

Équation aux différences

Exercice indépendant

On modélise la survenue de pannes dans une chaîne de production. Chaque jour il y a une probabilité $p \in]0, 1[$ qu'une panne se produise. Les réparations étant effectuées dans la nuit qui suit, les différents jours seront considérés comme indépendants. L'expérience débute au jour 1, et on note Y_1 la variable aléatoire donnant le numéro du jour où la première panne a lieu, Y_2 celui de la deuxième panne, etc...

a. On note P_j l'événement "une panne est survenue au jour j ". Soit $k \in \mathbb{N}^*$. Exprimer l'événement $(Y_1 = k)$ à l'aide des événements P_j . En déduire l'expression de $\mathbb{P}(Y_1 = k)$ à l'aide de p et de k . S'agit-il d'une loi connue ?

b. Calculer $\mathbb{E}[Y_1]$ et $\mathbb{V}[Y_1]$.

• On note pour $i > 1$, $T_i = Y_i - Y_{i-1}$ et on prend par convention $T_1 = Y_1$.

c. Que représente T_i ? Sans chercher à formaliser et avec une réponse très brève, dire

- quelle est selon vous la loi de T_i ,

- pourquoi les T_i sont des v.a. indépendantes.

d. Exprimer la loi de Y_2 : préciser les valeurs prises par Y_2 et donner $\mathbb{P}(Y_2 = n)$ pour $n \in \mathbb{N}$.

e. Exprimer plus généralement la loi de Y_j , $j > 1$.

f. Donner l'espérance et la variance de Y_j , $j > 1$.

Problème

Notations

— Dans tout le problème, $\mathbb{K}$ désigne $\mathbb{R}$ ou $\mathbb{C}$.

— On note $\mathbb{K}[X]$ le $\mathbb{K}$ -espace vectoriel des polynômes à coefficients dans $\mathbb{K}$.

— Pour tout $d \in \mathbb{N}$, $\mathbb{K}_d[X]$ désigne le $\mathbb{K}$ -espace vectoriel des polynômes de degré inférieur ou égal à d .

— On note $\mathbb{U}$ le groupe multiplicatif des nombres complexes de module 1.

Objectifs du problème

Soit h une fonction de $\mathbb{K}$ dans $\mathbb{K}$. On dit qu'une fonction f de $\mathbb{K}$ dans $\mathbb{K}$ est solution de l'équation (E_h) sur $\mathbb{K}$ si

$$\forall x \in \mathbb{K}, f(x+1) - f(x) = h(x) \quad (E_h)$$

Le but du problème est l'étude de l'équation (E_h) .

La partie I de ce problème étudie l'existence de solutions dans le cas où h est polynomiale.

La partie II introduit la définition et établit quelques propriétés des fonctions entières.

La partie III définit les polynômes de Bernoulli et explicite une solution polynomiale à l'équation (E_h) , ainsi qu'une application analytique de ces polynômes.

La partie IV étend la résolution de (E_h) au cas où h est une fonction entière.

I Étude de l'opérateur différence finie

On considère l'application Δ définie par :

$$\Delta : \begin{cases} \mathbb{K}[X] \rightarrow \mathbb{K}[X] \\ P(X) \mapsto P(X+1) - P(X) \end{cases}$$

Q 1. Montrer que Δ est un endomorphisme de $\mathbb{K}[X]$.

Q 2. Soit $P \in \mathbb{K}[X]$. Déterminer le degré de $\Delta(P)$ en fonction de celui de P .

Q 3. Montrer que, pour tout $d \in \mathbb{N}^*$, Δ induit un endomorphisme sur $\mathbb{K}_d[X]$.

On note Δ_d l'endomorphisme de $\mathbb{K}_d[X]$ induit par Δ (*comprendre : $\Delta_d(P) = \Delta(P)$ pour $P \in \mathbb{K}_d[X]$*).

Q 4. Déterminer $\ker(\Delta_d)$ et $\text{Im}(\Delta_d)$ pour tout $d \in \mathbb{N}^*$.

Q 5. En déduire $\ker(\Delta)$ et $\text{Im}(\Delta)$.

Q 6. On suppose (pour cette question seulement) que h est la fonction $x \mapsto x$. Déterminer une solution de (E_h) dans $\mathbb{K}_2[X]$, puis toutes les solutions polynomiales de l'équation (E_h) .

