

G196. Stop ! Seuil à ne pas dépasser ****

Vous lancez un dé à 6 faces supposé parfait autant de fois que vous le souhaitez et vous calculez la somme des numéros obtenus depuis le premier lancer. Quand vous vous arrêtez, la somme devient votre score à condition qu'elle ne dépasse pas le seuil $k = 13$, sinon votre score est nul. Déterminez la meilleure stratégie qui permet de maximiser l'espérance mathématique de votre score et démontrez que celle-ci peut être supérieure à 10.

Pour les plus courageux: le seuil à ne pas dépasser étant un entier k quelconque > 20 , trouvez une formule approchée donnant l'espérance mathématique optimale de votre score.

Proposition Th Eveilleau

Q1

Une bonne stratégie sera de s'arrêter dès que l'on approchera d'un seuil qui donnera la meilleure espérance si possible supérieure à 10.

Déterminons les probabilités d'obtenir certains scores avec un seuil de **9** donné par l'expérimentation qui nous mène à une espérance légèrement **supérieure à 10**.

En un seul lancer de dés (proba p1)

$$p_1(X=1) = 1/6$$

$$p_1(X=2) = 1/6$$

$$p_1(X=3) = 1/6$$

$$p_1(X=4) = 1/6$$

$$p_1(X=5) = 1/6$$

$$p_1(X=6) = 1/6$$

Cherchons le seuil

Quand on atteint le total t , à une étape donnée, le nouveau lancer va donner un variation de l'espérance de :

Jusqu'à $t=7$, on augmente l'espérance de :

$$\sum_{i=1}^{i=13-t} \left(\frac{1}{6}\right) * i = 1/6 * [(1+2+3+\dots+(13-t))$$

$$t=0 \rightarrow (1/6) [13*14/2] = 91/6$$

$$t=1 \rightarrow (1/6) [12*13/2] = 78/6$$

$$t=2 \rightarrow (1/6) [11*12/2] = 66/6$$

$$t=3 \rightarrow (1/6) [10*11/2] = 55/6$$

$$t=4 \rightarrow (1/6) [9*10/2] = 45/6$$

$$t=5 \rightarrow (1/6) [8*9/2] = 36/6$$

$$t=6 \rightarrow (1/6) [7*8/2] = 28/6$$

$$t=7 \rightarrow (1/6) [6*7/2] = 21/6$$

Ensuite selon le jeu on l'augmente ou diminue et la variation de l'espérance est :

$$\sum_{i=1}^{i=13-t} \left(\frac{1}{6}\right) * i - \sum_{i=14-t}^{i=6} \left(\frac{1}{6}\right) * t = 1/6 * [(1+2+3+\dots+(13-t)) - t * (9-t)]$$

$$t=8 \rightarrow (1/6) [5*6/2 - 8*1] = 7/6$$

$$t=9 \rightarrow (1/6) [4*5/2 - 9*2] = -8/6$$

$$t=10 \rightarrow (1/6) [3*4/2 - 10*3] = -24/6$$

Autre façon de voir :

Si on a un total de 8, on peut espérer : $(1/6)*(9+10+11+12+13) \sim 9.16666666\dots$

Si on a un total de 9, on peut espérer : $(1/6)*(10+11+12+13) \sim 7.666666\dots \rightarrow$ diminution, on s'arrête.

Si on a un total de 10, on peut espérer : $(1/6)*(11+12+13) \sim 6$

etc.

A partir d'un total de 9, la variation de l'espérance devient négative

→ Il faut stopper les lancers dès lors que nous obtenons un total de 9.

Ce résultat est confirmé par la simulation des lancers de dés.

Nous allons maintenant calculer l'espérance avec ce seuil de 9.

Les probabilités d'obtenir un score dépendent du total obtenu. A chaque étape.

Aussi nous devons calculer ces probabilités de proche en proche selon le nombre de lancers.

