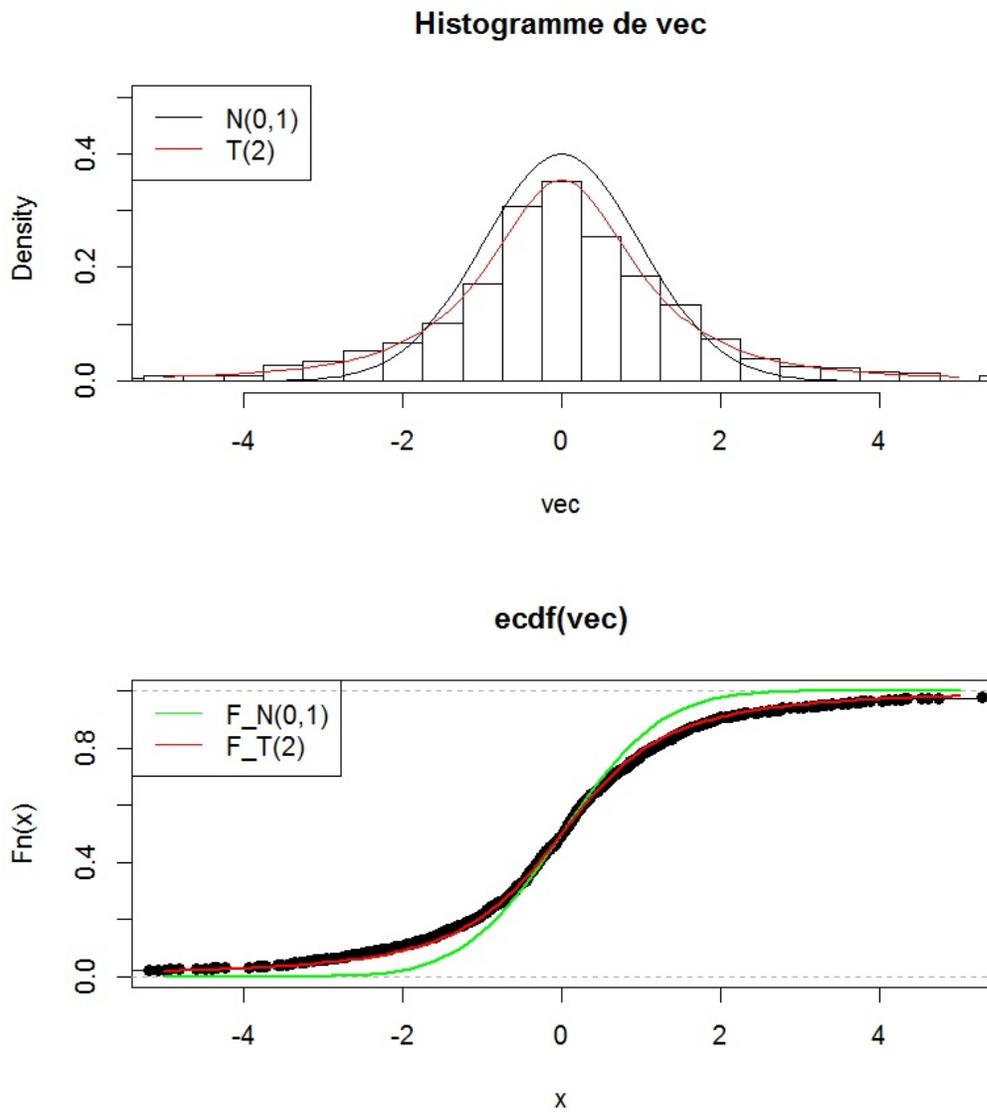
Cela renvoie :



