

Devoir surveillé 11

Correction

Exercice 1 :

Exercice 2 :

1. Pour calculer la limite en $t = x$, effectuons le changement de variable $t = x + h$. On a alors

$$f_n(x+h) = \frac{\cos(n(x+h)) - \cos(nx)}{\cos(x+h) - \cos(x)}.$$

On peut utiliser un développement limité en h , mais le plus simple est d'écrire

$$f_n(x+h) = \frac{\cos(n(x+h)) - \cos(nx)}{h} \frac{h}{\cos(x+h) - \cos(x)}.$$

On reconnaît les taux d'accroissement des fonctions $g = t \mapsto \cos(nt)$ et $h = t \mapsto \cos(t)$ au point x . Or $g'(x) = -n \sin(nx)$ et $h'(x) = -\sin(x) \neq 0$ (car $x \in]0, \pi[$), on résulte donc

$$f_n(t) \xrightarrow[t \rightarrow x]{} n \frac{\sin(nx)}{\sin(x)}.$$

On conclut que la fonction f_n se prolonge par continuité à $[0, \pi]$ par

la fonction \tilde{f}_n définie par $\tilde{f}_n(x) = \begin{cases} f_n(x) & \text{si } t \neq x \\ n \frac{\sin(nx)}{\sin(x)} & \text{si } t = x. \end{cases}$

2. On définit la suite (I_n) par

$$I_n = \int_0^\pi \tilde{f}_n(t) dt.$$

(a) On calcule, en utilisant le formulaire trigonométrique,

$$\begin{aligned} I_{n+2} + I_n &= \int_0^\pi \frac{\cos((n+2)t) + \cos(nt) - \cos((n+2)x) - \cos(nx)}{\cos(t) - \cos(x)} dt \\ &= \int_0^\pi \frac{2 \cos((n+1)t) \cos(t) - 2 \cos((n+1)x) \cos(x)}{\cos(t) - \cos(x)} dt \\ &= \int_0^\pi \frac{2 \cos((n+1)t)(\cos(t) - \cos(x)) + 2 \cos((n+1)t) \cos(x) - 2 \cos((n+1)x) \cos(x)}{\cos(t) - \cos(x)} dt \\ &= 2 \int_0^\pi \cos((n+1)t) dt + 2 \cos(x) \int_0^\pi \frac{\cos((n+1)t) - \cos((n+1)x)}{\cos(t) - \cos(x)} dt \\ &= 2 \underbrace{\left[\frac{\sin((n+1)t)}{n+1} \right]_0^\pi}_{=0} + 2 \cos(x) \int_0^\pi \frac{\cos((n+1)t) - \cos((n+1)x)}{\cos(t) - \cos(x)} dt \end{aligned}$$

On conclut

$$I_{n+2} + I_n = 2 \cos(x) I_{n+1}.$$

(b) On reconnaît une récurrence linéaire d'ordre 2. Son équation caractéristique est $r^2 - 2 \cos(x)r + 1 = 0$. On la résout et on trouve 2 racines $r_1 = e^{ix}$ et $r_2 = e^{-ix}$ qui sont différentes, car $x \in]0, \pi[$. On en déduit l'existence de A et B 2 complexes tel que pour tout n

$$I_n = A e^{int} + B e^{-inx}.$$

Or $I_0 = \int_0^\pi 0 dt = 0$ et $I_1 = \int_0^\pi 1 dt = \pi$, on résout

$$\begin{cases} A + B & = 0 \\ Ae^{ix} + Be^{-ix} & = \pi \end{cases}$$

On trouve alors $B = \frac{\pi}{e^{-ix} - e^{ix}} = -\frac{\pi}{2i \sin(x)}$ et $A = \frac{\pi}{-e^{-ix} + e^{ix}} = \frac{\pi}{2i \sin(x)}$, on injecte dans l'expression de I_n et on obtient, grâce aux formules d'Euler,

$$I_n = \frac{\pi}{2i \sin(x)} e^{inx} - \frac{\pi}{2i \sin(x)} e^{-inx} = \pi \frac{e^{inx} - e^{-inx}}{2i \sin(x)} = \pi \frac{\sin(nx)}{\sin(x)}.$$

Problème 1 :

- En utilisant l'indication, considérons l'application φ définie de F l'espace vectoriel des fonctions polynomiales de degré au plus 3 dans \mathbb{R}^4 par $\varphi(g) = (g(a), g'(a), g(b), g'(b))$. C'est une application linéaire par linéarité de la dérivation et de l'évaluation. On a $\dim F = 4 = \dim \mathbb{R}^4$. Montrons que φ est un isomorphisme. Comme les dimensions sont finies et égales, il suffit de montrer l'injectivité.

