

COUPLES DE VARIABLES ALÉATOIRES

À SAVOIR

- Couple de deux variables aléatoires
- Loi conjointe et lois marginales. Obtention des lois marginales par la loi conjointe.
- Loi de la somme.
- Espérance, formule de transfert.
- Covariance, symétrie, lien avec la variance. Variance d'une somme.
- Indépendance de deux variables aléatoires,
 - Espérance de deux variables aléatoires indépendantes.
 - Covariance de variables indépendantes.
 - Passage de l'indépendance à l'image.
- Indépendance mutuelle :
 - Lemme des coalitions.
 - Variance d'une somme de variables aléatoires indépendantes.
 - Interprétation de la loi de Bernoulli.

PREUVES ET EXERCICES À SAVOIR REFAIRE A MINIMA

- Loi du minimum.
- Loi du maximum.
- Loi faible des grands nombres.