

La loi normale

1 Du discret au continu

Lorsqu'on étudie la loi binomiale sur un grand nombre d'expériences ($n > 50$ par exemple) à condition que la probabilité de succès sur une expérience ne soit pas trop petite ($p > 0,1$), on peut approximer cette loi binomiale par une loi normale dont la représentation est une courbe en cloche ou courbe de Gauss. On passe ainsi d'une distribution discrète à une distribution continue beaucoup plus souple.

Cette loi normale intervient dans de nombreuses distributions statistiques, lorsqu'un critère d'un individu - par exemple la taille d'une femme adulte - dépend d'un grand nombre de facteurs ou paramètres. La répartition de la taille d'une femme adulte dans une population suit alors une loi normale (Théorème central limit)

2 La loi normale centrée réduite

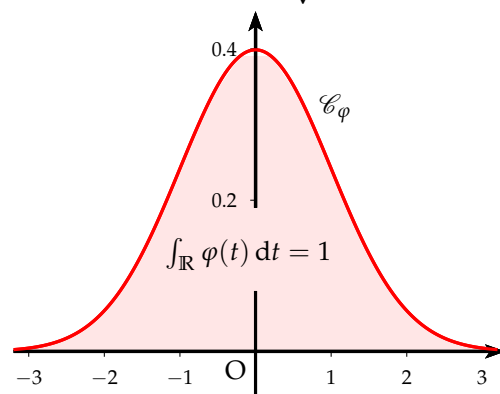
La densité de probabilité de Laplace-Gauss

Définition : On appelle densité de probabilité de Laplace-Gauss, la fonction φ définie sur \mathbb{R} par :

$$\varphi(t) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{t^2}{2}}$$

Remarque : Cette fonction φ correspond bien à une densité de probabilité :

- φ est bien continue et positive sur \mathbb{R} (composée de fonctions continues et la fonction exponentielle est positive sur \mathbb{R}).
- Cette fonction est paire et admet en 0 un maximum : $\varphi(0) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \simeq 0,4$
- Son intégrale sur \mathbb{R} est égale à 1. Sa démonstration est admise. Il faut cependant savoir qu'il n'existe pas de primitive s'exprimant avec des fonctions élémentaires pour cette fonction et que le calcul de l'aire sous la courbe demande des méthodes plus ou moins détournées tel un changement de variable.
- La courbe \mathcal{C}_φ est appelée **courbe en cloche** ou **courbe de Gauss**.



Comme la fonction φ est paire, on a alors :

$$\lim_{a \rightarrow +\infty} \int_{-a}^0 \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{t^2}{2}} dt = \lim_{a \rightarrow +\infty} \int_0^a \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{t^2}{2}} dt = \frac{1}{2}$$

Loi normale centrée réduite

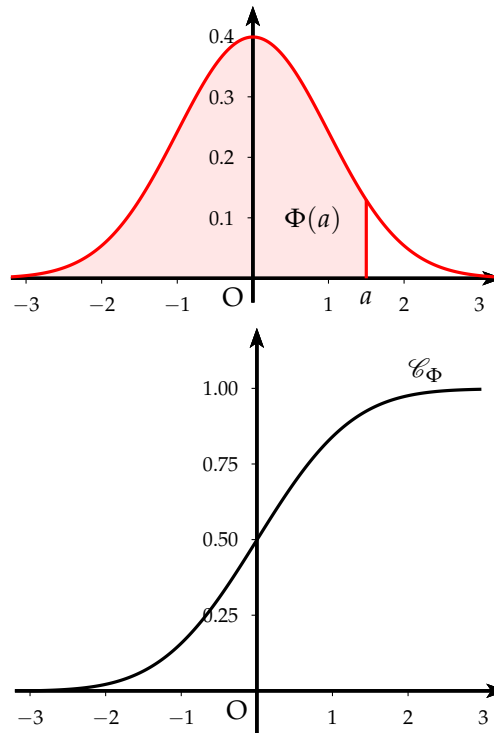
Définition : On dit que la variable aléatoire X suit une loi normale centrée réduite, notée $\mathcal{N}(0, 1)$ si sa densité de probabilité est égale à la fonction φ .

