
DS2 (version A)

Exercice 1

Partie I : Étude d'une suite récurrente

On considère une suite $(u_n)_{n \in \mathbb{N}}$ définie par $u_0 \in \mathbb{R}$ et : $\forall n \in \mathbb{N}, u_{n+1} = \frac{u_n^2}{n+1}$.

On suppose : $u_0 > 0$.

On pose : $\forall n \in \mathbb{N}, v_n = \frac{\ln(u_n)}{2^n}$.

1. Montrer que la suite $(v_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est bien définie et : $\forall n \in \mathbb{N}, u_n > 0$.

2. a) Montrer que la série $\sum_{k \geq 1} \frac{\ln(k)}{2^k}$ converge. Dans la suite, on note : $\sigma = -\sum_{k=1}^{+\infty} \frac{\ln(k)}{2^k}$.

b) (i) Pour tout $k \in \mathbb{N}^*$, exprimer $v_k - v_{k-1}$ en fonction de k .

Puis déterminer la nature de la série $\sum_{k \geq 1} (v_k - v_{k-1})$.

(ii) En déduire que la suite $(v_n)_{n \in \mathbb{N}}$ converge. Exprimer sa limite ℓ en fonction de u_0 et σ .

3. On suppose dans cette question que $u_0 \neq e^{-\sigma}$.

a) Déterminer le signe de ℓ .

On pourra distinguer les cas $u_0 > e^{-\sigma}$ et $u_0 < e^{-\sigma}$.

b) En déduire la limite de $(\ln(u_n))_{n \in \mathbb{N}}$, puis étudier le comportement en $+\infty$ de la suite $(u_n)_{n \in \mathbb{N}}$.

4. On suppose dans cette question : $u_0 = e^{-\sigma}$.

a) Vérifier que pour tout $n \in \mathbb{N}$, on a : $v_n = \sum_{k=n+1}^{+\infty} \frac{\ln(k)}{2^k}$.

b) En déduire $\lim_{n \rightarrow +\infty} u_n$.

Partie II : Approximation de σ

5. a) Montrer : $\forall x \in]0, +\infty[, \ln(x) \leq x$.

b) En déduire : $\forall n \in \mathbb{N}^*, \sum_{k=n+1}^{+\infty} \frac{\ln(k)}{2^k} \leq \frac{n+1}{2^{n-1}}$.

6. Montrer alors : $\forall n \in \mathbb{N}^*, \left| \sigma - \left(-\sum_{k=1}^n \frac{\ln(k)}{2^k} \right) \right| \leq \frac{n+1}{2^{n-1}}$.

7. Écrire une fonction **Scilab** d'entête `function sigma = approx(eps)` qui, prenant en argument un réel ε strictement positif, renvoie une valeur approchée de σ à ε près.

Exercice 2

On note $A = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 & 2 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \\ 2 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix} \in \mathcal{M}_4(\mathbb{R})$.

1. a) Soit $\lambda \in \mathbb{R}$. Montrer :

$$A - \lambda I_4 \text{ non inversible} \Leftrightarrow \lambda \in \{-2, -1, 1, 2\}$$

b) On définit les ensembles suivants :

$$E_{-2}(A) = \{X \in \mathcal{M}_{4,1}(\mathbb{R}) \mid AX = -2X\}$$

$$E_{-1}(A) = \{X \in \mathcal{M}_{4,1}(\mathbb{R}) \mid AX = -X\}$$

$$E_1(A) = \{X \in \mathcal{M}_{4,1}(\mathbb{R}) \mid AX = X\}$$

$$E_2(A) = \{X \in \mathcal{M}_{4,1}(\mathbb{R}) \mid AX = 2X\}$$

Montrer que ce sont des espaces vectoriels et déterminer une base de chacun d'entre eux.
 En déduire leurs dimensions.

2. Montrer que la matrice $P = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 1 & 0 \\ 0 & -1 & 1 & 0 \\ -1 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$ est inversible et déterminer P^{-1} .

3. Déterminer la matrice $D = P^{-1}AP$.

On appelle commutant de A , et on note C_A , l'ensemble des matrices M de $\mathcal{M}_4(\mathbb{R})$ telles que :

$$AM = MA$$

On appelle commutant de D , et on note C_D , l'ensemble des matrices N de $\mathcal{M}_4(\mathbb{R})$ telles que :

$$DN = ND$$

4. Montrer que C_A est un sous-espace vectoriel de $\mathcal{M}_4(\mathbb{R})$.

5. Soit $M \in \mathcal{M}_4(\mathbb{R})$. On note $N = P^{-1}MP$. Montrer :

$$M \in C_A \Leftrightarrow N \in C_D$$

6. Déterminer C_D , en utilisant les coefficients des matrices.

7. En déduire :

$$C_A = \left\{ \begin{pmatrix} a & 0 & 0 & b \\ 0 & c & d & 0 \\ 0 & d & c & 0 \\ b & 0 & 0 & a \end{pmatrix} \mid (a, b, c, d) \in \mathbb{R}^4 \right\}$$

8. Déterminer une base de C_A et la dimension de C_A .

Exercice 3

On désigne par n un entier naturel supérieur ou égal à 2.