Calcul des probabilités selon le nombre de lancers

En deux lancers de dés (proba p2)

Le résultat est forcément supérieur ou égal à 2.

$$p_2(X=2) \rightarrow p(X=1) \cdot p(X=1) = 1/6^2$$

$$p_2(X=3) \rightarrow p(X=1) \cdot p(X=2) + p(X=2) \cdot p(X=1) = 1/36^2 + 1/36^2 = 2/36$$

$$p_2(X=4) \rightarrow p(X=1) \cdot p(X=3) + p(X=2) \cdot p(X=2) + p(X=3) \cdot p(X=1) = 3/36$$

$$p_2(X=5) \rightarrow 4/6^2$$

$$p_2(X=6) \rightarrow 5/6^2$$

$$p_2(X=7) \rightarrow 6/6^2$$

$$p_2(X=8) \rightarrow 5/6^2$$

$$p_2(X=9) \rightarrow 4/6^2$$

$$p_2(X=10) \rightarrow 3/6^2$$

$$p_2(X=11) \rightarrow 2/6^2$$

$$p_2(X=12) \rightarrow 1/6^2$$

Le total fait bien $36/36=1$ OK

$$6^2 \cdot p_2 = [0, 0, 1, 2, 3, 4, 5, 6, 5, 4, 3, 2, 1];$$

De la même façon, on trouvera numériquement les probabilités suivantes les unes après les autres.

Pour chaque tableau p_i , diviser la valeur par 6^i pour avoir la bonne probabilité

p_1 donne la probabilité d'une valeur à partir de 0 en un lancer de dés ;

p_2 donne la probabilité d'une valeur à partir de 0 en deux lancers de dés ; etc.

$$P_3(X=2) \rightarrow 0/6^3$$

$$p_3(X=3) \rightarrow p_2(X=2) \cdot p_1(X=1) = 1/6^3$$

$$p_3(X=4) \rightarrow p_2(X=2) \cdot p_1(X=2) + p_2(X=3) \cdot p_1(X=1) = 3/6^3$$

$$p_3(X=5) \rightarrow p_2(X=4) \cdot p_1(X=1) + p_2(X=3) \cdot p_1(X=2) + p_2(X=2) \cdot p_1(X=3) = (3+2+1)/6^3 = 6/6^3$$

$$p_3(X=6) \rightarrow (4+3+2+1)/6^3 = 10/6^3$$

$$p_3(X=7) \rightarrow (6+5+4+3+2+1)/6^3 = 15/6^3$$

$$p_3(X=8) \rightarrow (6+5+4+3+2+1)/6^3 = 21/6^3$$

$$p_3(X=9) \rightarrow (5+6+5+4+3+2)/6^3 = 25/6^3$$

$$p_3(X=10) \rightarrow p_2(X=8) \cdot p_1(X=2) + p_2(X=7) \cdot p_1(X=3) + p_2(X=6) \cdot p_1(X=4) + p_2(X=5) \cdot p_1(X=5) + p_2(X=4) \cdot p_1(X=6) = (5+6+5+4+3)/6^3 = 23/6^3$$

Attention on s'arrête dès que 9 est atteint, on ne doit donc pas le dépasser.

$$p_3(X=11) \rightarrow (5+6+5+4)/6^3 = 20/6^3$$

$$p_3(X=12) \rightarrow p_2(X=6) \cdot p_1(X=6) + p_2(X=7) \cdot p_1(X=5) + p_2(X=8) \cdot p_1(X=4) = (5+6+5)/6^3 = 16/6^3$$

$$p_3(X=13) \rightarrow p_2(X=7) \cdot p_1(X=6) + p_2(X=8) \cdot p_1(X=5) = (6+5)/6^3 = 11/6^3$$

$$p_3(X=14) \rightarrow (5)/6^3 = 5/6^3$$

S'arrêtant à 9 en deux coups, on ne peut pas atteindre 15 en 3 coups.

Les tableaux se lisent ainsi : $p_1(X=2)=1/36$

$$6^1 \cdot p_1 = [0, 1, 1, 1, 1, 1, 1, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0];$$

$$6^2 \cdot p_2 = [0, 0, 1, 2, 3, 4, 5, 6, 5, 4, 3, 2, 1, 0, 0, 0, 0];$$

$$6^3 \cdot p_3 = [0, 0, 0, 1, 3, 6, 10, 15, 21, 25, 23, 20, 16, 11, 5, 0, 0];$$

$$6^4 \cdot p_4 = [0, 0, 0, 0, 1, 4, 10, 20, 35, 56, 55, 52, 46, 36, 21];$$

$$6^5 \cdot p_5 = [0, 0, 0, 0, 0, 1, 5, 15, 35, 70, 70, 69, 65, 55, 35];$$

$$6^6 \cdot p_6 = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 6, 21, 56, 56, 55, 50, 35];$$

$$6^7 \cdot p_7 = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 7, 28, 28, 28, 27, 21];$$

$$6^8 \cdot p_8 = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 8, 8, 8, 8, 7];$$

$$6^9 \cdot p_9 = [0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 1, 1, 1, 1];$$

On a au maximum 9 lancers lorsque le seuil est à 9 !

