

## INÉGALITÉ DE MARKOV (B5, C13)

(07 / 05 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

Cette inégalité élémentaire du **calcul des probabilités** est à l'origine d'un certain nombre d'inégalités du même type (eg l'**inégalité de BIENAYME-CHEBICHEV**).

Soit  $\xi \in \mathcal{L}_{\mathbb{R}^+}^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$  une **vars** positive tq  $0 < E \xi < +\infty$ .

L'**inégalité de A.A. MARKOV** s'écrit :

$$(1) \quad P([\xi \geq \lambda \cdot E \xi]) \leq \lambda^{-1}, \quad \forall \lambda > 0.$$