

Copie anonyme - n°anonymat :

Maths S

DL-00225



Code épreuve : 282

Nombre de pages : 32

Session : 2023

Épreuve de : MATHS I HEC/ESSEC

Consignes

- Remplir soigneusement l'en-tête de chaque feuille avant de commencer à composer
- Rédiger avec un stylo non effaçable bleu ou noir
- Ne rien écrire dans les marges (gauche et droite)
- Numéroté chaque page (cadre en bas à droite)
- Placer les feuilles A3 ouvertes, dans le même sens et dans l'ordre

Partie I.

1. (a) Soit $f: x \mapsto \mathbb{1}_{[0,1]}$ ($\mathbb{1}$) est une densité de X .

Soit $k \in \mathbb{N}$. $\int_0^{+\infty} x^k f(x) dx = \int_0^1 x^k dx$ (cette intégrale converge car $x \mapsto x^k$ est continue sur $[0,1]$).

Ainsi $\int_0^{+\infty} x^k f(x) dx$ converge et vaut $\int_0^1 x^k dx = \left[\frac{x^{k+1}}{k+1} \right]_0^1 = \frac{1}{k+1}$.

D'après le théorème de transfert avec la fonction $t \mapsto t^k$ continue sur \mathbb{R} , X^k admet une espérance qui vaut $\frac{1}{k+1}$.

(b) Soit $k \in \mathbb{N}$. Soit $f: x \mapsto \lambda e^{-\lambda x} \mathbb{1}_{\mathbb{R}_+}$ ($\mathbb{1}_{\mathbb{R}_+}$) est une densité de X .

Étudions $\int_0^{+\infty} x^k f(x) dx = \int_0^{+\infty} x^k \lambda e^{-\lambda x} dx$.

On pose $\varphi: \mathbb{R}_+ \rightarrow \mathbb{R}_+$ (car $\lambda \geq 0$).

φ est de classe \mathcal{C}^1 , strictement croissante, et bijective de \mathbb{R}_+ dans \mathbb{R}_+ .

Par changement de variable, $\int_0^{+\infty} x^k \lambda e^{-\lambda x} dx$ et $\int_0^{+\infty} \left(\frac{t}{\lambda}\right)^k e^{-t} dt$ sont de même nature et égales en cas de convergence.

1 /

On rappelle que: $\forall z \in \mathbb{N}$, $E(X^z)$ ~~est~~ $= u \in \mathbb{C}(X)$ et que'elle existe

$$LWHLW = \int_{i=1}^n \int_{j=1}^n d_i d_j m_{ij-2}(X)$$

$$= E\left(\int_{i=1}^n \int_{j=1}^n d_i d_j X^{i+j-2}\right) \text{ par}$$

l'existence de
cette espérance est
obtenue par linéarité

linéarité de
l'espérance

$$= E\left(\left(\sum_{i=1}^n d_i X^{i-1}\right) \left(\sum_{j=1}^n d_j X^{j-1}\right)\right)$$

$$= E(|P(X)|^2)$$

P'après le théorème de transfert (car $E(|P(X)|^2)$ existe)
P est continu sur \mathbb{R} , $\int_0^{+\infty} P(x)^2 f(x) dx$ converge et ;

$$LWHLW = \int_0^{+\infty} (P(x))^2 f(x) dx$$

4. ~~f est une densité~~ Soit $n \in \mathbb{N}^*$ Soit $A \in \mathcal{S}_n(\mathbb{M}_n)$. Rappelons

que \mathbb{M}_n étant symétrique, le théorème spectral
nous qu'elle est diagonalisable. Ainsi $\mathcal{S}_n(\mathbb{M}_n)$ est non vide,
en particulier.

Soit λ un vecteur propre associé, on a $w = \begin{pmatrix} \lambda_1 \\ \vdots \\ \lambda_n \end{pmatrix}$
et on reprend le P défini précédemment.

f est une densité donc est à valeurs positives sur \mathbb{R} .

$x \mapsto (P(x))^2$ est à valeurs positives sur \mathbb{R} .

Par produit, $X \geq P(X)^2 f(x)$ et ρ valeurs positives sur \mathbb{R} , et en particulier sur \mathbb{R}^+ .

D'après la question précédente, $\int_0^{+\infty} P(X)^2 f(x) dx$ converge.

Pour croissance de l'intégrale (car " $+\infty > 0$ ") généralisée,

$$\int_0^{+\infty} P(X)^2 f(x) dx \geq 0.$$

~~Or~~ Ainsi, $\langle W | H | W \rangle \geq 0$.

$$\begin{aligned} \text{Or } \langle W | H | W \rangle &= \langle W | H | W \rangle \\ &= \langle W | \Delta | W \rangle \end{aligned}$$

$$= \int \|W\|^2.$$

$$\text{Donc } \frac{\langle W | H | W \rangle}{\|W\|^2} = 1 \quad (W \text{ est un vecteur propre donc } W \neq 0 \text{ et ainsi } \|W\|^2 \neq 0)$$

$$\text{donc } 1 \geq 0.$$

Ainsi, $\text{Sp}(H) \subset \mathbb{R}^+$.

