



Variables aléatoires

exercices

101**Un péage binomial**

À un péage autoroutier, n voitures franchissent au hasard et indépendamment l'une des trois barrières de péage mises à leur disposition. On note X_1, X_2, X_3 les variables aléatoires dénombrant les voitures ayant franchi ces barrières.

1. Déterminer la loi de X_1 , son espérance et sa variance.
2. Déterminer l'espérance et la variance de $X_2 + X_3$.

102**Deux questions indépendantes**

1. Deux joueurs lancent une pièce équilibrée n fois chacun.
Quelle est la probabilité qu'ils obtiennent le même nombre de fois FACE?
2. On effectue n lancers indépendants d'une pièce équilibrée. Quelle est la probabilité qu'on obtienne strictement plus de PILE que de FACE?

103**Plus grand numéro**

Une urne contient n boules numérotées de 1 à n . On tire au hasard s boules **sans** remise. On note X la VA égale au plus grand des numéros tirés. Déterminer la loi de X .

104**Loi hypergéométrique**

Une urne contient b boules blanches, et r boules rouges.

On tire simultanément n boules ($n \leq b + r$).

On note X la VA égale au nombre de boules blanches tirées.

Donner la loi de X . On pourra supposer $n \leq b$ et $n \leq r$.

Déterminer son espérance. Vérifier la cohérence des résultats avec $n = 1$ (alors X suit une loi ...) et $r = 0$ (et alors X est ...)

105**Rang d'apparition de la 1^{ère} blanche (sans remise)**

Une urne contient 2 boules blanches et $n - 2$ rouges. On effectue des tirages sans remise.

Soit X la VA égale au rang de sortie de la 1^{ère} boule blanche et Y la VA égale au nombre de boules rouges restant à ce moment dans l'urne.

1. Déterminer la loi de X et son espérance.
2. Donner une relation entre X et Y .
3. En déduire la loi de Y et son espérance.

106**Somme des numéros dans un tirage simultané de p jetons**

Une urne contient n jetons numérotés de 1 à n .

On tire p jetons simultanément.

Pour tout $i \in \llbracket 1, n \rrbracket$, on note A_i l'événement « le n° i est tiré ».

On note S la VA égale à la somme des numéros tirés.

Déterminer $E(S)$.

107**Minimum de deux uniformes indépendantes**

Soient X et Y deux variables aléatoires indépendantes suivant une loi uniforme sur $\llbracket 1, n \rrbracket$.

On pose $Z = \min(X, Y)$.

1. Démontrer le lemme suivant :

Lemme. Soit U une VA suivant une loi uniforme sur $\llbracket 1, n \rrbracket$.

On a

$$\forall \ell \in \llbracket 1, n \rrbracket, \quad \mathbb{P}(U \geq \ell) = \frac{n - \ell + 1}{n}$$

Cette égalité est également valable pour $\ell = n + 1$.

2. Déterminer la loi de Z . Puis déterminer son espérance.
3. On recommence tout l'exercice. En utilisant le résultat suivant :

Soit T une variable aléatoire telle que $T(\Omega) \subset \llbracket 0, n \rrbracket$. On a $E(T) = \sum_{k=1}^n \mathbb{P}(T \geq k)$

déterminer l'espérance de Z .

108**Rang d'apparition du 1^{er} PILE en n lancers**

Soit $n \geq 2$ fixé une fois pour toutes. Soit $p \in]0, 1[$ et $q = 1 - p$.

On dispose d'une pièce donnant PILE avec la proba p .

On lance cette pièce et on arrête les lancers dans l'une des deux situations suivantes :

- si on a obtenu PILE
- si on a obtenu n FACE

Pour tout $k \in \mathbb{N}^*$, on note F_k l'événement « obtenir FACE au $k^{\text{ème}}$ lancer ».

On note

- T_n la VA égale au nombre de lancers effectués
- X_n le nombre de PILE obtenus
- Y_n le nombre de FACE obtenus.

1. (a) Soit $k \in \llbracket 1, n-1 \rrbracket$. Déterminer $\mathbb{P}(T_n = k)$.
 (b) Déterminer $\mathbb{P}(T_n = n)$.
 (c) Vérifier par le calcul que $\sum_{k=1}^n \mathbb{P}(T_n = k) = 1$.
 (d) Montrer que $E(T_n) = \frac{1 - q^n}{1 - q}$.
2. Donner la loi de X_n et donner son espérance.
3. Déterminer la loi de Y_n .

109**Marche aléatoire**

Soit $N \in \mathbb{N}^*$ et $X_1, \dots, X_N$ des variables aléatoires indépendantes toutes de même loi où pour tout $i \in \llbracket 1, N \rrbracket$, on a $\mathbb{P}(X_i = -1) = \mathbb{P}(X_i = 1) = \frac{1}{2}$. Pour tout $n \in \llbracket 1, N \rrbracket$, on pose $S_n = \sum_{k=1}^n X_k$.

Soit $n \in \llbracket 1, N \rrbracket$. Déterminer la loi de S_n . Préciser $\mathbb{P}(S_n = 0)$.

110**Différence de deux dés**

Un joueur lance successivement deux fois un dé équilibré.

Soit X la variable aléatoire égale à la différence entre les résultats du premier et du deuxième lancer.

Déterminer les lois de X et $|X|$.

Conditionnement

111**Gain**

On dispose d'une boîte contenant trois objets A, B, C . Un jeu consiste en une succession de tirages d'un objet avec remise dans la boîte.

À chaque tirage, le joueur gagne 1 euro s'il tire l'objet A , ne gagne ni ne perd rien s'il tire l'objet B , et perd tout ce qu'il a gagné précédemment s'il tire l'objet C .

Pour tout $n \in \mathbb{N}$, on note X_n la VA égale au gain du joueur à l'issue de n tirages.

1. Déterminer les lois de X_0, X_1 et X_2 .
2. Soit $n \in \mathbb{N}$. Calculer $\mathbb{P}(X_n = n)$.
3. Soit $n \in \mathbb{N}$. Exprimer $\mathbb{P}(X_{n+1} = 0)$ en fonction de $\mathbb{P}(X_n = 0)$.
En déduire la valeur de $\mathbb{P}(X_n = 0)$.
4. Soit $a \in \mathbb{N}^*$ et $n \in \mathbb{N}$. Montrer que

$$\mathbb{P}(X_{n+1} = a) = \frac{1}{3}\mathbb{P}(X_n = a) + \frac{1}{3}\mathbb{P}(X_n = a - 1)$$

5. Trouver une relation entre $E(X_{n+1})$ et $E(X_n)$. En déduire $E(X_n)$ en fonction de n .

112**Avec remise de la couleur tirée**

Une urne contient initialement une boule blanche et une rouge. On effectue des tirages successifs d'une boule dans l'urne :

après chaque tirage, la boule tirée est remise dans l'urne et on rajoute une boule de la couleur qui vient d'être tirée.

Pour tout $n \in \mathbb{N}^*$, soit X_n la VA égale au nombre de boules blanches obtenues au cours des n^{ers} tirages.

1. Déterminer la loi de X_1 et celle de X_2 .
2. Émettre une conjecture concernant la loi de X_n . Prouver cette conjecture par récurrence.

113**Robin des bois**

Un archer tire sur n cibles. À chaque tir, il a la probabilité $p \in]0, 1[$ de toucher la cible et les tirs sont supposés indépendants. Il tire une première fois sur chaque cible et on note X le nombre de cibles atteintes lors de ce premier jet.

L'archer tire ensuite une seconde fois sur les cibles restantes et on note Y le nombre de cibles touchées lors de cette tentative.

On pose $Z = X + Y$.

1. Déterminer la loi de X .
2. Soit $k \in \llbracket 0, n \rrbracket$.
Déterminer la loi conditionnelle de Y sachant $\{X = k\}$.
En déduire la loi conjointe de X et Y .
3. En déduire la loi de Z ; reconnaître une loi classique.

On dispose de deux boîtes A et B , de deux boules noires et de deux boules rouges. Au départ, chaque urne contient deux des quatre boules. À chaque étape, on tire une boule de chacune des boîtes et on les échange.

Soit X_0 le nombre de boules noires placées initialement dans A et X_n le nombre de boules noires dans A après n étapes.

Pour tout $n \in \mathbb{N}$, on pose :

$$p_n = \mathbb{P}(X_n = 0), \quad q_n = \mathbb{P}(X_n = 1) \quad \text{et} \quad r_n = \mathbb{P}(X_n = 2).$$

1. Déterminer la loi de X_0 si, au départ, les boules sont placées au hasard dans les deux boîtes. Dans la suite, X_0 est quelconque.

2. Montrer qu'il existe $M \in \mathcal{M}_3(\mathbb{R})$ telle que : $\forall n \in \mathbb{N} \quad \begin{pmatrix} p_{n+1} \\ q_{n+1} \\ r_{n+1} \end{pmatrix} = M \begin{pmatrix} p_n \\ q_n \\ r_n \end{pmatrix}.$

3. Montrer que la matrice M est semblable à $D = \text{diag} \left(1, 0, -\frac{1}{2} \right).$

Expliciter une matrice P inversible telle que $M = PDP^{-1}.$

4. On pose $\begin{pmatrix} a \\ b \\ c \end{pmatrix} = P^{-1} \begin{pmatrix} p_0 \\ q_0 \\ r_0 \end{pmatrix}.$

Exprimer p_n, q_n et r_n en fonction de a, b, c et n .

En déduire que les suites $(p_n)_{n \in \mathbb{N}}, (q_n)_{n \in \mathbb{N}}$ et $(r_n)_{n \in \mathbb{N}}$ convergent.

Déterminer leurs limites respectives p, q et r (on pourra remarquer que $p + q + r = 1$).

Commenter.

Espérance, Covariance, Variance

115 Somme et différence de deux Bernoulli indépendantes

Soit X et Y deux variables de Bernoulli indépendantes et de paramètre $p \in]0, 1[$ sur le même espace probabilisé. Soit $U = X + Y$ et $V = X - Y$. Déterminer :

1. la loi du couple (U, V) ;
2. la covariance de U et V ;
3. U et V sont-elles indépendantes ?

116 Un calcul de covariance (1)

On considère une suite de N lancers de pile ou face indépendants, la probabilité d'obtenir pile étant $p \in]0, 1[$. Pour $n \in \llbracket 1, N \rrbracket$, on note S_n le nombre de piles obtenus lors des n premiers lancers. Calculer la covariance de (S_m, S_n) pour m et n dans $\llbracket 1, N \rrbracket$.

117 Un calcul de covariance (2)

Soit $n \geq 2$. On dispose de n urnes numérotées de 1 à n .

Dans l'urne n° k , il y a k boules numérotées de 1 à k . On choisit une urne au hasard et dans celle-ci, on pioche une boule au hasard.