Comme la stratégie consiste à s'arrêter dès que l'on obtient 9, il est inutile de faire le calcul pour plus de 9 lancers qui donneront forcément un score plus grand que 9.

Calcul de l'espérance

Avec un seuil de 9

On va effectuer au maximum 9 jeux car le 10^{ème} commence au minimum à un total de 10. Au-delà de 13 le gain étant de 0, on ne tient pas compte non plus des résultats plus grands que

Les scores seront compris entre 9 et 13. On ne va donc tenir compte que de ces résultats.

$$\begin{aligned} p(X=9) &= p_1(X=9) + p_2(X=9) + p_3(X=9) + p_4(X=9) + p_5(X=9) + p_6(X=9) + p_7(X=9) + p_8(X=9) + p_9(X=9) \\ &= 0 + 4/6^2 + 25/6^3 + 56/6^4 + 70/6^5 + 56/6^6 + 28/6^7 + 8/6^8 + 1/6^9 \\ &= (1\ 119\ 744 + 1\ 166\ 400 + 435\ 456 + 90\ 720 + 12\ 096 + 1008 + 48 + 1) / 10\ 077\ 696 \\ &= 2\ 825\ 413 / 10\ 077\ 696 \sim 0.2803689454414977 \end{aligned}$$

En procédant de même avec les autres, nous avons :

$$p(X=10) \sim 0.2425603034661891$$

$$p(X=11) \sim 0.19845022116166236$$

$$p(X=12) \sim 0.1469884584730478$$

$$p(X=13) \sim 0.08694973533633082$$

$$E = \sum_{i=9}^{i \infty 13} (i P(X = i))$$

$$E = 9 * p(X=9) + 10 * p(X=10) + \dots + 13 * p(X=13)$$

On obtient ainsi l'espérance : 101 039 827 / 10 077 696

$$E \sim 10.026084037462532$$

Une simulation sur 20 000 cas avec la condition d'arrêt sur 9 donne effectivement une moyenne de l'espérance comprise entre **10.02 et 10.03**

Animation :

http://therese.eveilleau.pagesperso-orange.fr/pages/truc_mat/textes/G196.swf

Q2

Posons comme variable $k > 20$, le stop à ne pas dépasser.

Cherchons le seuil

Nous allons voir que c'est

-k-4 pour k=20 ET

-tousjours k-5 pour $k \geq 21$.

Quand on atteint le total t , à une étape donnée, le nouveau lancer va donner une certaine variation de l'espérance.

Jusqu'à $t=k-6$, on augmente l'espérance :

$$\sum_{i=1}^{i=k-t} \left(\frac{1}{6}\right) * i = 1/6 * [(1+2+3+\dots+(k-t))]$$

$$t=0 \rightarrow (1/6) [(k-t)*(k-t+1)/2]$$

$$t=1 \rightarrow (1/6) [(k-t-1)*(k-t)/2]$$

$$t= k-6 \rightarrow (1/6) [6*7/2] = 21/6$$

Ensuite on l'augmente ou diminue le total acquis selon le lancer et la variation de l'espérance est :

$$\sum_{i=1}^{i=k-t} \left(\frac{1}{6}\right) * i - \sum_{i=k+1-t}^{i=6} \left(\frac{1}{6}\right) * t = 1/6 * [1 + 2 + \dots + (k-t) - t * (t-k+6)]$$

$$t=k-5 \rightarrow (1/6) [5*6/2 - (k-5)*1] = (20 - k)/6$$

$$t= k-4 \rightarrow (1/6) [4*5/2 - (k-4)*2] = (18 - 2*k)/6$$

$$t= k-3 \rightarrow (1/6) [3*4/2 - (k-3)*3] = (15 - 3*k)/6$$

$$t= k-2 \rightarrow (1/6) [2*3/2 - (k-2)*4] = (11 - 4*k)/6$$

$$t= k-1 \rightarrow (1/6) [1*2/2 - (k-1)*5] = (6 - 5*k)/6$$

Autre façon de voir :

Si on a un total de k-6, on peut espérer : $(1/6)^* (k-5 + k-4 + k-3 + k-2 + k-1 + k) = k - 2.5$

Si on a un total de k-5, $\rightarrow (1/6)^* (k-4 + k-3 + k-2 + k-1 + k) = 5k/6 - 10/6 \dots = k - k/6 - 1.666 \dots$