Solution 15. On fait :

```
stu = function(n,nb,mu,sigma) {
vec = numeric(nb)
for (i in 1:nb) {
simul = rnorm(n,mu,sigma)
xbar = mean(simul)
sech = sd(simul)
vec[i] = sqrt(n) * (xbar - mu) / sech
}
par(mfrow = c(2, 1))
hist(vec, prob = TRUE,
breaks = seq(-1000.25, 1000.25, by = 0.5), xlim = c(-5, 5), ylim = c(0, 0.5),
main = "Histogramme de vec")
curve(dnorm(x), -5, 5, add = TRUE)
curve(dt(x, n - 1), -5, 5, col = "red", add = TRUE)
legend("topleft",
legend = c("N(0,1)", paste("T(", n - 1, ")", sep = "")), col = c("black", "red"),
lwd = 1)
plot(ecdf(vec), xlim = c(-5, 5))
curve(pnorm(x), -5, 5, col = "green", lwd = 2, add = TRUE)
curve(pt(x, n-1), -5, 5, col = "red", lwd = 2, add = TRUE)
legend("topleft", legend = c("F_N(0,1)", paste("F_T(", n - 1, ")", sep = "")),
col = c("green", "red"), lwd = 1)
par(mfrow = c(1,1))
}
stu(3, 1000, 10, 2)
```

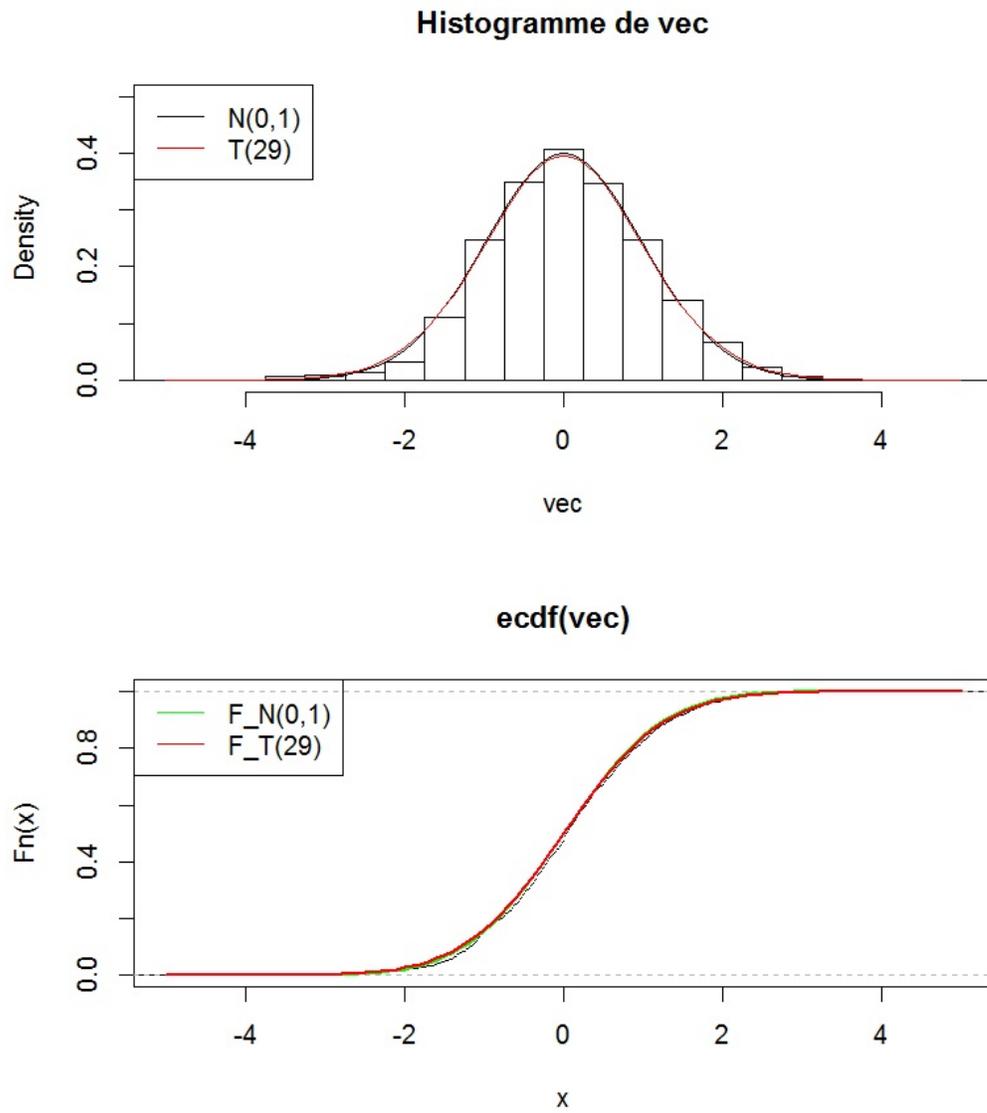
Cela renvoie :