Sa fonction de répartition Φ est donc définie par :

$$\Phi(x) = \int_{-\infty}^x \varphi(t) dt$$

Remarque :

- Le nombre $\Phi(a)$ représente l'aire du domaine délimité par cette courbe en cloche l'axe des abscisses et la droite $x = a$.
- La fonction Φ peut être considérée comme la primitive de la fonction φ qui vérifie $\Phi(0) = 0,5$.
- Avant l'arrivée des calculatrices, on avait des tables donnant les valeurs de $\Phi(a)$ pour les valeurs de a positives.
Avec la calculatrice TI, pour calculer $\Phi(1,24)$ on tape "**distrib**" puis on sélectionne "**normalFRép**(-1 E 99, 1.24)". On trouve alors 0,892 5 (voir notice page 290)



F Calcul de probabilités

Théorème : Si une variable aléatoire X suit une loi normale centrée réduite alors pour tous réels a et b tels que $a \leq b$, on a :

$$P(a \leq X \leq b) = \Phi(b) - \Phi(a)$$

$$P(X \geq a) = 1 - \Phi(a)$$

$$P(X \leq -|a|) = 1 - \Phi(|a|)$$

Démonstration : La première égalité est liée à la relation de Chasles pour l'intégrale (soustraction des aires sous la courbe)

La deuxième égalité est liée à l'événement contraire : $P(X \geq a) = 1 - P(X \leq a)$

Enfin la troisième égalité est liée à la parité de la fonction φ . L'aire sous la courbe de la partie gauche est égale à l'aire sous la courbe de la partie droite.

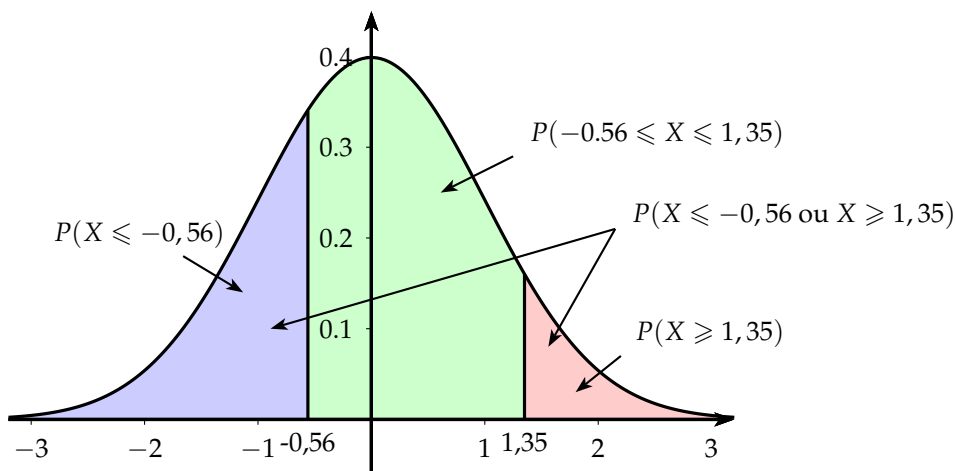
Exemples : Une variable aléatoire X suit une loi normale centrée réduite. A l'aide d'une table des valeurs de Φ , déterminer les probabilités suivantes :

- a) $P(X \geq 1,35)$
- b) $P(X \leq -0,56)$
- c) $P(-0,56 \leq X \leq 1,35)$
- d) $P(X \leq -0,56 \text{ ou } X \geq 1,35)$

////////////////////

On repère sur la table les valeurs : $\Phi(0,56) \simeq 0,7123$ et $\Phi(1,35) \simeq 0,9115$

- a) $P(X \geq 1,35) = 1 - P(X \leq 1,35) = 1 - \Phi(1,35) = 1 - 0,9115 = 0,0885$
- b) $P(X \leq -0,56) = \Phi(-0,56) = 1 - \Phi(0,56) = 1 - 0,7123 = 0,2877$
- c) $P(-0,56 \leq X \leq 1,35) = \Phi(1,35) - \Phi(-0,56) = 0,9115 - 0,2877 = 0,6238$
- d) $P(X \leq -0,56 \text{ ou } X \geq 1,35) = P(X \leq -0,56) + P(X \geq 1,35)$
 $P(X \leq -0,56 \text{ ou } X \geq 1,35) = 0,2877 + 0,0885 = 0,3762$



Remarque : Certaines valeurs interviennent souvent, il est bon de les mémoriser.