Montrons que $\text{Ker } \varphi = \{t \mapsto 0\}$. L'inclusion \supset est claire. Pour la réciproque, soit $g \in \text{Ker } \varphi$, on a donc $g(a) = g'(a) = 0$ et $g(b) = g'(b) = 0$, d'où a et b sont 2 racines distinctes au moins double de g , or le degré de g est au plus 3, donc g est nulle.

On conclut que φ est un isomorphisme, donc pour tout $f \in \mathcal{C}^4([a, b])$, il existe une unique fonction de g tel que

$$g(a) = f(a), \quad g(b) = f(b), \quad g'(a) = f'(a) \quad \text{et} \quad g'(b) = f'(b).$$

- On définit la fonction ψ sur $[a, b]$ par

$$\psi(t) = g(t) - \frac{f(a) + f(b)}{2} - \frac{f(b) - f(a)}{b - a} \left(t - \frac{a + b}{2} \right) - \frac{f'(b) - f'(a)}{2(b - a)} (t - a)(t - b)$$

- Comme $g(a) = f(a)$ et $g(b) = f(b)$, on a directement

$$\psi(a) = \psi(b) = 0.$$

- On calcule

$$\psi'(t) = g'(t) - \frac{f(b) - f(a)}{b - a} - \frac{f'(b) - f'(a)}{(b - a)} \left(t - \frac{a + b}{2} \right),$$

donc

$$\psi'(a) = f'(a) - \frac{f(b) - f(a)}{b - a} + \frac{f'(b) - f'(a)}{2} = -\frac{f(b) - f(a)}{b - a} + \frac{f'(a) + f'(b)}{2}$$

et

$$\psi'(b) = f'(b) - \frac{f(b) - f(a)}{b - a} - \frac{f'(b) - f'(a)}{2} = -\frac{f(b) - f(a)}{b - a} + \frac{f'(a) + f'(b)}{2} = \psi'(a)$$

Par sommation de fonctions polynomiales de degré au plus 3, on sait que ψ est une fonction polynomiale de degré au plus 3, donc ψ' est une fonction polynomiale de degré au plus 2. Comme $\psi'(a) = \psi'(b)$ et la majoration du degré, on en déduit que $\psi'(t) = \psi'(a) + \lambda(t - a)(t - b)$. On en déduit que $\psi(t) = \lambda \left(t - \frac{a + b}{2} \right)^2 - \lambda \left(\frac{a + b}{2} \right)^2 + \psi'(a)$ qui est bien la forme voulue. On conclut qu'il existe A et B 2 réels, tel que

$$\text{pour tout } t \in [a, b], \psi'(t) = A \left(t - \frac{a + b}{2} \right)^2 + B.$$

(c) Par sommation de fonctions polynomiales de degré au plus 3, on sait que ψ est une fonction de degré au plus 3, calculons son intégrale sur $[a, b]$.

Effectuons l'intégration par partie $\begin{cases} u(t) = \psi(t) & u'(t) = \psi'(t) \\ v'(t) = 1 & v(t) = t - \frac{a+b}{2} \end{cases}$, on a donc en utilisant $\psi'(a) = \psi'(b) = 0$

$$\int_a^b \psi(t) dt = \left[\psi(t) \left(t - \frac{a+b}{2} \right) \right]_a^b - \int_a^b \psi'(t) \left(t - \frac{a+b}{2} \right) dt = - \int_a^b \psi'(t) \left(t - \frac{a+b}{2} \right) dt.$$

En utilisant le résultat de la question précédente, on a

$$\int_a^b \psi(t) dt = - \int_a^b A \left(t - \frac{a+b}{2} \right)^3 + B \left(t - \frac{a+b}{2} \right) dt = - \left[\frac{A}{4} \left(t - \frac{a+b}{2} \right)^4 + \frac{B}{2} \left(t - \frac{a+b}{2} \right)^2 \right]_a^b = 0.$$

On conclut donc bien

$$g(t) = \frac{f(a) + f(b)}{2} + \frac{f(b) - f(a)}{b-a} \left(t - \frac{a+b}{2} \right) + \frac{f'(b) - f'(a)}{2(b-a)} (t-a)(t-b) + \psi(t),$$

où $\int_a^b \psi(t) dt = 0$.