Si on a un total de k-4, $\rightarrow (1/6)^* (k-3 + k-2 + k-1 + k) = 4k/6 - 6/6 \dots = 2k/3 - 1 \dots$

Si on a un total de k-3, $\rightarrow (1/6)^* (k-2 + k-1 + k) = k/2 - 1/2$

On voit que pour éviter les variations négatives, il faut choisir :

pour k=20 \rightarrow un seuil de k-4, soit 16

pour k=21 \rightarrow un seuil de k-5, soit 16

pour k=22 \rightarrow un seuil de k-5, soit 17

Ensuite, on voit que nous devons toujours choisir k-5 pour $k \geq 21$

pour k=23 \rightarrow un seuil de k-5, soit 18

pour k=24 \rightarrow un seuil de k-5, soit 19

etc.

Ces résultats sont confirmés par la simulation des lancers de dés.

Calcul de l'espérance

Posons le seuil s , $s=k-5$, pour un maximum à ne pas dépasser : k

Calcul général de p_3

$$P_3(X=2) \rightarrow 0/6^3$$

$$p_3(X=3) \rightarrow p_2(X=2) \cdot p_1(X=1) = 1/6^3$$

$$p_3(X=4) \rightarrow \sum_{i=2}^{i=3} P_2(X=i) (P_1(X=4-i)) = (1+2)/6^3 = 3/6^3$$

$$p_3(X=5) \rightarrow \sum_{i=2}^{i=4} P_2(X=i) (P_1(X=5-i)) = (1+2+3)/6^3 = 6/6^3$$

$$p_3(X=6) \rightarrow \sum_{i=2}^{i=5} P_2(X=i) (P_1(X=6-i)) = (1+2+3+4)/6^3 = 10/6^3$$

$$p_3(X=7) \rightarrow \sum_{i=2}^{i=6} P_2(X=i) (P_1(X=7-i)) = (1+2+3+4+5)/6^3 = 15/6^3$$

$$p_3(X=8) \rightarrow \sum_{i=2}^{i=7} P_2(X=i) (P_1(X=8-i)) = (1+2+3+4+5+6)/6^3 = 21/6^3$$

$$p_3(X=9) \rightarrow \sum_{i=3}^{i=8} P_2(X=i) (P_1(X=9-i)) = (2+3+4+5+6+5)/6^3 = 25/6^3$$

$$p_3(X=10) \rightarrow \sum_{i=4}^{i=9} P_2(X=i) (P_1(X=10-i)) = (3+4+5+6+5+4)/6^3 = 27/6^3$$

$$p_3(X=11) \rightarrow \sum_{i=5}^{i=10} P_2(X=i) (P_1(X=11-i)) = (4+5+6+5+4+3)/6^3 = 27/6^3$$

$$p_3(X=12) \rightarrow \sum_{i=6}^{i=11} P_2(X=i) (P_1(X=12-i)) = (5+6+5+4+3+2)/6^3 = 25/6^3$$

$$p_3(X=13) \rightarrow \sum_{i=7}^{i=12} P_2(X=i) (P_1(X=13-i)) = (6+5+4+3+2+1)/6^3 = 21/6^3$$

$$p_3(X=14) \rightarrow \sum_{i=8}^{i=12} P_2(X=i) (P_1(X=14-i)) = (5+4+3+2+1)/6^3 = 15/6^3$$

$$p_3(X=15) \rightarrow \sum_{i=9}^{i=12} P_2(X=i) (P_1(X=15-i)) = (4+3+2+1)/6^3 = 10/6^3$$

$$p_3(X=16) \rightarrow \sum_{i=10}^{i=12} P_2(X=i) (P_1(X=16-i)) = (3+2+1)/6^3 = 6/6^3$$

$$p_3(X=17) \rightarrow \sum_{i=11}^{i=12} P_2(X=i) (P_1(X=17-i)) = (2+1)/6^3 = 3/6^3$$

$$p_3(X=18) \rightarrow \sum_{i=12}^{i=12} P_2(X=i) (P_1(X=18-i)) = (1)/6^3 = 1/6^3$$

Au-delà de $x=18$, probabilité nulle.

$$\text{Si } x \leq 18 \rightarrow p_3(X=n) \rightarrow \sum_{i=\text{Min}(12, n-6, s)}^{i=12} P_2(X=i) (P_1(X=n-i))$$

SINON probabilité nulle.

$$6^3 \cdot p_3 = [0, 0, 0, 1, 3, 6, 10, 15, 21, 25, 27, 27, 25, 21, 15, 10, 6, 3, 1, 0, 0, 0]$$

