



PRÉPASIMPLE

prepasimple.fr

EM Lyon

Mathématiques — Option économique

2019

Mathématiques appliquées

Mathématiques appliquées — Prépa ECG

Annales de concours · Sujet

Exercice 1

Dans ce problème, toutes les variables aléatoires sont supposées définies sur un même espace probabilisé noté $(\Omega, \mathcal{A}, P)$.

Partie A : Des résultats préliminaires

Soient U et V deux variables aléatoires à densité indépendantes, de densités respectives f_U et f_V et de fonctions de répartition respectives F_U et F_V .

On suppose que les fonctions f_U et f_V sont nulles sur $] -\infty, 0[$ et continues sur $[0, +\infty[$.

1. a) Justifier : $\forall t \in [0, +\infty[, \quad 0 \leq F_U(t)f_V(t) \leq f_V(t)$.

1. b) En déduire que l'intégrale $\int_0^{+\infty} F_U(t)f_V(t) dt$ converge.

On admet le résultat suivant :

$$\int_0^{+\infty} F_U(t)f_V(t) dt = P([U \leq V]).$$

2. En déduire : $P([U > V]) = \int_0^{+\infty} (1 - F_U(t))f_V(t) dt$.

3. Exemple : soient $\lambda, \mu \in \mathbb{R}_+^*$. On suppose dans cette question que U suit la loi exponentielle de paramètre λ et que V suit la loi exponentielle de paramètre μ .

3. a) Rappeler, pour tout $t \in \mathbb{R}_+$, une expression de $F_U(t)$ et de $f_V(t)$.

3. b) En déduire : $P([U > V]) = \frac{\mu}{\lambda + \mu}$.

Partie B : Une application

Soit $\lambda \in \mathbb{R}_+^*$. On considère une suite $(T_n)_{n \in \mathbb{N}}$ de variables aléatoires indépendantes, suivant toutes la loi exponentielle de paramètre λ .

On définit ensuite la variable aléatoire N égale au plus petit entier k de $\mathbb{N}^*$ tel que $T_k \leq T_0$ si un tel entier existe, et égale à 0 sinon.

4. Soit $n \in \mathbb{N}^*$. On définit la variable aléatoire M_n par $M_n = \min(T_1, \dots, T_n)$.

4. a) Calculer, pour tout $t \in \mathbb{R}_+$, $P([M_n > t])$.

4. b) En déduire la fonction de répartition de M_n sur $\mathbb{R}$. Reconnaître la loi de M_n et préciser son ou ses paramètres.

5. a) Montrer : $P([N = 1]) = P([T_1 \leq T_0]) = \frac{1}{2}$.

5. b) Justifier : $\forall n \in \mathbb{N}^*$, $[M_n > T_0] = [N > n] \cup [N = 0]$, cette union étant disjointe.

En déduire, pour tout $n \in \mathbb{N}^*$, une expression de $P([N > n]) + P([N = 0])$ en fonction de n .

5. c) Montrer alors : $\forall n \in \mathbb{N} \setminus \{0, 1\}, \quad P([N = n]) = \frac{1}{n(n+1)}$.

5. d) En déduire la valeur de $P([N = 0])$.

6. La variable aléatoire N admet-elle une espérance ?

Exercice 2

On rappelle que deux matrices A et B de $\mathcal{M}_3(\mathbb{R})$ sont dites semblables lorsqu'il existe une matrice P de $\mathcal{M}_3(\mathbb{R})$ inversible telle que $B = P^{-1}AP$.

L'objectif de cet exercice est d'étudier des exemples de matrices inversibles qui sont semblables à leur inverse. Les trois parties de cet exercice sont indépendantes entre elles.

