

# RFIDEC — cours 3 : Intervalles de confiance, tests d'hypothèses, loi du $\chi^2$

Christophe Gonzales

LIP6 – Université Paris 6, France

- 1 Intervalles de confiance
- 2 Tests d'hypothèses
- 3 La loi du  $\chi^2$

## Intervalles de confiance

Estimateur  $T$  d'un paramètre  $\theta \implies$  valeur estimée  $\hat{\theta}$

Problème : peut-on avoir confiance dans l'estimation ponctuelle ?

### Intervalle de confiance

Un **intervalle de confiance** de niveau  $1 - \alpha =$  intervalle  $]a(T), b(T)[$  tel que :

$$\forall \theta \in \Theta, P_{\theta}(]a(T), b(T)[ \ni \theta) = 1 - \alpha$$



$1 - \alpha =$  proba que l'intervalle contienne  $\theta$

## Intervalles de confiance : exemple (1/2)

$$X \sim \mathcal{N}(\mu; \sigma^2)$$

échantillon de taille  $n \implies \bar{X} =$  moyenne

théorème central-limite  $\implies \frac{\bar{X} - \mu}{\sigma/\sqrt{n}} \sim \mathcal{N}(0; 1)$

$$\begin{cases} n \text{ très grand} \implies \text{la valeur observée } \bar{x} \text{ de } \bar{X} \approx \mu \\ n \text{ moins grand} \implies \bar{x} \not\approx \mu \end{cases}$$

$\implies$  estimation par intervalle de confiance de niveau 95%

$$\text{loi normale} \implies P\left(-1,96 \leq \frac{\bar{X} - \mu}{\sigma/\sqrt{n}} \leq 1,96\right) = 95\%$$

## Intervalle de confiance : exemple (2/2)

$$P\left(-1,96 \leq \frac{\bar{X} - \mu}{\sigma/\sqrt{n}} \leq 1,96\right) = 95\%$$

$$P\left(\bar{X} - 1,96 \frac{\sigma}{\sqrt{n}} \leq \mu \leq \bar{X} + 1,96 \frac{\sigma}{\sqrt{n}}\right) = 95\%$$

⇒ intervalle de confiance =  $\left] \bar{x} - 1,96 \frac{\sigma}{\sqrt{n}}, \bar{x} + 1,96 \frac{\sigma}{\sqrt{n}} \right[$

⚠ seulement maintenant, on tire un échantillon de taille  $n$

⇒ observation de  $\bar{x}$

⇒ on peut calculer  $\left] \bar{x} - 1,96 \frac{\sigma}{\sqrt{n}}, \bar{x} + 1,96 \frac{\sigma}{\sqrt{n}} \right[$

## Intervalle de confiance : autre exemple (1/2)

### Énoncé de l'exemple

- plusieurs centaines de candidats à un examen
- variance sur les notes obtenues  $\approx 16$
- correcteur  $\Rightarrow$  noté 100 copies, moyenne = 8,75
- Problème : moyenne sur toutes les copies de l'examen ?
- hypothèse : les notes suivent une loi normale  $\mathcal{N}(\mu; 16)$

$\bar{X}$  = variable aléatoire « moyenne des notes d'un correcteur »

théorème central-limite  $\Rightarrow \frac{\bar{X} - \mu}{\sigma/\sqrt{n}} = \frac{\bar{X} - \mu}{4/10} \sim \mathcal{N}(0; 1)$

chercher dans la table de la loi normale  $z_{\alpha/2}$  tel que :

$$P\left(\bar{X} - z_{\alpha/2} \frac{\sigma}{\sqrt{n}} \leq \mu \leq \bar{X} + z_{\alpha/2} \frac{\sigma}{\sqrt{n}}\right) = 1 - \alpha$$

## Intervalle de confiance : autre exemple (2/2)

$$P\left(\bar{X} - z_{\alpha/2} \frac{\sigma}{\sqrt{n}} \leq \mu \leq \bar{X} + z_{\alpha/2} \frac{\sigma}{\sqrt{n}}\right) = 1 - \alpha$$

