

- s'il est loué à Rosnoën un certain jour, alors il est laissé le lendemain à Landerneau avec la probabilité  $\frac{1}{4}$ , tandis qu'il est laissé à Milizac avec la probabilité  $\frac{3}{4}$ .
- s'il est loué à Landerneau un certain jour, alors il est laissé le lendemain à Rosnoën avec la probabilité  $\frac{1}{2}$ , tandis qu'il est laissé à Milizac avec la probabilité  $\frac{1}{4}$  et à ramené à Landerneau avec la probabilité  $\frac{1}{4}$ .
- s'il est loué à Miliza, il est laissé à Rosnoën avec la probabilité  $\frac{1}{2}$ , laissé à Landerneau avec la probabilité  $\frac{1}{4}$  et ramené à Milizac avec la probabilité  $\frac{1}{4}$ .

$R_n$ : “Le vélo se trouve à Rosnoën le $n$ -ième jour”	et	$r_n = P(R_n)$
$L_n$ : “Le vélo se trouve à Landerneau le $n$ -ième jour”	et	$\ell_n = P(L_n)$
$M_n$ : “Le vélo se trouve à Milizac le $n$ -ième jour”	et	$m_n = P(M_n)$

1. (a) Donner  $r_0$ ,  $\ell_0$  et  $m_0$ .

$$r_0 = 1, \quad \ell_0 = 0 \quad \text{et} \quad m_0 = 0.$$

Figure 1: An extensive form game tree. The root node branches into three nodes:  $R_0$  (top),  $L_0$  (middle), and  $M_0$  (bottom). From  $R_0$ , three branches lead to  $R_1$  (top),  $L_1$  (middle), and  $M_1$  (bottom) with payoffs  $(0, \frac{1}{4}, \frac{3}{4})$  respectively. From  $L_0$ , three branches lead to  $R_1$  (top),  $L_1$  (middle), and  $M_1$  (bottom) with payoffs  $(\frac{1}{2}, \frac{1}{4}, \frac{1}{4})$  respectively. From  $M_0$ , three branches lead to  $R_1$  (top),  $L_1$  (middle), and  $M_1$  (bottom) with payoffs  $(\frac{1}{2}, \frac{1}{4}, \frac{1}{4})$  respectively. The branches from the root to  $R_0$ ,  $L_0$ , and  $M_0$  are labeled 1, 0, and 0 respectively.

Comme le système  $(R_0, L_0, M_0)$  est un système complet d'évènements (le jour 0 le vélo se situe soit à Rosnoën, soit à Landerneau, soit à Milizac), par la **formule des**

$$\ell_1 = \frac{1}{4} \quad \text{et} \quad m_1 = \frac{3}{4}.$$

The diagram illustrates a game tree for a three-player extensive form game. The root node branches into three nodes:  $R_n$ ,  $L_n$ , and  $M_n$ . The edges are labeled  $r_n$ ,  $l_n$ , and  $m_n$  respectively. From  $R_n$ , three branches lead to  $R_{n+1}$  (with probability 0),  $L_{n+1}$  (with probability  $\frac{1}{4}$ ), and  $M_{n+1}$  (with probability  $\frac{3}{4}$ ). From  $L_n$ , three branches lead to  $R_{n+1}$  (with probability  $\frac{1}{2}$ ),  $L_{n+1}$  (with probability  $\frac{1}{4}$ ), and  $M_{n+1}$  (with probability  $\frac{1}{4}$ ). From  $M_n$ , three branches lead to  $R_{n+1}$  (with probability  $\frac{1}{2}$ ),  $L_{n+1}$  (with probability  $\frac{1}{4}$ ), and  $M_{n+1}$  (with probability  $\frac{1}{4}$ ).

$$r_{n+1} = \frac{1}{2}\ell_n + \frac{1}{2}m_n.$$

(c) Déterminer une relation analogue entre  $\ell_{n+1}$  et  $r_n, \ell_n$  et  $m_n$ .

