

Correction du DM n° 5

Le 14/11/23

Partie A

1.

$$[X = 2] = P_1 \cap P_2$$

donc par indépendance

$$P(X = 2) = P(P_1)P(P_2) = \frac{1}{2} \times \frac{1}{2}$$

D'autre part

$$[X = 3] = F_1 \cap P_2 \cap P_3 \quad [X = 4] = F_2 \cap P_3 \cap P_4$$

$$a_2 = \frac{1}{4}, a_3 = a_4 = \frac{1}{8}.$$

2. On a

$$U_n = [X \leq n] = \bigcup_{k=2}^n [X = k]$$

Comme l'union est disjointe

$$\text{pour tout entier } n \text{ supérieur ou égal à } 2 : u_n = \sum_{k=2}^n a_k.$$

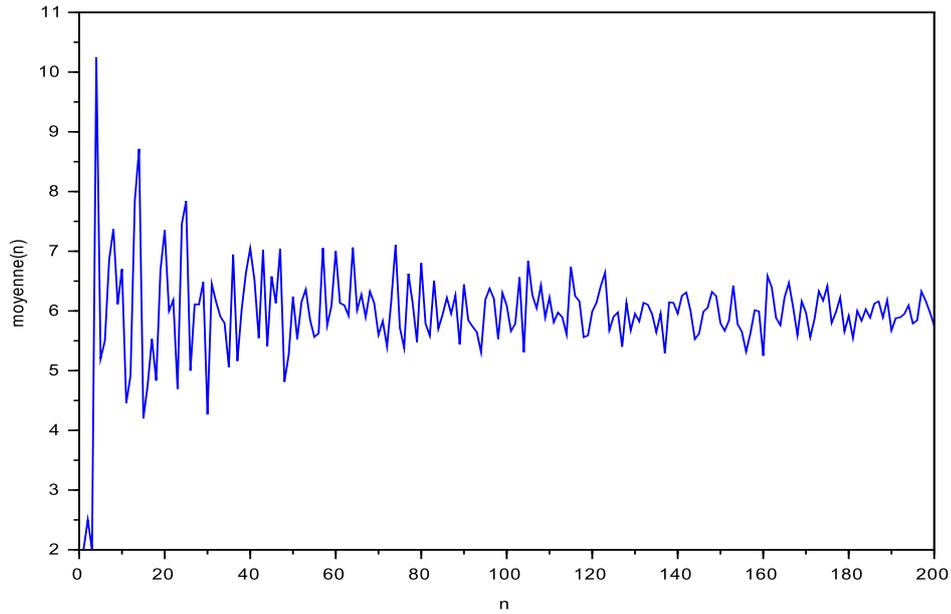
3. (c)

```
1 def simulX():
2     tirs = 0
3     pile = 0
4     while pile < 2
5         if rand() < 1/2:
6             pile = pile + 1
7         else:
8             pile = 0
9         tirs = tirs+1
10    return(tirs)
```

(b)

```
1 def moyenne(n)
2     s=0
3     for i in range(1,n+1):
4         s=s+simulX()
5     end
6     return(s/n)
```

(c) On calcule `moyenne(n)` pour chaque entier `n` de $\llbracket 1, 200 \rrbracket$, et on trace les résultats obtenus dans le graphe suivant.



Quand n devient grand on obtient une estimation de l'espérance de X

X a une espérance proche de 6.

Partie B

1. (a) Soit $n \in \mathbb{N} \setminus \{0, 1\}$

$$U_{n+1} = U_n \cup B_{n+1}$$

Comme les deux événements ne sont pas incompatibles, il faut utiliser la formule du crible

$$P(U_{n+1}) = P(U_n) + P(B_{n+1}) - P(U_n \cap B_{n+1})$$

$$P(U_{n+1}) = P(U_n) + P(B_{n+1}) - P(U_n \cap B_{n+1}).$$

- (b) On a $\Omega = P_{n-1} \cup F_{n-1}$

donc

$$U_n \cap B_{n+1} = (U_n \cap B_{n+1} \cap P_{n-1}) \cup (U_n \cap B_{n+1} \cap F_{n-1})$$

Or

$$U_n \cap F_{n-1} = U_{n-2} \cap F_{n-1}$$

car il le double pile arrive avant ou au moment du tir n et que le tir $n - 1$ est un Face alors le double pile arrive avant ou moment du tir $n - 2$.