On lance n fois une pièce équilibrée (c'est-à-dire donnant pile avec la probabilité $\frac{1}{2}$ et face également avec la probabilité $\frac{1}{2}$), les lancers étant supposés indépendants.

On note Z la variable aléatoire qui vaut 0 si l'on n'obtient aucun pile pendant ces n lancers et qui, dans le cas contraire, prend pour valeur le rang du premier pile.

1. a) Déterminer, en argumentant soigneusement, l'ensemble $Z(\Omega)$.

b) Pour tout k de $Z(\Omega)$, calculer $\mathbb{P}([Z = k])$. On distinguera les cas $k = 0$ et $k \geq 1$.

c) Vérifier que $\sum_{k \in Z(\Omega)} \mathbb{P}([Z = k]) = 1$.

d) On rappelle que l'instruction `grand(1, 1, 'bin', 1, 0.5)` renvoie un nombre au hasard parmi les nombres 0 et 1. Compléter le programme suivant pour qu'il simule l'expérience décrite ci-dessus, l'entier n étant entré au clavier par l'utilisateur (pile sera codé par le nombre 1 et face par 0).

```
1  n = input(' Entrez un entier n : ')
2  Z = 0
3  k = 1
4  lancer = grand(1, 1, 'bin', 1, 0.5)
5  while (lancer == 0) & (k <= n)
6      k = k + 1
7      lancer = grand(1, 1, 'bin', 1, 0.5)
8  end
9  if k <> (n+1) then
10     Z = .....
11 end
12 disp(Z)
```

On dispose de $n + 1$ urnes U_0, U_1, \dots, U_n telles que pour tout k de $\{0, 1, \dots, n\}$ l'urne U_k contient k boules blanches et $n - k$ boules noires.

On effectue des tirages d'une boule, au hasard et avec remise dans ces urnes de la façon suivante :

- × si après les lancers de la pièce décrits dans la première question, la variable Z prend la valeur k (avec $k \geq 1$), alors on tire une par une et avec remise, k boules dans l'urne U_k et l'on note X la variable aléatoire égale au nombre de boules blanches obtenues à l'issue de ces tirages,
- × si la variable Z a pris la valeur 0, aucun tirage n'est effectué et X prend la valeur 0.

2. Déterminer $X(\Omega)$.

3. a) Déterminer, en distinguant les cas $i = 0$ et $1 \leq i \leq n$, la probabilité $\mathbb{P}_{[Z=0]}([X = i])$.

b) Déterminer, en distinguant les cas $i = n$ et $0 \leq i \leq n - 1$, la probabilité $\mathbb{P}_{[Z=n]}([X = i])$.

c) Pour tout k de $\{1, 2, \dots, n - 1\}$ déterminer, en distinguant les cas $0 \leq i \leq k$ et $k < i \leq n$, la probabilité conditionnelle $\mathbb{P}_{[Z=k]}([X = i])$.

4. a) Montrer : $\mathbb{P}([X = 0]) = \sum_{k=1}^{n-1} \left(\frac{n-k}{2n}\right)^k + \frac{1}{2^n}$.

b) Montrer : $\mathbb{P}([X = n]) = \frac{1}{2^n}$.

c) Exprimer, pour tout i de $\{1, 2, \dots, n-1\}$, $\mathbb{P}([X = i])$ sous forme d'une somme que l'on ne cherchera pas à réduire.

5. Vérifier, avec les expressions trouvées à la question précédente, que $\sum_{i=0}^n \mathbb{P}([X = i]) = 1$.

Problème

Un joueur participe à un jeu se jouant en plusieurs parties.

Ses observations lui permettent d'affirmer que :

- × s'il gagne deux parties consécutives, alors il gagne la prochaine avec la probabilité $\frac{2}{3}$.
- × s'il perd une partie et gagne la suivante, alors il gagne la prochaine avec la probabilité $\frac{1}{2}$.
- × s'il gagne une partie et perd la suivante, alors il gagne la prochaine avec la probabilité $\frac{1}{2}$.
- × s'il perd deux parties consécutives, alors il gagne la prochaine avec la probabilité $\frac{1}{3}$.