Soit  $n \in \mathbb{N}$ . De manière analogue, comme le système  $(R_n, L_n, M_n)$  est un système complet d'évènements (le jour  $n$  le vélo se situe soit à Rosnoën, soit à Landerneau, soit à Milizac), par la **formule des probabilités totales**, on a

$$\begin{aligned}\ell_{n+1} &= P(R_n)P_{R_n}(L_{n+1}) + P(L_n)P_{L_n}(L_{n+1}) + P(M_n)P_{M_n}(L_{n+1}) \\ &= r_n \times \frac{1}{4} + \ell_n \times \frac{1}{4} + m_n \times \frac{1}{4} \\ &= \frac{1}{4}r_n + \frac{1}{4}\ell_n + \frac{1}{4}m_n.\end{aligned}$$

Donc, finalement,

$$\ell_{n+1} = \frac{1}{4}r_n + \frac{1}{4}\ell_n + \frac{1}{4}m_n.$$

(d) Déterminer une relation analogue entre  $m_{n+1}$  et  $r_n, \ell_n$  et  $m_n$ .

De la même manière, on obtient que

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad m_{n+1} = \frac{3}{4}r_n + \frac{1}{4}\ell_n + \frac{1}{4}m_n.$$

3. On introduit, pour tout  $n \in \mathbb{N}$ , la notation

$$U_n = \begin{pmatrix} r_n \\ \ell_n \\ m_n \end{pmatrix}.$$

(a) Donner  $U_0$ .

En utilisant la question 1(a), on a

$$U_0 = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}.$$

(b) À l'aide des questions 2(b), 2(c) et 2(d), déterminer une matrice  $A \in \mathcal{M}_3(\mathbb{R})$  telle que

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad U_{n+1} = AU_n.$$

Soit  $n \in \mathbb{N}$ . À l'aide des questions 2(b), 2(c) et 2(d), on a

$$U_{n+1} = \begin{pmatrix} r_{n+1} \\ \ell_{n+1} \\ m_{n+1} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \frac{1}{2}\ell_n + \frac{1}{2}m_n \\ \frac{1}{4}r_n + \frac{1}{4}\ell_n + \frac{1}{4}m_n \\ \frac{3}{4}r_n + \frac{1}{4}\ell_n + \frac{1}{4}m_n \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & \frac{1}{2} & \frac{1}{2} \\ \frac{1}{4} & \frac{1}{4} & \frac{1}{4} \\ \frac{3}{4} & \frac{1}{4} & \frac{1}{4} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} r_n \\ \ell_n \\ m_n \end{pmatrix} = AU_n,$$

avec

$$A = \begin{pmatrix} 0 & \frac{1}{2} & \frac{1}{2} \\ \frac{1}{4} & \frac{1}{4} & \frac{1}{4} \\ \frac{3}{4} & \frac{1}{4} & \frac{1}{4} \end{pmatrix} = \frac{1}{4} \begin{pmatrix} 0 & 2 & 2 \\ 1 & 1 & 1 \\ 3 & 1 & 1 \end{pmatrix}$$

(c) Démontrer alors par récurrence que

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad U_n = A^n U_0.$$

Montrons, par récurrence, que pour tout  $n \in \mathbb{N}$ , la propriété  $\mathcal{P}(n)$  : «  $U_n = A^n U_0$  » est vraie.

- *Initialisation* : Montrons que  $\mathcal{P}(0)$  est vraie, c'est-à-dire que  $U_0 = A^0 U_0$ . Par convention  $A^0 = I_3$ . Donc, on a bien  $U_0 = A^0 U_0$ . Donc la propriété  $\mathcal{P}(0)$  est vraie.