Donc

$$U_n \cap B_{n+1} \cap F_{n-1} = U_{n-2} \cap F_{n-1} \cap P_n \cap P_{n+1}$$

De plus comme $P_{n-1} \cap P_n \subset U_n$

$$U_n \cap P_{n-1} \cap P_n$$

et donc

$$U_n \cap B_{n+1} \cap P_{n-1} = U_n \cap P_{n-1} \cap P_n \cap P_{n+1} = \cap P_{n-1} \cap P_n \cap P_{n+1}$$

$$\boxed{U_n \cap B_{n+1} = (U_{n-2} \cap F_{n-1} \cap P_n \cap P_{n+1}) \cup (P_{n-1} \cap P_n \cap P_{n+1})}$$

(c) Soit n supérieur ou égal à 4. ($U_{n-2} \cap F_{n-1} \cap P_n \cap P_{n+1}$ et $(P_{n-1} \cap P_n \cap P_{n+1})$ sont incompatibles à causes des événements F_{n-1} et P_{n-1} .)

On constate que U_{n-2} qui dépend des résultats des tirs 1 à $n-2$ est indépendant de des résultats des tirs $n-1$, n

$$\begin{aligned} P(U_n \cap B_{n+1}) &= P((U_{n-2} \cap F_{n-1} \cap P_n \cap P_{n+1}) \cup (P_{n-1} \cap P_n \cap P_{n+1})) && \text{question précédente} \\ &= P(U_{n-2} \cap F_{n-1} \cap P_n \cap P_{n+1}) + P(P_{n-1} \cap P_n \cap P_{n+1}) && \text{incompatibilité} \\ &= P(U_{n-2}) P(F_{n-1}) P(P_n) P(P_{n+1}) + P(P_{n-1}) P(P_n) P(P_{n+1}) && \text{indépendance} \\ &= u_{n-2} \left(\frac{1}{2}\right)^3 + \left(\frac{1}{2}\right)^3 \\ &= \frac{1}{8}u_{n-2} + \frac{1}{8} \end{aligned}$$

En utilisant 1.a, et comme $P(B_{n+1}) = P(P_{n-1}) P(P_n) = \frac{1}{2} \times \frac{1}{2}$

$$u_{n+1} = u_n + \frac{1}{4} - u_{n-2} \frac{1}{8} - \frac{1}{8}$$

donc

$$u_{n+1} = u_n + \frac{1}{8} - u_{n-2} \frac{1}{8}$$

$$\boxed{\text{pour tout entier } n \text{ supérieur ou égal à } 4 : u_{n+1} = u_n + \frac{1}{8} (1 - u_{n-2})}$$

2. Soit $n \geq 4$

$$u_{n+1} - u_n = \frac{1}{8}(1 - u_n)$$

Or comme u_{n-2} est une probabilité, $0 \leq u_n \leq 1$ donc

$$u_{n+1} - u_n \leq 0$$

$\boxed{\text{La suite } (u_n)_{n \geq 4} \text{ est croissante.}}$

Comme de plus elle majorée par 1, d'après le théorème de la limite monotone elle converge vers une limite ℓ .

Attention : Ce théorème ne permet pas de calculer la limite.

On sait que

$$\forall n \in \mathbb{N} \llbracket 4; +\infty \llbracket \quad u_{n+1} = u_n + \frac{1}{8} (1 - u_{n-2})$$

en passant à la limite

$$\ell = \ell + \frac{1}{8}(1 - \ell)$$

$$\boxed{\ell = 1}$$

3. Les valeurs prises par X étant dans $\mathbb{N} \cup \{-1\}$ la première égalité est juste. Pour $n \in \mathbb{N}$ $U_n = [X \leq n]$ étant une suite d'événements croissante car

$$\forall n \in \mathbb{N} \setminus \{0, 1\} \quad [X \leq n] \subset [X \leq n + 1]$$

Ou de façon plus intuitive si le premier « Pile Pile » arrive avant ou au tirage n , alors a fortiori cette séquence arrive avant le rang $n + 1$.

