

INÉGALITÉ DE CHEBICHEV (C02, C13)

(07 / 06 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

L'inégalité de CHEBICHEV est une inégalité élémentaire du **calcul des probabilités**.

Soit (Ω, \mathcal{F}, P) un **espace probabilisé**, $\xi : \Omega \mapsto \mathbf{R}$ une **vars**, $f : \mathbf{R} \mapsto \mathbf{R}$ et $g : \mathbf{R} \mapsto \mathbf{R}$ deux fonctions **mesurables** non décroissantes.

L'inégalité de P.L. CHEBYCHEV s'écrit :

$$(1) \quad C(f(\xi), g(\xi)) \geq 0.$$

où $C(v, w)$ désigne le **coefficient de corrélation linéaire** entre deux va v et w (cf **corrélation, dépendance quadrangulaire**).

Si f est non décroissante et g non croissante, elle s'écrit :

$$(2) \quad C(f(\xi), g(\xi)) \leq 0.$$