Soit $n \in \mathbb{N}^*$.
S. Or reprend les notations précédentes avec cette fois $\lambda \in \text{Sp}(G)$ et cette fois W un vecteur propre associé à G pour la valeur propre λ ($W \neq 0$)

$$\begin{aligned} \text{Or } \langle W | G | W \rangle &= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n a_{ij} x_{ij}^{-1} \\ &= \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n a_{ij} E(X_{ij}^{-1}). \end{aligned}$$

Par linéarité de l'espérance (car X admet des moments de tous les ordres),

Copie anonyme - n°anonymat :

Code épreuve : 282

Nombre de pages : 32

Session : 2023

Emplacement
QR Code

Épreuve de : MATHS I LIEC/ESSEC

Consignes

- Remplir soigneusement l'en-tête de chaque feuille avant de commencer à composer
- Rédiger avec un stylo non effaçable bleu ou noir
- Ne rien écrire dans les marges (gauche et droite)
- Numéroté chaque page (cadre en bas à droite)
- Placer les feuilles A3 ouvertes, dans le même sens et dans l'ordre

$$E\left(\sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^m a_{ij} x^{i+j-1}\right) = E(x(P(x)|^2)) \text{ existe,}$$

et vaut $\|W\|_{G \times W}$.

D'après le théorème de transfert, $\int_0^{+\infty} x(P(x)|^2) f(x) dx$ converge
et vaut $E(x(P(x)|^2)) = \|W\|_{G \times W}$.

$x \mapsto x(P(x)|^2) f(x)$ est, par opérations, à valeurs positives sur \mathbb{R}^+ .

Par positivité de l'intégral (car $+\infty > 0$),

$$\int_0^{+\infty} x(P(x)|^2) f(x) dx \geq 0.$$

Ainsi $\|W\|_{G \times W} \geq 0$.

Comme $\|W\|_{G \times W} = \lambda \|W\|^2$,

$$\text{il vient } \frac{\|W\|_{G \times W}}{\|W\|^2} \geq 1 \text{ (car } W \neq 0)$$

$$\text{donc } \lambda \geq 0.$$

Ainsi, $\lambda \in \text{Sp}(G \times W) \cap \mathbb{R}^+$.

6. On a $G_2 = \begin{pmatrix} u_1 & u_2 \\ u_2 & u_3 \end{pmatrix}$ / On doit utiliser le fait que $S_1(G_2) \subset \mathbb{R}^+$.
 \rightarrow On admet le résultat

Soit $\lambda \in \mathbb{R}$.

$$\text{rg}(G_2 - \lambda I_2) < 2 \Leftrightarrow (u_1 - \lambda)(u_3 - \lambda) - (u_2)^2 = 0$$

$$\Leftrightarrow \left(\frac{1}{2} - \lambda\right)(u_3 - \lambda) - \frac{1}{9} = 0$$

$$\Leftrightarrow \lambda^2 - \left(\frac{1}{2} + u_3\right)\lambda + \frac{1}{2}u_3 - \frac{1}{9} = 0$$

Le discriminant associé à (E) : $\Delta = \left(\frac{1}{2} + u_3\right)^2 - 4\left(\frac{1}{2}u_3 - \frac{1}{9}\right) = 0$

$$\text{est } \Delta = \left(\frac{1}{2} + u_3\right)^2 + \frac{4}{9}u_3 - \frac{2}{9}$$

$$= \left(\frac{1}{2} + u_3\right)^2 + \frac{2}{9}u_3.$$

$$= \frac{1}{4} + \frac{11}{9}u_3 + (u_3)^2.$$

Donc $\Delta \geq 0$, car G_2 admet au moins une valeur propre (G_2 est symétrique).

Soit $n \in \mathbb{N}^*$. $\mathbb{R}_+ \rightarrow \mathbb{R}$
 7. a) On pose $h: t \mapsto t^n e^{-t\theta}$.