Le théorème de la limite monotone chapitre probabilités de ECE1 affirme alors que

$$P\left(\bigcup_{n=2}^{+\infty} U_n\right) = \lim_{n \rightarrow +\infty} P(U_n)$$

et cette limite vaut 1 d'après la question précédente

$$\boxed{P([X = -1]) = 1 - P\left(\bigcup_{n=2}^{+\infty} U_n\right) = 0}$$

On vient de montrer qu'il est presque certain d'obtenir deux « Pile » successifs.

Partie C

Dans cette partie, on pose pour tout entier $n \geq 2$:

$$v_n = 1 - u_n \quad \text{et} \quad S_n = \sum_{k=2}^n k P([X = k])$$

1. Soit n un entier supérieur ou égal à 4.

$$\begin{aligned} v_n - v_{n+1} &= 1 - u_n - 1 + u_{n+1} \\ &= u_{n+1} - u_n \\ &= u_n + \frac{1}{8}(1 - u_{n-2}) - u_n && \text{résultat B.1.c} \\ &= \frac{1}{8}(1 - u_{n-2}) \\ &= \frac{1}{8}v_{n-2} \end{aligned}$$

$$\boxed{\text{Pour tout entier } n \text{ supérieur ou égal à 4 : } v_n - v_{n+1} = \frac{1}{8} v_{n-2}}$$

2. la formule $P(A \setminus B) = P(A) - P(B)$ est valable si $A \subset B$.

Soit n un entier supérieur ou égal à 2.

$$[X = n + 1] \cup [X \leq n] = [X \leq n + 1]$$

et l'union est disjointe donc

$$P([X = n + 1]) + u_n = u_{n+1}$$

puis

$$P([X = n + 1]) = u_{n+1} - u_n = 1 - v_{n+1} - (1 - v_n)$$

Pour tout entier n supérieur ou égal à 2 : $P([X = n + 1]) = v_n - v_{n+1}$

3. **Initialisation** : Soit $n = 2$

$$S_2 = 2P(X = 2) = 2 \times \frac{1}{4} = \frac{1}{2}$$

et

$$v_2 = 1 - u_2 = 1 - \frac{1}{4} = \frac{3}{4}$$

$$\begin{aligned} v_4 &= 1 - u_4 = 1 - (a_2 + a_3 + a_4) \\ &= 1 - \left(\frac{1}{4} + \frac{1}{8} + \frac{1}{8}\right) \\ &= \frac{1}{2} \end{aligned}$$

question A.1.a

$$6 - 8v_{2+2} - 2v_2 = 6 - 4 - 2 \times \frac{3}{4} = \frac{1}{2}$$

$$S_n = 6 - 8v_4 - nv_2$$

Hérédité : Soit $n \in \mathbb{N} \setminus \{0, 1\}$ tel que

$$S_n = 6 - 8v_{n+2} - nv_n$$

La question C.3 donne

$$8v_{n+2} - v_n = 8v_{n+3}$$

Alors

$$\begin{aligned} S_{n+1} &= \sum_{k=2}^{n+1} kP(X = k) \\ &= \sum_{k=2}^n kP(X = k) + (n+1)P(X = n+1) \\ &= S_n + (n+1)P(X = n+1) \\ &= S_n + (n+1)(v_n - v_{n+1}) \\ &= 6 - 8v_{n+2} - nv_n + (n+1)(v_n - v_{n+1}) \\ &= 6 - 8v_{n+2} - v_n - (n+1)v_{n+1} \\ &= 6 - 8v_{n+3} - (n+1)v_{n+1} \end{aligned}$$

question précédente

hypothèse de récurrence

remarque préliminaire

Conclusion :

Pour tout entier n supérieur ou égal à 2 : $S_n = 6 - 8v_{n+2} - nv_n$

4. On a montré que

$$\forall n \in \mathbb{N} \setminus \{0, 1\} \quad S_{n+1} = S_n + (n+1)P(X = n+1)$$

comme une probabilité est positive, cela démontre que la suite (S_n) est croissante.