$1 - \alpha$	intervalle de confiance
50%	$[8,75 - 0,674 \times 0,4; 8,75 + 0,674 \times 0,4] = [8,48; 9,02]$
75%	$[8,75 - 1,15 \times 0,4; 8,75 + 1,15 \times 0,4] = [8,29; 9,21]$
80%	$[8,75 - 1,28 \times 0,4; 8,75 + 1,28 \times 0,4] = [8,24; 9,26]$
90%	$[8,75 - 1,645 \times 0,4; 8,75 + 1,645 \times 0,4] = [8,09; 9,41]$
95%	$[8,75 - 1,96 \times 0,4; 8,75 + 1,96 \times 0,4] = [7,96; 9,53]$
99%	$[8,75 - 2,575 \times 0,4; 8,75 + 2,575 \times 0,4] = [7,72; 9,78]$

## Exemple : analyse des déchets (cf. cours 2)

- Grenelle de l'environnement
  - ⇒ réduction des déchets
  - ⇒ analyse des déchets
  - ⇒ échantillon de taille 100



- $\bar{x}$  : moyenne de l'échantillon = 390 kg/an/habitant
- écart-type  $\sigma = 20$  supposé connu
- $\bar{X} \sim \mathcal{N}(\mu, 4)$

$$\Rightarrow P\left(-z_{\alpha/2} \leq \frac{\bar{X} - \mu}{2} \leq z_{\alpha/2}\right) = 1 - \alpha$$

⇒ estimation par intervalle de confiance de niveau  $1 - \alpha$  :

$$\left] \bar{x} - 2z_{\alpha/2}, \bar{x} + 2z_{\alpha/2} \right[$$

## Exemple : analyse des déchets (suite)

Estimation par intervalle de confiance de niveau  $1 - \alpha$  :

$$\left] \bar{x} - 2z_{\alpha/2}, \bar{x} + 2z_{\alpha/2} \right[$$

$1 - \alpha$	intervalle de confiance
50%	$[390 - 0,674 \times 2; 390 + 0,674 \times 2] = [388,65; 391,35]$
75%	$[390 - 1,15 \times 2; 390 + 1,15 \times 2] = [387,70; 392,30]$
80%	$[390 - 1,28 \times 2; 390 + 1,28 \times 2] = [387,44; 392,56]$
90%	$[390 - 1,645 \times 2; 390 + 1,645 \times 2] = [386,71; 393,29]$
95%	$[390 - 1,96 \times 2; 390 + 1,96 \times 2] = [386,08; 393,92]$
99%	$[390 - 2,575 \times 2; 390 + 2,575 \times 2] = [384,85; 395,15]$

## Exemple du réchauffement climatique (cf. cours 2)

- opinion des gens sur le réchauffement climatique
- 1000 personnes de 15 ans et + interrogées
- 790 pensent qu'il y a un changement climatique
- 210 ne le pensent pas
- $\bar{P}$  : proportion de succès moyenne de l'échantillon
- $p$  : proportion de personnes pensant qu'il y a dérèglement climatique dans la population française



$$\frac{\bar{P} - p}{\sqrt{\frac{p(1-p)}{n}}} \sim \mathcal{N}(0; 1)$$

⇒ estimation par intervalle de confiance de niveau  $1 - \alpha$  :

$$\left] \bar{p} - \sqrt{\frac{p(1-p)}{n}} z_{\alpha/2}; \bar{p} + \sqrt{\frac{p(1-p)}{n}} z_{\alpha/2} \right[ \approx \left] \bar{p} - \sqrt{\frac{\bar{p}(1-\bar{p})}{n}} z_{\alpha/2}; \bar{p} + \sqrt{\frac{\bar{p}(1-\bar{p})}{n}} z_{\alpha/2} \right[$$

## Tests d'hypothèses en statistique classique (1/2)

### Hypothèses

- $\Theta$  = ensemble des valeurs du paramètre  $\theta$
- $\Theta$  partitionné en  $\Theta_0$  et  $\Theta_1$
- hypothèses** = assertions  $H_0 = " \theta \in \Theta_0 "$  et  $H_1 = " \theta \in \Theta_1 "$
- $H_0$  = **hypothèse nulle**,  $H_1$  = **contre-hypothèse**
- hypothèse  $H_i$  est **simple** si  $\Theta_i$  est un singleton ; sinon elle est **multiple**
- test **unilatéral** = valeurs dans  $\Theta_1$  toutes soit plus grandes, soit plus petites, que celles dans  $\Theta_0$  ; sinon test **bilatéral**