Puis :

```
stu(30, 1000, 10, 2)
```

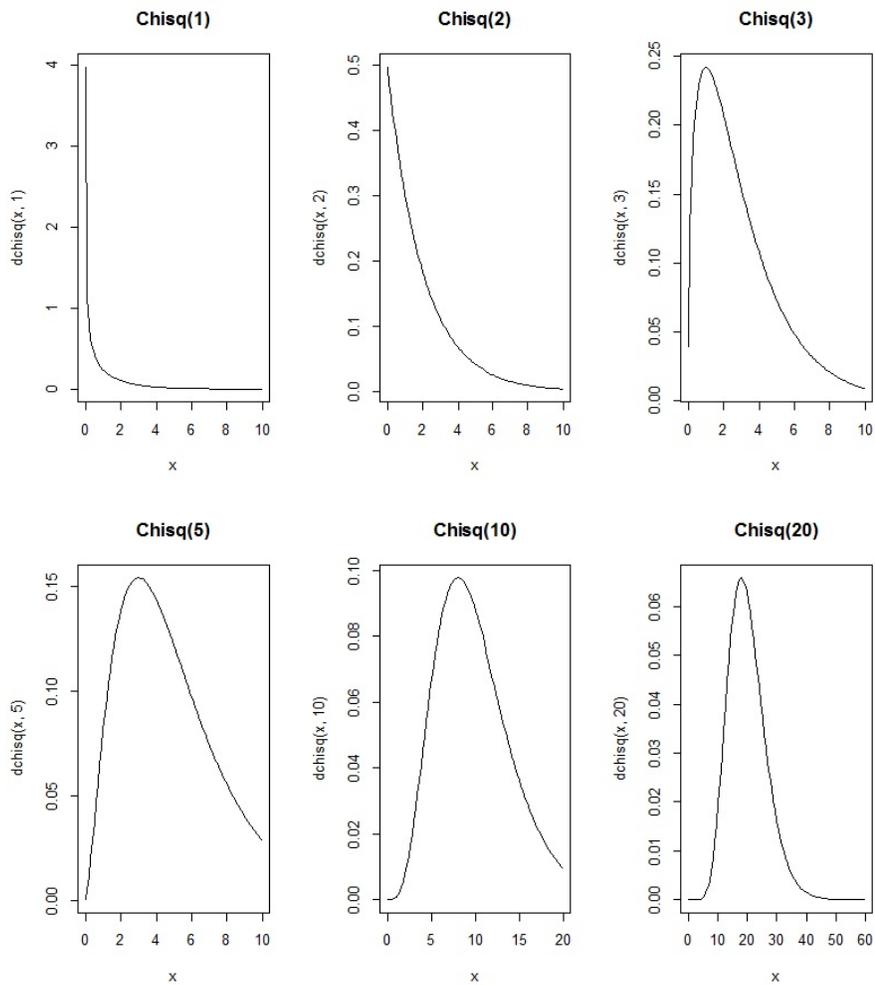
Cela renvoie :



Solution 16. On considère les commandes :

```
par(mfrow = c(2, 3))
curve(dchisq(x, 1), 0.01, 10, main = "Chisq(1)")
curve(dchisq(x, 2), 0.01, 10, main = "Chisq(2)")
curve(dchisq(x, 3), 0.01, 10, main = "Chisq(3)")
curve(dchisq(x, 5), 0.01, 10, main = "Chisq(5)")
curve(dchisq(x, 10), 0.01, 20, main = "Chisq(10)")
curve(dchisq(x, 20), 0.01, 60, main = "Chisq(20)")
par(mfrow = c(1, 1))
```