De plus la question précédente et le fait que (v_n) en tant que suite de probabilités est à termes positifs permet de démontrer que

$$\forall n \in \mathbb{N} \setminus \{0, 1\} \quad S_n \leq 6$$

La suite $(S_n)_{n \geq 2}$, est croissante et majorée.

5. En utilisant le théorème de la limite monotone on en déduit que la suite $(S_n)_{n \geq 2}$ est convergent, cela signifie que la série $\sum_{k \geq 2} kP(X = k)$ converge et comme X est à valeurs positives, la convergence absolue se confond avec la convergence

X admet une espérance

6. (a) D'après la question 3, pour tout entier n plus grand que 2

$$nv_n = 6 - 8v_{n+2} - S_n$$

Or on sait que les suite $(v_n)_{n \geq 2}$ et $(S_n)_{n \geq 2}$ convergent, donc

La suite $(nv_n)_{n \geq 2}$ converge vers un réel λ

- (b) Si λ est non nul, alors

$$nv_n \sim_{+\infty} \lambda$$

donc

$$v_n \sim_{+\infty} \frac{\lambda}{n}$$

Or $\sum \frac{\lambda}{n}$ est une série de Riemann divergente, en, utilisant le théorème de comparaison sur les séries à termes positifs

Si $\lambda \neq 0$ la série $\sum_{n \geq 2} v_n$ diverge.

Soit $N \geq 4$

$$\begin{aligned} \sum_{k=4}^N v_k &= 8 \sum_{k=4}^N (v_{n+2} - v_n) && \text{question C.1} \\ &= 8(v_{N+2} + v_{N+1} - v_5 - v_4) && \text{télescopage} \end{aligned}$$

Comme (v_n) converge cela démontre que la série $\sum v_n$ converge. Il y a donc contradiction

$\lambda = 0$

- (c) En utilisant C.3 et

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} v_n = 0 \quad \lim_{n \rightarrow +\infty} nv_n = 0$$

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} S_n = 6$$

X admet une espérance égale à 6.

Exercice n°2

Pour tout entier naturel n , on pose $u_n = \int_0^1 (1-t^2)^n dt$. On a donc, en particulier, $u_0 = 1$.

1.

$$\begin{aligned}u_0 &= \int_0^1 (1-t^2)^0 dt \\ &= \int_0^1 1 dt \\ &= 1\end{aligned}$$

$$\begin{aligned}u_1 &= \int_0^1 (1-t^2)^1 dt \\ &= \left[t - \frac{t^3}{3} \right]_0^1 \\ &= 1 - \frac{1}{3} \\ &= \frac{2}{3}\end{aligned}$$

$$\begin{aligned}u_2 &= \int_0^1 (1-t^2)^2 dt \\ &= \int_0^1 (1-2t^2+t^4) dt \\ &= \left[t - \frac{2}{3}t^3 + \frac{t^5}{5} \right]_0^1 \\ &= 1 - \frac{2}{3} + \frac{1}{5} \\ &= \frac{8}{15}\end{aligned}$$

$$\boxed{u_1 = \frac{2}{3} \text{ et } u_2 = \frac{8}{15}.}$$

2. (a) Soit $n \in \mathbb{N}$ et $t \in [0; 1]$, on a

$$0 \leq t^2 \leq 1$$

donc

$$0 \leq 1 - t^2 \leq 1$$

donc

$$0 \leq (1-t^2)^{n+1} \leq (1-t^2)^n \leq 1$$

Comme $0 \leq 1$ et par croissance de l'intégrale

$$\int_0^1 0 dt \leq \int_0^1 (1-t^2)^{n+1} dt \leq \int_0^1 (1-t^2)^n dt \leq \int_0^1 1 dt$$

$\boxed{\text{La suite } (u_n)_{n \in \mathbb{N}} \text{ est décroissante}}$

- (b) On a aussi démontré dans la question précédente que la suite était positive, minorée par 0. D'après le théorème de la limite monotone

La suite (u_n) est convergente.