3. On calcule

$$\int_a^b 1 dt = (b-a), \quad \int_a^b \left(t - \frac{a+b}{2} \right) dt = \left[\frac{1}{2} \left(t - \frac{a+b}{2} \right)^2 \right]_a^b = 0$$

et

$$\begin{aligned} \int_a^b (t-a)(t-b) dt &= \left[\frac{t^3}{3} - \frac{a+b}{2} t^2 + abt \right] \\ &= \frac{b^3}{3} - \frac{a+b}{2} b^2 + ab^2 - \frac{a^3}{3} + \frac{a+b}{2} a^2 - a^2 b \\ &= -\frac{b^3 - 3ab^2 + 3a^2 b - a^3}{6} = -\frac{(b-a)^3}{6}. \end{aligned}$$

Par linéarité de l'intégrale et le fait que $\int_a^b \psi(t) dt = 0$, on conclut

$$\int_a^b g(t) dt = (b-a) \frac{f(a) + f(b)}{2} - \frac{(b-a)^2}{12} (f'(b) - f'(a)).$$

4. Soit $c \in]a, b[$, utilisons l'indication et choisissons λ tel que $h_\lambda(c) = 0$, il suffit de prendre $\lambda = \frac{f(c) - g(c)}{(c-a)^2(c-b)^2}$. (possible car $c \neq a$ et $c \neq b$).

Par construction, on a donc $h_\lambda(a) = h_\lambda(c) = h_\lambda(b) = 0$. Par les règles de composition, la fonction h_λ est dérivable sur $[a, b]$, comme $a < c < b$, on peut donc appliquer le théorème de Rolle et il existe α et β tel que $a < \alpha < c < \beta < b$ et $h'_\lambda(\alpha) = h'_\lambda(\beta) = 0$. De plus, on calcule $h'_\lambda(a) = h'_\lambda(b) = 0$. Comme h_λ est de classe \mathcal{C}^4 , on peut stéré le procédé et on a donc h''_λ a au moins 3 zéros, h'''_λ a au moins 2 zéros, puis $h^{(4)}_\lambda$ a au moins 1 zéro d . Comme g est polynomiale de degré au plus 3, on a

$$h^{(4)}_\lambda(t) = g^{(4)}(t) - f^{(4)}(t) + 24\lambda = -f^{(4)}(t) + 24\lambda.$$

On a donc $-f^{(4)}(d) + 24\lambda = 0$ et on a donc $d \in]a, b[$ tel que :

$$f(c) = g(c) + \frac{f^{(4)}(d)}{24}(c-a)^2(c-b)^2.$$

5. La fonction f est de classe \mathcal{C}^4 par composition, donc la fonction $|f^{(4)}|$ est continue sur le segment $[a, b]$, elle admet donc un maximum donc $M = \sup_{x \in [a, b]} |f^{(4)}(x)|$ existe.

Grâce à la question précédente, on a, pour $t \in [a, b]$,

$$|f(t) - g(t)| \leq \frac{M}{24}(t-a)^2(b-t)^2.$$

On en déduit

$$\left| \int_a^b f(t) dt - \int_a^b g(t) dt \right| \leq \int_a^b |f(t) - g(t)| dt \leq M \int_a^b (t-a)^2(b-t)^2 dt.$$

Première méthode calculer explicitement l'intégrale (un peu lourd...) et on obtient

$$\left| \int_a^b f(t) dt - \int_a^b g(t) dt \right| \leq \frac{M}{24} \cdot \frac{(b-a)^5}{30} \dots$$

Deuxième méthode, plus simple, permettant d'obtenir un résultat un peu plus grossier, mais suffisant pour les questions suivantes :