$P(-1 \leq X \leq 1) = 0,683$
$P(-2 \leq X \leq 2) = 0,954$
$P(-3 \leq X \leq 3) = 0,997$

Espérance et variance

Théorème : Si une variable aléatoire X suit une loi normale centrée réduite alors son espérance est nulle et sa variance est égale à 1

Remarque : C'est pour cette raison que cette loi normale est centrée ($E(X) = 0$) et réduite ($V(X) = 1$)

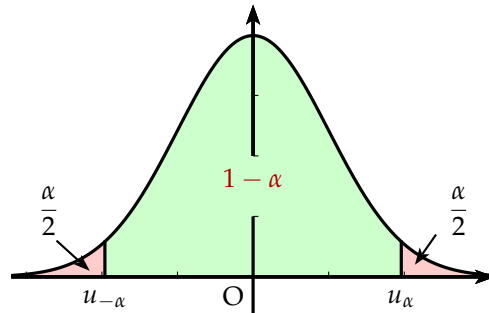
Probabilité d'intervalle centré en 0

Théorème : X est une variable aléatoire qui suit une loi normale centrée réduite. Soit α un réel de l'intervalle $]0;1[$. Il existe un **unique** réel **strictement positif** u_α tel que :

$$P(-u_\alpha \leq X \leq u_\alpha) = 1 - \alpha$$

Démonstration : On cherche un réel x strictement positif tel que :

$$\begin{aligned} P(-x \leq X \leq x) &= 1 - \alpha \\ \Phi(x) - \Phi(-x) &= 1 - \alpha \\ \Phi(x) - 1 + \Phi(x) &= 1 - \alpha \\ 2\Phi(x) - 1 &= 1 - \alpha \\ \Phi(x) &= 1 - \frac{\alpha}{2} \end{aligned}$$



On sait que la fonction Φ est continue et strictement croissante sur $]0; +\infty[$. De plus :

$$\lim_{x \rightarrow 0} \Phi(x) = \Phi(0) = \frac{1}{2} \quad \text{et} \quad \lim_{x \rightarrow +\infty} \Phi(x) = 1$$

$$\text{et } 0 < \alpha < 1 \quad \Leftrightarrow \quad \frac{1}{2} < 1 - \frac{\alpha}{2} < 1$$

donc d'après le théorème des valeurs intermédiaires, il existe un unique $x = u_\alpha$ strictement positif tel que $\Phi(u_\alpha) = 1 - \frac{\alpha}{2}$

Remarque : Il est bon de retenir les valeurs de $u_{0,05}$ et $u_{0,01}$, On obtient ainsi :

$$\begin{aligned} P(-1.96 \leq X \leq 1.96) &= 0,95 \\ P(-2.58 \leq X \leq 2.58) &= 0,99 \end{aligned}$$

Exemple : X est une variable aléatoire qui suit une loi normale centrée réduite. Déterminer l'intervalle I centré en 0 tel que $P(X \in I) = 0,8$. On donnera les bornes de l'intervalle avec une précision de 10^{-2} .

////////////////////

$$\text{On a donc : } 1 - \alpha = 0,8 \quad \Leftrightarrow \quad \alpha = 0,2$$

$$\text{On doit donc avoir : } \Phi(u_\alpha) = 1 - \frac{\alpha}{2} = 0,9 \quad \Leftrightarrow \quad u_\alpha = \Phi^{-1}(0,9).$$

A l'aide de la calculatrice avec la fonction "**FracNorm(0.9)**" ou à l'aide d'une table, on trouve :

$$u_\alpha \simeq 1,28 \quad \text{donc} \quad I = [-1,28; 1,28]$$

3 Loi normale générale

Loi normale d'espérance μ et d'écart type σ

Définition : Si une variable aléatoire X suit une loi normale de paramètres μ et σ notée $\mathcal{N}(\mu, \sigma^2)$, alors la variable aléatoire $Z = \frac{X - \mu}{\sigma}$ suit une loi normale centrée réduite $\mathcal{N}(0, 1)$ et réciproquement.

Propriété : Si une variable aléatoire X suit une loi normale $\mathcal{N}(\mu, \sigma^2)$ alors son espérance vaut μ et sa variance vaut σ^2 .