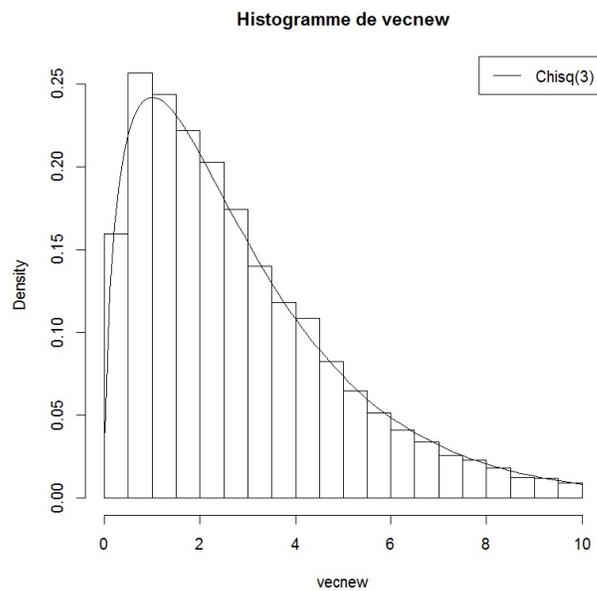
Cela renvoie :



Solution 17. On fait :

```
khi2 = function(n, nb, mu, sigma) {  
  vec = numeric(nb)  
  for (i in 1:nb) {  
    simul = rnorm(n, mu, sigma)  
    sech2 = var(simul)  
    vec[i] = (n-1) * sech2 / sigma^2  
  }  
  vecnew = vec[vec >= 0.01 & vec <= 10]  
  hist(vecnew, prob = TRUE, main = "Histogramme de vecnew")  
  curve(dchisq(x, n-1), 0.01, 10, add = TRUE)  
  legend("topright", legend = paste("Chisq(",n-1,")", sep = ""), col = "black",  
  lwd = 1)  
}  
par(mfrow = c(1, 1))  
khi2(4, 10000, 10, 2)
```

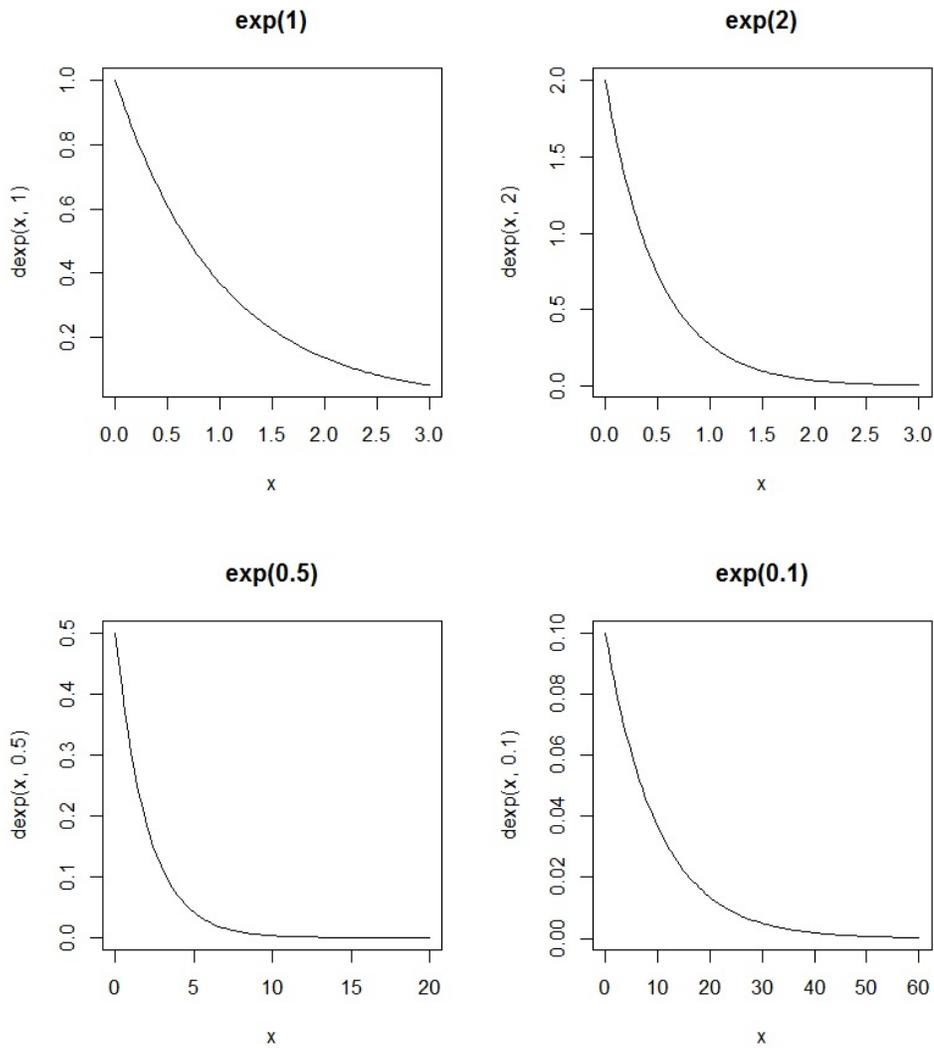
Cela renvoie :