On calcule le maximum de $t \mapsto (t-a)(b-t)$ sur $[a, b]$ et on trouve $\frac{(b-a)^2}{4}$, on en déduit

$$\left| \int_a^b f(t) dt - \int_a^b g(t) dt \right| \leq \frac{M}{24} \cdot \frac{(b-a)^5}{16}.$$

Soit $n \in \mathbb{N}^*$, on note (a_0, \dots, a_n) la subdivision régulière du segment $[a, b]$ (c'est-à-dire pour tout $i \in \llbracket 0, n \rrbracket$, $a_i = a + i \frac{b-a}{n}$). On note $g_n : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ la fonction telle que, pour tout $i \in \llbracket 0, n-1 \rrbracket$, la restriction $g_{[a_i, a_{i+1}]}$ est la fonction spline de $f_{[a_i, a_{i+1}]}$.

On pose enfin $S_n = \int_a^b g_n(t) dt$.

6. En utilisant la relation de Chasles, on a

$$S_n = \sum_{i=0}^{n-1} \int_{a_i}^{a_{i+1}} g_n(t) dt.$$

Comme $g_{[a_i, a_{i+1}]}$ est une fonction spline, grâce à la question 3, on en déduit

$$S_n = \sum_{i=0}^{n-1} \left((a_{i+1} - a_i) \frac{f(a_i) + f(a_{i+1})}{2} - \frac{(a_{i+1} - a_i)^2}{12} (f'(a_{i+1}) - f'(a_i)) \right).$$

En simplifiant, on obtient

$$S_n = \sum_{i=0}^{n-1} \left(\frac{b-a}{n} \frac{f(a_i) + f(a_{i+1})}{2} - \frac{(b-a)^2}{12n^2} (f'(a_{i+1}) - f'(a_i)) \right).$$

Puis en simplifiant par télescopage, on obtient

$$S_n = -\frac{(b-a)^2}{12n^2} (f'(b) - f'(a)) + \frac{b-a}{n} \sum_{i=0}^{n-1} \left(\frac{f(a_i) + f(a_{i+1})}{2} \right).$$

7. En réutilisant la relation de Chasles, on a

$$S_n - \int_a^b f(t)dt = \sum_{i=0}^{n-1} \int_{a_i}^{a_{i+1}} (g_n(t) - f(t))dt.$$

On en déduit

$$\left| S_n - \int_a^b f(t)dt \right| = \sum_{i=0}^{n-1} \int_{a_i}^{a_{i+1}} |g_n(t) - f(t)| dt.$$

En utilisant la question 5, on a

$$\int_{a_i}^{a_{i+1}} |g_n(t) - f(t)| dt \leq M \frac{(a_{i+1} - a_i)^5}{24 \cdot 30} = \frac{M}{24 \cdot 30n^5}.$$

Par sommation, on en déduit,

$$\left| S_n - \int_a^b f(t)dt \right| \leq \frac{M}{24 \cdot 30n^4}.$$

On conclut donc

$$\boxed{S_n - \int_a^b f(t)dt = O_{n \rightarrow +\infty} \left(\frac{1}{n^4} \right).}$$

On applique la méthode précédente pour f définie sur $[0, 1]$ par $f(t) = \frac{1}{1+t}$ et $n = 2$.

8. On calcule

$$S_2 = -\frac{1}{48}(f'(1) - f'(0)) + \sum_{i=0}^1 \frac{f\left(\frac{i}{2}\right) + f\left(\frac{i+1}{2}\right)}{2} = -\frac{1}{48} \cdot \left(-\frac{1}{4} + 1\right) + \frac{1}{2} + \frac{1}{2} \left(\frac{1}{2} + \frac{2}{3} + \frac{1}{4}\right) = \frac{133}{192} \approx 0,693$$

On calcule $f^{(4)}(t) = \frac{24}{(1+t)^5}$. On en déduit que $\sup_{t \in [0,1]} |f^{(4)}(t)| = 24$. En utilisant la question 7, on en déduit que

$$|S_2 - \ln 2| \leq \frac{1}{30} \cdot \frac{1}{2^4} \approx 0,002.$$

9. Comme pour $t \in [0, 1]$, $f^{(4)}(t) \geq 0$, la question 4 nous permet de dire que g est une approximation par défaut de la fonction f .