Calcul général de p4

$$P4(X=2) \rightarrow 0/6^3 ; \quad p4(X=3) \rightarrow p3(X=2)*p1(X=2) = 0/6^3$$

$$p4(X=4) \rightarrow \sum_{i=3}^{i=3} P3(X=i) (P1(X=4-i)) = 1/6^4$$

$$p4(X=5) \rightarrow \sum_{i=3}^{i=4} P3(X=i) (P1(X=5-i)) = (1+3)/6^3 = 4/6^4$$

$$p4(X=6) \rightarrow \sum_{i=3}^{i=5} P3(X=i) (P1(X=6-i)) = (1+3+6)/6^3 = 10/6^4$$

$$p4(X=7) \rightarrow \sum_{i=3}^{i=6} P3(X=i) (P1(X=7-i)) = (1+3+6+10)/6^3 = 20/6^4$$

$$p4(X=8) \rightarrow \sum_{i=3}^{i=7} P3(X=i) (P1(X=8-i)) = (1+3+6+10+15)/6^3 = 35/6^4$$

$$p4(X=9) \rightarrow \sum_{i=3}^{i=8} P3(X=i) (P1(X=9-i)) = (1+3+6+10+15+21)/6^3 = 56/6^4$$

$$p4(X=10) \rightarrow \sum_{i=4}^{i=9} P3(X=i) (P1(X=10-i)) = (3+6+10+15+21+25)/6^3 = 80/6^4$$

$$p4(X=11) \rightarrow \sum_{i=5}^{i=10} P3(X=i) (P1(X=11-i)) = (6+10+15+21+25+27)/6^3 = 114/6^4$$

$$p4(X=12) \rightarrow \sum_{i=6}^{i=11} P3(X=i) (P1(X=12-i)) = (10+15+21+25+27+27)/6^3 = 125/6^4$$

$$p4(X=13) \rightarrow \sum_{i=7}^{i=12} P3(X=i) (P1(X=13-i)) = (15+21+25+27+27+25)/6^3 = 140/6^4$$

$$p4(X=14) \rightarrow \sum_{i=8}^{i=13} P3(X=i) (P1(X=14-i)) = (21+25+27+27+25+21)/6^3 = 146/6^4$$

$$p4(X=15) \rightarrow \sum_{i=9}^{i=14} P3(X=i) (P1(X=15-i)) = (25+27+27+25+21+15)/6^3 = 140/6^4$$

$$p4(X=16) \rightarrow \sum_{i=10}^{i=15} P3(X=i) (P1(X=16-i)) = (27+27+25+21+15+10)/6^3 = 125/6^4$$

$$p4(X=17) \rightarrow \sum_{i=11}^{i=16} P3(X=i) (P1(X=17-i)) = (27+25+21+15+10+6)/6^3 = 104/6^4$$

$$p4(X=18) \rightarrow \sum_{i=12}^{i=Min(17,k-5)} P3(X=i) (P1(X=18-i)) = (1+3+6+10)/6^3 = 20/6^4$$

$$p4(X=19) \rightarrow \sum_{i=13}^{i=Min(16,k-5)} P3(X=i) (P1(X=18-i)) = (1+3+6+10)/6^3 = 20/6^4$$

$$p4(X=k-5) \rightarrow \sum_{i=k-11}^{i=k-6} P3(X=i) (P1(X=k-5-i)) \text{ si } k-5 \leq 24 \text{ SINON } 0$$

$$p4(X=k-4) \rightarrow \sum_{i=k-10}^{i=k-5} P3(X=i) (P1(X=k-4-i)) \text{ si } k-4 \leq 24 \text{ SINON } 0$$

On s'arrête à k-5

$$p4(X=k-3) \rightarrow \sum_{i=k-9}^{i=k-5} P3(X=i) (P1(X=k-3-i)) \text{ si } k-3 \leq 24 \text{ SINON } 0$$

$$p4(X=k) \rightarrow \sum_{i=k-5}^{i=k-5} P3(X=i) (P1(X=k-i)) \text{ si } k-3 \leq 24 \text{ SINON } 0$$

Au-delà de x=24, probabilité nulle pour p4.

On va effectuer au maximum s=k-5 jeux car le (s+1)^{ème} commence au minimum à un total de s+1. Au-delà de k le gain étant de 0, on ne tient pas compte non plus des résultats plus grands que k.

Les scores seront compris entre s et k. On ne va donc tenir compte que de ces résultats.