Pour tout entier naturel n non nul, on note A_n l'événement : « le joueur gagne la $n^{\text{ème}}$ partie ».

De plus, pour tout entier naturel n supérieur ou égal à 2, on pose :

$$E_n = A_{n-1} \cap A_n \quad F_n = \overline{A_{n-1}} \cap A_n \quad G_n = A_{n-1} \cap \overline{A_n} \quad H_n = \overline{A_{n-1}} \cap \overline{A_n}$$

1. a) Utiliser la formule des probabilités totales pour montrer que, pour tout entier naturel n supérieur ou égal à 2, on a :

$$\mathbb{P}(E_{n+1}) = \frac{2}{3} \mathbb{P}(E_n) + \frac{1}{2} \mathbb{P}(F_n)$$

b) Exprimer de la même façon (aucune explication n'est exigée) les probabilités $\mathbb{P}(F_{n+1})$, $\mathbb{P}(G_{n+1})$ et $\mathbb{P}(H_{n+1})$ en fonction de $\mathbb{P}(E_n)$, $\mathbb{P}(F_n)$, $\mathbb{P}(G_n)$ et $\mathbb{P}(H_n)$.

c) Pour tout entier naturel n supérieur ou égal à 2, on pose : $U_n = \begin{pmatrix} \mathbb{P}(E_n) \\ \mathbb{P}(F_n) \\ \mathbb{P}(G_n) \\ \mathbb{P}(H_n) \end{pmatrix}$.

Vérifier que $U_{n+1} = M U_n$, où $M = \begin{pmatrix} \frac{2}{3} & \frac{1}{2} & 0 & 0 \\ 0 & 0 & \frac{1}{2} & \frac{1}{3} \\ \frac{1}{3} & \frac{1}{2} & 0 & 0 \\ 0 & 0 & \frac{1}{2} & \frac{2}{3} \end{pmatrix}$.

2. a) Soient $P = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 3 & 3 \\ -2 & -1 & -1 & 2 \\ 2 & -1 & 1 & 2 \\ -1 & 1 & -3 & 3 \end{pmatrix}$ et $Q = \begin{pmatrix} -1 & -3 & 3 & 1 \\ 2 & -3 & -3 & 2 \\ 2 & 1 & -1 & -2 \\ 1 & 1 & 1 & 1 \end{pmatrix}$.

Calculer PQ . En déduire que P est inversible et donner son inverse.

b) Déterminer la matrice $D = P^{-1}MP$.

Dans toute la suite, on suppose que le joueur a gagné les deux premières parties.

3. a) Montrer par récurrence que : $\forall n \in \mathbb{N}, M^n = PD^n P^{-1}$.
b) Montrer, également par récurrence, que : $\forall n \geq 2, U_n = M^{n-2} U_2$.
c) Pour tout entier naturel n supérieur ou égal à 2, donner la première colonne de M^n , puis en déduire $\mathbb{P}(E_n)$, $\mathbb{P}(F_n)$, $\mathbb{P}(G_n)$ et $\mathbb{P}(H_n)$.
d) Montrer que l'on a :

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} \mathbb{P}(E_n) = \frac{3}{10} \quad \lim_{n \rightarrow +\infty} \mathbb{P}(F_n) = \frac{2}{10} \quad \lim_{n \rightarrow +\infty} \mathbb{P}(G_n) = \frac{2}{10} \quad \lim_{n \rightarrow +\infty} \mathbb{P}(H_n) = \frac{3}{10}$$

4. Pour tout entier naturel k non nul, on note X_k la variable aléatoire qui vaut 1 si le joueur gagne la $k^{\text{ème}}$ partie et qui vaut 0 sinon (X_1 et X_2 sont donc deux variables certaines).
a) Pour tout entier naturel k supérieur ou égal à 2, exprimer A_k en fonction de E_k et F_k .
b) En déduire, pour tout entier naturel k supérieur ou égal à 2, la loi de X_k .
5. Pour tout entier naturel n supérieur ou égal à 2, on note S_n la variable aléatoire égale au nombre de parties gagnées par le joueur lors des n premières parties.
a) Calculer $\mathbb{P}([S_n = 2])$ en distinguant les cas $n = 2$, $n = 3$ et $n \geq 4$.
b) Déterminer $\mathbb{P}([S_n = n])$.
c) Pour tout entier n supérieur ou égal à 3, écrire S_n en fonction des variables X_k , puis déterminer $\mathbb{E}(S_n)$ en fonction de n .