

EDHEC 2007

OPTION : ÉCONOMIQUE

MATHÉMATIQUES

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 $M = \begin{pmatrix} a & b \\ c & d \end{pmatrix}$ alors ${}^tM = \begin{pmatrix} a & c \\ b & d \end{pmatrix}$.

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 $\varphi(M) = M + {}^tM$.

- Montrer que φ est un endomorphisme de $\mathcal{M}_2(\mathbb{R})$.
 - Ecrire la matrice A de φ dans \mathcal{B} .
 - En déduire que φ est diagonalisable et non bijectif.
- calculer A^2 et en déduire que , pour tout n de \mathbb{N}^* : $A^n = 2^{n-1}A$
- Montrer que $\text{Im}\varphi = \text{Vect}(E_1, E_2 + E_3, E_4)$, puis établir que $\dim \text{Im}(\varphi) = 3$.
 - En déduire la dimension de $\ker \varphi$ puis déterminer une base de $\ker \varphi$.
 - Etablir que $\text{Im}\varphi$ est le sous espace propre associé à la valeur propre 2
 - 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.

On considère deux variables aléatoires réelles X et U définies sur le même espace probabilisé (Ω, \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 probabilisé (Ω, \mathcal{A}, P) .

- En utilisant la formule des probabilités totales, montrer que :

$$P(Y \leq x) = P([U = 1] \cap [X \leq x]) + P([U = -1] \cap [X \geq -x])$$

- En déduire que Y suit la même loi que X .
- Calculer l'espérance de U puis montrer que $E(XY) = 0$
 - En déduire que $\text{Cov}(X, Y) = 0$.
- Rappeler la valeur de $E(X^2)$ et en déduire que $\int_0^{+\infty} x^2 e^{-\frac{x^2}{2}} = \frac{1}{2}\sqrt{2\pi}$

b) Montrer, grace à une intégration par parties que

$$\forall A \in \mathbb{R}_+ : \int_0^A x^4 e^{-\frac{x^2}{2}} dx = -A^3 e^{-\frac{A^2}{2}} + 3 \int_0^A x^2 e^{-\frac{x^2}{2}} dx$$

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

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

4. a) Vérifier que $E(X^2 Y^2) = 3$

b) Déterminer $\text{Cov}(X^2, Y^2)$

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.

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 pour tout $x > 0 : x - \ln(x) > 0$

b) On pose alors
$$\begin{cases} f(x) = \frac{\ln(x)}{x - \ln(x)} & \text{si } x > 0 \\ f(0) = -1 \end{cases}$$

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

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

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 de $D \setminus \{0\}$.

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

c) Dresser le tableau de variations de f .

4. Etudier le signe de $f(x)$.

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

a) Montrer que F est de classe \mathcal{C}^1 sur D puis étudier ses variations.

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

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" étant toutes deux égales à $\frac{1}{2}$) et 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 ($k \in \mathbb{N}^*$), 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 un "face"» par 0.

On rappelle que la fonction `random` renvoie, pour un argument k de type `integer` (où k désigne un entier supérieur ou égal à 1) un entier aléatoire compris entre 0 et $k - 1$.

- 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.

```

Program edhec_2007 ;
Var z,hasard :integer ;
begin
  randomize ; z :=0 ;
  repeat
    z :=..... ; hasard :=..... ; until (hasard=1) ;
  writeln(z) ;
end.

```

- b) Quelle instruction faut-il rajouter avant la dernière ligne de ce programme pour qu'il simule l'expérience aléatoire décrite dans ce problème et affiche la valeur prise par la variable aléatoire X ?

2. Etablir la convergence de la série de terme général $\frac{1}{k} \left(\frac{1}{2}\right)^k$ ($k \in \mathbb{N}^*$).

3. Rappeler la loi de Z ainsi que son espérance et sa variance.

4. a) Pour tout couple (i, k) de $\mathbb{N}^* \times \mathbb{N}^*$, déterminer la probabilité $P_{[Z=k]}(X = i)$

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

c) On admet dans cette question que $\sum_{i=1}^{+\infty} \sum_{k=i}^{+\infty} = \sum_{k=1}^{+\infty} \sum_{i=1}^k$. Vérifier que $\sum_{i=1}^{+\infty} P(X = i) = 1$

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

b) En déduire que X possède une espérance.

c) Montrer, en admettant qu'il est licite de permuter les symboles \sum comme dans la question 4c), que

$$E(X) = \frac{3}{2}$$

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

b) Etablir, alors, toujours en admettant qu'il est licite de permuter les symboles \sum comme dans la question 4c), que

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

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

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

7. a) Ecrire l'inégalité de Bienaymé-Chebychev, pour la variable X .

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

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

a) Ecrire explicitement en fonction de x et n la somme $\sum_{k=1}^n x^{k-1}$ (n désignant un entier naturel non nul et x un réel différent de 1).

b) En déduire que : $\forall n \in \mathbb{N}^* : \sum_{k=1}^n \frac{1}{k} \left(\frac{1}{2}\right)^k = \ln(2) - \int_0^{1/2} \frac{x^n}{1-x} dx$

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 $\lim_{n \rightarrow +\infty} \int_0^{1/2} \frac{x^n}{1-x} dx$

d) Etablir alors que $P(X = 1) = \ln(2)$ puis donner la valeur de $P(X = 2)$.

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 ?