Soit X la variable aléatoire égale au numéro de l'urne et Y la variable aléatoire égale au numéro de la boule tirée.

Montrer que

$$\text{cov}(X, Y) = \frac{(n+1)(n-1)}{24}$$

118 Urne de Pólya

Soit r , b et c trois entiers naturels non nuls. L'urne $\mathcal{U}$ contient initialement r boules rouges et b boules blanches. On pose $N = r + b$. On tire les boules de $\mathcal{U}$ une à une ; à l'issue de chaque tirage, la boule prélevée dans l'urne est remise, avec c boules de la même couleur.

Pour tout $n \in \mathbb{N}^*$, on note X_n le nombre de boules rouges tirées lors des n premiers tirages, Y_n la variable indicatrice de l'événement « le n^{e} tirage donne une boule rouge ».

1. Déterminer la loi de Y_1 .
2. À l'aide de la formule des probabilités totales, montrer que l'on a, pour tout $n \in \mathbb{N}^*$:

$$\mathbb{E}(Y_{n+1}) = \frac{r + c\mathbb{E}(X_n)}{N + nc}.$$

3. Exprimer X_n à l'aide des variables $Y_1, \dots, Y_n$ et en déduire que toutes les variables Y_n ont même loi.
4. Déterminer l'espérance de X_n .

119 Poignée

Une urne contient n jetons numérotés de 1 à n .

On tire une poignée de jetons (*i.e.* une partie, éventuellement vide, de l'ensemble des jetons).

On note N le nombre de jetons tirés, et S la somme des numéros des jetons tirés.

Enfin, pour tout $i \in \llbracket 1, n \rrbracket$, on note X_i la variable de Bernoulli qui vaut 1 si le $i^{\text{ème}}$ jeton est dans la poignée et 0 sinon.

On suppose que toutes les poignées sont équiprobables.

1. Déterminer la loi de N , son espérance et sa variance.
2. Déterminer la loi de X_i . Montrer que les variables X_i sont deux à deux indépendantes.
3. Exprimer S en fonction des X_i . Calculer $\mathbb{E}(S)$ et $\text{V}(S)$.

555**Fonction génératrice**

Soit X est une variable aléatoire finie telle que $X(\Omega) \subset \mathbb{N}$.

On définit la **fonction génératrice de X** , notée g_X , par :

$$\forall t \in \mathbb{R}, \quad g_X(t) = E(t^X) = \sum_{k \in X(\Omega)} t^k \mathbb{P}(X = k).$$

1. Montrer que la loi de X est entièrement déterminée par la fonction g_X .
2. Soit X_1 et X_2 des variables aléatoires finies et indépendantes à valeurs dans $\mathbb{N}$.
Montrer que :

$$g_{X_1+X_2} = g_{X_1}g_{X_2}.$$

3. Déterminer la fonction génératrice d'une variable suivant une loi binomiale.
En déduire que, si X_1 et X_2 sont des variables indépendantes suivant les lois binomiales de paramètres (n_1, p) et (n_2, p) , alors $X_1 + X_2$ suit une loi binomiale dont on précisera les paramètres.
4. On lance deux dés classiques à six faces.
On note X_i la variable aléatoire indiquant le numéro du dé n° i .
Les variables aléatoires X_1 et X_2 sont supposées indépendantes.
On pose $Y = X_1 + X_2$.
 - (a) On veut montrer que, même si les dés sont pipés, il est impossible que Y suive la loi uniforme sur $\llbracket 2, 12 \rrbracket$.
On raisonne par l'absurde, en supposant que Y suive la loi uniforme sur $\llbracket 2, 12 \rrbracket$.
 - i. Déterminer alors la fonction génératrice de Y . Quelles sont ses racines ?
 - ii. Montrer que g_{X_1} et g_{X_2} sont deux polynômes de degré 6 ayant 0 comme racine tels que $g_{X_1}g_{X_2} = g_Y$. Conclure.
 - (b) On veut montrer que si les dés sont pipés, il est impossible que la loi de Y soit la même que quand les dés ne sont pas pipés.
 - i. Déterminer la fonction génératrice de Y quand les dés sont équilibrés. On la note P . Préciser les racines de P .
 - ii. On suppose que $X_1 + X_2$ suit la même loi que dans le cas où les dés sont équilibrés. En écrivant que $g_{X_1}g_{X_2} = P$, montrer que les dés sont équilibrés.

556**Inégalité de Bernstein**

Soit S_n une variable aléatoire suivant la loi binomiale de paramètre (n, p) et $x > 0$.

On pose $q = 1 - p$.

1. Soit $\lambda > 0$.
 - (a) Montrer que :

$$\mathbb{P}(S_n - np \geq nx) \leq \frac{E(e^{\lambda(S_n - np)})}{e^{n\lambda x}}.$$

- (b) Montrer que

$$E(e^{\lambda(S_n - np)}) = (pe^{\lambda q} + qe^{-\lambda p})^n.$$

- (c) Montrer que

$$\forall t \in \mathbb{R}, \quad e^t \leq e^{t^2} + t$$

Cette question s'avère plus difficile que prévue.

- (d) En déduire que :

$$\mathbb{P}(S_n - np \geq nx) \leq e^{n(\lambda^2 - \lambda x)},$$

2. Montrer :

$$\mathbb{P}(S_n - np \geq nx) \leq e^{-\frac{nx^2}{4}}.$$

3. En remarquant que $n - S_n$ suit une loi usuelle, montrer que :

$$\mathbb{P}(S_n - np \leq -nx) \leq e^{-\frac{nx^2}{4}}.$$

4. En déduire l'inégalité de Bernstein :

$$\mathbb{P}\left(\left|\frac{S_n}{n} - p\right| \geq x\right) \leq 2e^{-\frac{nx^2}{4}}.$$

5. Comparer cette inégalité avec l'inégalité de Bienaymé-Tchebychev.

Soit $n \in \mathbb{N}^*$.

On effectue une série de n tirages d'une boule avec remise dans une urne contenant n boules numérotées de 1 à n .

Pour tout entier $k \in \mathbb{N}^*$, on note :

- X_k la variable aléatoire égale au numéro de la boule obtenue au k -ième tirage ;
- S_k la somme des numéros des boules obtenues lors des k premiers tirages.

Comme les tirages sont avec remise, les v.a. X_k sont indépendantes.

On considère enfin la variable aléatoire T_n égale au nombre de tirages nécessaires pour que, pour la première fois, la somme des numéros des boules obtenues soit supérieure ou égale à n .

Par exemple, pour $n = 5$, si le tirage est $\omega = (3, 1, 4, 1, 5)$, alors $S_1(\omega) = 3$, $S_2(\omega) = 4$, $S_3(\omega) = 8$, $S_4(\omega) = 9$, $S_5(\omega) = 14$ et $T_5(\omega) = 3$.

1. Soit $k \in \llbracket 1, n \rrbracket$, déterminer la loi de X_k ainsi que son espérance.
2. (a) Déterminer $T_n(\Omega)$.
(b) Calculer $\mathbb{P}(T_n = 1)$ et $\mathbb{P}(T_n = n)$
3. (a) Déterminer la loi de T_2 .
(b) Donner la loi de T_3 . Vérifier que $E(T_3) = \frac{16}{9}$.
4. Soit $k \in \llbracket 1, n \rrbracket$. Déterminer $S_k(\Omega)$.
5. Soit $k \in \llbracket 1, n-1 \rrbracket$. Montrer soigneusement que :

$$\forall i \in \llbracket k+1, n \rrbracket, \quad \mathbb{P}(S_{k+1} = i) = \frac{1}{n} \sum_{j=k}^{i-1} \mathbb{P}(S_k = j).$$

6. Montrer que pour tout $k \in \llbracket 1, n \rrbracket$, on a :

$$\llbracket \forall i \in \llbracket k, n \rrbracket, \quad \mathbb{P}(S_k = i) = \frac{1}{n^k} \binom{i-1}{k-1} \rrbracket.$$

7. (a) Soit $k \in \llbracket 1, n-1 \rrbracket$. Exprimer l'événement $\{T_n > k\}$ à l'aide de S_k .
(b) Montrer que $\forall k \in \llbracket 0, n-1 \rrbracket, \quad \mathbb{P}(T_n > k) = \frac{1}{n^k} \binom{n-1}{k}$.
8. Démontrer que $E(T_n) = \sum_{k=0}^{n-1} \mathbb{P}(T_n > k)$, puis que $E(T_n) = \left(1 + \frac{1}{n}\right)^{n-1}$.
9. Calculer $\lim_{n \rightarrow +\infty} E(T_n)$.

Pour tout entier $n \geq 1$, on considère l'expérience suivante : on dispose de n urnes initialement vides et on dispose d'un grand stock de boules que l'on dépose une à une dans ces urnes.

Pour chaque boule, on choisit au hasard, de façon équiprobable, l'urne dans laquelle la boule est déposée.

On note X_n le rang du premier tirage pour lequel une des urnes contiendra deux boules.

- Déterminer la loi de X_1 , la loi de X_2 .

Désormais, $n \in \mathbb{N}^*$ est quelconque. Quel est l'univers image de X_n ?

- Avec l'importation `import random as rd`, la commande `rd.randint(a,b)` retourne un entier aléatoire dans $\llbracket a, b \rrbracket$.
Écrire une fonction `Tirage(n)` pour qu'elle simule une réalisation de la variable aléatoire X_n . Autrement dit, on crée n urnes et on place les boules jusqu'à ce que l'une des urnes en contienne au moins 2. Et on renvoie le nombre de tirages effectués.
- Écrire une fonction `LoiEmpiriqueX(n)` qui retourne une liste contenant les approximations de $\mathbb{P}(X_n = k)$. Quelle est la longueur de cette liste ? !
- Montrer que la loi de X_n est donnée par :

$$\forall k \in \llbracket 2, n+1 \rrbracket, \quad \mathbb{P}(X_n = k) = \frac{k-1}{n} \prod_{i=0}^{k-2} \left(1 - \frac{i}{n}\right).$$

Variables aléatoires

corrigés

① ▷ **Loi de X**

On trouve $X(\Omega) \subset \llbracket 1, n \rrbracket$, et même si l'on veut $X(\Omega) \subset \llbracket 1, n-1 \rrbracket$.

Soit $k \in X(\Omega)$. L'événement

$$[X = k] = R_1 \cap \dots \cap R_{k-1} \cap B_k$$

où R_i est l'événement « tirer une boule rouge au $i^{\text{ème}}$ tirage » et B_i « tirer une boule blanche au $i^{\text{ème}}$ tirage ».

