

Aléatoire PC 5 :

Pierre Del Moral

Exercice 1.

Soit $(X_j)_{j \geq 1}$ une suite de variables aléatoires réelles I.I.D. et de carré intégrable, $\bar{X}_n = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n X_j$ et $V_n = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n X_j^2 - (\bar{X}_n)^2$.

1. Montrer que V_n converge presque sûrement vers une limite à préciser.
2. Montrer que $\mathbb{E}(V_n) = \frac{n-1}{n} \text{Var}(X_1)$. Comme l'espérance de V_n est différente de $\text{Var}(X_1)$, on dit que V_n est un estimateur biaisé de $\text{Var}(X_1)$. En revanche, $S_n^2 = \frac{n}{n-1} V_n$ est un estimateur sans biais.

Exercice 2.

Soit $0 < a < 1 < b$ et $(X_i)_{i \geq 1}$ une suite de variables aléatoires I.I.D. à valeurs dans $\{a, b\}$ et d'espérance 1. On pose $Y_n = \prod_{i=1}^n X_i$.

1. En remarquant que pour $x \in]0, \infty[\setminus \{1\}$, $\ln(x) < x - 1$, vérifier que $\mathbb{E}(\ln(X_1)) < 0$.
Montrer que la suite Y_n converge presque sûrement vers une limite que l'on précisera.
Un joueur joue tous les jours le dixième de sa fortune à pile ou face avec un ami.
Quelle est l'évolution de cette fortune au bout d'un temps très long ?
2. Calculer $\mathbb{E}(Y_n)$. La suite Y_n converge-t-elle en moyenne ?
La variable aléatoire $\sup_{n \in \mathbb{N}^*} Y_n$ est-elle intégrable ?

Exercice 3.

Soit $(X_i)_{i \geq 1}$ une suite de variables I.I.D. suivant la loi uniforme sur $[0, \theta]$ où $\theta > 0$. On pose $Y_n = \max(X_1, X_2, \dots, X_n)$.

1. Pour $n \geq 1$, calculer la fonction de répartition de Y_n . En déduire que la suite Y_n converge en probabilité vers θ . Converge-t-elle presque sûrement ? (on pourra s'intéresser à la monotonie de $(Y_n)_n$.)
2. Donner la loi de Y_n et calculer $\mathbb{E}(Y_n)$, $\text{Var}(Y_n)$ et $\mathbb{E}((Y_n - \theta)^2)$.
Vérifier que Y_n converge en moyenne quadratique vers θ et retrouver qu'elle converge également presque sûrement vers cette limite.
3. Montrer que Y_n a même loi que $\theta U^{\frac{1}{n}}$ où $U \sim \mathcal{U}[0, 1]$ et vérifier que $n(\theta - \theta U^{\frac{1}{n}})$ converge presque sûrement vers une limite à préciser.

Exercice 4. Soit $(X_j)_{j \geq 1}$ une suite de variables aléatoires centrées de carré intégrable indépendantes et $(c_j)_{j \geq 1}$ une suite décroissante de réels strictement positifs. Pour $n \leq m$ deux entiers, on pose $Y = \sum_{j=n}^{m-1} (c_j^2 - c_{j+1}^2) (X_1 + \dots + X_j)^2 + c_m^2 (X_1 + \dots + X_m)^2$.

