

Le barème est indicatif. L'utilisation de documents, téléphones portables, calculatrices ou tout autre appareil électronique, est interdite. Les réponses devront être soigneusement argumentées et justifiées.

Écrivez "Sujet AM/BM" sur votre copie et la rendez avec LE SUJET s.v.p. !

Exercice 1. Couple d'entiers (8 points)

On considère une variable aléatoire X à valeurs dans \mathbb{N}^* et une variable aléatoire Y à valeurs dans \mathbb{N} qui vérifient, pour un $a \in \mathbb{R}$,

$$\forall i \in \mathbb{N}^*, \quad \forall j \in \mathbb{N}, \quad \mathbb{P}(X = i, Y = j) = \frac{1}{j!(a+2)^i}.$$

1. Calculer a .
2. Déterminer la loi de X et celle de Y .
3. Donner les noms des lois obtenues dans la question précédente.
4. Les variables X et Y sont elles indépendantes ? Pourquoi ?
5. On note $S = X - Y$. Donner l'espérance et la variance de S .

Rappel des lois usuelles

Loi	IE	Var
\mathcal{U}_n	$\frac{n+1}{2}$	$\frac{n^2-1}{12}$
$\mathcal{Ber}(p)$	p	$p(1-p)$
$\mathcal{Bin}(n, p)$	np	$np(1-p)$
$\mathcal{G}(p)$	$\frac{1}{p}$	$\frac{1-p}{p^2}$
$\mathcal{P}(\lambda)$	λ	λ

Exercice 2. Variables aléatoires discrètes (8 points)

Une personne a investi durant 4 jours sur une action en bourse et a eu un résultat journalier égal à la variable aléatoire entière X variant entre -2 et 3 . La variable aléatoire X suit la loi uniforme. Les résultats des jours différents sont indépendants.

Soit Y la variable aléatoire égale au nombre de jours où cette personne obtient un profit, c.a.d. $X > 0$.

1. Donner la loi de Y .
2. Quelle est la probabilité que cette personne obtient un profit sur 3 jours parmi les 4 ?
3. Sachant que cette personne a eu un profit tous les jours, quelle est la probabilité que la somme de ces gains soit au moins égale à 5 ?

Soit $E = \{\text{Profit, Neutre, Perte}\}$ et une chaîne de Markov Z_n , tel que $Z_0 = X$ et la matrice de transition

$$M = \begin{pmatrix} 0 & 2/5 & 1/2 \\ 2/3 & 3/5 & 0 \\ 1/3 & 0 & 1/2 \end{pmatrix}.$$

4. Déterminer les états récurrents et transitoires.
5. Calculer la probabilité de la suite $(Z_0, \dots, Z_4) = (\text{Profit, Neutre, Profit, Perte, Profit})$.
6. Déterminer la mesure invariante.
7. Après des centaines d'occurrences, quel est l'état le plus probable de Z_n ?

Écrivez "Sujet AM/BM" sur votre copie et la rendez avec LE SUJET s.v.p. !

Exercice 3. Chaîne de Markov (*4 points*)

On considère la suite X_0, \dots, X_n, \dots telle que $X_0 = -1$ et qui vérifie l'équation

$$X_{n+1} = \text{int} \left(\frac{X_n}{2} + e_n \right)$$

où $\text{int}(\cdot)$ est la fonction partie entière ($\text{int}(x)$ est l'entier inférieur à x le plus proche de x , par exemple, $\text{int}(2,5) = 2$ et $\text{int}(-0,5) = -1$) et $(e_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est une suite des variables aléatoires i.i.d. issues de loi de Bernoulli de paramètre $1/3$.

1. Montrer que X_0, X_1, X_2, \dots est une chaîne de Markov.
2. Quels sont les états possibles pour $(X_n)_{n \in \mathbb{N}}$? Lesquels sont récurrents ? lesquels ne le sont pas ?
3. Calculer la matrice de transition de la chaîne de Markov. Justifier votre réponse.