En utilisant la formule des probas composées

$$\mathbb{P}(X = k) = \mathbb{P}(R_1) \times \mathbb{P}_{R_1}(R_2) \times \dots \times \mathbb{P}_{R_1 \cap \dots \cap R_{k-2}}(R_{k-1}) \times \mathbb{P}_{R_1 \cap \dots \cap R_{k-1}}(B_k)$$

$$\mathbb{P}(X = k) = \frac{n-2}{n} \times \frac{n-3}{n-1} \times \dots \times \frac{n-k}{n-k+2} \times \frac{2}{n-k+1}$$

Après simplification, on trouve :

$$\forall k \in X(\Omega), \quad \mathbb{P}(X = k) = \frac{2(n-k)}{n(n-1)}$$

Remarque : pour $k = n$, on trouve une proba nulle comme attendu (pourquoi « comme attendu » ?).

Autre solution On peut aussi raisonner en dénombrant.

Prenons pour Ω l'ensemble des n -arrangements de $\{B_1, B_2, R_1, \dots, R_{n-2}\}$ muni de la probabilité uniforme.

Le cardinal de Ω vaut $n!$.

Soit $k \in X(\Omega)$. Un tirage réalisant l'événement $[X = k]$ est du type :

$$(R_*, \dots, R_*, B_*, \text{ce-qui-reste})$$

Se donner un tel tirage revient à

— choisir les $k-1$ boules rouges et les permuter : $\binom{n-2}{k-1} \times (k-1)! = \frac{(n-2)!}{(n-k-1)!}$

— choisir une des deux boules blanches en $k^{\text{ème}}$ position : 2 choix

— choisir un $(n-k)$ -arrangement des $n-k$ boules restantes : $(n-k)!$ choix

D'où

$$\mathbb{P}(X = k) = \frac{\frac{(n-2)!}{(n-k-1)!} \times 2 \times (n-k)!}{n!} = \frac{2(n-k)}{n(n-1)}$$

▷ **Espérance de X**

$$E(X) = \sum_{k=1}^n k \mathbb{P}(X = k) = \frac{2}{n(n-1)} \sum_{k=1}^n k(n-k) = \frac{2}{n(n-1)} \left(n \sum_{k=1}^n k - \sum_{k=1}^n k^2 \right) = \dots = \frac{n+1}{3}$$

② Soit $k \in \llbracket 1, n \rrbracket$.

Lorsque l'on a tiré la première blanche au $k^{\text{ème}}$ tirage, il reste $(n-2) - (k-1) = n-k-1$ rouges dans l'urne ; et réciproquement.

Ainsi, on a l'égalité d'événements :

$$[X = k] = [Y = n - k - 1]$$

BILAN. On a l'égalité de **variables aléatoires** :

$$Y = n - X - 1 \quad \text{c'est-à-dire} \quad Y = (-1)X + (n-1)$$

③ ▷ **Loi de Y**

• Déterminons l'univers image de Y .

Comme la v.a. Y est la transformée de la v.a. X par la fonction $t \mapsto -t + (n-1)$, il suffit de regarder l'image de $X(\Omega) \subset \llbracket 1, n \rrbracket$ par cette fonction.

Ainsi $Y(\Omega) \subset \llbracket -1, n-2 \rrbracket$.

• Comme $Y = (-1)X + (n-1)$, on a également X en fonction de Y ; en effet $X = (n-1) - Y$.

Ainsi, pour $y \in Y(\Omega)$, on a l'égalité d'événements :

$$[Y = y] = [X = n - 1 - y]$$

Comme on connaît la loi de X , on en déduit la loi de Y ; en effet, on a

$$P(Y = y) = \frac{2\binom{n - (n - 1 - y)}{2}}{n(n - 1)} = \frac{2(y + 1)}{n(n - 1)}$$

▷ **Espérance de Y**

Une mauvaise stratégie consiste à refaire tout un calcul pour $E(Y)$.

Il est bien mieux de profiter du fait que Y est la transformée de X par une fonction affine. Ainsi

$$E(Y) = -E(X) + (n - 1)$$

Après petit calcul, on trouve

$$E(Y) = \frac{2n - 4}{3}$$

Soient X et Y deux variables aléatoires indépendantes suivant une loi uniforme sur $\llbracket 1, n \rrbracket$.

1. Soit $\ell \in \llbracket 1, n \rrbracket$.

On a

$$\mathbb{P}(U \geq \ell) = \sum_{i=\ell}^n \frac{1}{n} = \frac{n - \ell + 1}{n}$$

Cette égalité est encore valable pour $\ell = n + 1$. En effet, pour $\ell = n + 1$, on doit avoir $\mathbb{P}(Z \geq \ell) = 0$. Et le membre droit donne bien 0.

2. Déterminons la loi de $Z = \min(X, Y)$.

On a $Z(\Omega) = \llbracket 1, n \rrbracket$.

Fixons $k \in \llbracket 1, n \rrbracket$.

On a, par définition du minimum,

$$[Z \geq k] = [X \geq k] \cap [Y \geq k]$$

Par indépendance de X et Y , on a alors

$$\mathbb{P}(Z \geq k) = \mathbb{P}(X \geq k)\mathbb{P}(Y \geq k) \stackrel{\text{why}}{=} \left(\frac{n - k + 1}{n}\right)^2$$

Il s'agit maintenant de revenir à $\mathbb{P}(Z = k)$.

Comme Z est à valeurs entières, on a :

$$\forall \ell \in \mathbb{Z}, \quad \mathbb{P}(Z = \ell) = \mathbb{P}(Z \geq \ell) - \mathbb{P}(Z \geq \ell + 1)$$

WARNING. La formule $\mathbb{P}(Z \geq k)$ trouvée précédemment n'est pas valable pour tous les $k \in \mathbb{Z}$. Elle ne fonctionne, **a priori**, que pour les $k \in \llbracket 1, n \rrbracket$.

Or, on constate que la formule fonctionne également pour $k = n + 1$.

On obtient donc

$$\mathbb{P}(Z = k) = \left(\frac{n - k + 1}{n}\right)^2 - \left(\frac{n - (k + 1) + 1}{n}\right)^2 = \frac{(n - k + 1)^2 - (n - k)^2}{n^2} = \frac{2n + 1 - 2k}{n^2}$$

BILAN :

$$\forall k \in \llbracket 1, n \rrbracket, \quad \mathbb{P}(Z = k) = \frac{2n + 1 - 2k}{n^2}$$

- On peut maintenant déterminer l'espérance de Z . On a

$$\mathbb{E}(Z) = \sum_{k=1}^n k\mathbb{P}(Z = k) = \dots = \frac{(n + 1)(2n + 1)}{6n}$$

3. Déterminons l'espérance de Z uniquement avec $\mathbb{P}(Z \geq k)$.

D'après la formule rappelée (que l'on peut appliquer car Z est à valeurs dans $\llbracket 1, n \rrbracket$, donc dans $\llbracket 0, n \rrbracket$), on a :

$$\mathbb{E}(Z) = \sum_{k=1}^n \left(\frac{n - k + 1}{n}\right)^2 = \frac{1}{n^2} \sum_{k=1}^n (k^2 - 2(n + 1)k + (n + 1)^2) = \dots = \frac{(n + 1)(2n + 1)}{6n}$$

Remarque. Ce calcul est très maladroit. On peut faire (il faut faire !) un changement d'indice dans la première somme en posant $j = n + 1 - k$.

1. (a) Comme $k \in \llbracket 1, n-1 \rrbracket$, le jeu s'arrête au premier pile obtenu, on a l'égalité d'événements :

$$[T_n = k] = F_1 \cap F_2 \cap \cdots \cap F_{k-1} \cap \overline{F_k}$$

En appliquant $\mathbb{P}$, on a :

$$\mathbb{P}(T_n = k) = \mathbb{P}(F_1 \cap F_2 \cap \cdots \cap F_{k-1} \cap \overline{F_k})$$

D'où par indépendance des F_i

$$\mathbb{P}(T_n = k) = \mathbb{P}(F_1)\mathbb{P}(F_2) \cdots \mathbb{P}(F_{k-1})\mathbb{P}(\overline{F_k})$$

D'où

$$\mathbb{P}(T_n = k) = q^{k-1}p$$

- (b) On a l'égalité d'événements

$$[T_n = n] = F_1 \cap F_2 \cap \cdots \cap F_{n-1}$$

En utilisant la même technique qu'à la question précédente, on trouve $\mathbb{P}(T_n = n) = q^{n-1}$.

- (c) On a

$$\begin{aligned} \sum_{k=1}^n \mathbb{P}(T_n = k) &= \sum_{k=1}^{n-1} \mathbb{P}(T_n = k) + \mathbb{P}(T_n = n) \\ &= \sum_{k=1}^{n-1} q^{k-1}p + q^{n-1} \\ &= pq^{1-1} \frac{1 - q^{n-1}}{1 - q} + q^{n-1} \\ &= 1 \end{aligned}$$

- (d) La va T_n admet une espérance en tant que va *finie*.

Après avoir écrit la définition de $E(T_n)$, on constate que l'on ne peut pas faire grand chose dans le calcul.

Une idée est donc de montrer que $(1 - q)E(T_n) = 1 - q^n$.

$$\begin{aligned} (1 - q)E(T_n) &= (1 - q) \left(\sum_{k=1}^{n-1} k \mathbb{P}(T_n = k) + n \mathbb{P}(T_n = n) \right) \\ &= (1 - q) \sum_{k=1}^{n-1} k \underbrace{\mathbb{P}(T_n = k)}_{q^{k-1}p} + n \underbrace{(1 - q)}_p \underbrace{\mathbb{P}(T_n = n)}_{q^{n-1}} \\ &= p \sum_{k=1}^{n-1} (k q^{k-1} - k q^k) + n p q^{n-1} \\ &= p \sum_{k=1}^{n-1} [(k-1) + 1] q^{k-1} - k q^k + n p q^{n-1} \\ &= p \sum_{k=1}^{n-1} [(k-1) q^{k-1} - k q^k] + p \sum_{k=1}^{n-1} q^{k-1} + n p q^{n-1} \\ &= -(n-1) p q^{n-1} + p \frac{1 - q^{n-1}}{1 - q} + n p q^{n-1} \\ &= p q^{n-1} + (1 - q^{n-1}) \\ &= 1 - q^{n-1} (1 - p) \\ &= 1 - q^{n-1} q \\ &= 1 - q^n \end{aligned}$$

2. Le nombre de PILE obtenu est soit 0, soit 1.

Donc $X_n(\Omega) = \{0, 1\}$. Ainsi, X_n suit une loi de Bernoulli de paramètre $P(X_n = 1)$.

On a l'égalité d'événements

$$[X_n = 0] = F_1 \cap F_2 \cap \cdots \cap F_n$$

Par indépendance, on a donc $\mathbb{P}(X_n = 0) = q^n$.

Ainsi,

$$X_n \sim \mathcal{B}(1 - q^n)$$

On a alors $E(X_n) = 1 - q^n$.