- *Hérédité* : Soit  $n \in \mathbb{N}$ . On suppose que  $\mathcal{P}(n)$  est vraie, c'est-à-dire que  $U_n = A^n U_0$ . Montrons que  $\mathcal{P}(n+1)$  est vraie, c'est-à-dire que  $U_{n+1} = A^{n+1} U_0$ . Par construction (cf. question 3(b)),

$$U_{n+1} = AU_n.$$

Donc, en utilisant l'hypothèse de récurrence, on obtient

$$U_{n+1} = AU_n = AA^n U_0 = A^{n+1} U_0.$$

Donc  $\mathcal{P}(n+1)$  est vraie.

- *Conclusion* : Donc, par principe de récurrence, on obtient

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad U_n = A^n U_0.$$

4. On considère la matrice

$$P = \begin{pmatrix} 4 & 1 & 0 \\ 3 & 0 & 1 \\ 5 & -1 & -1 \end{pmatrix}$$

(a) Montrer que pour tout  $B \in \mathcal{M}_{3,1}(\mathbb{R})$ , l'équation  $PX = B$  admet une unique solution  $X \in \mathcal{M}_{3,1}(\mathbb{R})$ . En déduire que  $P$  est inversible et expliciter  $P^{-1}$ .

Soient

$$B = \begin{pmatrix} \alpha \\ \beta \\ \gamma \end{pmatrix} \in \mathcal{M}_{3,1}(\mathbb{R}) \quad \text{et} \quad X = \begin{pmatrix} x \\ y \\ z \end{pmatrix} \in \mathcal{M}_{3,1}(\mathbb{R}).$$

On a

$$\begin{aligned}PX = B &\Leftrightarrow \begin{pmatrix} 4 & 1 & 0 \\ 3 & 0 & 1 \\ 5 & -1 & -1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \\ z \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \alpha \\ \beta \\ \gamma \end{pmatrix} \\ &\Leftrightarrow \begin{cases} 4x + y = \alpha \\ 3x + z = \beta \\ 5x - y - z = \gamma \end{cases} \\ &\Leftrightarrow \begin{cases} 4x + y = \alpha \\ -\frac{3}{4}y + z = \beta - \frac{3}{4}\alpha & L_2 \leftarrow L_2 - \frac{3}{4}L_1 \\ -\frac{5}{4}y - z = \gamma - \frac{5}{4}\alpha & L_3 \leftarrow L_3 - \frac{5}{4}L_1 \end{cases} \\ &\Leftrightarrow \begin{cases} 4x - y = \alpha \\ -\frac{4}{3}y + z = \beta - \frac{4}{3}\alpha \\ -4z = \alpha - 3\beta + \gamma & L_3 \leftarrow L_3 - 3L_2 \end{cases} \\ &\Leftrightarrow \begin{cases} 4x - y = \alpha \\ -\frac{4}{3}y + z = \beta - \frac{4}{3}\alpha \\ z = -\frac{1}{4}\alpha + \frac{3}{4}\beta - \frac{1}{4}\gamma \end{cases} \\ &\Leftrightarrow \begin{cases} 4x - y = \alpha \\ y = \frac{2}{3}\alpha - \frac{1}{3}\beta - \frac{1}{3}\gamma \\ z = -\frac{1}{4}\alpha + \frac{3}{4}\beta - \frac{1}{4}\gamma \end{cases} \\ &\Leftrightarrow \begin{cases} x = \frac{1}{12}\alpha + \frac{1}{12}\beta + \frac{1}{12}\gamma \\ y = \frac{2}{3}\alpha - \frac{1}{3}\beta - \frac{1}{3}\gamma \\ z = -\frac{1}{4}\alpha + \frac{3}{4}\beta - \frac{1}{4}\gamma \end{cases} \end{aligned}$$