## Tests d'hypothèses en statistique classique (2/2)

	hypothèse	test
$H_0 : \mu = 4$	simple	unilatéral
$H_1 : \mu = 6$	simple	
$H_0 : \mu = 4$	simple	test unilatéral
$H_1 : \mu > 4$	composée	
$H_0 : \mu = 4$	simple	test bilatéral
$H_1 : \mu \neq 4$	composée	
$H_0 : \mu = 4$	simple	formulation incorrecte : les hypothèses ne sont pas mutuellement exclusives
$H_1 : \mu > 3$	composée	

## Exemples pratiques d'hypothèses

- association de consommateurs
  - échantillon de 100 bouteilles de Bordeaux
  - **Pb** : la quantité de vin est-elle bien égale à 75cl ? 
- 
- paramètre  $\theta$  étudié =  $\mu = E(X)$
  - $X$  = quantité de vin dans les bouteilles
  - rôle de l'association  $\implies H_0 : \mu = 75\text{cl}$  et  $H_1 : \mu < 75\text{cl}$

- le mois dernier, taux de chômage = 10%
  - échantillon : 400 individus de la pop. active
  - **Pb** : le taux de chômage a-t-il été modifié ?
- 
- paramètre étudié =  $p = \%$  de chômeurs
  - $H_0 : p = 10\%$  et  $H_1 : p \neq 10\%$



## Tests d'hypothèse

### Définition du test

- test entre deux hypothèses  $H_0$  et  $H_1 =$  **règle de décision**  $\delta$
- règle fondée sur les observations
- ensemble des décisions possibles =  $\mathcal{D} = \{d_0, d_1\}$
- $d_0 =$  "accepter  $H_0$ "
- $d_1 =$  "accepter  $H_1$ " = "rejeter  $H_0$ "

### région critique

- échantillon  $\implies n$ -uplet  $(x_1, \dots, x_n)$  de valeurs (dans  $\mathbb{R}$ )
- $\delta =$  fonction  $\mathbb{R}^n \mapsto \mathcal{D}$
- **région critique** :  $W = \{n\text{-uplets } \mathbf{x} \in \mathbb{R}^n : \delta(\mathbf{x}) = d_1\}$
- région critique = **région de rejet**
- **région d'acceptation** =  $A = \{\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n : \delta(\mathbf{x}) = d_0\}$

## Régions critiques

Hypothèses	Règle de décision
$H_0 : \mu = \mu_0$ $H_1 : \mu > \mu_0$	« rejeter $H_0$ si $\bar{x} > c$ », où $c$ est un nombre plus grand que $\mu_0$
$H_0 : \mu = \mu_0$ $H_1 : \mu < \mu_0$	« rejeter $H_0$ si $\bar{x} < c$ », où $c$ est un nombre plus petit que $\mu_0$
$H_0 : \mu = \mu_0$ $H_1 : \mu \neq \mu_0$	« rejeter $H_0$ si $\bar{x} < c_1$ ou $c_2 < \bar{x}$ », où $c_1$ et $c_2$ sont des nombres respectivement plus petit et plus grand que $\mu_0$ , et également éloignés de celui-ci

**Problème** : erreurs dans les décisions prises

## Erreurs dans les décisions

Décision prise \ Réalité	$H_0$ est vraie	$H_1$ est vraie
	$H_0$ est rejetée	mauvaise décision : erreur de type I
$H_0$ n'est pas rejetée	bonne décision	mauvaise décision : erreur de type II

$\alpha =$  risque de première espèce  
 = probabilité de réaliser une erreur de type I  
 = probabilité de rejeter  $H_0$  sachant que  $H_0$  est vraie  
 =  $P(\text{rejeter } H_0 | H_0 \text{ est vraie})$ ,

$\beta =$  risque de deuxième espèce  
 = probabilité de réaliser une erreur de type II  
 = probabilité de rejeter  $H_1$  sachant que  $H_1$  est vraie  
 =  $P(\text{rejeter } H_1 | H_1 \text{ est vraie})$ .