3. Le nombre de FACE obtenu est 0, 1, ... ou n . Donc $Y_n(\Omega) = \llbracket 0, n \rrbracket$.

Fixons $k \in \llbracket 0, n \rrbracket$.

- Pour $k = n$, on a $[Y_n = n] = F_1 \cap \dots \cap F_n$. D'où $\mathbb{P}(Y_n = n) = q^n$.
- Pour $k \in \llbracket 0, n-1 \rrbracket$, on a $[Y_n = k] = F_1 \cap \dots \cap F_k \cap \overline{F_{k+1}}$. D'où

$$\mathbb{P}(Y_n = k) = \mathbb{P}(F_1 \cap \dots \cap F_k \cap \overline{F_{k+1}}) = q^k p$$

BILAN. On a $Y_n(\Omega) = \llbracket 0, n \rrbracket$ et :

$$\forall k \in \llbracket 0, n-1 \rrbracket, \mathbb{P}(Y_n = k) = q^k p \quad \text{et} \quad \mathbb{P}(Y_n = n) = q^n$$

Solution se voulant savante, mais qui n'apporte rien. Je la laisse quand même car elle est instructive.

On a l'égalité de VA suivante : $X_n + Y_n = T_n$, qui traduit le fait que le nombre de PILE plus le nombre de FACE vaut le nombre de lancers. Ainsi, $Y_n = T_n - X_n$.

Comme $T_n(\Omega) = \llbracket 1, n \rrbracket$ et $X_n(\Omega) = \{0, 1\}$, on a

$$Y_n(\Omega) = \llbracket 0, n \rrbracket$$

Fixons $k \in \llbracket 0, n \rrbracket$. On a l'égalité d'événements

$$[Y_n = k] = [T_n = k] \cap [X_n = 0] \sqcup [T_n = k+1] \cap [X_n = 1]$$

- Pour $k = n$, elle s'écrit

$$[Y_n = n] = \underbrace{[T_n = n] \cap [X_n = 0]}_{F_1 \cap \dots \cap F_n} \sqcup \underbrace{[T_n = n+1] \cap [X_n = 1]}_{\emptyset}$$

D'où $\mathbb{P}(Y_n = n) = \mathbb{P}(F_1 \cap \dots \cap F_n) = q^n$.

- Et pour $k \in \llbracket 0, n-1 \rrbracket$, on a

$$[Y_n = k] = \underbrace{[T_n = k] \cap [X_n = 0]}_{\emptyset} \sqcup \underbrace{[T_n = k+1] \cap [X_n = 1]}_{F_1 \cap \dots \cap F_k \cap \overline{F_{k+1}}}$$

On a donc

$$\mathbb{P}(Y_n = k) = \mathbb{P}(F_1 \cap \dots \cap F_k \cap \overline{F_{k+1}}) = q^k p$$

Cet exercice n'est pas si facile. Il faut en prendre possession en prenant des exemples : commencer par prendre $n = 1$, puis $n = 2$, puis $n = 3$ et même $n = 4$.

Première solution. Après avoir cherché au brouillon les petits cas ci-dessus, on comprend que l'on peut faire intervenir le nombre de 1.

Considérons donc D_n la variable aléatoire égale au nombre de 1.

Si vous voulez faire un peu de formalisme, voilà ce que vaut D_n en fonction des X_k :

$$D_n = \sum_{k=1}^n \mathbb{1}_{\{X_k=1\}}$$

De même, on introduit G_n la variable aléatoire égale au nombre de -1 .

Les lettres D et G sont les premières lettres des mots « droite » et « gauche ».

On a les deux relations suivantes :

$$\begin{cases} S_n = D_n - G_n \\ n = D_n + G_n \end{cases}$$

Par somme, on trouve $2D_n = S_n + n$.

Ainsi, S_n s'exprime en fonction de D_n , dont on connaît la loi!!!!

En effet, D_n suit une loi binomiale $\mathcal{B}(n, p)$ où $p = \frac{1}{2}$.

Donc on va pouvoir trouver la loi de S_n à l'aide de $S_n = 2D_n - n$ et de la loi de D_n .

On a donc

$$\star S_n(\Omega) = \{2k - n, k \in D_n(\Omega)\} = \{2k - n, k \in \llbracket 0, n \rrbracket\}$$

Pour information : un entier i s'écrit $2k - n$ pour un certain k si et seulement si i et n ont même parité.

Ainsi, on peut dire que

$$S_n(\Omega) = \left\{ i \in \llbracket -n, n \rrbracket \mid i \text{ et } n \text{ ont même parité} \right\}$$

$\star$ Soit $i \in S_n(\Omega)$ (donc i et n ont même parité!).

On a l'égalité d'événements

$$\{S_n = i\} = \left\{ D_n = \frac{i+n}{2} \right\}$$

En appliquant $\mathbb{P}$, on a donc (car ici, $\frac{i+n}{2}$ est un entier) :

$$\mathbb{P}(S_n = i) = \binom{n}{\frac{i+n}{2}} p^{\frac{i+n}{2}} (1-p)^{n-\frac{i+n}{2}}$$

Comme $p = \frac{1}{2}$, on obtient après simplifications :

$$\mathbb{P}(S_n = i) = \binom{n}{\frac{i+n}{2}} \frac{1}{2^n}$$

Pour $i = 0$, on obtient

$$\mathbb{P}(S_n = 0) = \begin{cases} \binom{n}{\frac{n}{2}} \frac{1}{2^n} & \text{si } n \text{ est pair} \\ 0 & \text{si } n \text{ est impair} \end{cases}$$

qui peut encore s'écrire

$$\mathbb{P}(S_n = 0) = \begin{cases} \binom{2m}{m} \frac{1}{4^m} & \text{si } n = 2m \text{ est pair} \\ 0 & \text{si } n \text{ est impair} \end{cases}$$

Deuxième solution. On va, en quelque sorte, transformer les X_i pour qu'elles suivent une loi de Bernoulli (donc à valeurs dans $\{0, 1\}$).

Pour tout i , on pose

$$Y_i = \frac{X_i + 1}{2}$$

Ainsi, Y_i est à valeurs dans $\{0, 1\}$ et on a l'égalité d'événements $\{Y_i = 1\} = \{X_i = 1\}$.

Ainsi, Y_i suit une loi de Bernoulli de paramètre $\mathbb{P}(X_i = 1)$, c'est-à-dire $p = \frac{1}{2}$.

On renverse la vapeur. La va X_i s'exprime en fonction de Y_i . En sommant, on trouve

$$S_n = 2 \left(\sum_{i=1}^n Y_i \right) - n$$

Or la variable aléatoire $\sum_{i=1}^n Y_i$ est une somme de Bernoulli **indépendantes** (WHY), donc suit une loi binomiale $\mathcal{B}(n, p)$.

On termine comme la première solution, en notant $D_n = \sum_{i=1}^n Y_i$.

Loi de X . Vous devez trouver $X(\Omega) = \llbracket -5, 5 \rrbracket$ et

$$\forall k \in \llbracket -5, 5 \rrbracket, \quad \mathbb{P}(X = k) = \frac{6 - |k|}{36}.$$

Loi de $|X|$. On a $|X|(\Omega) = \llbracket 0, 5 \rrbracket$ et :

$$\forall k \in \llbracket 0, 5 \rrbracket, \quad \mathbb{P}(|X| = k) = \begin{cases} \mathbb{P}(X = 0) = \frac{1}{6} & \text{si } k = 0 \\ \mathbb{P}(X = -k) + \mathbb{P}(X = k) = \frac{6 - k}{18} & \text{sinon} \end{cases}$$

On va noter A_i l'événement « tirer l'objet A au $i^{\text{ème}}$ tirage ». De même, on définit B_i et C_i .

1. • On peut raisonnablement penser que X_0 est la va constante égale à 1 (avant de jouer, on dispose d'un gain égal à 0).

• On a $X_1(\Omega) = \{0, 1\}$.

L'événement $[X_1 = 1]$ est « tirer A ». Donc $\mathbb{P}(X_1 = 1) = \frac{1}{3}$.

Bilan : $X_1 \sim \mathcal{B}(\frac{1}{3})$.

• On a $X_2(\Omega) = \{0, 1, 2\}$.

On a l'égalité d'événement $[X_2 = 2] = A_1 \cap A_2$. Ainsi, $\mathbb{P}(X_2 = 2) = (\frac{1}{3})^2$.

On a l'égalité d'événement $[X_2 = 1] = A_1 \cap B_2 \sqcup \overline{A_1} \cap A_2$.

Ainsi, par additivité de $\mathbb{P}$, puis par indépendance de A_1 et B_2 d'une part et $\overline{A_1}$ et A_2 d'autre part, on a

$$\mathbb{P}(X_2 = 1) = \mathbb{P}(A_1 \cap B_2) + \mathbb{P}(\overline{A_1} \cap A_2) = \mathbb{P}(A_1)\mathbb{P}(B_2) + \mathbb{P}(\overline{A_1})\mathbb{P}(A_2) = \frac{1}{3} \times \frac{1}{3} + (1 - \frac{1}{3}) \times \frac{1}{3} = \frac{1}{3}$$

On a donc $\mathbb{P}(X_2 = 0) = 1 - \mathbb{P}(X_2 = 1) - \mathbb{P}(X_2 = 2) = 1 - \frac{3}{9} - \frac{1}{9} = \frac{5}{9}$.

2. On a l'égalité d'événements

$$[X_n = n] = A_1 \cap A_2 \cap \dots \cap A_n$$

Par indépendance des A_i , on a

$$\mathbb{P}(X_n = n) = \prod_{i=1}^n \mathbb{P}(A_i) = \prod_{i=1}^n \frac{1}{3} = \frac{1}{3^n}$$

3. On a l'égalité d'événements

$$[X_{n+1} = 0] = [X_n = 0] \cap \overline{A_{n+1}} \sqcup [\overline{X_n = 0}] \cap C_{n+1}$$

Par additivité de $\mathbb{P}$ et indépendance, on a

$$\mathbb{P}(X_{n+1} = 0) = \mathbb{P}(X_n = 0)(1 - \mathbb{P}(A_{n+1})) + (1 - \mathbb{P}(X_n = 0))\mathbb{P}(C_{n+1})$$

Notons $u_n = \mathbb{P}(X_n = 0)$. On a la relation de récurrence :

$$u_{n+1} = u_n \times \frac{2}{3} + (1 - u_n) \times \frac{1}{3}$$

D'où $u_{n+1} = \frac{1}{3}u_n + \frac{1}{3}$.

BILAN. La suite $(u_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est arithmético-géométrique de premier terme $u_0 = 1$.

