

Colles de Mathématiques en E2A

Chaînes de Markov, convergence et approximation

Semaine 21 : 16 - 20 février

Toutes les définitions et tous les énoncés de théorèmes/propositions du cours sont exigibles des élèves. Les démonstrations des théorèmes du cours ne sont pas exigibles, sauf si elles apparaissent en question de cours.

On pourra à tout moment demander à un·e élève de donner la nature (réel, suite, fonction, ensemble, proposition, etc) d'une expression manipulée dans un exercice, pour vérifier sa bonne compréhension. On pourra aussi demander de préciser quelles sont les variables libres et quelles sont les variables liées (muettes).

On portera une attention toute particulière à ce que les objets soient correctement introduits avant d'être utilisés, et ne soient pas introduits pour rien.

1 Chapitre XVI : Chaînes de Markov

1.1 Définitions

- Notion de graphe probabiliste.
- Chaîne de Markov.
- Probabilités de transition (ou probabilités transitionnelles). Chaîne de Markov homogène.
- Le n^{e} état probabiliste de la chaîne de Markov est une **matrice ligne**. Etat initial.
- Matrice de transition associée à une chaîne de Markov. Graphe probabiliste associé à une matrice de transition.
- Etat stable (ou loi stationnaire).

1.2 Résultats

- Soit M une matrice de transition d'une chaîne de Markov. Alors les coefficients de la matrice M sont tous positifs ou nuls et la somme des coefficients de chaque ligne est égale à 1.
- Caractérisation des états stables d'une chaîne de Markov (où M est la matrice de transition)

$$\begin{aligned} \pi \text{ est un état stable de la chaîne de Markov} &\iff \begin{cases} {}^t\pi \text{ est un vecteur propre de } {}^tM \text{ associé à la valeur propre } 1 \\ \pi \text{ définit une loi de probabilité} \end{cases} \\ &\iff \begin{cases} {}^t\pi \text{ est un vecteur propre de } {}^tM \text{ associé à la valeur propre } 1 \\ \forall j \in \llbracket 1, r \rrbracket, \pi_j \geq 0 \\ \sum_{j=1}^r \pi_j = 1 \end{cases} \end{aligned}$$

- Soit (X_n) une chaîne de Markov homogène à r états notés $1, 2, \dots, r$. Si la suite (X_n) converge en loi, alors la loi limite est nécessairement une loi stationnaire de la chaîne de Markov. Autrement dit, si, pour tout $j \in \llbracket 1, r \rrbracket$, $\pi_j = \lim_{n \rightarrow +\infty} \mathbb{P}(X_n = j)$ existe, alors le vecteur $\pi = (\pi_1, \dots, \pi_r)$ est un état stable de la chaîne de Markov.

1.3 Méthodes

Il faut savoir redémontrer le théorème suivant, qui est une question classique des concours.

Théorème 1.1. Soit (X_n) une chaîne de Markov homogène à r états notés $1, 2, \dots, r$. On note $M = (p_{i,j})_{\substack{1 \leq i \leq r \\ 1 \leq j \leq r}}$ sa matrice de transition. Alors, pour tout $n \in \mathbb{N}$,

$$V_n = V_0 M^n$$

La preuve se fait en deux étapes.

1. En utilisant la formule des probabilités totales, on montre la formule de récurrence : $V_{n+1} = V_n M$.
2. On démontre ensuite que $V_n = V_0 M^n$ par récurrence. Même si la récurrence est très simple, il faut la détailler si c'est le coeur de la question.

2 Chapitre XVII : Convergence et approximation

2.1 Définitions

- Convergence en loi.

(On a vu la notion de convergence simple d'une suite de fonctions en cours pour préparer la définition de la convergence en loi, mais cette notion est hors-programme)

2.2 Résultats

- Inégalité de Markov. Conséquence pour une v.a.r. admettant un moment d'ordre m .
- Inégalité de Bienaymé-Tchebychev.
- Loi faible des grands nombres.
- Traduction de la convergence en loi dans deux cas particuliers (v.a.r. à densité et v.a.r. discrètes à valeurs dans $\mathbb{N}$ ou $\mathbb{Z}$). Il faut aussi avoir en tête le cas particulier d'une chaîne de Markov (suite de v.a.r. discrètes finies à valeurs dans $\llbracket 1, r \rrbracket$ ou $\llbracket 0, r \rrbracket$ selon les exercices).
- Convergence en loi de (X_n) où $X_n \hookrightarrow \mathcal{B}\left(n, \frac{\lambda}{n}\right)$ avec $\lambda > 0$. Il faut savoir refaire le calcul, car il illustre plusieurs techniques importantes qui peuvent servir ailleurs.

2.3 Méthodes

Pour montrer que (X_n) converge en loi vers X , on est amené à fixer $x \in \mathbb{R}$ et à séparer des cas avant de calculer $\lim_{n \rightarrow +\infty} F_{X_n}(x)$.

- Il est IMPERATIF de ne faire que des cas qui ne dépendent pas de n . Autrement dit, on doit fixer x dans un intervalle qui ne dépend pas de n .
- Au brouillon, on fait les « limites d'intervalles de définitions de F_{X_n} », ce qui donne les cas à séparer.
- On écrit les différents cas avec des inégalités STRICTES, ce qui revient à se placer sur des intervalles OUVERTS.
- On réfléchit à la fin aux points de recollement. En général on peut les rajouter à l'un des cas précédents gratuitement. Si ce n'est pas le cas, on les traite à part (un cas pour chaque point de recollement qui pose problème). On gardera en tête que la limite ne nous intéresse que si x est un point de continuité de F_X (pour ne pas faire de calculs inutiles).

3 Questions de cours

1. Citer puis démontrer l'inégalité de Bienaymé-Tchebychev à l'aide de l'inégalité de Markov.
2. Citer puis démontrer la loi faible des grands nombres à l'aide de l'inégalité de Bienaymé-Tchebychev.

3. Soit $\lambda > 0$. Soit $(X_n)_{n \in \mathbb{N}^*}$ une suite de v.a.r. . On suppose que : $\forall n \in \mathbb{N}^*, X_n \hookrightarrow \mathcal{B}\left(n, \frac{\lambda}{n}\right)$. Montrer que $X_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\mathcal{L}} X$ où $X \hookrightarrow \mathcal{P}(\lambda)$.
4. Soit $(X_n)_{n \in \mathbb{N}^*}$ une suite de v.a.r. . On suppose que : $\forall n \geq 3, X_n \hookrightarrow \mathcal{U}([\frac{1}{n}, 1 - \frac{1}{n}])$. Montrer que $X_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\mathcal{L}} X$ où $X \hookrightarrow \mathcal{U}([0, 1])$. (exo 7 du TD reformulé)