## Exemple de calcul de $\alpha$ (1/2)

### Exemple

- échantillon de taille 25
- paramètre estimé :  $\mu$  d'une variable  $X \sim \mathcal{N}(\mu; 100)$
- hypothèses :  $H_0 : \mu = 10$     $H_1 : \mu > 10$

$$\text{Sous } H_0 : \frac{\bar{X} - \mu}{\sigma/\sqrt{n}} = \frac{\bar{X} - 10}{10/5} = \frac{\bar{X} - 10}{2} \sim \mathcal{N}(0; 1)$$

Sous  $H_0$  : peu probable que  $\bar{X}$  éloignée de plus de 2 écarts-types de  $\mu$  (4,56% de chance)

$\Rightarrow$  peu probable que  $\bar{X} < 6$  ou  $\bar{X} > 14$

$\Rightarrow$  région critique pourrait être « rejeter  $H_0$  si  $\bar{x} > 14$  »

## Exemple de calcul de $\alpha$ (2/2)

- échantillon de taille 25
- paramètre estimé :  $\mu$  d'une variable  $X \sim \mathcal{N}(\mu; 100)$
- hypothèses :  $H_0 : \mu = 10$     $H_1 : \mu > 10$
- région critique : « rejeter  $H_0$  si  $\bar{x} > 14$  »

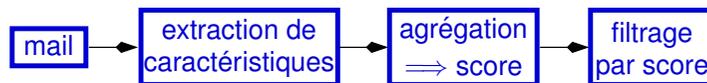
$$\begin{aligned}\alpha &= P(\text{rejeter } H_0 | H_0 \text{ est vraie}) \\ &= P(\bar{X} > 14 | \mu = 10) \\ &= P\left(\frac{\bar{X} - 10}{2} > \frac{14 - 10}{2} \mid \mu = 10\right) \\ &= P\left(\frac{\bar{X} - 10}{2} > 2\right) = 0,0228\end{aligned}$$



en principe  $\alpha$  est fixé et on cherche la région critique

## Exemple de test d'hypothèses (1/2)

- filtre de mails sur un serveur mail :



- $X = \text{score} \geq 18000 \Rightarrow$  spam ; historiques des mails  $\Rightarrow \sigma_X = 5000$
- le serveur reçoit un envoi en masse de  $n = 400$  mails de  $xx@yy.fr$
- **Problème** :  $xx@yy.fr$  est-il un spammeur ?
- $H_0 : xx@yy.fr =$  « spammeur » v.s.  $H_1 : xx@yy.fr \neq$  « spammeur »
- test :  $H_0 : \mu = 18000$  v.s.  $H_1 : \mu < 18000$  où  $\mu = E(X)$
- règle : si  $\bar{x} < c$  alors rejeter  $H_0$
- 400 mails  $\Rightarrow$  théorème central limite  $\Rightarrow$  sous  $H_0$  :

$$Z = \frac{\bar{X} - \mu}{\sigma/\sqrt{n}} = \frac{\bar{X} - 18000}{5000/\sqrt{400}} = \frac{\bar{X} - 18000}{250} \sim \mathcal{N}(0; 1)$$

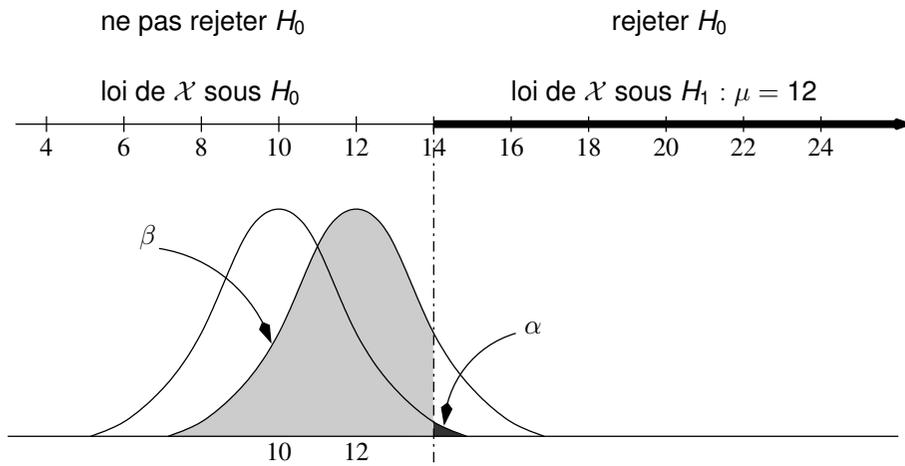
## Exemple de test d'hypothèses (2/2)

$$Z = \frac{\bar{X} - \mu}{\sigma/\sqrt{n}} = \frac{\bar{X} - 18000}{5000/\sqrt{400}} = \frac{\bar{X} - 18000}{250} \sim \mathcal{N}(0; 1)$$

