



PRÉPASIMPLE

prepasimple.fr

EDHEC

Mathématiques — Option économique

2007

Mathématiques appliquées

Mathématiques appliquées — Prépa ECG

Annales de concours · Sujet

Exercice 1

Pour toute matrice M élément de $\mathcal{M}_2(\mathbb{R})$, on note ${}^tM$ la matrice transposée de M ,

définie de la façon suivante : si $M = \begin{pmatrix} a & c \\ b & d \end{pmatrix}$, alors ${}^tM = \begin{pmatrix} a & b \\ c & d \end{pmatrix}$.

On pose $E_1 = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$, $E_2 = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$, $E_3 = \begin{pmatrix} 0 & 0 \\ 1 & 0 \end{pmatrix}$ et $E_4 = \begin{pmatrix} 0 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$.

On rappelle que $\mathcal{B} = (E_1, E_2, E_3, E_4)$ est une base de $\mathcal{M}_2(\mathbb{R})$.

On note φ l'application qui à toute matrice M de $\mathcal{M}_2(\mathbb{R})$ associe $\varphi(M) = M + {}^tM$.

- 1) a) Montrer que φ est un endomorphisme de $\mathcal{M}_2(\mathbb{R})$.
- 1) b) Écrire la matrice A de φ dans la base $\mathcal{B}$.
- 1) c) En déduire que φ est diagonalisable et non bijectif.
- 2) Calculer A^2 et en déduire que, pour tout $n \in \mathbb{N}^*$, $A^n = 2^{n-1}A$.
- 3) a) Montrer que $\text{Im } \varphi = \text{Vect}(E_1, E_2 + E_3, E_4)$, puis établir que $\dim \text{Im } \varphi = 3$.
- 3) b) En déduire la dimension de $\text{Ker } \varphi$ puis déterminer une base de $\text{Ker } \varphi$.
- 3) c) Établir que $\text{Im } \varphi$ est le sous-espace propre de φ associé à la valeur propre 2.
- 3) d) Donner, pour résumer, les valeurs propres de φ ainsi qu'une base de chacun des sous-espaces propres associés.

Exercice 2

On admet que, si Z_1 et Z_2 sont deux variables aléatoires à densité, définies sur le même espace probabilisé, alors leur covariance, si elle existe, est définie par :

$$\text{Cov}(Z_1, Z_2) = E(Z_1 Z_2) - E(Z_1)E(Z_2).$$

On admet également que si Z_1 et Z_2 sont indépendantes alors leur covariance est nulle, lorsqu'elle existe.

Pour les variables X et Y définies ci-dessous, on admet que ces deux résultats s'appliquent aussi au couple (X^2, Y^2) dès que $E(X^4)$ et $E(Y^4)$ sont finis, sans qu'il soit nécessaire d'étudier des densités de X^2 et Y^2 .

On considère deux variables aléatoires réelles X et U définies sur le même espace probabilisé $(\Omega, \mathcal{A}, P)$, indépendantes, X suivant la loi normale $\mathcal{N}(0, 1)$ et U suivant la loi discrète uniforme sur $\{-1, 1\}$.

On pose $Y = UX$ et on admet que Y est une variable aléatoire à densité, définie elle aussi sur l'espace $(\Omega, \mathcal{A}, P)$.

1) a) En utilisant la formule des probabilités totales, montrer que :

$$\forall x \in \mathbb{R}, \quad P(Y \leq x) = P([U = 1] \cap [X \leq x]) + P([U = -1] \cap [X \geq -x]).$$

1) b) En déduire que Y suit la même loi que X .

2) a) Calculer l'espérance de U puis montrer que $E(XY) = 0$.

2) b) En déduire que $\text{Cov}(X, Y) = 0$.

3) a) Rappeler la valeur de $E(X^2)$ et en déduire que $\int_0^{+\infty} x^2 e^{-x^2/2} dx = \frac{1}{2} \sqrt{2\pi}$.

3) b) Montrer, grâce à une intégration par parties, que :

$$\forall A \in \mathbb{R}_+, \quad \int_0^A x^4 e^{-x^2/2} dx = -A^3 e^{-A^2/2} + 3 \int_0^A x^2 e^{-x^2/2} dx.$$

3) c) En déduire que l'intégrale $\int_0^{+\infty} x^4 e^{-x^2/2} dx$ converge et vaut $\frac{3}{2}\sqrt{2\pi}$.

3) d) Établir finalement que X possède un moment d'ordre 4 et que $E(X^4) = 3$.

4) a) Vérifier que $E(X^2 Y^2) = 3$.

4) b) Déterminer $\text{Cov}(X^2, Y^2)$.

4) c) En déduire que X^2 et Y^2 ne sont pas indépendantes. Montrer alors que X et Y ne le sont pas non plus.

4) d) Cet exercice a permis de montrer qu'un résultat classique concernant les variables discrètes est encore valable pour les variables à densité. Lequel ?

Exercice 3

1) a) Montrer que : $\forall x > 0, x - \ln x > 0$.

1) b) On pose alors $f(x) = \frac{\ln x}{x - \ln x}$ si $x > 0$ et $f(0) = -1$.

Déterminer l'ensemble de définition D de la fonction f .

2) a) Montrer que f est continue sur D .

2) b) Montrer que f est dérivable à droite en 0 et que $f'_d(0) = 0$.

3) a) Justifier que f est dérivable sur $D \setminus \{0\}$ et calculer $f'(x)$ pour tout $x \in D \setminus \{0\}$.

3) b) Déterminer la limite de f en $+\infty$.

3) c) Dresser le tableau de variation de f .

4) Étudier le signe de $f(x)$.