En posant $\gamma = \frac{1}{2}$, on a :

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad \begin{cases} u_{n+1} &= \frac{1}{3}u_n + \frac{1}{3} \\ \gamma &= \frac{1}{3}\gamma + \frac{1}{3} \end{cases}$$

Ainsi, par différence, on a :

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad u_{n+1} - \gamma = \frac{1}{3}(u_n - \gamma)$$

La suite $(u_n - \gamma)_{n \in \mathbb{N}}$ est donc géométrique, d'où :

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad u_n - \gamma = \frac{1}{3^n}(u_0 - \gamma) \quad \text{c'est-à-dire} \quad u_n = \frac{1}{3^n}\left(1 - \frac{1}{2}\right) + \frac{1}{2} = \frac{1}{2}\left(\frac{1}{3^n} + 1\right)$$

BILAN

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad \mathbb{P}(X_n = 0) = \frac{1}{2}\left(\frac{1}{3^n} + 1\right)$$

4. Soit $a, n \in \mathbb{N}^*$. Comme $a \neq 0$, on a l'égalité d'événements

$$[X_{n+1} = a] = [X_n = a] \cap B_{n+1} \sqcup [X_n = a - 1] \cap A_{n+1}$$

Par additivité de $\mathbb{P}$ et indépendance, on a

$$\mathbb{P}(X_{n+1} = a) = \frac{1}{3}\mathbb{P}(X_n = a) + \frac{1}{3}\mathbb{P}(X_n = a - 1)$$

5. On a

$$E(X_{n+1}) = \sum_{a \in X_{n+1}(\Omega)} a \mathbb{P}(X_{n+1} = a) = \sum_{a=1}^{n+1} a \mathbb{P}(X_{n+1} = a)$$

car le terme de la somme pour $a = 0$ est nul.

Avec la relation de récurrence de la question précédente et en utilisant que X_n ne prend pas la valeur $n + 1$, on a :

$$\begin{aligned} E(X_{n+1}) &= \frac{1}{3} \sum_{a=1}^n a \mathbb{P}(X_n = a) + \frac{1}{3} \sum_{a=1}^{n+1} a \mathbb{P}(X_n = a - 1) \\ &= \frac{1}{3} \sum_{a=1}^n a \mathbb{P}(X_n = a) + \frac{1}{3} \sum_{b=0}^n (b+1) \mathbb{P}(X_n = b) \\ &= \frac{1}{3} \sum_{a=1}^n a \mathbb{P}(X_n = a) + \frac{1}{3} \sum_{b=0}^n b \mathbb{P}(X_n = b) + \underbrace{\frac{1}{3} \sum_{b=0}^n \mathbb{P}(X_n = b)}_{=1} \\ &= \frac{2}{3} \sum_{a=1}^n a \mathbb{P}(X_n = a) + \frac{1}{3} \\ &= \frac{2}{3} E(X_n) + \frac{1}{3} \end{aligned}$$

La suite $(E(X_n))$ est donc arithmético-géométrique.

En posant $e_n = E(X_n)$ et $\gamma = 1$, on a :

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad \begin{cases} e_{n+1} &= \frac{2}{3} e_n + \frac{1}{3} \\ \gamma &= \frac{2}{3} \gamma + \frac{1}{3} \end{cases}$$

Ainsi, par différence, on a :

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad e_{n+1} - \gamma = \frac{2}{3} (e_n - \gamma)$$

La suite $(e_n - \gamma)_{n \in \mathbb{N}}$ est donc géométrique, et $e_0 = E(X_0) = 0$, d'où

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad e_n - \gamma = \left(\frac{2}{3}\right)^n (e_0 - \gamma) \quad \text{c'est-à-dire} \quad e_n = \left(\frac{2}{3}\right)^n (0 - 1) + 1$$

BILAN

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad E(X_n) = 1 - \left(\frac{2}{3}\right)^n$$

1. On a $X_1(\Omega) = \llbracket 0, 1 \rrbracket$.

Et $\mathbb{P}(X_1 = 0) = \frac{1}{2}$ et $\mathbb{P}(X_1 = 1) = \frac{1}{2}$.

On a $X_2(\Omega) = \llbracket 0, 2 \rrbracket$.

Et

$$\mathbb{P}(X_2 = 0) = \mathbb{P}(R_1 \cap R_2) = \mathbb{P}(R_1) \times \mathbb{P}_{R_1}(R_2) = \frac{1}{2} \times \frac{2}{3}$$

Idem pour $\mathbb{P}(X_2 = 2)$ car les boules rouges et blanches jouent le même rôle.

$$\mathbb{P}(X_2 = 1) = \mathbb{P}(B_1 \cap R_2) + \mathbb{P}(R_1 \cap B_2) = \frac{1}{2} \times \frac{1}{3} + \frac{1}{3} \times \frac{1}{2}$$

2. Pour tout $n \in \mathbb{N}^*$, il est clair que $X_n(\Omega) = \llbracket 0, n \rrbracket$ et on conjecture que

$$\forall k \in \llbracket 0, n \rrbracket, \quad \mathbb{P}(X_n = k) = \frac{1}{n+1}$$

Prouvons par récurrence que pour tout $n \in \mathbb{N}^*$, la propriété $\mathcal{H}_n$ est vraie où :

$$\mathcal{H}_n : \quad \llbracket \forall k \in \llbracket 0, n \rrbracket, \quad \mathbb{P}(X_n = k) = \frac{1}{n+1} \rrbracket$$

INITIALISATION. À vous.

HÉRÉDITÉ.

Utilisons le système complet d'événements $([X_n = i])_{0 \leq i \leq n}$.

D'après la formule des probabilités totales, on a pour tout $k \in \llbracket 0, n+1 \rrbracket$.

$$\mathbb{P}(X_{n+1} = k) = \sum_{i=0}^n \mathbb{P}(X_n = i) \mathbb{P}_{X_n=i}(X_{n+1} = k)$$

d'où

$$\mathbb{P}(X_{n+1} = k) = \mathbb{P}(X_n = k-1) \underbrace{\mathbb{P}_{X_n=k-1}(X_{n+1} = k)}_{\mathbb{P}_{X_n=k-1}(B_{n+1})} + \mathbb{P}(X_n = k) \underbrace{\mathbb{P}_{X_n=k}(X_{n+1} = k)}_{\mathbb{P}_{X_n=k}(R_{n+1})}$$

Utilisons $\mathcal{H}_n$ pour $\mathbb{P}(X_n = k-1)$ et $\mathbb{P}(X_n = k)$.

Pour cela, il faut que $k-1$ et k soient dans $\llbracket 0, n \rrbracket$, c-à-d $0 < k < n+1$.

Distinguons donc plusieurs cas. Avant de commencer, examinons la composition de l'urne à un temps t donné.

Après le $n^{\text{ème}}$ tirage (ou **avant** le $n+1^{\text{ème}}$ tirage), il y a $n+2$ boules dans l'urne. Si $X_n = j$ est réalisé, alors l'urne contient $j+1$ boules blanches, donc $n+2 - (j+1) = n-j+1$ boules rouges.

▷ Si $k = 0$, alors

$$\mathbb{P}(X_{n+1} = 0) = \underbrace{\mathbb{P}(X_n = 0)}_{\frac{1}{n+1}} \underbrace{\mathbb{P}_{X_n=0}(R_{n+1})}_{\frac{n-0+1}{n+2}} = \frac{1}{n+2}$$

▷ Si $k = n+1$, alors

$$\mathbb{P}(X_{n+1} = n+1) = \underbrace{\mathbb{P}(X_n = n)}_{\frac{1}{n+1}} \underbrace{\mathbb{P}_{X_n=n}(B_{n+1})}_{\frac{n+1}{n+2}} = \frac{1}{n+2}$$

▷ Si $0 < k < n+1$, alors

$$\mathbb{P}(X_{n+1} = k) = \underbrace{\mathbb{P}(X_n = k-1)}_{\frac{1}{n+1}} \mathbb{P}_{X_n=k-1}(B_{n+1}) + \underbrace{\mathbb{P}(X_n = k)}_{\frac{1}{n+1}} \mathbb{P}_{X_n=k}(R_{n+1})$$

Or

$$\mathbb{P}_{X_n=k-1}(B_{n+1}) = \frac{(k-1)+1}{n+2} \quad \text{et} \quad \mathbb{P}_{X_n=k}(R_{n+1}) = \frac{(n-k+1)}{n+2}$$

D'où

$$\mathbb{P}(X_{n+1} = k) = \frac{1}{n+1} \frac{k}{n+2} + \frac{1}{n+1} \frac{(n-k+1)}{n+2} = \frac{1}{n+2}$$

Bilan : Les 3 cas montrent que

$$\forall k \in \llbracket 0, n+1 \rrbracket, \quad \mathbb{P}(X_{n+1} = k) = \frac{1}{n+2}$$

c-à-d $\mathcal{H}_{n+1}$ est vraie.

1. X suit une loi binomiale $\mathcal{B}(n, p)$.
2. La variable aléatoire Y est à valeurs dans $\llbracket 0, n \rrbracket$.
La loi conditionnelle de Y sachant $\{X = k\}$ est la loi binomiale $\mathcal{B}(n - k, p)$.
• Déterminons la loi conjointe.
Soit $(k, \ell) \in \llbracket 0, n \rrbracket^2$.
On en déduit que,

$$\begin{aligned}\mathbb{P}(X = k, Y = \ell) &= \mathbb{P}(X = k) \mathbb{P}_{\{X=k\}}(Y = \ell) \\ &= \begin{cases} \binom{n}{k} p^k (1-p)^{n-k} \binom{n-k}{\ell} p^\ell (1-p)^{n-k-\ell} & \text{si } \ell \leq n-k \\ 0 & \text{si } \ell > n-k \end{cases}\end{aligned}$$

Et il n'y a même pas besoin de disjonction de cas grâce à la convention classique sur le coefficient binomial.

Dans le cas $\ell \leq n - k$, on simplifie pour obtenir :

$$\mathbb{P}(X = k, Y = \ell) = \frac{n!}{k! \ell! (n - k - \ell)!} p^{k+\ell} (1-p)^{2(n-k)-\ell}.$$

3. La variable Z est à valeurs dans $\llbracket 0, n \rrbracket$ et, pour tout $i \in \llbracket 0, n \rrbracket$, on a

$$\begin{aligned}\mathbb{P}(Z = i) &= \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} p^k q^{n-k} \binom{n-k}{i-k} p^{i-k} q^{n-k-(i-k)} = \sum_{k=0}^n \underbrace{\binom{n}{k} \binom{n-k}{i-k}}_{\binom{n}{i} \binom{i}{k}} p^i q^{2n-k-i} \\ \mathbb{P}(Z = i) &= \sum_{k=0}^i \mathbb{P}(X = k, Y = i - k) \\ &= \sum_{k=0}^i \binom{n}{k} p^k q^{n-k} \binom{n-k}{i-k} p^{i-k} q^{n-k-(i-k)} \\ &= \sum_{k=0}^i \underbrace{\binom{n}{k} \binom{n-k}{i-k}}_{\binom{n}{i} \binom{i}{k}} p^i q^{2n-k-i} \\ &= \binom{n}{i} p^i q^{2n-i} \sum_{k=0}^i \binom{i}{k} q^{-k} \\ &= \binom{n}{i} p^i q^{2n-i} \left(1 + \frac{1}{q}\right)^i \quad \text{d'après la formule du binôme} \\ &= \binom{n}{i} (p(1+q))^i (q^2)^{n-i}\end{aligned}$$

Montrons que Z suit une loi binomiale de paramètre (n, p') où $p' = p(1+q)$.