Démonstration : De la linéarité de l'espérance, on en déduit :

$$E(Z) = \frac{E(X) - \mu}{\sigma} = 0 \quad \text{comme} \quad E(Z) = 0 \quad \text{alors} \quad E(X) = \mu$$

De plus, comme $V(aX) = a^2V(X)$, on a :

$$V(Z) = \frac{1}{\sigma^2}V(X) \quad \text{comme} \quad V(Z) = 1 \quad \text{alors} \quad V(X) = \sigma^2$$

Exemple : Les températures de l'eau du mois de juillet, autour du lac Léman, suivent la loi normale d'espérance $18,2^\circ\text{C}$ et d'écart-type $3,6^\circ\text{C}$.

Une personne part camper en juillet sur le pourtour du lac Léman. Que peut-on lui indiquer comme probabilité de température de l'eau des plages dans les cas suivants :

- températures inférieures à 16°C
- températures comprises entre 20°C et $24,5^\circ\text{C}$
- températures supérieures à 21°C .

////////////////////

On appelle T la variable aléatoire associée aux températures et Z la variable aléatoire associée à la loi normale centrée réduite.

Il y a deux façons d'obtenir les résultats, soit on utilise une table et alors on doit revenir à la loi normale centrée réduite, soit on utilise la calculatrice et alors on peut utiliser la loi normale de l'énoncé.

- On veut calculer : $P(T \leq 16)$

Avec la calculatrice, on tape :

"**normalFRép**(-1 E 99, 16, 18.2, 3.6)", on trouve alors : 0,271

Avec une table, on revient à la variable X , on a alors :

$$T \leq 16 \quad \Leftrightarrow \quad Z \leq \frac{16 - 18,2}{3,6} \quad \Leftrightarrow \quad Z \leq -0,611$$

On a alors : $\Phi(-0,611) = 1 - \Phi(0,611) = 1 - 0,729 = 0,271$

b) On veut calculer : $P(20 \leq T \leq 24,5)$

Avec la calculatrice, on tape :

"**normalFRép**(20,24.5,18.2,3.6)", on trouve alors : 0,268

Avec une table, on revient à la variable X , on a alors :

$$20 \leq T \leq 24,5 \Leftrightarrow \frac{20 - 18,2}{3,6} \leq Z \leq \frac{24,5 - 18,2}{3,6} \Leftrightarrow 0,5 \leq Z \leq 1,75$$

On a alors : $\Phi(1,75) - \Phi(0,5) = 0,960 - 0,692 = 0,268$

c) On veut calculer : $P(T \geq 21)$

Avec la calculatrice, on tape :

"**normalFRép**(21,1E99,18.2,3.6)", on trouve alors : 0,218

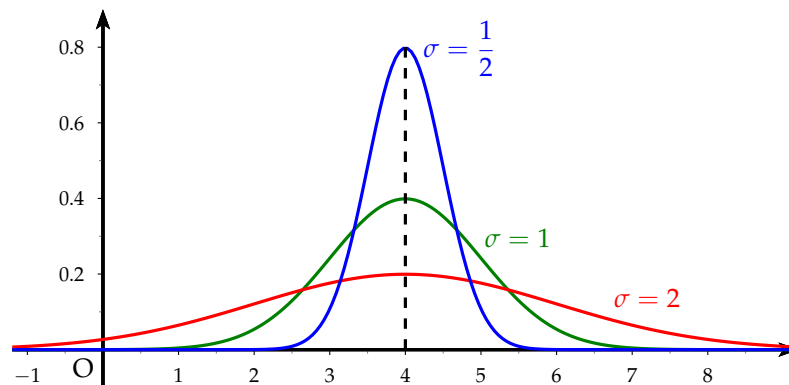
Avec une table, on revient à la variable X , on a alors :

$$T \geq 21 \Leftrightarrow Z \geq \frac{21 - 18,2}{3,6} \Leftrightarrow Z \geq 0,78$$

