



PRÉPASIMPLE

prepasimple.fr

EM Lyon

Mathématiques — Option économique

2013

Mathématiques appliquées

Mathématiques appliquées — Prépa ECG

Annales de concours · Sujet

Exercice 1

Partie I - Calcul d'une intégrale dépendant d'un paramètre

On considère l'application $g : [0; 1] \rightarrow \mathbb{R}$ définie, pour tout $t \in [0; 1]$, par :

$$g(t) = \begin{cases} -t \ln t & \text{si } 0 < t \leq 1, \\ 0 & \text{si } t = 0. \end{cases}$$

1. Montrer que g est continue sur $[0; 1]$.
2. À l'aide d'une intégration par parties, calculer, pour tout $x \in]0; 1[$, l'intégrale $\int_x^1 g(t) dt$.

3. En déduire que l'intégrale $\int_0^1 g(t) dt$ converge et que :

$$\int_0^1 g(t) dt = \frac{1}{4}.$$

Partie II - Exemple de densité

On considère l'application $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ définie, pour tout $t \in \mathbb{R}$, par :

$$f(t) = \begin{cases} -t \ln t + t^{1/3} & \text{si } 0 < t < 1, \\ 0 & \text{sinon.} \end{cases}$$

1. Montrer que f est continue sur $] -\infty; 1[$ et sur $]1; +\infty[$. Est-ce que f est continue en 1 ?

2. Établir que l'intégrale $\int_{-\infty}^{+\infty} f(t) dt$ converge et que :

$$\int_{-\infty}^{+\infty} f(t) dt = 1.$$

3. Montrer que f est une densité.
4. a. Montrer que f est de classe C^2 sur $]0; 1[$ et calculer $f'(t)$ et $f''(t)$ pour tout $t \in]0; 1[$.
- b. En déduire que l'équation $f'(t) = 0$, d'inconnue $t \in]0; 1[$, admet une solution et une seule, notée α , et montrer :

$$\frac{1}{e} < \alpha < 1.$$

- c. Écrire un programme en Python qui calcule et affiche une valeur approchée de α à 10^{-3} près, mettant en œuvre l'algorithme de dichotomie.

On pourra utiliser la bibliothèque NumPy, importée par `import numpy as np` : `np.log(t)` calcule le logarithme népérien de $t > 0$ et `np.exp(t)` calcule son exponentielle. La commande `print(valeur)` affiche la valeur donnée.

Partie III - Calcul d'une fonction de répartition

On admet qu'il existe une variable aléatoire réelle X ayant f pour densité, l'application f ayant été définie au début de la partie II, et on note F la fonction de répartition de X .

1. Calculer, pour tout $x \in]0; 1[$, l'intégrale $\int_x^1 f(t) dt$. On pourra utiliser le résultat obtenu à la question I.2.
2. Calculer $F(x)$ pour tout $x \in \mathbb{R}$.

3. Tracer l'allure de la courbe représentative de F .

Partie IV - Étude d'extremum local pour une fonction de deux variables réelles

On note D l'ensemble des couples (x, y) appartenant à $]0; +\infty[^2$ tels que $x + y < 1$ et $2x < 1$.

On considère l'application $G : D \rightarrow \mathbb{R}$, de classe C^2 sur l'ouvert D , définie, pour tout $(x, y) \in D$, par :

$$G(x, y) = f(x + y) - \frac{1}{2}f(2x),$$

l'application f ayant été définie au début de la partie II.

1. Représenter l'ensemble D .
2. Calculer, pour tout $(x, y) \in D$, les dérivées partielles premières de G en (x, y) , en fonction de x, y, f' .
3. Soit $(x, y) \in D$. Montrer que (x, y) est un point critique de G si et seulement si :

$$f'(2x) = 0 \quad \text{et} \quad f'(x + y) = 0.$$

4. En déduire que G admet un point critique et un seul, et qu'il s'agit de $\left(\frac{\alpha}{2}, \frac{\alpha}{2}\right)$, le réel α ayant été défini en II.4.b.
5. Est-ce que G admet un extremum local ?

Exercice 2

On note :

$$A = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 & 2 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \\ 2 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix} \in \mathcal{M}_4(\mathbb{R}).$$

1. Est-ce que A est diagonalisable dans $\mathcal{M}_4(\mathbb{R})$?
2. Déterminer les valeurs propres de A et, pour chaque valeur propre de A , déterminer une base du sous-espace propre associé.
3. En déduire une matrice diagonale $D \in \mathcal{M}_4(\mathbb{R})$, à coefficients diagonaux rangés dans l'ordre croissant, et une matrice inversible $P \in \mathcal{M}_4(\mathbb{R})$, à coefficients diagonaux tous égaux à 1, telles que $A = PDP^{-1}$, et calculer P^{-1} .