Pour cela, il s'agit de montrer que $p' + q^2 = 1$.

Allons-y.

On a

$$p' + q^2 = p(1+q) = (1-q)(1+q) + q^2 = 1 - q^2 + q^2 = 1$$

Jeanne Delareux, CDmaths 2021-2022, me dit qu'il y a une interprétation de ce résultat, et elle a raison.

L'expérience peut être vue comme la répétition de manière identique et indépendante de n épreuves, où chaque épreuve est « tirer deux fois sur une cible » avec une probabilité d'échec égale à q^2 , donc de succès égale à $1 - q^2$.

Compter le nombre de succès de cette expérience revient à compter le nombre de succès lors des deux séances de tirs de l'énoncé (en effet, lors de la deuxième séance de tirs, on peut laisser l'archer tenter sa chance sur les cibles déjà atteintes la première fois, et ne pas tenir compte du score de ces cibles).

Ainsi, il est normal que Z suive une loi binomiale de paramètres n et $1 - q^2$.

1. On choisit deux boules parmi quatre que l'on place dans la boîte A , les deux autres boules étant placées dans la boîte B . Il y a $\binom{4}{2} = 6$ choix possibles.

On obtient $p_0 = \frac{1}{6}$ (il faut placer les deux boules rouges dans A : il y a un cas favorable) et de même $r_0 = \frac{1}{6}$. On en déduit $q_0 = 1 - p_0 - r_0 = \frac{2}{3}$.

2. Soit $n \in \mathbb{N}$. On applique la formule des probabilités totales avec le système complet d'événements $(\{X_n = 0\}, \{X_n = 1\}, \{X_n = 2\})$. On obtient :

$$p_{n+1} = p_n \mathbb{P}_{\{X_n=0\}}(X_{n+1} = 0) + q_n \mathbb{P}_{\{X_n=1\}}(X_{n+1} = 0) + r_n \mathbb{P}_{\{X_n=2\}}(X_{n+1} = 0)$$

On a :

— $\mathbb{P}_{\{X_n=0\}}(X_{n+1} = 0)$ et $\mathbb{P}_{\{X_n=2\}}(X_{n+1} = 0)$ valent 0, car si la boîte A contient 0 ou 2 boules noires, elle en contiendra une après échange ;

— $\mathbb{P}_{\{X_n=1\}}(X_{n+1} = 0) = \frac{1}{4}$, car si la boîte A contient une boule noire, il faut échanger cette boule noire avec la boule rouge de l'autre boîte.

Ainsi $p_{n+1} = \frac{1}{4}q_n$. En raisonnant de la même façon, on obtient :

$$q_{n+1} = p_n + \frac{1}{2}q_n + r_n \quad \text{et} \quad r_{n+1} = \frac{1}{4}q_n.$$

La matrice M cherchée est donc $\begin{pmatrix} 0 & 1/4 & 0 \\ 1 & 1/2 & 1 \\ 0 & 1/4 & 0 \end{pmatrix}$.

3. Soit u l'endomorphisme de $\mathbb{R}^3$ canoniquement associé à M . On cherche une base (e_1, e_2, e_3) de $\mathbb{R}^3$, dans laquelle la matrice de u est D , c'est-à-dire vérifiant :

$$u(e_1) = e_1, \quad u(e_2) = 0 \quad \text{et} \quad u(e_3) = -\frac{1}{2}e_3.$$

En résolvant $MX = X$, où $X \in \mathcal{M}_{3,1}(\mathbb{R})$, on voit que $e_1 = (1, 4, 1)$ convient.

On trouve de même $e_2 = (1, 0, -1)$ et $e_3 = (1, -2, 1)$.

On montre facilement que (e_1, e_2, e_3) est libre donc est une base de $\mathbb{R}^3$.

La matrice de u dans cette base est D .

On a donc $M = PDP^{-1}$, avec $P = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 4 & 0 & -2 \\ 1 & -1 & 1 \end{pmatrix}$.

4. En notant Y_n la matrice colonne $\begin{pmatrix} p_n \\ q_n \\ r_n \end{pmatrix}$, on a $Y_{n+1} = MY_n$.

On en déduit que

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad Y_n = M^n Y_0 = PD^n P^{-1} Y_0.$$

On a $P^{-1}Y_0 = \begin{pmatrix} a \\ b \\ c \end{pmatrix}$. On obtient, après calcul :

$$\begin{pmatrix} p_n \\ q_n \\ r_n \end{pmatrix} = Y_n = P \text{diag}(1, 0, (-1/2)^n) \begin{pmatrix} a \\ b \\ c \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} a + (-1/2)^n c \\ 4a - 2(-1/2)^n c \\ a + (-1/2)^n c \end{pmatrix}.$$

Les suites (p_n) , (q_n) et (r_n) convergent respectivement vers a , $4a$ et a .

De plus, $p_n + q_n + r_n = 1$ (car $(\{X_n = 0\}, \{X_n = 1\}, \{X_n = 2\})$ est un système complet d'événements).

Par passage à la limite, on obtient $a + 4a + a = 1$ et donc $a = \frac{1}{6}$.

On a donc $p = \frac{1}{6}$, $q = \frac{2}{3}$ et $r = \frac{1}{6}$.

On voit que, lorsque n tend vers $+\infty$, la loi de X_n tend vers la loi obtenue quand on place les boules au hasard dans les deux boîtes.

On considère la variable X_i qui vaut 1 si le $i^{\text{ème}}$ lancer donne pile et 0 sinon.

On obtient des variables indépendantes $X_1, \dots, X_N$.

On a $S_m = \sum_{i=1}^m X_i$ et $S_n = \sum_{j=1}^n X_j$.

En utilisant la bilinéarité de la covariance, on obtient :

$$\text{cov}(S_m, S_n) = \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^n \text{cov}(X_i, X_j).$$

Si $i \neq j$, la covariance de X_i et X_j est nulle car ces variables sont indépendantes.

Les termes non nuls de la somme sont les $\text{cov}(X_i, X_i)$ avec $i \leq m$ et $i \leq n$, c'est-à-dire $i \leq \min(m, n)$.

D'autre part, on a $\text{cov}(X_i, X_i) = V(X_i) = p(1-p)$.

D'où

$$\text{cov}(S_m, S_n) = \sum_{i=1}^{\min(m, n)} V(X_i) = \min(m, n) p(1-p).$$

- La variable X suit une loi uniforme sur $\llbracket 1, n \rrbracket$ donc $E(X) = \frac{n+1}{2}$.
- La variable Y est à valeurs dans $\llbracket 1, n \rrbracket$.
 Pour $k \in \llbracket 1, n \rrbracket$, la loi de Y sachant $\{X = k\}$ est la loi uniforme sur $\llbracket 1, k \rrbracket$.
 Pour $(k, i) \in \llbracket 1, n \rrbracket^2$, on a donc :

$$\mathbb{P}(\{X = k\} \cap \{Y = i\}) = \mathbb{P}(X = k) \mathbb{P}_{\{X=k\}}(Y = i) = \begin{cases} 0 & \text{si } i > k \\ \frac{1}{nk} & \text{si } i \leq k \end{cases}$$

On en déduit que, pour tout $i \in \llbracket 1, n \rrbracket$,

$$\mathbb{P}(Y = i) = \sum_{k=1}^n \mathbb{P}(\{X = k\} \cap \{Y = i\}) = \sum_{k=i}^n \frac{1}{nk}.$$

On obtient alors :

$$E(Y) = \sum_{i=1}^n i \mathbb{P}(Y = i) = \sum_{i=1}^n \sum_{k=i}^n \frac{i}{nk},$$

et en échangeant les sommations :

$$E(Y) = \sum_{k=1}^n \sum_{i=1}^k \frac{i}{nk} = \sum_{k=1}^n \left(\frac{1}{nk} \sum_{i=1}^k i \right) = \sum_{k=1}^n \frac{1}{nk} \cdot \frac{k(k+1)}{2} = \frac{1}{2n} \sum_{k=1}^n (k+1)$$

et donc :

$$E(Y) = \frac{1}{2n} \left(\frac{n(n+1)}{2} + n \right) = \frac{n+3}{4}.$$

- On calcule ensuite l'espérance de XY :

$$E(XY) = \sum_{k=1}^n \sum_{i=1}^k ki \mathbb{P}(\{X = k\} \cap \{Y = i\}) = \sum_{k=1}^n \left(\sum_{i=1}^k ki \frac{1}{nk} \right) = \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n \left(\sum_{i=1}^k i \right)$$

et donc :

$$E(XY) = \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n \frac{k(k+1)}{2} = \frac{1}{2n} \left(\frac{n(n+1)(2n+1)}{6} + \frac{n(n+1)}{2} \right) = \frac{(n+1)(n+2)}{6}.$$

- On en déduit :

$$\begin{aligned} \text{cov}(X, Y) &= E(XY) - E(X)E(Y) \\ &= \frac{(n+1)(n+2)}{6} - \frac{(n+1)(n+3)}{8} \\ &= \frac{(n+1)(n-1)}{24} \end{aligned}$$

1. La variable aléatoire Y_1 est à valeurs dans $\{0, 1\}$.

La probabilité de tirer une boule rouge au premier tirage est $\frac{r}{N}$, c'est-à-dire $\mathbb{P}(Y_1 = 1) = \frac{r}{N}$.

Donc Y_1 suit la loi de Bernoulli de paramètre $\frac{r}{N}$.

2. La variable aléatoire X_n est à valeurs dans $\llbracket 0, n \rrbracket$.

On prend comme système complet d'événements $(\{X_n = k\})_{k \in \llbracket 0, n \rrbracket}$.

D'après la formule des probabilités totales, on a

$$\mathbb{P}(Y_{n+1} = 1) = \sum_{k=0}^n \mathbb{P}(X_n = k) \mathbb{P}_{\{X_n = k\}}(Y_{n+1} = 1).$$

Déterminons la probabilité conditionnelle $\mathbb{P}_{\{X_n = k\}}(Y_{n+1} = 1)$.