On a alors : $1 - \Phi(0,78) = 1 - 0,782 = 0,218$

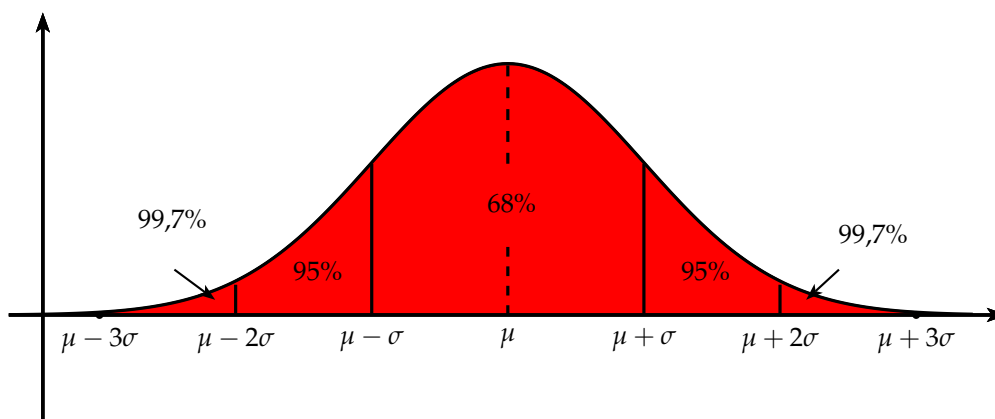
Influence de l'écart type

Voici ci-dessous les courbes des densités correspondantes à une espérance de 4 et aux écarts types respectifs de : $\frac{1}{2}$, 1 et 2.



On constate que plus l'écart type est important, plus la courbe de densité est évasée et plus le maximum est petit. En effet un écart type important signifie que la dispersion des données est importante.

Ces différentes courbes peuvent être repérées par 3 intervalles caractéristiques : $[\mu - \sigma, \mu + \sigma]$, $[\mu - 2\sigma, \mu + 2\sigma]$ et $[\mu - 3\sigma, \mu + 3\sigma]$



On a alors :

- $P(\mu - \sigma \leq X \leq \mu + \sigma) = 0,68$
- $P(\mu - 2\sigma \leq X \leq \mu + 2\sigma) = 0,95$
- $P(\mu - 3\sigma \leq X \leq \mu + 3\sigma) = 0,997$

2.3.3 Approximation normale d'une loi binomiale

Théorème : Théorème de Moivre-Laplace

X est une variable aléatoire qui suit la loi binomiale $\mathcal{B}(n, p)$ et Z la variable aléatoire telle que : $Z = \frac{X - E(X)}{\sigma(X)} = \frac{X - np}{\sqrt{np(1-p)}}$.

Pour tous nombres a et b tels que $a < b$, on a :

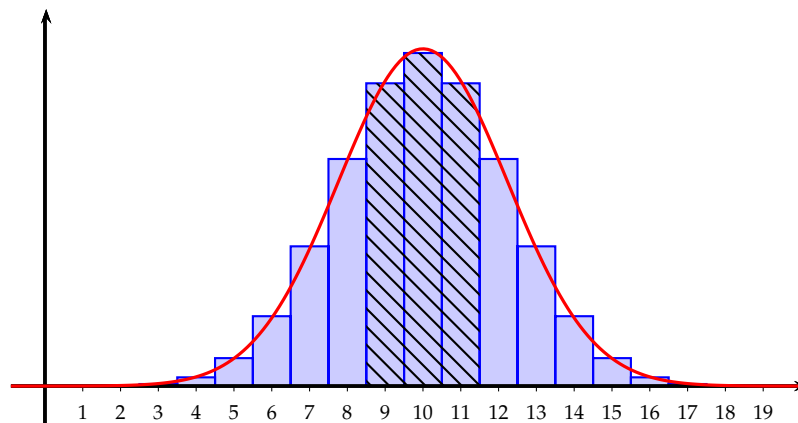
$$\lim_{n \rightarrow +\infty} P(a \leq Z \leq b) = \int_a^b \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{t^2}{2}} dt$$

Remarque : Pour les grandes valeurs de n la loi binomiale $\mathcal{B}(n, p)$ est proche de la loi normale $\mathcal{N}(np, np(1-p))$

En pratique, on pourra faire l'approximation d'une loi binomiale par une loi normale lorsque l'on aura les conditions suivantes :

$$n \geq 30, \quad np \geq 5 \quad \text{et} \quad n(1-p) \geq 5$$

Dans l'exemple ci-dessous, on a tracé $\mathcal{B}(20; 0,5)$ et la densité de la loi normale correspondante ($\mu = 20 \times 0,5 = 10$ et $\sigma = \sqrt{20 \times 0,5^2} = \sqrt{5}$). Les deux dernières conditions sont respectées ($np = 10$ et $n(1-p) = 10$)



Calculons $P(9 \leq X \leq 11)$ avec la loi binomiale $\mathcal{B}(20; 0,5)$ puis avec la loi normale $\mathcal{N}(10,5)$.