Q 7. Montrer que la seule valeur propre de Δ est 0.

II Fonctions entières

On note ω l'application de $[0, 1]$ dans $\mathbb{C}$ définie, pour tout $t \in [0, 1]$, par $\omega(t) = e^{2i\pi t}$.

II.A - Généralités

On note $\mathcal{E}$ l'ensemble des fonctions $f : \mathbb{C} \rightarrow \mathbb{C}$ développables en série entière de rayon de convergence infini.

Q 8. Justifier que si $(f, g) \in \mathcal{E}^2$ et $(\lambda, \mu) \in \mathbb{C}^2$, alors $\lambda f + \mu g \in \mathcal{E}$ et $fg \in \mathcal{E}$.

Q 9. Soit $f \in \mathcal{E}$ dont on note $\sum a_n z^n$ le développement en série entière. Montrer que, pour tout $k \in \mathbb{Z}$:

$$\int_0^1 f(\omega(t)) \omega(t)^{-k} dt = \begin{cases} a_k & \text{si } k \in \mathbb{N} \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}$$

II. B- Une intégrale

Pour tout $p \in \mathbb{Z}$, on pose (*oui c'est bien cela*)

$$I_p = \int_0^1 \frac{\omega(t)^{p+1}}{e^{\omega(t)} - 1} dt$$

Q 10. Vérifier que cette intégrale est bien définie pour tout $p \in \mathbb{Z}$.

Q 11. Montrer qu'il existe une fonction $\beta \in \mathcal{E}$ et une constante $C \in]0, 1[$ telles que, pour tout $\zeta \in \mathbb{U}$,

$$e^\zeta - 1 = \zeta(1 + \zeta\beta(\zeta)) \quad \text{et} \quad |\beta(\zeta)| \leq C$$

Q 12. En déduire que pour tout $\zeta \in \mathbb{U}$ et tout $p \in \mathbb{Z}$,

$$\frac{\zeta^p}{e^\zeta - 1} = \sum_{j=0}^{+\infty} (-1)^j \zeta^{j+p-1} \beta(\zeta)^j$$

Q 13. Montrer que $I_0 = 1$ et que, pour tout $p \in \mathbb{N}^*$, $I_p = 0$.

III Polynômes de Bernoulli

Pour tout $n \in \mathbb{N}$ et tout $z \in \mathbb{C}$, on définit dans cette partie :

$$B_n(z) = n! \int_0^1 \frac{e^{z\omega(t)}}{(e^{\omega(t)} - 1) \omega(t)^{n-1}} dt$$

III. A - Lien avec l'équation (E_h)

Q 14. Montrer que, pour tout $n \in \mathbb{N}$ et tout $z \in \mathbb{C}$,

$$B_n(z) = n! \sum_{k=0}^n \frac{z^k}{k!} I_{k-n}$$

En déduire que B_n est un polynôme unitaire de degré n .

Q 15. Montrer que, pour tout $n \in \mathbb{N}^*$, $B'_n = nB_{n-1}$.

Q 16. Montrer que, pour tout $n \in \mathbb{N}^*$ et tout $z \in \mathbb{C}$,

$$B_n(z+1) - B_n(z) = nz^{n-1}$$

Q 17. En déduire l'expression d'une fonction polynomiale vérifiant l'équation (E_h) sur $\mathbb{C}$ lorsque h est une fonction polynomiale.

III. B - Unicité

Q 18. Montrer que $(B_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est l'unique suite de polynômes vérifiant

$$\begin{cases} B_0 = 1 \\ \forall n \in \mathbb{N}^*, B'_n = nB_{n-1} \\ \forall n \in \mathbb{N}^*, \int_0^1 B_n(t) dt = 0 \end{cases}$$

Q 19. Soit $(H_n)_{n \in \mathbb{N}}$ la suite de polynômes définie par : $\forall n \in \mathbb{N}, H_n(X) = (-1)^n B_n(1-X)$. Montrer que pour tout $n \in \mathbb{N}$, $H_n = B_n$.

III. C - Une application analytique

Soit ψ la fonction de $\mathbb{R}$ dans $\mathbb{R}$ telle que, pour tout $x \in \mathbb{R}$,

$$\psi(x) = \begin{cases} \frac{x}{e^x - 1} & \text{si } x \neq 0 \\ 1 & \text{sinon} \end{cases}$$

Soit de plus u la fonction de $\mathbb{R}^2$ dans $\mathbb{R}$ telle que, pour tout $(x, t) \in \mathbb{R}^2$,

$$u(x, t) = \psi(x)e^{tx}$$

Q 20. Montrer que ψ est de classe $\mathcal{C}^\infty$ sur $\mathbb{R}$.