Donc, l'équation  $PX = B$  admet une unique solution donnée par

$$X = \begin{pmatrix} \frac{1}{12}\alpha + \frac{1}{12}\beta + \frac{1}{12}\gamma \\ \frac{2}{3}\alpha - \frac{1}{3}\beta - \frac{1}{3}\gamma \\ -\frac{1}{4}\alpha + \frac{3}{4}\beta - \frac{1}{4}\gamma \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \frac{1}{12} & \frac{1}{12} & \frac{1}{12} \\ \frac{2}{3} & -\frac{1}{3} & -\frac{1}{3} \\ -\frac{1}{4} & \frac{3}{4} & -\frac{1}{4} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \alpha \\ \beta \\ \gamma \end{pmatrix}$$

On en déduit que  $P$  est inversible et que

$$P^{-1} = \begin{pmatrix} \frac{1}{12} & \frac{1}{12} & \frac{1}{12} \\ \frac{5}{3} & -\frac{1}{3} & -\frac{1}{3} \\ -\frac{1}{4} & \frac{3}{4} & -\frac{1}{4} \end{pmatrix}.$$

(b) On note  $D = P^{-1}AP$ . Montrer que  $A = PDP^{-1}$ .

Comme  $P$  est inversible, on peut multiplier la relation  $D = P^{-1}AP$  à gauche par la matrice  $P$  pour obtenir,

$$PD = PP^{-1}AP = AP,$$

car  $PP^{-1} = I_3$ . De même, en multipliant par  $P^{-1}$  la relation précédente, on obtient

$$PDP^{-1} = A.$$

(c) Montrer que  $D$  est une matrice diagonale.

En effectuant deux produits matriciels, on a

$$\begin{aligned} D &= P^{-1}AP \\ &= \begin{pmatrix} \frac{1}{12} & \frac{1}{12} & \frac{1}{12} \\ \frac{5}{3} & -\frac{1}{3} & -\frac{1}{3} \\ -\frac{1}{4} & \frac{3}{4} & -\frac{1}{4} \end{pmatrix} \frac{1}{4} \begin{pmatrix} 0 & 2 & 2 \\ 1 & 1 & 1 \\ 3 & 1 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 4 & 1 & 0 \\ 3 & 0 & 1 \\ 5 & -1 & -1 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} \frac{1}{12} & \frac{1}{12} & \frac{1}{12} \\ \frac{5}{3} & -\frac{1}{3} & -\frac{1}{3} \\ -\frac{1}{4} & \frac{3}{4} & -\frac{1}{4} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 4 & -\frac{1}{2} & 0 \\ 3 & 0 & 0 \\ 5 & \frac{1}{2} & 0 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & -\frac{1}{2} & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix} \end{aligned}$$

(d) En déduire, pour tout  $n \in \mathbb{N}$ , l'expression de  $D^n$ .

En utilisant l'expression de  $D$  donnée à la question 4(c), par une récurrence immédiate, on obtient que

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad D^n = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & (-\frac{1}{2})^n & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}$$

(e) Montrer par récurrence que,

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad A^n = PD^nP^{-1}.$$

Montrons par récurrence que pour tout  $n \in \mathbb{N}$ , la propriété

$$\mathcal{P}(n) : \ll A^n = PD^nP^{-1} \gg$$

est vraie.

- *Initialisation.* Montrons que  $\mathcal{P}(0)$  est vraie, c'est-à-dire que  $A^0 = PD^0P^{-1}$ . D'une part  $A^0 = I_3$ . D'autre part,  $PD^0P^{-1} = PI_3P^{-1} = PP^{-1} = I_3$ . Donc la propriété  $\mathcal{P}(0)$  est vraie.
- *Hérédité.* Soit  $n \in \mathbb{N}$ . Supposons que la propriété  $\mathcal{P}(n)$  soit vraie, c'est-à-dire que

$$A^n = PD^nP^{-1}.$$

Montrons que la propriété  $\mathcal{P}(n+1)$  est vraie, c'est-à-dire que

$$A^{n+1} = PD^{n+1}P^{-1}.$$

D'après la question 4(b), on a  $A = PDP^{-1}$ , donc,

$$A^{n+1} = A^n \times A = A^n PDP^{-1}.$$

Puis, en utilisant l'hypothèse de récurrence, on a

$$A^{n+1} = PD^nP^{-1}PDP^{-1} = PD^nI_3DP^{-1} = PD^nDP^{-1} = PD^{n+1}P^{-1}$$

Donc la propriété  $\mathcal{P}(n+1)$  est vraie.