- Avec la loi binomiale. Sur la calculatrice "**binomFdp(20;0.5,{9,10,11})**"

$$P(9 \leq X \leq 11) \simeq 0,4966$$

- Avec la loi normale. Comme on remplace un diagramme en bâton par un histogramme, il faut intégrer trois rectangles centrés en 9, 10 et 11. donc il faut calculer $8,5 \leq X \leq 11,5$. C'est ce qu'on appelle la **correction de continuité**. Avec la calculatrice : "**NormalFRép(8.5,11.5,10,√5)**"

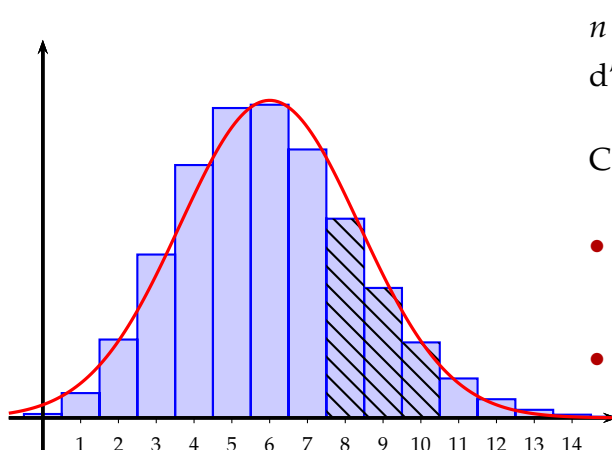
$$P(8,5 \leq X \leq 11,5) \simeq 0,4977$$

L'erreur est donc de 0,1%

Il se peut par contre que n soit grand et cependant p trop petit pour qu'on soit dans les conditions de l'approximation normale. Cela se produit par exemple lorsque l'on considère le nombre d'accidents provoqués par un vaccin, le nombre de suicides dans une grande ville, pour une période donnée.

Dans le cas des petites valeurs de p c'est à dire pour $p < 0,1$, l'approximation de la loi binomiale ne pourra pas se faire avec une loi normale

Dans l'exemple ci-dessous, on a :



$$n = 100 \quad \text{et} \quad p = 0,06$$

$$\text{d'où } E(X) = 6 \quad \text{et} \quad \sigma(X) = \sqrt{5,56}.$$

Calculons alors $P(8 \leq X \leq 10)$.

- Avec la loi binomiale
 $P(8 \leq X \leq 10) \simeq 0,2140$

- Avec la loi normale
 $P(7,5 \leq X \leq 10,5) \simeq 0,2342$

L'erreur est alors de 2%

Exemple : On lance 180 fois un dé à jouer et on note X la variable aléatoire qui représente le nombre d'apparition du 6. En utilisant l'approximation normale calculer au millième les probabilités suivantes :

- a) $P(X \leq 20)$ b) $P(X > 40)$ c) $P(X \leq 20 \text{ ou } X > 40)$

//////////

Il faut d'abord calculer les paramètres de la loi normale correspondante à cette loi binomiale $\mathcal{B}(180, 1/6)$

$$E(X) = np = 180 \times \frac{1}{6} = 30 \quad \text{et} \quad \sigma(X) = \sqrt{180 \times \frac{1}{6} \times \frac{5}{6}} = 5$$

Il faut vérifier qu'on se trouve dans les hypothèses de l'approximation :
 $np = 30 \geq 5$ et $n(1 - p) = 150 \geq 5$

A l'aide d'une calculatrice, on trouve alors :

a) $P(X \leq 20) = P_N(X \leq 20, 5) = \text{NormalFRép}(-1,99, 20,5, 30,5) \simeq 0,029$

b) $P(X > 40) = P_N(X \geq 40, 5) = \text{NormalFRép}(40,5, 1,99, 30,5) \simeq 0,018$

c) $P(X \leq 20 \text{ ou } X > 40) = P_N(X \leq 20,5) + P_N(X > 40,5) \simeq 0,047$

Si on utilise une table, il faut changer de variable : $Z = \frac{X - 30}{5}$.

a) $P(X \leq 20) = P_N(X \leq 20, 5) = P_N\left(Z \leq \frac{20,5 - 30}{5}\right)$

$$P(X \leq 20) = P_N(Z \leq -1,9) = \Phi(-1,9) = 1 - \Phi(1,9) \simeq 0,029$$

b) $P(X > 40) = P_N(X \geq 40, 5) = P(Z \geq 2,1) \simeq 0,018$