Partie A : Premier exemple

On considère la matrice A de $\mathcal{M}_3(\mathbb{R})$ définie par :

$$A = \begin{pmatrix} 1 & -1 & 1 \\ 0 & 1/2 & 0 \\ 0 & 0 & 2 \end{pmatrix}.$$

1. Déterminer les valeurs propres de A . Justifier que A est inversible et diagonalisable.
2. Déterminer une matrice D de $\mathcal{M}_3(\mathbb{R})$ diagonale où les coefficients diagonaux sont rangés dans l'ordre croissant, et une matrice P de $\mathcal{M}_3(\mathbb{R})$ inversible telle que $A = PDP^{-1}$. Expliciter la matrice D^{-1} .

$$3. \text{ On note } Q = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \end{pmatrix}. \text{ Calculer } Q^2 \text{ et } QDQ.$$

4. En déduire que les matrices A et A^{-1} sont semblables.

Partie B : Deuxième exemple

On considère l'endomorphisme f de $\mathbb{R}^3$ défini par :

$$\forall (x, y, z) \in \mathbb{R}^3, \quad f(x, y, z) = (x, -z, y + 2z).$$

On note M la matrice de f dans la base canonique de $\mathbb{R}^3$.

On considère également les vecteurs u_1 et u_2 de $\mathbb{R}^3$ définis par $u_1 = (1, 0, 0)$ et $u_2 = (0, 1, -1)$.

5. Expliciter la matrice M et montrer que M est inversible.
6. a) Vérifier que 1 est valeur propre de f et que (u_1, u_2) est une base du sous-espace propre associé.
6. b) Déterminer un vecteur u_3 de $\mathbb{R}^3$ tel que $f(u_3) - u_3 = u_2$.
6. c) Montrer que la famille $\mathcal{B}_1 = (u_1, u_2, u_3)$ est une base de $\mathbb{R}^3$.

On admet que $\mathcal{B}_2 = (u_1, -u_2, u_3)$ est également une base de $\mathbb{R}^3$.

7. a) Écrire la matrice M_1 de f dans la base $\mathcal{B}_1$ et la matrice M_2 de f dans la base $\mathcal{B}_2$.
7. b) Justifier que les matrices M_1 et M_2 sont semblables, et calculer $M_1 M_2$.
8. En déduire que les matrices M et M^{-1} sont semblables.

Partie C : Troisième exemple

On considère la matrice T de $\mathcal{M}_3(\mathbb{R})$ définie par :

$$T = \begin{pmatrix} 1 & -1 & 1 \\ 0 & 1 & -1 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}.$$

On note I_3 la matrice identité de $\mathcal{M}_3(\mathbb{R})$ et on pose $N = T - I_3$.

9. Justifier que la matrice T est inversible. Est-elle diagonalisable ?

10. a) Calculer N^3 puis $(I_3 + N)(I_3 - N + N^2)$.
10. b) En déduire une expression de T^{-1} en fonction de I_3 , N et N^2 .
11. On note g l'endomorphisme de $\mathbb{R}^3$ dont la matrice dans la base canonique est N .
11. a) Justifier qu'il existe un vecteur u de $\mathbb{R}^3$ tel que $g \circ g(u) \neq 0$ et $g \circ g \circ g(u) = 0$.
11. b) Montrer que la famille $\mathcal{B}_3 = (g \circ g(u), g(u), u)$ est une base de $\mathbb{R}^3$.
11. c) Écrire la matrice de g dans la base $\mathcal{B}_3$.
11. d) Calculer $N^2 - N$ et en déduire que les matrices N et $N^2 - N$ sont semblables.
12. Montrer que les matrices T et T^{-1} sont semblables.

Exercice 3

On considère la fonction f définie sur $]0, +\infty[$ par :

$$\forall t \in]0, +\infty[, \quad f(t) = t + \frac{1}{t}.$$

Partie A : Étude d'une fonction d'une variable

1. Étudier les variations de la fonction f sur $]0, +\infty[$. Dresser le tableau de variations de f en précisant les limites en 0 et en $+\infty$.
2. Montrer que f réalise une bijection de $[1, +\infty[$ vers $[2, +\infty[$.

