

EML 2019

EXERCICE 1

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

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

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

On admet le résultat suivant :

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

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

3. **Exemple** : Soient $\lambda, \mu \in \mathbb{R}^2$. On suppose dans cette question que U suit la loi exponentielle de paramètre λ et que V suit la loi exponentielle de paramètre μ .

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

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

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 : $M_n = \min(T_1, \dots, T_n)$.

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

b) En déduire la fonction de répartition de M_n sur \mathbb{R} .

Reconnaitre la loi de M_n et préciser son (ses) paramètre(s).

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

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

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

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

d) En déduire la valeur de $\mathbb{P}([N = 0])$.

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 P de $\mathcal{M}_3(\mathbb{R})$ inversible telle que :

$$B = P^{-1} A P$$

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

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 telles que : $A = P D P^{-1}$.

Expliciter la matrice D^{-1} .

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

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

PARTIE B : Deuxième exemple

On considère f l'endomorphisme 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 (u_1, u_2) est une base du sous-espace propre associée.

b. Déterminer un vecteur u_3 de \mathbb{R}^3 tel que : $f(u_3) - u_3 = u_2$.

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 .

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 $(I_3 + N)(I_3 - N + N^2)$.
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 .
a. Justifier qu'il existe un vecteur u de \mathbb{R}^3 tel que : $g \circ g(u) \neq 0_{\mathbb{R}^3}$ et $g \circ g \circ g(u) = 0_{\mathbb{R}^3}$.
b. Montrer que la famille $\mathcal{B}_3 = (g \circ g(u), g(u), u)$ est une base de \mathbb{R}^3 .
c. Écrire la matrice de g dans la base \mathcal{B}_3 .
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 :

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

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 $+\infty$.
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 .
b) Justifier que la fonction g est dérivable sur $]2, +\infty[$.
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 :

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

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

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

6. En déduire que h admet un unique point critique sur U dont on précisera les coordonnées (a, b) .

7. a) Vérifier : $\forall (x, y) \in U, h(x, y) = 2 + f(x) + f(y) + f\left(\frac{x}{y}\right)$.

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 :

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

8. Montrer que, pour tout n de \mathbb{N}^* , u_n existe et $u_n \geq 1$.

9. Recopier et compléter les lignes 3 et 4 de la fonction **Scilab** suivante afin que, prenant en argument un entier n de \mathbb{N}^* , elle renvoie la valeur de u_n .

```

1  function u=suite(n)
2      u = 1
3      for k = .....
4          u = .....
5      end
6  endfunction

```

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

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

b) En déduire la nature de la série $\sum_{n \geq 1} v_n$.

c) Calculer, pour tout 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 : $\frac{1}{k^2} \leq \int_{k-1}^k \frac{1}{t^2} dt$.

b) Pour tous entiers n et p tels que $2 \leq p < n$, calculer $\sum_{k=p}^{n-1} v_k$ et en déduire :

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

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

d) Montrer, pour tout entier p supérieur ou égal à 2 :

$$0 \leq \ell - u_p \leq \frac{1}{p-1}$$

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