- choix du risque de première espèce :  $\alpha = 0,01$
- $\alpha = 0,01 = P(\bar{X} < c | \mu = 18000)$ 
$$= P\left(\frac{\bar{X} - 18000}{250} < \frac{c - 18000}{250} \mid \mu = 18000\right)$$
$$= P\left(Z < \frac{c - 18000}{250}\right)$$
$$= P(Z < -2,326)$$
$$\Rightarrow \frac{c - 18000}{250} = -2,326 \Rightarrow c = 17418,5$$

règle de décision : si  $\bar{x} < 17418,5$ , rejeter  $H_0 \Rightarrow$  non spam

## Interprétation de $\alpha$ et $\beta$



## Puissance du test

$$\alpha = P(\text{rejeter } H_0 | H_0 \text{ est vraie})$$

$$\beta = P(\text{rejeter } H_1 | H_1 \text{ est vraie})$$

$\alpha$  et  $\beta$  varient en sens inverse l'un de l'autre

⇒ test = compromis entre les deux risques

$H_0$  = hypothèse privilégiée, vérifiée jusqu'à présent et que l'on n'aimerait pas abandonner à tort

⇒ on fixe un *seuil*  $\alpha_0$  :

- $\alpha \leq \alpha_0$
- test minimisant  $\beta$  sous cette contrainte
- $\min \beta = \max 1 - \beta$

$$1 - \beta = \text{puissance du test}$$

## Exemple de calcul de $\beta$ (1/2)

- échantillon de taille 25
- paramètre estimé :  $\mu$  d'une variable  $X \sim \mathcal{N}(\mu; 100)$
- hypothèses :  $H_0 : \mu = 10$      $H_1 : \mu > 10$
- région critique : « rejeter  $H_0$  si  $\bar{x} > 14$  »

sous  $H_1$  : plusieurs valeurs de  $\mu$  sont possibles

⇒ courbe de puissance du test en fonction de  $\mu$

Supposons que  $\mu = 11$  :

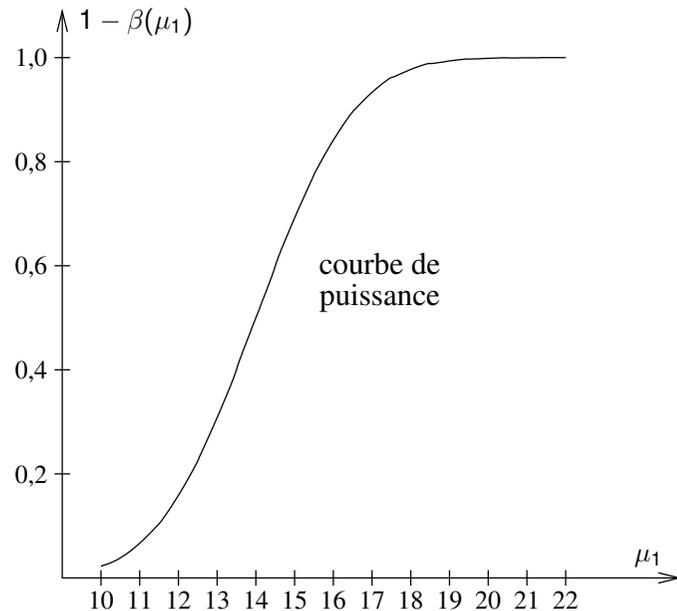
$$\mu = 11 \Rightarrow \frac{\bar{X} - \mu}{\sigma/\sqrt{n}} = \frac{\bar{X} - 11}{2} \sim \mathcal{N}(0; 1)$$

## Exemple de calcul de $\beta$ (2/2)

$$\begin{aligned} 1 - \beta(11) &= P(\text{rejeter } H_0 | H_1 : \mu = 11 \text{ est vraie}) \\ &= P(\bar{X} > 14 | \mu = 11) \\ &= P\left(\frac{\bar{X} - 11}{2} > \frac{14 - 11}{2} \mid \mu = 11\right) \\ &= P\left(\frac{\bar{X} - 11}{2} > 1,5\right) = 0,0668 \end{aligned}$$

