

On considère deux files d'attente indépendantes. Deux personnes arrivent simultanément et se présentent respectivement aux deux files d'attente. On note  $X$  le temps d'attente de la première personne,  $Y$  le temps d'attente de la seconde personne, en minutes. On supposera que  $X$  et  $Y$  suivent chacune une loi exponentielle de paramètre  $\lambda = 2$ .

1. Quel est le temps d'attente moyen pour chaque personne ?

Puisque  $X$  et  $Y$  suivent chacune une loi exponentielle de paramètre  $\lambda = 2$ , on a  $\mathbb{E}(X) = \mathbb{E}(Y) = 0.5$  minutes, ce qui donne le temps d'attente moyen pour chaque personne.

2. Quelle est la densité de la variable  $X^2$  ? la variable  $-Y$  ?

Pour obtenir la loi de  $X^2$ , on cherche sa densité par identification. Soit  $h$  une fonction continue bornée quelconque :

$$\begin{aligned}\mathbb{E}(h(X^2)) &= \int_0^{+\infty} h(x^2) 2e^{-2x} dx \\ &= \int_0^{+\infty} 2h(u) e^{-2\sqrt{u}} \frac{1}{2\sqrt{u}} du\end{aligned}$$

Par identification, on en déduit une densité de  $X^2$  définie par  $f_{X^2}(x) = \frac{e^{-2\sqrt{u}}}{\sqrt{u}} 1_{\mathbb{R}_+}(x)$ .  
On procède de même pour obtenir la loi de  $-Y$  :

$$\begin{aligned}\mathbb{E}(h(-Y)) &= \int_0^{+\infty} h(-x) 2e^{-2x} dx \\ &= \int_0^{-\infty} 2h(u) e^{2u} \times (-du) \\ &= \int_{-\infty}^0 2h(u) e^{2u} du\end{aligned}$$

Par identification, on en déduit une densité de  $-Y$  définie par  $f_{-Y}(y) = 2e^{2y} 1_{\mathbb{R}_-}(y) = f_Y(-y)$ .

3. Calculer la probabilité que la différence d'attente entre les deux personnes soit inférieure à 1 minute.

On calcule  $P(|X - Y| < 1) = P(-1 < X - Y < 1)$  en utilisant la loi du couple  $(X, Y)$ . Par indépendance de  $X$  et  $Y$ , le couple  $(X, Y)$  admet pour densité  $g(x, y) = 2e^{-2x} \times 2e^{-2y} 1_{\mathbb{R}_+^2}(x, y)$ . La probabilité cherchée est

$$P(|X - Y| < 1) = \iint_D g(x, y) dx dy$$

où  $D = \{(x, y) \in \mathbb{R}^2, x > 0, y > 0, -1 < x - y < 1\} = \{y \in [0; 1], x \in [0; 1 + y]\} \cup \{y \in ]1; +\infty, x \in [-1 + y; 1 + y]\}$ .

On utilise cette décomposition du domaine  $D$  pour écrire l'intégrale sous forme d'une somme :

$$\begin{aligned}\iint_D g(x, y) dx dy &= \int_0^1 \int_0^{1+y} 2e^{-2x} dx 2e^{-2y} dy + \int_1^{+\infty} \int_{y-1}^{y+1} 2e^{-2x} dx 2e^{-2y} dy \\ &= \int_0^1 2e^{-2y} (1 - e^{-2(1+y)}) dy + \int_1^{+\infty} (e^{-2(y-1)} - e^{-2(y+1)}) (1 - e^{-2(1+y)}) dy \\ &= 1 - \frac{3}{2}e^{-2} + \frac{1}{2}e^{-6} + \frac{1}{2}e^{-2} - \frac{1}{2}e^{-6} \\ &= 1 - e^{-2}\end{aligned}$$