3. (a) Il suffit de choisir $\sigma = \frac{1}{\sqrt{2n}}$ alors l'indication donne

$$\int_{-\infty}^{+\infty} \frac{1}{\frac{1}{\sqrt{2n}}\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{nt^2}{1}} dt = 1$$

$$\int_{-\infty}^{+\infty} e^{-nt^2} dt = \sqrt{\frac{\pi}{n}}$$

Comme la fonction $t \mapsto \exp(-nt^2)$ est paire⁽¹⁾

$$\int_0^{+\infty} e^{-nt^2} dt = \frac{1}{2} \int_{-\infty}^{+\infty} e^{-nt^2} dt$$

$$\int_0^{+\infty} e^{-nt^2} dt = \frac{1}{2} \sqrt{\frac{\pi}{n}}$$

- (b) L'inégalité de convexité classique

$$\forall x \in \mathbb{R} \quad 1 + x \leq e^x$$

On posant $x = -t^2$ pour $t \in \mathbb{R}$

$$\forall t \in \mathbb{R} \quad 1 - t^2 \leq e^{-t^2}$$

Pour tout réel t , on a : $e^{-t^2} \geq 1 - t^2$.

- (c) On a donc pour $t \in [0; 1]$

$$0 \leq 1 - t^2 \leq e^{-t^2}$$

donc

$$0 \leq ((1 - t^2)^n \leq (e^{-t^2})^n$$

$$\int_0^1 0 dt \leq \int_0^1 ((1 - t^2)^n dt \leq \int_0^1 (e^{-t^2})^n dt$$

donc

$$0 \leq u_n \leq \int_0^1 (e^{-t^2})^n dt \leq \int_0^{+\infty} (e^{-t^2})^n dt$$

La dernière inégalité découlant de la positivité de l'intégrande.

Et donc

Pour tout $n \in \mathbb{N}$, $0 \leq u_n \leq \frac{1}{2} \sqrt{\frac{\pi}{n}}$

(1). limite des résultats du programme, on peut montrer avec le changement de variable $u = -t$ que si f est paire et que les intégrales convergent $\int_{-\infty}^0 f(t) dt = \int_0^{+\infty} f(t) dt$

En utilisant le théorème des encadrements :

$$\boxed{\lim_{n \rightarrow +\infty} u_n = 0}$$

4. Soit $n \in \mathbb{N}$

$$\begin{aligned} \int_0^1 (1-t)^n dt &= \left[-\frac{(1-t)^{n+1}}{n+1} \right]_0^1 \\ &= \frac{1}{n+1} \end{aligned}$$

Or pour $t \in [0; 1]$

$$0 \leq t^2 \leq t \leq 1$$

Donc

$$0 \leq 1-t \leq 1-t^2 \leq 1$$

Puis

$$0 \leq (1-t)^n \leq (1-t^2)^n \leq 1$$

Donc

$$\int_0^1 (1-t)^n dt \leq u_n$$

$$\boxed{\text{Pour } n \in \mathbb{N}, u_n \geq \frac{1}{n+1}.$$

On a

$$\forall n \in \mathbb{N} \quad 0 \leq \frac{1}{n+1} \leq u_n$$

Or la série harmonique $\sum \frac{1}{n}$ diverge, donc en utilisant le critère de convergence des séries à termes positifs

$$\boxed{\text{La série } \sum u_n \text{ diverge.}}$$

5. (a) Soit $n \in \mathbb{N}$

$$\begin{aligned} u_{n+1} &= \int_0^1 (1-t^2)^{n+1} dt \\ &= \int_0^1 (1-t^2)^{n+1} 1 dt \end{aligned}$$

On pose pour $t \in [0; 1]$

$$\begin{aligned} f(t) &= t & f'(t) &= 1 \\ g(t) &= (1-t^2)^{n+1} & g'(t) &= -2(n+1)t(1-t^2)^n \end{aligned}$$

Comme ces fonctions sont classe de \mathcal{C}^1 sur $[0; 1]$.