Solution 18. On fait :

```
par(mfrow = c(2, 2))
curve(dexp(x, 1), 0, 3, main = "exp(1)")
curve(dexp(x, 2), 0, 3, main = "exp(2)")
curve(dexp(x, 0.5), 0,20, main = "exp(0.5)")
curve(dexp(x, 0.1), 0,60, main = "exp(0.1)")
par(mfrow=c(1, 1))
```

Cela renvoie :



Solution 19. On considère les commandes :

```
curve(dnorm(x, 0, 1), xlim = c(-10, 10), ylim = c(0, 0.58), col = "red", lwd = 3,
ylab = "", main = "Exemples de densités associées à la loi normale")
curve(dnorm(x, 2, 3), col = "green", lwd = 3, add = TRUE)
curve(dnorm(x, 0, 5), col = "blue", lwd = 3, add = TRUE)
curve(dnorm(x, -2, 0.7), col = "yellow", lwd = 3, add = TRUE)
legend("topright", legend = c("N(0,1)", "N(2,9)", "N(0,25)", "N(-2,0.49)"),
lty = 1, lwd = 3, col = c("red", "green", "blue", "yellow"))
```

Solution 20. On considère les commandes :

```
curve(dexp(x, 0.5), xlim = c(0, 3), ylim = c(0, 1), col = "red", lwd = 3,
ylab = "", main = "Exemples de densités associées à la loi exponentielle")
curve(dexp(x, 1), col = "green", lwd = 3, add = TRUE)
curve(dexp(x, 1.5), col = "blue", lwd = 3, add = TRUE)
curve(dexp(x, 2), col = "yellow", lwd = 3, add = TRUE)
legend("topright", legend = c("E(0.5)", "E(1)", "E(1.5)", "E(2)"),
lty = 1, lwd = 3, col = c("red", "green", "blue", "yellow"))
```

Solution 21.

1. On fait :

```
densexp = function(x, lambda) {
  ifelse (x >= 0, lambda * exp(-lambda * x), 0)
}
```

2. On fait :

```
integrate(function(x) dexp(x, 1 / 10), 0, 100)
```

Cela renvoie : 0.9999546 with absolute error < 2.8e-14

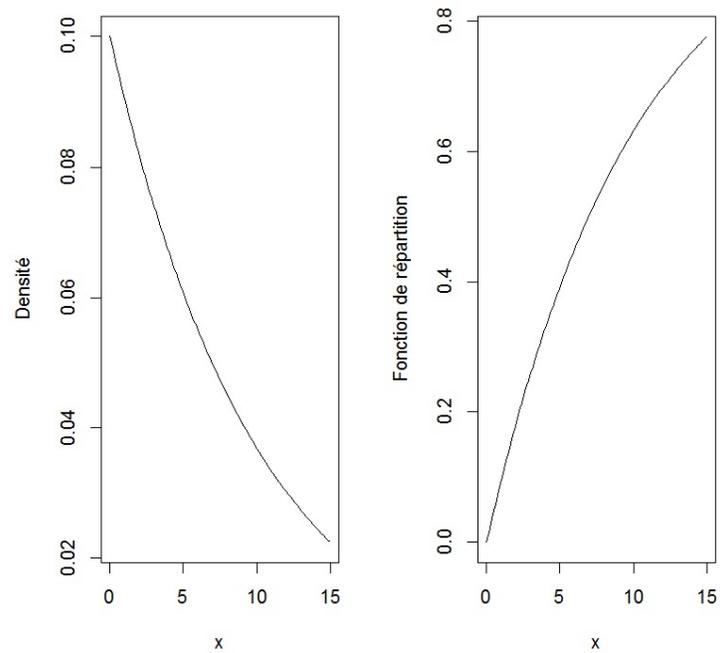
3. On considère les commandes :

```
par(mfrow = c(1, 2))
```

```
curve(dexp(x, 1 / 10), 0, 15, ylab = "Densité")
```

```
curve(pexp(x, 1 / 10), 0, 15, ylab = "Fonction de répartition")
```

Cela renvoie :



4. La probabilité que la durée de vie d'une voiture dépasse 10.2 ans est donnée par :

```
1 - pexp(10.2, 1 / 10)
```

Cela renvoie : [1] 0.3605949

Solution 22.