5) Pour tout réel $x \in D$, on pose $F(x) = \int_0^x f(t) dt$.

5) a) Montrer que F est de classe C^1 sur D puis étudier ses variations.

5) b) Déterminer $\lim_{x \rightarrow +\infty} \int_1^x \frac{\ln t}{t} dt$.

5) c) En déduire $\lim_{x \rightarrow +\infty} \int_1^x \frac{\ln t}{t - \ln t} dt$, puis $\lim_{x \rightarrow +\infty} F(x)$.

Problème

On lance une pièce équilibrée : la probabilité d'obtenir « pile » et celle d'obtenir « face » sont toutes deux égales à $1/2$. Les lancers successifs sont indépendants. On note Z la variable aléatoire égale au rang du lancer où l'on obtient le premier « pile ».

Après cette série de lancers, si Z a pris la valeur k , avec $k \in \mathbb{N}^*$, on remplit une urne de k boules numérotées $1, 2, \dots, k$, puis on extrait au hasard une boule de cette urne.

On note X la variable aléatoire égale au numéro de la boule tirée après la procédure décrite ci-dessus.

1) On décide de coder l'événement « obtenir un pile » par 1 et l'événement « obtenir une face » par 0.

Après l'importation `import numpy.random as rd`, la commande `rd.randint(k)` renvoie un entier aléatoire équiprobable parmi $0, 1, \dots, k-1$, pour tout entier $k \geq 1$. Plus

généralement, `rd.randint(a, b)` renvoie un entier équiprobable parmi $a, a + 1, \dots, b - 1$, lorsque $a < b$ sont des entiers. Les appels successifs simulent ici des tirages indépendants.

- 1) a) Compléter le programme suivant pour qu'il affiche la valeur prise par Z lors de la première partie de l'expérience décrite ci-dessus.

Python

```
import numpy.random as rd

z = 0
hasard = 0
while hasard != 1:
    z = ...
    hasard = ...
print(z)
```

- 1) b) Quelle instruction faut-il rajouter après `print(z)` pour que ce programme simule l'expérience aléatoire décrite dans ce problème et affiche la valeur prise par la variable aléatoire X ?
- 2) Établir la convergence de la série de terme général $\frac{1}{k} \left(\frac{1}{2}\right)^k$, pour $k \in \mathbb{N}^*$.
- 3) Rappeler la loi de Z ainsi que son espérance et sa variance.
- 4) a) Pour tout couple $(i, k) \in \mathbb{N}^* \times \mathbb{N}^*$, déterminer la probabilité $P_{[Z=k]}(X = i)$.
- 4) b) En déduire que :

$$\forall i \in \mathbb{N}^*, \quad P(X = i) = \sum_{k=i}^{+\infty} \frac{1}{k} \left(\frac{1}{2}\right)^k.$$

- 4) c) On admet, dans cette question, qu'il est licite de permuter les sommes selon les domaines d'indices

$$\sum_{i=1}^{+\infty} \sum_{k=i}^{+\infty} = \sum_{k=1}^{+\infty} \sum_{i=1}^k.$$

Vérifier que

$$\sum_{i=1}^{+\infty} P(X = i) = 1.$$

- 5) a) Montrer que, pour tout entier naturel i non nul, $iP(X = i) \leq \left(\frac{1}{2}\right)^{i-1}$.

- 5) b) En déduire que X possède une espérance.

- 5) c) Montrer, en admettant qu'il est licite de permuter les symboles

$$\sum$$

comme dans la question 4) c), que $E(X) = \frac{3}{2}$.

- 6) a) Utiliser le résultat de la question 5) a) pour montrer que X a un moment d'ordre 2.

- 6) b) Établir alors, toujours en admettant qu'il est licite de permuter les symboles

$$\sum$$

comme dans la question 4) c), que :

$$E(X^2) = \frac{1}{6} \sum_{k=1}^{+\infty} (k+1)(2k+1) \left(\frac{1}{2}\right)^k.$$

6) c) Déterminer les réels a, b, c tels que : $\forall k \in \mathbb{N}^*, (k+1)(2k+1) = ak(k-1) + bk + c$.

6) d) En déduire la valeur de $E(X^2)$ et vérifier que $V(X) = \frac{11}{12}$.

7) a) Écrire l'inégalité de Bienaymé-Tchebychev pour la variable X .

7) b) En déduire que $P(X \geq 3) \leq \frac{11}{27}$.

8) On se propose dans cette question de calculer $P(X = 1)$, $P(X = 2)$ et $P(X \geq 3)$.

8) a) Écrire explicitement en fonction de x et n la somme

$$\sum_{k=1}^n x^{k-1},$$

où n désigne un entier naturel non nul et x un réel différent de 1.

8) b) En déduire que :

$$\forall n \in \mathbb{N}^*, \quad \sum_{k=1}^n \frac{1}{k} \left(\frac{1}{2}\right)^k = \ln 2 - \int_0^{1/2} \frac{x^n}{1-x} dx.$$

8) c) Montrer que : $\forall n \in \mathbb{N}^*, 0 \leq \int_0^{1/2} \frac{x^n}{1-x} dx \leq \left(\frac{1}{2}\right)^n$.

En déduire la valeur de $\lim_{n \rightarrow +\infty} \int_0^{1/2} \frac{x^n}{1-x} dx$.

- 8) d) Établir alors que $P(X = 1) = \ln 2$, puis donner la valeur de $P(X = 2)$.
- 8) e) Utiliser les résultats précédents pour calculer $P(X \geq 3)$, puis donner une valeur approchée de $P(X \geq 3)$ en prenant $\ln 2 \simeq 0,7$. Que peut-on en déduire en ce qui concerne le majorant trouvé à la septième question ?