Partie hors DS - ne pas traiter ces questions 21,22 données juste pour information

Vraie Q20 - u est de classe $\mathcal{C}^\infty$ sur $\mathbb{R}^2$.

Q21 - Pour tout $(x, t) \in \mathbb{R}^2$, calculer $\frac{\partial u}{\partial t}(x, t)$ puis montrer que, pour tout $n \in \mathbb{N}^*$,

$$\frac{\partial}{\partial t} \frac{\partial^n u}{\partial x^n}(x, t) = x \frac{\partial^n u}{\partial x^n}(x, t) + n \frac{\partial^{n-1} u}{\partial x^{n-1}}(x, t)$$

Pour tout $n \in \mathbb{N}$, soit A_n la fonction de $\mathbb{R}$ dans $\mathbb{R}$ telle que, pour tout $t \in \mathbb{R}$, $A_n(t) = \frac{\partial^n u}{\partial x^n}(0, t)$.

Q22- Montrer que, pour tout $n \in \mathbb{N}$, $A_n = B_n$.

Reprise du DS

IV Solution entière de l'équation (E_h)

IV.A - Une inégalité de contrôle

On se propose dans cette partie de montrer par l'absurde la propriété $\mathcal{P}$:

$$\exists c > 0, \forall n \in \mathbb{N}, \forall z \in \mathbb{C}, (|z| = (2n+1)\pi \Rightarrow |e^z - 1| \geq c)$$

On suppose que $\mathcal{P}$ est fausse.

Q 23. Montrer l'existence d'une suite d'entiers naturels $(n_p)_{p \in \mathbb{N}}$ et d'une suite de nombres complexes $(z_p)_{p \in \mathbb{N}}$ telles que :

$$e^{z_p} \xrightarrow{p \rightarrow +\infty} 1 \text{ et } \forall p \in \mathbb{N}, |z_p| = (2n_p + 1)\pi$$

Pour tout $p \in \mathbb{N}$, on note $a_p = \Re(z_p)$ et $b_p = \Im(z_p)$.

Q 24. Montrer que $a_p \xrightarrow{p \rightarrow +\infty} 0$ et $|z_p| - |b_p| \xrightarrow{p \rightarrow +\infty} 0$.

Q 25. Pour tout $p \in \mathbb{N}$, on note

$$\varepsilon_p = \begin{cases} +1 & \text{si } b_p \geq 0 \\ -1 & \text{si } b_p < 0 \end{cases}$$

En étudiant $\exp(z_p - i\varepsilon_p |z_p|)$, aboutir à une contradiction et conclure.

IV.B - Une solution à (E_h)

Pour tout $n \in \mathbb{N}$, on définit maintenant

$$\gamma_n : \begin{cases} [0, 1] & \rightarrow \mathbb{C} \\ t & \mapsto (2n+1)\pi e^{2i\pi t} \end{cases}$$

Pour tout $n \in \mathbb{N}$ et tout $z \in \mathbb{C}$, soit

$$Q_n(z) = n! \int_0^1 \frac{e^{z\gamma_n(t)}}{(e^{\gamma_n(t)} - 1) \gamma_n(t)^{n-1}} dt$$

Q 26. Montrer que, pour tout $n \in \mathbb{N}$, $Q_n \in \mathcal{E}$.

Q 27. Montrer que

$$\forall n \in \mathbb{N}^*, \forall z \in \mathbb{C}, \quad Q_n(z+1) - Q_n(z) = nz^{n-1}$$

Q 28. Montrer qu'il existe deux constantes $a, b \in \mathbb{R}_+^*$ telles que, pour tout $n \in \mathbb{N}^*$ et tout $z \in \mathbb{C}$,

$$|Q_n(z)| \leq ae^{bn|z|}$$

Q 29. En déduire l'existence d'une solution dans $\mathcal{E}$ à l'équation (E_h) lorsque $h \in \mathcal{E}$.

C'est ce que demande l'énoncé, cherchez une solution mais ne cherchez pas à justifier qu'elle est dans $\mathcal{E}$, cela demanderait une utilisation précise de la théorie des familles sommables.