1. On fait :

```
densgamma = function(x, m, lambda) {  
  ifelse (x >= 0, (1/factorial(m - 1)) * lambda^m * x^(m - 1) *  
    exp(-lambda * x), 0)  
}
```

2. On fait :

```
integrate(function(x) dgamma(x, 5, 1), 0, 100)
```

Cela renvoie : 1 with absolute error < 2.7e-07

3. On considère les commandes :

```
x = 2:10
```

```
pgamma(x, 5, 1)
```

Cela renvoie :

```
[1] 0.05265302 0.18473676 0.37116306 0.55950671 0.71494350 0.82700839 0.90036760
```

```
[8] 0.94503636 0.97074731
```

Ces valeurs correspondent à $F_X(2), \dots, F_X(10)$ respectivement.

4. On fait :

```
qgamma(0.92, 5, 1)
```

Cela renvoie : [1] 8.376739

Solution 23.

1. On fait :

```
densnorm = function(x) {  
  (1 / sqrt(2 * pi)) * exp(-x^2 / 2)  
}
```

2. On fait :

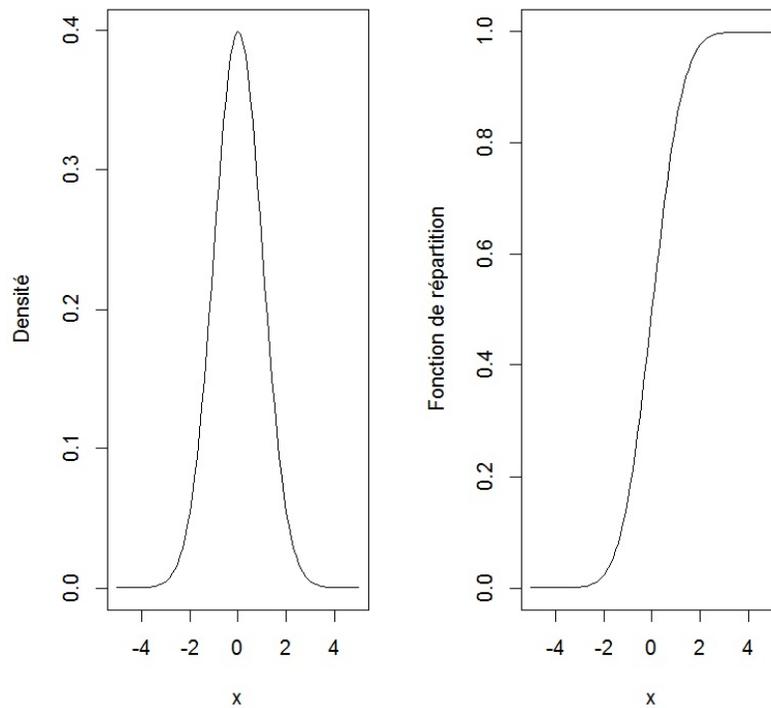
```
integrate(function(x) dnorm(x), -100, 100)
```

Cela renvoie : 1 with absolute error < 3.2e-07

3. On considère les commandes :

```
par(mfrow = c(1, 2))  
curve(dnorm(x), -5, 5, ylab = "Densité")  
curve(pnorm(x), -5, 5, ylab = "Fonction de répartition")
```

Cela renvoie :



4. – La probabilité $\mathbb{P}(X \leq 2.2)$ est donnée par :

```
pnorm(2.2)
```

Cela renvoie : [1] 0.9860966

– $\mathbb{P}(X \geq 1.7)$ est donnée par :

```
1 - pnorm(1.7)
```

(ou `pnorm(1.7, lower.tail = FALSE)`)