On conclut donc que S_2 est une approximation par défaut de l'intégrale de f .

1. Problème : ruine du joueur

On considère le jeu suivant : deux personnes s'affrontent en une succession de manches mutuellement indépendantes. Une manche fixée peut être remportée par le joueur A avec une probabilité $a \in]0,1[$, ou bien par le joueur B avec une probabilité $b = 1 - a$. La fortune du gagnant augmente alors de 1 euro, pendant que celle de son adversaire diminue du même montant. La fortune initiale de A est de n euros, la fortune initiale de B est $N - n$ euros, où N est un entier naturel strictement positif fixé (sauf indication contraire) et n un entier naturel inférieur ou égal à N . Dès qu'un joueur est ruiné (c'est-à-dire dès que sa fortune devient nulle), le jeu s'arrête.

On note également p_n la probabilité que A finisse par remporter la partie. Cette probabilité dépend bien sûr de sa fortune initiale n . On a par exemple $p_0 = 0$ et $p_N = 1$. On note enfin q_n la probabilité que B gagne la partie.

On pourra éventuellement utiliser les notations suivantes : A_k est l'événement « A remporte la k ième manche », B_k l'événement « B remporte la k ième manche ».

1.1. Justifier que $p_n = ap_{n+1} + (1 - a)p_{n-1}$ si $n \in \llbracket 1, N - 1 \rrbracket$.

Soit $n \in \llbracket 1, N - 1 \rrbracket$ et A l'événement « A finit par remporter la partie ». D'après la formule des probabilités totales appliquée au SCE $(A_1, \overline{A_1})$, on a $\boxed{p(A) = p(A_1)p_{A_1}(A) + p(\overline{A_1})p_{\overline{A_1}}(A)}$ soit encore $p_n = ap_{n+1} + (1 - a)p_{n-1}$. En effet, si A remporte le premier point il se retrouve avec une mise de $n + 1$ euros pendant que B possèdera $N - (n + 1)$ euros.

1.2. On suppose dans cette question que $a = \frac{1}{2}$.

1.2.1. Déterminer la valeur de p_n en fonction de n .

L'équation caractéristique associée à cette suite RL2 est $ar^2 - r + (1 - a) = 0$. Le discriminant vaut

$\Delta = 1 - 4a(1 - a) = 0$ car ici $a = \frac{1}{2}$. La racine double est 1. Donc p_n peut s'écrire ici $\alpha + \beta n$. Comme $p_0 = 0$ et

$p_N = 1$ on obtient $\boxed{p_n = \frac{n}{N}}$.

1.2.2. Donner par un raisonnement rapide la valeur de q_n .

Vue la fortune initiale de B, on a *mutatis mutandis* $\boxed{q_n = \frac{N - n}{N}}$.

1.2.3. Calculer $p_n + q_n$ et interpréter.

On a $\boxed{p_n + q_n = 1}$. Cela signifie que la probabilité que le jeu s'éternise est nulle.

1.3. On suppose dans cette question que $a \neq \frac{1}{2}$. On pose $\alpha = \frac{1 - a}{a}$.

1.3.1. Exprimer p_n pour tout $n \in \llbracket 0, N \rrbracket$ en fonction de α , n et N .

L'équation $ar^2 - r + (1 - a) = 0$ a pour solutions $r = 1$ et $r = \frac{1 - a}{a} = \alpha \neq 1$ car $a \neq \frac{1}{2}$.

Donc $p_n = A + B\alpha^n$. On a $p_0 = 0, p_N = 1$ donc $A + B = 0$ et $A + B\alpha^N = 1$ donc $B = -A$ et $A = \frac{1}{1 - \alpha^N}$.

Finalement $\boxed{p_n = \frac{1 - \alpha^n}{1 - \alpha^N} = a^{N-n} \frac{a^n - (1 - a)^n}{a^N - (1 - a)^N}}$ pour tout $n \in \llbracket 0, N \rrbracket$.