$\mu_1$	$z_1 = \frac{14 - \mu_1}{2}$	$1 - \beta(\mu_1) = P(Z > z_1)$	$\beta(\mu_1)$
10	2,0	0,0228	0,9772
11	1,5	0,0668	0,9332
12	1,0	0,1587	0,8413
13	0,5	0,3085	0,6915
14	0,0	0,5000	0,5000
15	-0,5	0,6915	0,3085
16	-1,0	0,8413	0,1587
17	-1,5	0,9332	0,0668

## Courbe de puissance du test



## Exemple : notes d'examen de RFIDEC (1/3)

- les années précédentes, notes d'examen  $\sim \mathcal{N}(14, 6^2)$
- cette année, correction d'un échantillon de 9 copies :

10	8	13	20	12	14	9	7	15
----	---	----	----	----	----	---	---	----

Les notes sont-elles en baisse cette année ?

- hypothèse  $H_0 = \ll \text{la moyenne est égale à } 14 \gg$   
hypothèse  $H_1 = \ll \text{la moyenne a baissé, i.e., elle est } \leq 14 \gg$   
test d'hypothèse de niveau de confiance  $1 - \alpha = 95\%$   
 $\implies$  déterminer seuil  $c$  tel que  $\bar{x} < c \implies H_1$  plus probable que  $H_0$

## Exemple : notes d'examen de RFIDEC (2/3)

10	8	13	20	12	14	9	7	15
----	---	----	----	----	----	---	---	----

 $H_0 : \mu = 14, \sigma = 6$

- sous hypothèse  $H_0$ , on sait que  $\frac{\bar{X} - 14}{\sigma/\sqrt{n}} = \frac{\bar{X} - 14}{2} \sim \mathcal{N}(0; 1)$

- calcul du seuil  $c$  (région de rejet) :

$$P\left(\frac{\bar{X} - 14}{2} < \frac{c - 14}{2} \mid \frac{\bar{X} - 14}{2} \sim \mathcal{N}(0; 1)\right) = 0,05$$

- Table de la loi normale :  $\frac{c-14}{2} \approx -1,645 \implies c = 10,71$

- Règle de décision : rejeter  $H_0$  si  $\bar{x} < 10,71$

- tableau  $\implies \bar{x} = 12$

$\implies$  on ne peut déduire que la moyenne a diminué

## Exemple : notes d'examen de RFIDEC (3/3)

Problème : le risque de 2ème espèce est-il élevé ?

Puissance du test pour une moyenne de 12

- $H_1$  : la moyenne est égale à 12
- Puissance du test =  $1 - \beta(12)$   
=  $P(\text{rejeter } H_0 | H_1)$   
=  $P(\bar{X} < 10,71 \mid \frac{\bar{X} - 12}{2} \sim \mathcal{N}(0; 1))$   
=  $P(\frac{\bar{X} - 12}{2} < -0,645 \mid \frac{\bar{X} - 12}{2} \sim \mathcal{N}(0; 1))$   
 $\approx 25,95\%$ .

## Lemme de Neyman-Pearson (1/2)

$$\text{Cas : } \Theta_0 = \{\theta_0\} \quad \Theta_1 = \{\theta_1\}$$

- Échantillon  $(x_1, \dots, x_n)$  de taille  $n$
- Échantillon  $\implies$  les  $x_i$  = réalisations de variables aléatoires  $X_i$
- Échantillon i.i.d.  $\implies$  les  $X_i$  sont mutuellement indépendants  
 $\implies P(X_1 = x_1, \dots, X_n = x_n | \theta = \theta_k) = \prod_{i=1}^n P(X_i = x_i | \theta = \theta_k)$

### Vraisemblance d'un échantillon

- $x = (x_1, \dots, x_n)$  : échantillon de taille  $n$
- $L(x, \theta_k)$  = Vraisemblance de l'échantillon
- $L(x, \theta_k)$  = proba d'obtenir **cet** échantillon sachant que  $\theta = \theta_k$

$$L(x, \theta_k) = P(x_1, \dots, x_n | \theta = \theta_k) = \prod_{i=1}^n P(x_i | \theta = \theta_k)$$