- *Conclusion.* Donc, par principe de récurrence, on a montré que

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad A^n = PD^nP^{-1}.$$

(f) En déduire que,

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad A^n = \begin{pmatrix} \frac{1}{3} + \frac{2}{3} \times (-\frac{1}{2})^n & \frac{1}{3} - \frac{1}{3} \times (-\frac{1}{2})^n & \frac{1}{3} - \frac{1}{3} \times (-\frac{1}{2})^n \\ \frac{5}{12} - \frac{2}{3} \times (-\frac{1}{2})^n & \frac{5}{12} + \frac{1}{3} \times (-\frac{1}{2})^n & \frac{5}{12} + \frac{1}{3} \times (-\frac{1}{2})^n \end{pmatrix}$$

Soit  $n \in \mathbb{N}$ . À l'aide des questions 4(d) et 4(e), on obtient

$$\begin{aligned} A^n &= PD^nP^{-1} \\ &= \begin{pmatrix} 4 & 1 & 0 \\ 3 & 0 & 1 \\ 5 & -1 & -1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & (-\frac{1}{2})^n & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \frac{1}{12} & \frac{1}{12} & \frac{1}{12} \\ \frac{5}{3} & -\frac{1}{3} & -\frac{1}{3} \\ -\frac{1}{4} & \frac{3}{4} & -\frac{1}{4} \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} 4 & 1 & 0 \\ 3 & 0 & 1 \\ 5 & -1 & -1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \frac{1}{12} & \frac{1}{12} & \frac{1}{12} \\ \frac{5}{3} & -\frac{1}{3} & -\frac{1}{3} \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} \frac{1}{3} + \frac{2}{3} \times (-\frac{1}{2})^n & \frac{1}{3} - \frac{1}{3} \times (-\frac{1}{2})^n & \frac{1}{3} - \frac{1}{3} \times (-\frac{1}{2})^n \\ \frac{5}{12} - \frac{2}{3} \times (-\frac{1}{2})^n & \frac{5}{12} + \frac{1}{3} \times (-\frac{1}{2})^n & \frac{5}{12} + \frac{1}{3} \times (-\frac{1}{2})^n \end{pmatrix} \end{aligned}$$

(g) En déduire, pour tout  $n \in \mathbb{N}$ , l'expression de  $U_n$ .

Soit  $n \in \mathbb{N}$ . En utilisant le résultat de la question 3(c), l'expression de  $U_0$  donnée à la question 3(a) et l'expression de  $A^n$  donnée à la question 4(f), on obtient que

$$U_n = \begin{pmatrix} \frac{1}{3} + \frac{2}{3} \times (-\frac{1}{2})^n & \frac{1}{3} - \frac{1}{3} \times (-\frac{1}{2})^n & \frac{1}{3} - \frac{1}{3} \times (-\frac{1}{2})^n \\ \frac{5}{12} - \frac{2}{3} \times (-\frac{1}{2})^n & \frac{5}{12} + \frac{1}{3} \times (-\frac{1}{2})^n & \frac{5}{12} + \frac{1}{3} \times (-\frac{1}{2})^n \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}$$

c'est-à-dire que

$$U_n = \begin{pmatrix} \frac{1}{3} + \frac{2}{3} \times (-\frac{1}{2})^n \\ \frac{5}{12} - \frac{2}{3} \times (-\frac{1}{2})^n \end{pmatrix}$$

5. (a) Exprimer, pour tout  $n \in \mathbb{N}$ ,  $r_n$ ,  $\ell_n$  et  $m_n$  en fonction de  $n$ .