On note $g : [2, +\infty[\rightarrow [1, +\infty[$ la bijection réciproque de la restriction de f à $[1, +\infty[$.

3. a) Dresser le tableau de variations de g .
3. b) Justifier que la fonction g est dérivable sur $]2, +\infty[$.
3. c) Soit $y \in [2, +\infty[$. En se ramenant à une équation du second degré, résoudre l'équation $f(t) = y$, d'inconnue $t \in]0, +\infty[$. En déduire une expression de $g(y)$, en fonction de y .

Partie B : Étude d'une fonction de deux variables

On considère la fonction h de classe $\mathcal{C}^2$ sur l'ouvert $U =]0, +\infty[\times]0, +\infty[$ définie par :

$$\forall (x, y) \in U, \quad h(x, y) = \left(\frac{1}{x} + \frac{1}{y} \right) (1+x)(1+y).$$

4. Calculer les dérivées partielles d'ordre 1 de h en tout (x, y) de U .
5. Soit $(x, y) \in U$. Montrer :

$$(x, y) \text{ est un point critique de } h \iff \begin{cases} y = x^2, \\ x = y^2. \end{cases}$$

6. En déduire que h admet un unique point critique sur U dont on précisera les coordonnées (a, b) .
7. a) Vérifier : $\forall (x, y) \in U, \quad h(x, y) = 2 + f(x) + f(y) + f\left(\frac{x}{y}\right).$
7. b) En déduire que h admet en (a, b) un minimum global sur U .

Partie C : Étude d'une suite

On introduit la suite $(u_n)_{n \in \mathbb{N}^*}$ définie par :

$$u_1 = 1 \quad \text{et} \quad \forall n \in \mathbb{N}^*, \quad u_{n+1} = u_n + \frac{1}{n^2 u_n} = \frac{1}{n} f(nu_n).$$

8. Montrer que, pour tout n de $\mathbb{N}^*$, u_n existe et $u_n \geq 1$.
9. Recopier et compléter les lignes de boucle et de mise à jour de la fonction Python suivante afin que, prenant en argument un entier n de $\mathbb{N}^*$, elle renvoie la valeur de u_n .

Python

```
def suite(n):
    u = 1
    for k in ...:
        u = ...
    return u
```

10. On pose, pour tout n de $\mathbb{N}^*$, $v_n = u_{n+1} - u_n$.

10. a) Montrer : $\forall n \in \mathbb{N}^*, \quad 0 \leq v_n \leq \frac{1}{n^2}$.

10. b) En déduire la nature de la série

$$\sum_{n \geq 1} v_n.$$

On pourra utiliser, pour $n \geq 2$, l'inégalité $\frac{1}{n^2} \leq \frac{1}{n-1} - \frac{1}{n}$ et étudier directement les sommes partielles.

10. c) Calculer, pour tout entier n supérieur ou égal à 2,

$$\sum_{k=1}^{n-1} v_k.$$

En déduire que la suite $(u_n)_{n \in \mathbb{N}^*}$ converge vers un réel ℓ , que l'on ne cherchera pas à déterminer.

11. a) Montrer que, pour tout entier k supérieur ou égal à 2, on a : $\frac{1}{k^2} \leq \int_{k-1}^k \frac{1}{t^2} dt$.

11. b) Pour tous entiers n et p tels que $2 \leq p < n$, calculer

$$\sum_{k=p}^{n-1} v_k$$

et en déduire :

$$0 \leq u_n - u_p \leq \int_{p-1}^{n-1} \frac{1}{t^2} dt.$$

11. c) En déduire, pour tout entier n supérieur ou égal à 3 : $u_2 \leq u_n \leq 1 + u_2$. Montrer que ℓ appartient à l'intervalle $[2, 3]$.

11. d) Montrer, pour tout entier p supérieur ou égal à 2 : $0 \leq \ell - u_p \leq \frac{1}{p-1}$.

11. e) En déduire une fonction Python qui renvoie une valeur approchée de ℓ à 10^{-4} près.