## Lemme de Neyman-Pearson (2/2)

$$\text{Cas : } \Theta_0 = \{\theta_0\} \quad \Theta_1 = \{\theta_1\}$$

### Lemme de Neyman-Pearson

- il existe toujours un test (aléatoire) le plus puissant de seuil donné  $\alpha_0$
- c'est un test du rapport de vraisemblance :

$$\frac{L(x, \theta_0)}{L(x, \theta_1)} > k \implies x \in A \text{ (accepter } H_0)$$

$$\frac{L(x, \theta_0)}{L(x, \theta_1)} < k \implies x \in W \text{ (rejeter } H_0)$$

$$\frac{L(x, \theta_0)}{L(x, \theta_1)} = k \implies \delta(x) = \rho \text{ (accepter } H_0 \text{ avec proba } 1 - \rho$$

$H_1$  avec proba  $\rho$ )

- $k$  et  $\rho$  déterminés de façon unique par  $\alpha = \alpha_0$

## Loi du $\chi^2$ (1/3)

- population  $\implies$  répartie en  $k$  classes

$p_1$	$p_2$	$p_3$		$p_k$
-------	-------	-------	--	-------

- hypothèse : répartition dans les classes connues  
 $\implies p_r$  = proba qu'un individu appartienne à la classe  $c_r$
- échantillon de  $n$  individus
- $N_r$  = variable aléatoire « nombre d'individus tirés de classe  $c_r$  »
- Chaque individu  $\implies p_r$  chances d'appartenir à la classe  $c_r$   
 $\implies X_i^r$  = v.a. succès si l'individu  $i$  appartient à la classe  $c_r$   
 $\implies X_i^r \sim \mathcal{B}(1, p_r)$   
 $\implies N_r \sim \mathcal{B}(n, p_r)$   
 $\implies N_r \sim$  loi normale quand  $n$  grand

## Loi du $\chi^2$ (2/3)

- population  $\implies$  répartie en  $k$  classes

$p_1$	$p_2$	$p_3$		$p_k$
-------	-------	-------	--	-------

- $p_r$  = proba qu'un individu appartienne à la classe  $c_r$
- échantillon de  $n$  individus
- $N_r$  = v.a. « nb d'individus tirés de classe  $c_r$  »  $\sim$  loi normale

$$D_{(n)}^2 = \sum_{r=1}^k \frac{(N_r - n.p_r)^2}{n.p_r}$$

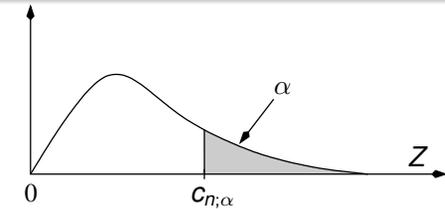
$\implies D_{(n)}^2$  = somme des carrés de  $k$  v.a.  $\sim$  lois normales

- $D_{(n)}^2$  = écart entre théorie et observation
- $D_{(n)}^2$  tend en loi, lorsque  $n \rightarrow \infty$ , vers une loi du  $\chi_{k-1}^2$

Loi du  $\chi^2$

- loi du  $\chi_r^2$  = la loi de la somme des carrés de  $r$  variables indépendantes et de même loi  $\mathcal{N}(0, 1)$
- espérance =  $r$
- variance =  $2r$

valeurs dans le tableau  
ci-dessous : les  $c_{n,\alpha}$   
tels que  $P(Z > c_{n,\alpha}) = \alpha$



$n \setminus \alpha$	0,995	0,99	0,975	0,95	0,90	0,10	0,05	0,025	0,01	0,005
1	0,00004	0,0002	0,001	0,0039	0,0158	2,71	3,84	5,02	6,63	7,88
2	0,0100	0,0201	0,0506	0,103	0,211	4,61	5,99	7,38	9,21	10,6
3	0,0717	0,115	0,216	0,352	0,584	6,25	7,81	9,35	11,3	12,8
4	0,207	0,297	0,484	0,711	1,06	7,78	9,49	11,1	13,3	14,9
5	0,412	0,554	0,831	1,15	1,61	9,24	11,1	12,8	15,1	16,7
6	0,676	0,872	1,24	1,64	2,20	10,6	12,6	14,4	16,8	18,5
7	0,989	1,24	1,69	2,17	2,83	12,0	14,1	16,0	18,5	20,3
8	1,34	1,65	2,18	2,73	3,49	13,4	15,5	17,5	20,1	22,0
9	1,73	2,09	2,70	3,33	4,17	14,7	16,9	19,0	21,7	23,6
10	2,16	2,56	3,25	3,94	4,87	16,0	18,3	20,5	23,2	25,2