Supposons l'événement $\{X_n = k\}$ réalisé. On a rajouté ck boules rouges dans l'urne et cn boules en tout, avant le $(n+1)$ -ième tirage. On a donc $\mathbb{P}_{\{X_n = k\}}(Y_{n+1} = 1) = \frac{r + ck}{N + cn}$.

On obtient :

$$\mathbb{P}(Y_{n+1} = 1) = \sum_{k=0}^n \mathbb{P}(X_n = k) \frac{r + ck}{N + cn}$$

Essayons de transformer toutes ces probabilités en espérance !

Comme Y_n est une Bernoulli, le membre gauche vaut $E(Y_{n+1})$.

Et le membre droit s'exprime différemment avec le théorème de transfert.

On a donc

$$E(Y_{n+1}) = E\left(\frac{r + cX_n}{N + cn}\right),$$

Par linéarité, on a

$$E(Y_{n+1}) = \frac{r + cE(X_n)}{N + cn}.$$

3. • On a $X_n = Y_1 + \dots + Y_n$.

Il s'agit de montrer que pour tout $n \in \mathbb{N}^*$, « Y_n a même loi que Y_1 ».

Autrement dit, montrons que

$$\forall n \in \mathbb{N}^*, \quad Y_n \sim \mathcal{B}\left(\frac{r}{N}\right)$$

Comme Y_n est une variable de Bernoulli, cela équivaut à montrer que :

$$\forall n \in \mathbb{N}^*, \quad \underbrace{E(Y_n)}_{\mathcal{H}_n} = \frac{r}{N}$$

Initialisation : $\mathcal{H}_1$ est vraie.

Hérédité. Supposons $\mathcal{H}_1, \dots, \mathcal{H}_n$.

Avec la question précédente, on a

$$E(Y_{n+1}) = \frac{r + cE(X_n)}{N + cn}$$

Pour déterminer $E(X_n)$, on utilise le fait que $X_n = Y_1 + \dots + Y_n$. Par linéarité de l'espérance, on a

$$\text{donc } E(X_n) = \sum_{k=1}^n E(Y_k).$$

D'après $\mathcal{H}_1, \dots, \mathcal{H}_n$, on a donc $E(X_n) = n \frac{r}{N}$.

D'où

$$E(Y_{n+1}) = \frac{r + nc \frac{r}{N}}{N + cn} = \frac{r}{N}$$

D'où $\mathcal{H}_{n+1}$.

4. On a $E(X_n) = nE(Y_1) = \frac{nr}{N}$.

On prend pour Ω l'ensemble des parties de l'urne muni de la probabilité uniforme.
Ainsi, $\text{card } \Omega = 2^n$.

1. La variable aléatoire N est à valeurs dans $\llbracket 0, n \rrbracket$.

Pour tout $k \in \llbracket 0, n \rrbracket$, on a $\mathbb{P}(N = k) = \frac{\binom{n}{k}}{2^n}$, qui vaut encore $\binom{n}{k} \left(\frac{1}{2}\right)^k \left(\frac{1}{2}\right)^{n-k}$.

Donc N suit la loi binomiale $\mathcal{B}(n, \frac{1}{2})$.

On en déduit $E(N) = \frac{n}{2}$ et $V(N) = \frac{n}{4}$.

2. La variable X_i est à valeurs dans $\{0, 1\}$.

On a $\mathbb{P}(X_i = 1) = \frac{2^{n-1}}{2^n} = \frac{1}{2}$, car il y a 2^{n-1} poignées contenant le jeton i (en effet, une telle poignée est constituée du jeton i et d'une partie quelconque de l'ensemble des $n - 1$ jetons restants).

La variable aléatoire X_i suit donc la loi de Bernoulli de paramètre $\frac{1}{2}$.

On a donc $E(X_i) = \frac{1}{2}$ et $V(X_i) = \frac{1}{4}$.

- Soit $i \neq j$. Montrons que X_i et X_j sont indépendantes.

Comme ce sont des variables de Bernoulli, il suffit de montrer que

$$\mathbb{P}(\{X_i = 1\} \cap \{X_j = 1\}) = \mathbb{P}(X_i = 1) \mathbb{P}(X_j = 1)$$

Le membre gauche vaut $\mathbb{P}(\{X_i = 1\} \cap \{X_j = 1\}) = \frac{2^{n-2}}{2^n} = \frac{1}{4}$, car il y a 2^{n-2} poignées contenant les jetons i et j (il s'agit de choisir une partie quelconque de l'ensemble des $n - 2$ jetons différents des jetons i et j).

Le membre droit vaut $\mathbb{P}(X_i = 1) \mathbb{P}(X_j = 1) = \frac{1}{2} \frac{1}{2} = \frac{1}{4}$.

Cela montre l'indépendance de ces deux variables de Bernoulli.

3. On a $S = \sum_{i=1}^n iX_i$.

Par linéarité de l'espérance, on a donc

$$E(S) = \sum_{i=1}^n iE(X_i) = \frac{1}{2} \sum_{i=1}^n i = \frac{n(n+1)}{4}.$$

Comme les variables X_i sont deux à deux indépendantes, les variables iX_i le sont aussi, donc on a :

$$V(S) = \sum_{i=1}^n i^2 V(X_i) = \frac{1}{4} \sum_{i=1}^n i^2 = \frac{n(n+1)(2n+1)}{24}.$$

1. La fonction g_X est une fonction polynomiale dont les coefficients sont les $(\mathbb{P}(X = k))_{k \in X(\Omega)}$.

La donnée de g_X détermine donc les $(\mathbb{P}(X = k))_{k \in X(\Omega)}$, c'est-à-dire la loi de X .

Plus précisément, on a

$$\forall k \in \mathbb{N}, \quad \mathbb{P}(X = k) = \frac{g^{(k)}(0)}{k!}$$

2. Soit $t \in \mathbb{R}$. On a

$$g_{X_1+X_2}(t) = \mathbb{E}(t^{X_1+X_2}) = \mathbb{E}(t^{X_1}t^{X_2})$$

Comme X_1 et X_2 sont indépendantes, il en est de même de t^{X_1} et t^{X_2} (transformées de variables indépendantes). Donc l'espérance du produit est le produit des espérances, et on a alors :

$$g_{X_1+X_2}(t) = \mathbb{E}(t^{X_1})\mathbb{E}(t^{X_2}) = g_{X_1}(t)g_{X_2}(t)$$

D'où l'égalité de fonctions $g_{X_1+X_2} = g_{X_1}g_{X_2}$.

3. Soit $X \sim \mathcal{B}(n, p)$. D'après la formule du binôme de Newton, on a :

$$\forall t \in \mathbb{R}, \quad g_X(t) = \sum_{k=0}^n t^k \mathbb{P}(X = k) = \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} (pt)^k (1-p)^{n-k} = (pt + 1 - p)^n.$$

Prenons X_1 et X_2 deux variables aléatoires indépendantes suivant des lois binomiales.

Alors, on a

$$\forall t \in \mathbb{R}, \quad g_{X_1+X_2}(t) = g_{X_1}(t)g_{X_2}(t) = (pt + 1 - p)^{n_1} (pt + 1 - p)^{n_2} = (pt + 1 - p)^{n_1+n_2}.$$

On reconnaît la fonction génératrice de la loi binomiale de paramètres $(n_1 + n_2, p)$.

D'après la question 1, on en déduit que $X_1 + X_2$ suit la loi binomiale de paramètres $(n_1 + n_2, p)$.

4. $Y = X_1 + X_2$, où X_1 et X_2 sont indépendants donc $g_Y = g_{X_1+X_2} = g_{X_1}g_{X_2}$ d'après la question 2.

(a) i. Comme $Y \sim \mathcal{U}([1, 12])$, on a

$$\forall t \in \mathbb{R}, \quad g_Y(t) = \sum_{k=2}^{12} t^k \mathbb{P}(Y = k) = \sum_{k=2}^{12} t^k \frac{1}{11} = \frac{1}{11} t^2 \sum_{j=0}^{10} t^j.$$

La fonction génératrice de Y est donc une fonction polynomiale de degré 12.

On voit que 0 est racine double de g_Y .

Par ailleurs, comme $\sum_{j=0}^{10} t^j = \frac{t^{11} - 1}{t - 1}$, les autres racines de g_Y sont les racines onzièmes de l'unité différentes de 1.

Les racines de g_Y sont donc

$$0 \text{ de multiplicité } 2 \quad \text{et} \quad \text{les éléments de } \mathbb{U}_{11} \setminus \{1\}$$

Comme 11 est impair, l'ensemble $\mathbb{U}_{11} \setminus \{1\}$ ne contient aucun réel (rappel, en toute généralité $\mathbb{U}_m$ contient les réels ± 1 si m est pair, et uniquement 1 si m est impair).

- ii. D'après la question 2, on a $g_Y = g_{X_1}g_{X_2}$.

Comme $X_1(\Omega) = X_2(\Omega) \subset [1, 6]$, les polynômes g_{X_1} et g_{X_2} sont de degré inférieurs ou égal à 6 et ont 0 comme racine.

Comme g_Y est de degré 12, les polynômes g_{X_1} et g_{X_2} sont exactement de degré 6 et les racines de ces deux polynômes sont incluses dans les racines de g_Y .

Les racines de g_{X_1} et g_{X_2} sont donc

$$0 \quad \text{et} \quad 5 \text{ éléments de } \mathbb{U}_{11} \setminus \{1\}$$

Or un polynôme à coefficient réel (à savoir g_{X_1}) ne peut pas avoir un nombre impair de racines complexes non réelles.

Ainsi, Y ne suit pas la loi uniforme sur $[2, 12]$.

- (b) i. Supposons que les dés soient équilibrés.

Alors X_1 et X_2 suivent la loi uniforme sur $[1, 6]$.

Soit $t \in \mathbb{R}$. Alors

$$g_{X_i}(t) = \frac{1}{6} \sum_{k=1}^6 t^k$$

Donc

$$P(t) = g_{X_1}(t)g_{X_2}(t) = \frac{t^2}{36} \left(\sum_{j=0}^5 t^j \right)^2$$

$$\forall t \neq 1, \quad P(t) = \frac{1}{36} t^2 \left(\frac{t^6 - 1}{t - 1} \right)^2$$

Les racines de P sont 0 et les racines sixièmes de l'unité différentes de 1 toutes doubles.

P a donc deux racines réelles 0 et -1 et quatre racines complexes non réelles (deux à deux conjuguées), toutes de multiplicité 2.

ii. On a toujours $g_{X_1} g_{X_2} = P$.

Comme $X_1(\Omega) = X_2(\Omega) \subset \llbracket 1, 6 \rrbracket$, les polynômes g_{X_1} et g_{X_2} sont de degré inférieurs ou égal à 6 et ont 0 comme racine.

