Devoir Maison numéro 0

A rendre obligatoirement le lundi 2 septembre 2019

EXERCICE 1

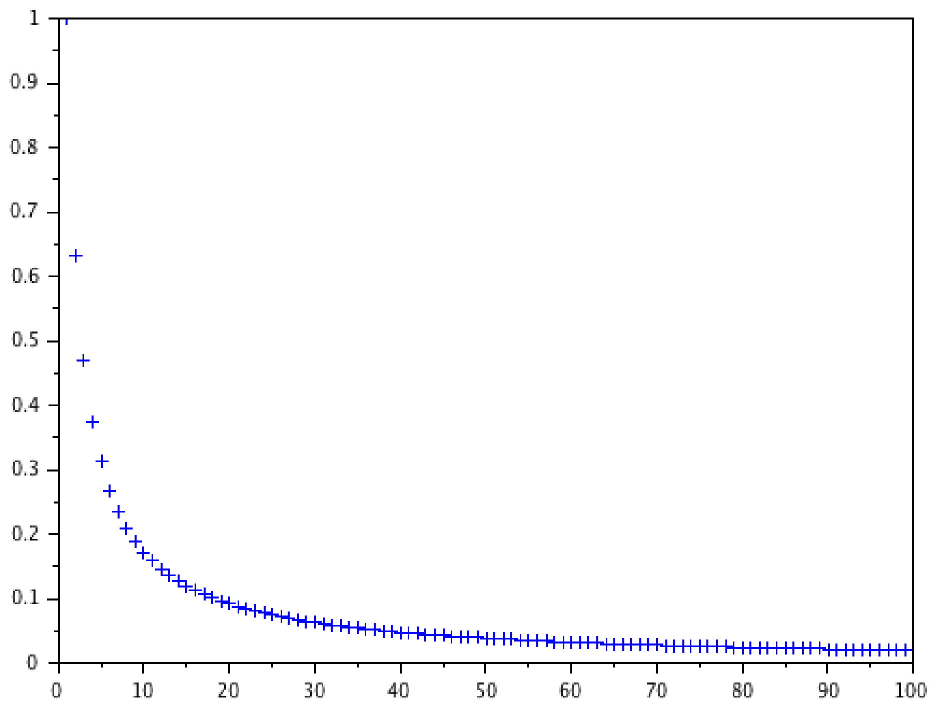
Les deux parties de cet exercice sont indépendantes.

I - Une loi exponentielle et une suite

1. **Une loi exponentielle**.
   Soit X une variable aléatoire réelle qui suit une loi exponentielle de paramètre 1.
   (a) Donner une densité de X et rappeler les valeurs de l'espérance et de la variance de la variable aléatoire X.
   (b) Redémontrer que la fonction de répartition de la variable aléatoire X est la fonction F définie pour tout réel x par :
   $$F(x) = \begin{cases} 0 & \text{si } x < 0, \\ 1 - e^{-x} & \text{si } x \geqslant 0. \end{cases}$$
2. **Étude d'une suite**.
   On considère la suite $(u_n)_{n\geqslant 1}$ définie par $u_1 = 1$ et pour tout entier naturel non nul n par : $u_{n+1} = F(u_n)$.
   (a) Montrer que pour tout réel x : $e^x \geqslant x + 1$.
   Montrer que l'égalité a lieu **si et seulement si** $x = 0$.
   (b) Montrer que pour tout entier naturel n, on a : $u_n > 0$.
   (c) Recopier et compléter le programme SCILAB suivant qui permet de représenter les cent premiers termes de la suite $(u_n)_{n\geqslant 1}$:

```
U = zeros(1,100)
U(1) = 1
for n = 1 : 99
        U(n+1) = _________________
end
plot(U,"+")
```

(d) Le programme précédent complété permet d'obtenir la représentation graphique suivante :



Quelle conjecture pouvez-vous émettre sur la monotonie et la limite de la suite $(u_n)_{n\geqslant 1}$?

(e) Étudier la monotonie de la suite $(u_n)_{n\geqslant 1}$.

(f) En déduire que la suite $(u_n)_{n\geqslant 1}$ est convergente et déterminer sa limite.