1.3.2. Donner par un raisonnement rapide la valeur de q_n (on donnera une expression avec une seule barre de fraction).

On a *mutatis mutandis* ($a \leftarrow 1 - a, n \leftarrow N - n$) $q_n = \frac{1 - \frac{1}{\alpha^{N-n}}}{1 - \frac{1}{\alpha^N}} = \alpha^n \frac{\alpha^{N-n} - 1}{\alpha^N - 1}$, donc $q_n = \alpha^n \frac{1 - \alpha^{N-n}}{1 - \alpha^N}$.

1.3.3. Vérifier que $p_n + q_n = 1$.

Donc $p_n + q_n = \frac{1 - \alpha^n + \alpha^n(1 - \alpha^{N-n})}{1 - \alpha^N} = \frac{1 - \alpha^N}{1 - \alpha^N}$, donc $p_n + q_n = 1$. Cela signifie encore une fois que la probabilité que la partie n'ait pas de vainqueur (que le jeu ne s'arrête pas) est nulle.

1.3.4. Montrer que si $a = \frac{4}{5}$ et $n = 4$ alors la probabilité que B finisse par l'emporter est inférieure à 4 millièmes quelque soit la fortune initiale de B !

Supposons que $a = \frac{4}{5}$ et $n = 4$. Alors $p_n = \frac{1 - \alpha^n}{1 - \alpha^N} > 1 - \alpha^n$ car $0 < 1 - \alpha^N < 1$ et $1 - \alpha^n > 0$. Donc

$q_n = 1 - p_n < \alpha^n = \frac{1}{4^4} = \frac{1}{256} < \frac{1}{250} = 4\text{‰}$ i.e. la probabilité que B finisse par l'emporter est inférieure à 4 millièmes

quelque soit la fortune initiale de B !

1.3.5. Dans cette question n est fixé et la fortune initiale de B est très grande : on considèrera qu'elle tend vers $+\infty$. Discuter la limite de p_n (n fixé, $N \rightarrow +\infty$) en discutant selon la valeur de a .

On a ici $\alpha > 0$ et $\alpha \neq 1$. Deux cas se présentent : si $\alpha > 1$, i.e. $a < \frac{1}{2}$, alors $p_n = \frac{1 - \alpha^n}{1 - \alpha^N} \rightarrow 0$ quand $N \rightarrow \infty$.

Sinon $0 < \alpha < 1$ et $p_n \rightarrow 1 - \alpha^n$!

1.4. Quelques précisions

On note respectivement $p(n, k)$ (resp. $q(n, k)$) la probabilité que A (resp. B) remporte la partie après k manches exactement, la fortune initiale de A valant n . Ces notations et hypothèses sont valables dans la suite.

1.4.1. Donner la valeur de $q(n, k)$ en fonction de a, b (ou a seulement) dans les cas suivants :

1.4.1.1. $k = n \in \{1, \dots, N - 1\}$

Ici B doit gagner n manches consécutives donc $q(n, n) = b^n$

1.4.1.2. $k < n$

B ne peut pas ruiner A en moins de manches que A n'a d'euros donc $q(n, k) = 0$

1.4.1.3. $n = 1, k = 3, N > 2$

On a $q(1, 3) = ab^2$ (A doit remporter la première manche et B les deux suivantes)

1.4.1.4. $n = 1, k = 5, N > 3$

On a $q(1, 3) = a^2b^3 + abab^2 = 2a^2b^3$ (deux parties possibles : AABBB et ABABB)

1.4.2. Exprimer $q(n, k)$ à l'aide de a, b et de valeurs de la forme $q(l, k - 1)$ si $n, k \in \mathbb{N}^*$.

On a $q(n, k) = aq(n + 1, k - 1) + bq(n - 1, k - 1)$ si $n, k \in \mathbb{N}^*$ par le même raisonnement qu'à la question 1, sauf qu'il faut tenir compte de la durée des parties.

1.4.3. Expliquer rapidement comment obtenir grâce à cette formule les valeurs des $q(n, k)$ en fonction de n et k dans un cas concret où N est connu.

On a donc une formule de récurrence simple sur k portant sur les $q(n, k)$. Comme on connaît les $q(n, 1)$ (ainsi d'ailleurs que les $q(n, 0)$ si on préfère redescendre d'un cran) qui valent tous 0 sauf $q(1, 1) = b$, on peut en déduire les $q(n, k)$ qui sont nuls si $n > k$ (donc il y aura un nombre fini de calculs à faire !)