Cela renvoie : [1] 0.04456546

– La probabilité $\mathbb{P}(0.2 \leq X < 1.4)$ est donnée par :

```
pnorm(1.4) - pnorm(0.2)
```

Cela renvoie : [1] 0.3399836

– La probabilité $\mathbb{P}(|X| \leq 1.96) = 2\mathbb{P}(X \leq 1.96) - 1$ est donnée par :

```
2 * pnorm(1.96) - 1
```

Cela renvoie : [1] 0.9500042

5. On fait :

```
qnorm(0.98)
```

Cela renvoie : [1] 2.053749

Solution 24. La probabilité qu'un foie gras pèse

– moins de 650 grammes est donnée par :

```
pnorm(650, 550, 100)
```

Cela renvoie : [1] 0.8413447

– plus de 746 grammes est donnée par :

```
1 - pnorm(746, 550, 100)
```

(ou `pnorm(746, 550, 100, lower.tail = FALSE)`)

Cela renvoie : [1] 0.0249979

– entre 550 grammes et 600 grammes est donnée par :

```
pnorm(600, 550, 100) - pnorm(550, 550, 100)
```

Cela renvoie : [1] 0.1914625

Solution 25. On fait :

```
foncrep = function(x) {  
  n = 1 + 2 * 0:50  
  0.5 + (1 / sqrt(2 * pi)) * exp(-x^2 / 2) * sum(x^n / cumprod(n))  
}
```

Par exemple, on fait :

```
foncrep(1.2)
```

Cela renvoie : [1] 0.8849303

Cela correspond exactement au résultat de `pnorm(1.2)`.

Solution 26.

```
x = sample(c(0, 2, 5), 1000, replace = T, prob = c(0.2, 0.5, 0.3))  
table(x)
```

Solution 27. On considère les commandes :

```
Urne = function(k, p, q) {  
  contenu = rep(c("Rouge", "Noire"), c(p, q))  
  sample(contenu, k)  
}
```

Solution 28. On fait :

```
Freq = function(n) {  
  tirage = sample(1:6, n, replace = T)  
  sum(tirage == 5) / n  
}
```

On compare les fréquences pour $n \in \{10, 100, 1000\}$, avec la probabilité (théorique) d'obtenir un 5 lorsqu'on lance un dé :

```
Freq(10) renvoie (ici) : [1] 0.4
```

```
Freq(100) renvoie (ici) : [1] 0.22
```

```
Freq(1000) renvoie (ici) : [1] 0.165
```

On constate que cette dernière probabilité est proche de $1/6$, la probabilité théorique d'obtenir un 5 lorsqu'on lance un dé.

Solution 29.

1. On fait,

- pour E_1 : `sample(c(0, 1), 10, replace = T, prob = c(2 / 3, 1 / 3))`
- pour E_2 : `sample(c(rep(0, 10), rep(1, 5)), 10)`

2. (a) On fait,

- pour X :

```
x = numeric()
for(i in 1:500){
  x[i] = sum(sample(c(0, 1), 10, replace = T, prob = c(2 / 3, 1 / 3)))
}
```
- pour Y :

```
y = numeric()
for(i in 1:500){
  y[i] = sum(sample(c(rep(0, 10), rep(1, 5)), 10))
}
```

(b) On propose les commandes :

```
titre1 = "Fréquences obtenues pour 500 tirages avec remise"
titre2 = "B(10, 1/3)"
titre3 = "Fréquences obtenues pour 500 tirages sans remise"
titre4 = "H(10, 5, 10)"
par(mfrow = c(2, 2))
barplot(table(x) / 500, main = titre1)
barplot(dbinom(0:10, 10, 1/3), names.arg = 0:10, main = titre2)
barplot(table(y) / 500, main = titre3)
barplot(dhyper(0:5, 5, 10, 10), names.arg = 0:5, main = titre4)
```

Solution 30. On considère les commandes :

```
n = 10000
u = sample(c(-1,1), n, replace = T)
x = cumsum(u)
x = c(0, x)
```

Solution 31. On fait :

```
n = 0
x = rep(0, 5)
while(sum(x != 6) != 0) {
  x[x != 6] = sample(1:6, sum(x != 6), rep = T)
  print(x)
  n = n + 1
}
print(n)
```