1. Vérifier que $\mathbb{E}(Y) = c_n^2 \sum_{j=1}^n \mathbb{E}(X_j^2) + \sum_{j=n+1}^m c_j^2 \mathbb{E}(X_j^2)$.
2. Pour $k \in \{n, n+1, \dots, m\}$ et $\varepsilon > 0$, on pose $A_k = \{c_k |X_1 + \dots + X_k| \geq \varepsilon\}$ et $B_k = A_k \cap \bigcap_{j=n}^{k-1} A_j^c$. Vérifier que pour $j \geq k$, $\mathbb{E}((X_1 + \dots + X_j)^2 | B_k) \geq \frac{\varepsilon^2}{c_k^2}$. En déduire que $\mathbb{E}(Y | B_k) \geq \varepsilon^2$.
3. Vérifier que $\sum_{k=n}^m \mathbb{E}(Y | B_k) \mathbb{P}(B_k) \leq \mathbb{E}(Y)$ et conclure à l'inégalité de Hajek Renyi :
$$\mathbb{P}(\max_{n \leq k \leq m} c_k |X_1 + \dots + X_k| \geq \varepsilon) \leq \frac{1}{\varepsilon^2} \left(c_n^2 \sum_{j=1}^n \mathbb{E}(X_j^2) + \sum_{j=n+1}^m c_j^2 \mathbb{E}(X_j^2) \right).$$
4. On pose $\bar{X}_k = \frac{1}{k} \sum_{j=1}^k X_j$ et on suppose que $\sum_{j \in \mathbb{N}^*} \frac{\text{Var}(X_j)}{j^2} < +\infty$. Montrer que $\frac{1}{n^2} \sum_{j=1}^n \mathbb{E}(X_j^2) \rightarrow 0$ lorsque $n \rightarrow \infty$ et en déduire que $\mathbb{P}(\bigcap_{n \in \mathbb{N}^*} \{\max_{k \geq n} |\bar{X}_k| \geq \varepsilon\}) = 0$. Conclure que \bar{X}_k converge presque sûrement vers 0 lorsque $k \rightarrow \infty$.

Exercice 5.

Soit $(X_k)_{k \geq 1}$ une suite de variables aléatoires réelles de même loi que X . On suppose d'abord que X est intégrable.

1. On pose $\bar{X}_n = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n X_j$. Exprimer $\frac{X_k}{k}$ à l'aide de \bar{X}_k et \bar{X}_{k-1} et en déduire que si les X_j sont indépendantes, alors $\frac{X_k}{k}$ converge presque sûrement vers 0 lorsque k tend vers l'infini.
2. On suppose que X est à valeurs dans \mathbb{N} . Montrer que $\mathbb{E}(X) = \sum_{j=1}^{+\infty} \mathbb{P}(X \geq j)$. En déduire que pour $m \in \mathbb{N}^*$, $\sum_{k=1}^{+\infty} \mathbb{P}\left(\frac{X_k}{k} \geq \frac{1}{m}\right) < +\infty$ puis que $\frac{X_k}{k}$ converge presque sûrement vers 0 lorsque k tend vers l'infini.
3. Dans les deux cas précédents, conclure que $\frac{1}{n} \max(X_1, \dots, X_n)$ converge presque sûrement vers 0 lorsque n tend vers l'infini.

On suppose maintenant que X est une variable aléatoire réelle t.q. $\mathbb{E}(\max(X, 0)) < +\infty$.

4. Montrer que $\frac{1}{n} \max(X_1, \dots, X_n)$ converge presque sûrement vers 0 lorsque n tend vers l'infini.

Exercice 6.

Soit $f : [0, 1] \rightarrow \mathbb{R}$ une fonction continue et pour tout $x \in [0, 1]$, soit S_n^x une variable distribuée suivant la loi binomiale de paramètres (n, x) .

1. Soit $\alpha > 0$. Montrer que

$$\mathbb{E}(|f(S_n^x/n) - f(x)|) \leq 2 \sup_{y \in [0, 1]} |f(y)| \mathbb{P}(|S_n^x/n - x| \geq \alpha) + \sup_{\substack{y, z \in [0, 1] \\ |y-z| \leq \alpha}} |f(y) - f(z)|.$$

2. à l'aide de l'inégalité de Bienaymé-Chebyshev, en déduire que lorsque $n \rightarrow +\infty$, $f(S_n^x/n)$ converge en moyenne vers $f(x)$ uniformément pour $x \in [0, 1]$.
3. Conclure que f est limite uniforme sur $[0, 1]$ d'une suite de polynômes (théorème de Weierstrass).