On appelle commutant de A , et on note C_A , l'ensemble des matrices M de $\mathcal{M}_4(\mathbb{R})$ telles que $AM = MA$.

On appelle commutant de D , et on note C_D , l'ensemble des matrices N de $\mathcal{M}_4(\mathbb{R})$ telles que $DN = ND$.

4. Montrer que C_A est un sous-espace vectoriel de $\mathcal{M}_4(\mathbb{R})$.
5. Soit $M \in \mathcal{M}_4(\mathbb{R})$. On note $N = P^{-1}MP$. Montrer :

$$M \in C_A \iff N \in C_D.$$

6. Déterminer C_D , en utilisant les coefficients des matrices.

7. En déduire :

$$C_A = \left\{ \begin{pmatrix} a & 0 & 0 & b \\ 0 & c & d & 0 \\ 0 & d & c & 0 \\ b & 0 & 0 & a \end{pmatrix} ; (a, b, c, d) \in \mathbb{R}^4 \right\}.$$

8. Déterminer une base de C_A et la dimension de C_A .

Exercice 3

Soit n un entier supérieur ou égal à 2.

On considère une urne $\mathcal{U}$ contenant n boules numérotées de 1 à n et indiscernables au toucher. On effectue une suite de tirages d'une boule avec remise de la boule dans l'urne $\mathcal{U}$.

Partie I

Soit k un entier supérieur ou égal à 1. Pour tout $i \in \llbracket 1; n \rrbracket$, on note X_i la variable aléatoire égale au nombre d'obtentions de la boule numéro i au cours des k premiers tirages.

1. Soit $i \in \llbracket 1; n \rrbracket$. Donner la loi de X_i . Rappeler l'espérance et la variance de X_i .
2. Les variables aléatoires $X_1, X_2, \dots, X_n$ sont-elles indépendantes ?
3. Soit $(i, j) \in \llbracket 1; n \rrbracket^2$ tel que $i \neq j$.

- a. Déterminer la loi de la variable aléatoire $X_i + X_j$. Rappeler la variance de $X_i + X_j$.
- b. En déduire la covariance du couple (X_i, X_j) .

Pour tout entier k supérieur ou égal à 1, on note Z_k la variable aléatoire égale au nombre de numéros distincts obtenus au cours des k premiers tirages et on note $E(Z_k)$ l'espérance de Z_k .

Partie II

1. Déterminer la loi de la variable aléatoire Z_1 et la loi de la variable aléatoire Z_2 . En déduire $E(Z_1)$ et $E(Z_2)$.
2. Soit k un entier supérieur ou égal à 1.
 - a. Déterminer $P(Z_k = 1)$ et déterminer $P(Z_k = k)$.
 - b. Montrer, pour tout $\ell \in \llbracket 1; n \rrbracket$:

$$P(Z_{k+1} = \ell) = \frac{\ell}{n}P(Z_k = \ell) + \frac{n - \ell + 1}{n}P(Z_k = \ell - 1).$$

- c. En déduire :

$$E(Z_{k+1}) = \frac{n-1}{n}E(Z_k) + 1.$$

3. Montrer que la suite $(v_k)_{k \geq 1}$, de terme général $v_k = E(Z_k) - n$, est une suite géométrique. En déduire, pour tout entier k supérieur ou égal à 1 :

$$E(Z_k) = n \left(1 - \left(\frac{n-1}{n} \right)^k \right).$$

Partie III

On suppose maintenant que $n = 4$; ainsi l'urne $\mathcal{U}$ contient quatre boules numérotées de 1 à 4. Soit k un entier supérieur ou égal à 4. On se propose de déterminer la loi de Z_k .

1. Rappeler la valeur de $P(Z_k = 1)$. Déterminer $P(Z_k \geq 5)$.

2. Montrer :

$$P(Z_k = 2) = 6 \frac{2^k - 2}{4^k}.$$

3. On note, pour tout $i \in \llbracket 1; 4 \rrbracket$, A_i l'événement : « la boule numéro i n'a pas été obtenue au cours des k premiers tirages ».

a. Montrer :

$$P(Z_k \leq 3) = 4P(A_1) - 6P(A_1 \cap A_2) + 4P(A_1 \cap A_2 \cap A_3).$$

b. Calculer $P(A_1)$, $P(A_1 \cap A_2)$ et $P(A_1 \cap A_2 \cap A_3)$.

c. En déduire $P(Z_k \leq 3)$, puis $P(Z_k = 3)$ et $P(Z_k = 4)$.