$$\begin{aligned} u_{n+1} &= [t(1-t^2)^{n+1}]_0^1 + 2(n+1) \int_0^1 t^2(1-t^2)^n dt \\ &= 0 - 0 + 2(n+1) \int_0^1 (t^2 - 1 + 1)(1-t^2)^n dt \\ &= (2n+2) \left[\int_0^1 (t^2 - 1)(1-t^2)^n dt + \int_0^1 (1-t^2)^n dt \right] \\ &= (2n+2) \left[- \int_0^1 (1-t^2)^{n+1} dt + \int_0^1 (1-t^2)^n dt \right] \\ &= (2n+2)(u_n - u_{n+1}) \end{aligned}$$

Pour tout entier naturel n , on a : $u_{n+1} = (2n + 2)(u_n - u_{n+1})$

(b) On a pour $n \in \mathbb{N}$

$$u_{n+1} = (2n + 2)u_n - (2n + 2)u_{n+1}$$

et donc

$$u_{n+1} = \frac{2n + 2}{2n + 3}u_n$$

Démontrons l'égalité par récurrence

- **Initialisation** $u_0 = 1$ et

$$\frac{4^0(0!)^2}{(2 \times 0 + 1)!} = 1$$

- **Hérédité** Soit $n \in \mathbb{N}$ supposons que

$$u_n = \frac{4^n(n!)^2}{(2n + 1)!}$$

alors

$$\begin{aligned} u_{n+1} &= \frac{2n + 2}{2n + 3}u_n \\ &= \frac{2n + 2}{2n + 3} \cdot \frac{4^n(n!)^2}{(2n + 1)!} \\ &= (2n + 2) \cdot \frac{4^n(n!)^2}{(2n + 3)(2n + 1)!} \\ &= (2n + 2)(2n + 2) \cdot \frac{4^n(n!)^2}{(2n + 3)(2n + 2)(2n + 1)!} \\ &= (2n + 2)^2 \cdot \frac{4^n(n!)^2}{(2n + 3)!} \\ &= 4(n + 1)^2 \cdot \frac{4^n(n!)^2}{(2n + 3)!} \\ &= \frac{4^{n+1}((n + 1)!)^2}{(2(n + 1) + 1)!} \end{aligned}$$

- **Conclusion** Par récurrence

$$\text{Pour } n \in \mathbb{N} \quad u_n = \frac{4^n(n!)^2}{(2n + 1)!}$$

(c) L'indication donne

$$(2n)! \underset{+\infty}{\sim} \sqrt{4\pi n} (2n)^2 n e^{-2n}$$

et

$$2n + 1 \sim 2n$$

Donc

$$(2n)! \underset{+\infty}{\sim} \sqrt{4\pi n} 4^n n^2 n e^{-2n}$$

et

$$(n!)^2 \underset{+\infty}{\sim} \left(\sqrt{2\pi n}\right)^2 n^{2n} e^{-2n}$$

Donc

$$u_n \underset{+\infty}{\sim} \frac{4^n 2\pi n n^{2n} e^{-2n}}{2n \sqrt{4\pi n} 4^n (n)^{2n} e^{-2n}}$$

donc

$$u_n \underset{+\infty}{\sim} \frac{\pi}{\sqrt{4\pi n}}$$

$$u_n \underset{+\infty}{\sim} \frac{\sqrt{\pi}}{2\sqrt{n}}$$

$$u_n \underset{+\infty}{\sim} \frac{1}{2} \sqrt{\frac{\pi}{n}}$$

6. Informatique.

On admet que, si \mathbf{t} est un vecteur, la commande `np.prod(t)` renvoie le produit des éléments de \mathbf{t} . Compléter le script Python suivant afin qu'il permette de calculer et d'afficher la valeur de u_n pour une valeur n entrée par l'utilisateur.

```
import numpy as np

n=int(input('entrez une valeur pour n : '))
x=np.arange(1,n+1,1)
m=2*n+1
y=np.arange(1,m+1,1)
v=np.prod(x)
w=np.prod(y)
u=4**n*(v**2)/w
print(u)
```