Soit  $n \in \mathbb{N}$ . En utilisant la question 4(g), et par définition du vecteur  $U_n$ , on a

$$r_n = \frac{1}{3} + \frac{2}{3} \times (-\frac{1}{2})^n, \quad \ell_n = \frac{1}{4} \quad \text{et} \quad m_n = \frac{5}{12} - \frac{2}{3} \times (-\frac{1}{2})^n.$$

(b) Vérifier que,

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad r_n + \ell_n + m_n = 1.$$

Soit  $n \in \mathbb{N}$ . En utilisant le résultat de la question 5(a), on a

$$\begin{aligned} r_n + \ell_n + m_n &= \frac{1}{3} + \frac{2}{3} \times \left(-\frac{1}{2}\right)^n + \frac{1}{4} + \frac{5}{12} - \frac{2}{3} \times \left(-\frac{1}{2}\right)^n \\ &= \frac{1}{3} + \frac{1}{4} + \frac{5}{12} \\ &= 1 \end{aligned}$$

- (c) Déterminer les limites des suites  $(r_n)_{n \in \mathbb{N}}$ ,  $(\ell_n)_{n \in \mathbb{N}}$  et  $(m_n)_{n \in \mathbb{N}}$ .

Par propriété sur les suites géométriques,

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} \left(-\frac{1}{2}\right)^n = 0 \quad \text{car} \quad -1 < -\frac{1}{2} < 1.$$

Donc, en utilisant les expressions des suites  $(r_n)_{n \in \mathbb{N}}$ ,  $(\ell_n)_{n \in \mathbb{N}}$  et  $(m_n)_{n \in \mathbb{N}}$  trouvées à la question 5(a), on obtient

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} r_n = \frac{1}{3} \quad \text{et} \quad \lim_{n \rightarrow +\infty} m_n = \frac{5}{12}.$$

Et, comme  $(\ell_n)_{n \in \mathbb{N}}$  est une suite constante, on a directement

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} \ell_n = \frac{1}{4}.$$

6. (a) Si le vélo se trouve à Landerneau le deuxième jour, quelle est la probabilité qu'il se trouve à Milizac le premier jour ?

On cherche à calculer  $P_{L_2}(M_1)$ . Par la **formule de Bayes**, on a

$$P_{L_2}(M_1) = \frac{P(M_1)P_{M_1}(L_2)}{P(L_2)}.$$

Or d'après l'énoncé,

$$P_{M_1}(L_2) = \frac{1}{4}.$$

Puis, en utilisant le résultat de la question 5(a), on a

$$P(M_1) = m_1 = \frac{3}{4} \quad \text{et} \quad P(L_2) = \ell_2 = \frac{1}{4}.$$

Finalement, on a On cherche à calculer  $P_{L_2}(M_1)$ . Par la **formule de Bayes**, on a

$$P_{L_2}(M_1) = \frac{\frac{3}{4} \times \frac{1}{4}}{\frac{1}{4}} = \frac{3}{4}.$$

Si le vélo se trouve à Landerneau le deuxième jour, quelle est la probabilité qu'il se trouve à Milizac le premier jour est de  $\frac{3}{4}$ .

- (b) Le fait que le vélo se trouve à Landerneau le premier jour est-il indépendant du fait qu'il se trouve à Milizac le deuxième jour ?

On se demande si  $P(M_2) = P_{L_1}(M_2)$ . Pour cela, on va calculer les deux probabilités.

D'une part, d'après l'énoncé,

$$P_{L_1}(M_2) = \frac{1}{4}.$$

D'autre part, en utilisant le résultat de la question 5(a), on a

$$P(M_2) = m_2 = \frac{5}{12} - \frac{2}{3} \times \left(-\frac{1}{2}\right)^2 = \frac{1}{4}.$$

Comme  $P(M_2) = P_{L_1}(M_2)$ , les deux événements sont indépendants.