Comme g_{X_1} est à coefficients réels, il ne peut pas avoir un nombre impair de racines complexes non réelles. Idem pour g_{X_2} .

Nécessairement, ils ont chacun -1 comme racine simple, leurs autres racines étant deux à deux conjuguées. Deux cas sont possibles.

— Soit chacun des polynômes a pour racines (simples) $e^{-i\pi/3}, e^{i\pi/3}, e^{-i2\pi/3}$ et $e^{i2\pi/3}$, alors g_{X_1} et g_{X_2} sont à une constante près égaux à $\sum_{k=1}^6 t^k$.

Comme la somme des coefficients doit être égale à 1, on trouve $g_{X_1}(t) = g_{X_2}(t) = \frac{1}{6} \sum_{k=1}^6 t^k$ (i.e. la fonction génératrice d'une loi uniforme sur $\llbracket 1, 6 \rrbracket$, donc les dés sont équilibrés).

— Soit l'un des polynômes a pour racines doubles $e^{-i\pi/3}$ et $e^{i\pi/3}$, l'autre $e^{-i2\pi/3}$ et $e^{i2\pi/3}$.

On a alors par exemple, en notant α le coefficient dominant :

$$g_{X_1}(t) = \alpha t(t+1)(t-e^{-i\pi/3})^2(t-e^{i\pi/3})^2 = \alpha t(t+1)(t^2-t+1)^2 = \alpha(t^6-t^5+t^4+t^3-t^2+t).$$

g_{X_1} a donc des coefficients négatifs, ce qui est absurde car ce sont des probabilités (de la forme $\mathbb{P}(X_1 = k)$). Ainsi, ce deuxième cas est exclu.

On en déduit que les dés sont équilibrés.

1. (a) Comme $\exp$ et $\ln$ sont croissantes, on a l'égalité d'événements :

$$\{S_n - np \geq nx\} = \{\lambda(S_n - np) \geq n\lambda x\} = \{e^{\lambda(S_n - np)} \geq e^{n\lambda x}\}.$$

La variable aléatoire $e^{\lambda(S_n - np)}$ étant positive, l'inégalité de Markov donne :

$$\mathbb{P}(S_n - np \geq nx) = \mathbb{P}(e^{\lambda(S_n - np)} \geq e^{n\lambda x}) \leq \frac{\mathbb{E}(e^{\lambda(S_n - np)})}{e^{n\lambda x}}$$

- (b) **Première solution.** En appliquant la formule de transfert, on obtient :

$$\begin{aligned} \mathbb{E}(e^{\lambda(S_n - np)}) &= \sum_{k=0}^n e^{\lambda(k - np)} \binom{n}{k} p^k q^{n-k} \\ &= e^{-n\lambda p} \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} (e^{\lambda p})^k q^{n-k} \\ &= e^{-n\lambda p} (e^{\lambda p} + q)^n \\ &= (pe^{-\lambda p} + qe^{-\lambda p})^n \end{aligned}$$

Deuxième solution

Considérons $X_1, \dots, X_n$ des variables aléatoires indépendantes suivant la loi de Bernoulli de paramètre p , et posons $T_n = \sum_{k=1}^n X_k$.

On sait alors que T_n suit la loi binomiale de paramètre (n, p) , donc a même loi que S_n .

Les variables aléatoires $T_n - np$ et $S_n - np$ ont ainsi même loi, donc même espérance.

On a :

$$\begin{aligned} \mathbb{E}(e^{\lambda(S_n - np)}) &= \mathbb{E}(e^{\lambda(T_n - np)}) = \mathbb{E}\left(\exp\left(\lambda\left(\sum_{k=1}^n X_k - np\right)\right)\right) \\ &= \mathbb{E}\left(\exp\left(\sum_{k=1}^n \lambda(X_k - p)\right)\right) = \mathbb{E}\left(\prod_{k=1}^n e^{\lambda(X_k - p)}\right) \end{aligned}$$

Les variables $X_1, \dots, X_n$ étant indépendantes et de même loi, il en est de même pour les variables $\lambda(X_1 - p), \dots, \lambda(X_n - p)$, d'où :

$$\mathbb{E}(e^{\lambda(S_n - np)}) = \prod_{k=1}^n \mathbb{E}(e^{\lambda(X_k - p)}) = \left(\mathbb{E}(e^{\lambda(X_1 - p)})\right)^n.$$

Cela donne le résultat, car en revenant à la définition de l'espérance, on a :

$$\mathbb{E}(e^{\lambda(X_1 - p)}) = pe^{\lambda q} + qe^{-\lambda p}.$$

- (c) Posons $f : t \mapsto e^{t^2} + t - e^t$ et montrons que f est positive.

On a

$$\forall t \in \mathbb{R}, \quad f'(t) = 2te^{t^2} + 1 - e^t \quad \text{et} \quad f''(t) = (4t^2 + 2)e^{t^2} - e^t.$$

— Si $t \notin [0, 1]$, on a $f''(t) > 0$ car $t^2 \geq t$ et donc $(4t^2 + 2)e^{t^2} \geq 2e^t > e^t$.

— Si $t \in [0, 1]$, on écrit $f''(t) = e^{t^2}(4t^2 + 2 - e^{t-t^2})$.

Comme $t - t^2 \leq \frac{1}{4}$ pour $t \in [0, 1]$, on a $e^{t-t^2} \leq e^{\frac{1}{4}} < 2$ et donc $f''(t) > 0$.

La fonction f' croît sur $\mathbb{R}$.

Comme $f'(0) = 0$, elle est négative sur $\mathbb{R}_-$ et positive sur $\mathbb{R}_+$.

Le minimum de f est obtenu en 0 et vaut $f(0) = 0$.

Ainsi :

$$\forall t \in \mathbb{R}, \quad e^t \leq e^{t^2} + t.$$

Autre stratégie.

On peut aussi poser $f : t \mapsto \frac{e^{t^2} + t}{e^t} = e^{t^2 - t} + te^{-t}$.

Et il s'agit de montrer que f est supérieure à 1.

La fonction f est dérivable sur $\mathbb{R}$ et $f' : t \mapsto (2t - 1)e^{t^2 - t} + (1 - t)e^{-t}$.

Comme $e^{-t} > 0$, le réel $f'(t)$ est du signe de $g(t) := (2t - 1)e^{t^2} + (1 - t)$.

La fonction g est dérivable sur $\mathbb{R}$ et $g' : t \mapsto (4t^2 - 2t + 2)e^{t^2} - 1$.

Le minimum de $t \mapsto 4t^2 - 2t + 2$ vaut $\frac{7}{4}$ donc, pour tout $t \in \mathbb{R}$, on a $g'(t) \geq \frac{7}{4} - 1 > 0$.

Ainsi, la fonction g est croissante.

Comme $g(0) = 0$, la fonction g est négative sur $\mathbb{R}^-$ et positive sur $\mathbb{R}^+$.

Il en est de même de f' .

Le minimum de f est obtenu en 0 et il vaut $f(0) = 1$.

(d) En combinant les résultats des questions 1(a) et 1 (b), on a :

$$\mathbb{P}(S_n - np \geq nx) \leq (pe^{\lambda q} + qe^{-\lambda p})^n e^{-n\lambda x}.$$

Comme $e^{-n\lambda x} \geq 0$, il suffit pour obtenir le résultat souhaité de prouver que :

$$pe^{\lambda q} + qe^{-\lambda p} \leq e^{\lambda^2}.$$

En appliquant l'inégalité obtenue à la question 1 (c) à λq et $-\lambda p$, on a :

$$pe^{\lambda q} \leq pe^{\lambda^2 q^2} + pq\lambda \quad \text{et} \quad qe^{-\lambda p} \leq qe^{\lambda^2 p^2} - pq\lambda,$$

et ainsi :

$$pe^{\lambda q} + qe^{-\lambda p} \leq pe^{\lambda^2 q^2} + qe^{\lambda^2 p^2}.$$

En majorant $\lambda^2 q^2$ et $\lambda^2 p^2$ par λ^2 , on obtient :

$$pe^{\lambda q} + qe^{-\lambda p} \leq (p + q)e^{\lambda^2} = e^{\lambda^2},$$

d'où le résultat.

2. L'inégalité obtenue à la question ?? est vraie pour tout $\lambda > 0$. En choisissant la valeur de λ minimisant le membre de droite de l'inégalité, c'est-à-dire $x/2$, on obtient :

$$\mathbb{P}(S_n - np \geq nx) \leq e^{-\frac{nx^2}{4}}.$$

3. On a les égalités d'événements suivantes :

$$\{S_n - np \leq -nx\} = \{np - S_n \geq nx\} = \{n(1 - q) - S_n \geq nx\} = \{(n - S_n) - nq \geq nx\}.$$

La variable aléatoire $n - S_n$ est valeurs dans $\llbracket 0, n \rrbracket$, et, pour tout $k \in \llbracket 0, n \rrbracket$, on a :

$$\mathbb{P}(n - S_n = k) = \mathbb{P}(S_n = n - k) = \binom{n}{n-k} p^{n-k} (1-p)^k = \binom{n}{k} q^k (1-q)^{n-k},$$

donc la variable aléatoire $n - S_n$ suit la loi binomiale de paramètre (n, q) . Ainsi, on peut appliquer le résultat de la question précédente et obtenir :

$$\mathbb{P}((n - S_n) - nq \geq nx) \leq e^{-\frac{nx^2}{4}} \quad \text{d'où} \quad \mathbb{P}(S_n - np \leq -nx) \leq e^{-\frac{nx^2}{4}}.$$

4. On a :

$$\left\{ \left| \frac{S_n}{n} - p \right| \geq x \right\} = \{|S_n - np| \geq nx\} = \{S_n - np \geq nx\} \cup \{S_n - np \leq -nx\}.$$

Par sous-additivité, on obtient :

$$\mathbb{P}\left(\left| \frac{S_n}{n} - p \right| \geq x\right) \leq \mathbb{P}(S_n - np \geq nx) + \mathbb{P}(S_n - np \leq -nx),$$

puis en utilisant les inégalités précédemment obtenues :

$$\mathbb{P}\left(\left| \frac{S_n}{n} - p \right| \geq x\right) \leq 2e^{-\frac{nx^2}{4}}.$$

5. On a $E\left(\frac{S_n}{n}\right) = p$ et $V\left(\frac{S_n}{n}\right) = \frac{p(1-p)}{n}$.

L'inégalité de Bienaymé-Tchebychev donne :

$$\mathbb{P}\left(\left| \frac{S_n}{n} - p \right| \geq x\right) \leq \frac{p(1-p)}{nx^2}$$

Pour les grandes valeurs de n , l'inégalité de Bernstein fournit des inégalités nettement plus fines que l'inégalité de BT.