(g) À l'aide de la question 2(a), montrer successivement que pour tout entier naturel n non nul :

$$u_{n+1} \geqslant \frac{u_n}{1+u_n} \qquad \text{et} \qquad \frac{1}{u_{n+1}} \leqslant 1+\frac{1}{u_n}.$$

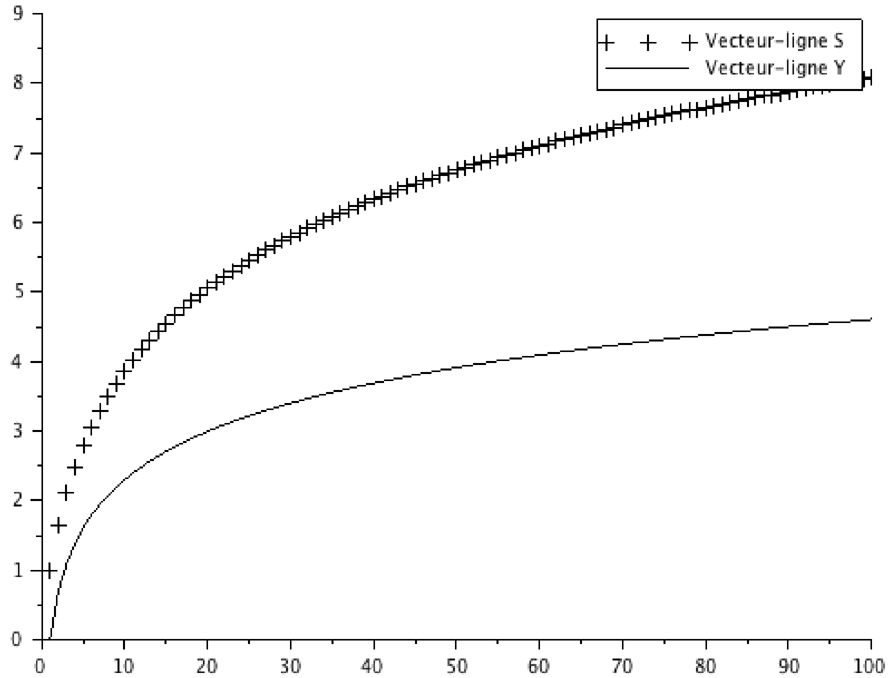
(h) Montrer par récurrence que pour tout entier naturel n non nul :

$$u_n \geqslant \frac{1}{n}.$$

(i) On modifie le programme écrit en question 2(c) en remplaçant la dernière ligne par :

```
X = 1: 100
S = cumsum(U)
Y = log(X)
plot2d(X,S)
plot2d(X,Y)
```

Le programme ci-dessus permet d'obtenir la représentation graphique suivante :



Que représente le vecteur-ligne S ?

Quelle conjecture pouvez-vous émettre sur la nature de la série de terme général u_n ?

(j) A l'aide de la question 2(h), établir la nature de la série de terme général u_n.

II - Une fonction et une variable aléatoire à densité

Soit g la fonction définie sur $\mathbb{R}$ par :

$$g(x) = \begin{cases} 0 & \text{si } x < 0, \\ xe^{-x} & \text{si } x \geqslant 0. \end{cases}$$

1. **Étude de la fonction** g.

   (a) Montrer que g est dérivable sur $]-\infty, 0[$ et sur $]0, +\infty[$. Est-elle continue en 0 ? Est-elle dérivable en 0 ?

   (b) Donner le tableau de variations de g sur $[0, +\infty[$ (on précisera la limite de g en $+\infty$).

   (c) Étudier la convexité de g sur $]0, +\infty[$.

   (d) Donner l'allure de la courbe représentative de la fonction g sur $\mathbb{R}$.
   On précisera avec soin cette allure au voisinage du point d'abscisse 0 de la courbe. On rappelle que $e^{-1} \approx 0,37$.

2. **Étude de variables aléatoires**.

   (a) Montrer que la fonction g est une densité de probabilité.

   On note Y une variable aléatoire dont une densité est la fonction g, et dont la fonction de répartition est notée G.

   (b) Sans calcul, justifier que la fonction G est de classe $\mathscr{C}^1$ sur $\mathbb{R}$.

   (c) Montrer que pour tout réel x,

$$G(x) = \begin{cases} 0 & \text{si } x < 0, \\ 1 - e^{-x}(1+x) & \text{si } x \geqslant 0. \end{cases}$$

(d) Montrer que la variable aléatoire Y admet une espérance, que l'on calculera.

3. On considère la variable aléatoire $Z = e^{Y}$.

   (a) Déterminer la fonction de répartition notée H de la variable aléatoire Z.

   (b) En déduire que Z est une variable aléatoire à densité et déterminer une densité de Z.

   (c) La variable aléatoire Z admet-elle une espérance ?