Par opérations, h est dérivable sur \mathbb{R}_+^* (~~sur \mathbb{R}_+ et $\theta > 0$~~)

$$\begin{aligned} \forall t > 0, h'(t) &= n t^{n-1} e^{-t\theta} - \theta t^{\theta-1} t^n e^{-t\theta} \\ &= e^{-t\theta} (n t^{n-1} - \theta t^{n+\theta-1}) \\ &= t^{n-1} e^{-t\theta} (n - \theta t^\theta). \end{aligned}$$

Soit $t \in \mathbb{R}_+^*$.

$$h'(t) \geq 0 \Leftrightarrow t^{n-1} e^{-t\theta} (n - \theta t^\theta) \geq 0$$

$$\Leftrightarrow n - \theta t^\theta \geq 0 \text{ car } t^{n-1} e^{-t\theta} > 0$$

ft.

$$\Leftrightarrow n \leq \theta t^\theta$$

$$\Leftrightarrow \frac{n}{\theta} \geq t^\theta \text{ car } \theta > 0$$

$$\Leftrightarrow \ln\left(\frac{n}{\theta}\right) \geq \theta \ln(t) \text{ par stricte croissance de } \ln \text{ sur } \mathbb{R}_+^*$$

$$\Leftrightarrow e^{\frac{\ln(n/\theta)}{\theta}} \geq t \text{ par stricte croissance de } t \mapsto e^{\frac{t}{\theta}} \text{ sur } \mathbb{R}_+^* \text{ car } \theta > 0$$

Ainsi, h est croissante sur $]0, e^{\frac{\ln(n/\theta)}{\theta}}]$ et décroissante sur $[e^{\frac{\ln(n/\theta)}{\theta}}, +\infty[$.

Par conséquent, h admet un maximum en $e^{\frac{\ln(n/\theta)}{\theta}}$.

$$\begin{aligned} \text{On } h\left(e^{\frac{\ln(n/\theta)}{\theta}}\right) &= h\left(\frac{\ln\left(\frac{n}{\theta}\right)}{\theta}\right) \\ &= h\left(\frac{\ln(n/\theta)}{\theta}\right) \end{aligned}$$

$$= \left(\frac{r}{\theta}\right)^n e^{-\left(\frac{r}{\theta}\right)\theta}$$

$$= \left(\frac{r}{\theta}\right)^{\frac{r}{\theta}} e^{-\frac{r}{\theta}}$$

Ainsi : $\forall t \in \mathbb{R}_+^*$, $t^r e^{-t\theta} \leq \left(\frac{r}{\theta}\right)^{\frac{r}{\theta}} e^{-\frac{r}{\theta}}$.

Or on en outre $0^r e^{-0\theta} = 0$ (car $r > 0$).

Comme $\left(\frac{r}{\theta}\right)^{\frac{r}{\theta}} e^{-\frac{r}{\theta}} > 0$, l'inégalité est aussi vraie pour $t=0$.

(b). Soit $r \in \mathbb{N}^*$.

D'après J. (a) :

Comme f est nulle hors de J ,
 $X(\omega) \in \mathbb{R}_+$.

Ainsi : $\forall \omega \in \Omega$,

$$0 \leq X(\omega)^r e^{-(X(\omega)\theta)} \leq \left(\frac{r}{\theta}\right)^{\frac{r}{\theta}} e^{-\frac{r}{\theta}}$$

$$0 \leq X(\omega)^r \leq \left(\frac{r}{\theta}\right)^{\frac{r}{\theta}} e^{-\frac{r}{\theta}} e^{(X(\omega)\theta)}$$

$$\text{Donc } 0 \leq X^r \leq \left(\frac{r}{\theta}\right)^{\frac{r}{\theta}} e^{-\frac{r}{\theta}} e^{X\theta}$$

$\int_0^{+\infty} f(t) e^{t\theta} dt$ converge donc d'après le théorème de transfert avec $t \mapsto e^{t\theta}$,

$E(e^{X\theta})$ existe. De plus, $E(X^r)$ existe par hypothèse sur X .

Ainsi, par croissance de l'espérance,

Copie anonyme - n°anonymat :

Emplacement QR Code	Code épreuve : 282	Nombre de pages : 32	Session : 2023
	Épreuve de : MATHS I HEC ESSEC		
Consignes <ul style="list-style-type: none">• Remplir soigneusement l'en-tête de chaque feuille avant de commencer à composer• Rédiger avec un stylo non effaçable bleu ou noir• Ne rien écrire dans les marges (gauche et droite)• Numéroté chaque page (cadre en bas à droite)• Placer les feuilles A3 ouvertes, dans le même sens et dans l'ordre			

$$u_n \in \left(\frac{\sigma}{\theta}\right)^{\frac{\sigma}{n}} e^{-\frac{\sigma}{\theta}} E(e^{X\theta}) \quad (*)$$

L'application $t \mapsto t^{\frac{\sigma}{n}}$ est décroissante sur \mathbb{R}^+ .

Comme X est à densité, on a $P(X=0) = 0$. Comme X est à valeurs positives, on a ainsi presque sûrement $X > 0$

et pour tout $n \in \mathbb{N}^*$, $X^n > 0$ par stricte croissance de $t \mapsto t^n$ sur \mathbb{R}^+

d'où $E(X^n) > 0$ par stricte croissance de l'espérance.

On peut ainsi appliquer $t \mapsto t^{-\frac{\sigma}{n}}$ dans $(*)$ et on a :

$$\begin{aligned} (u_n)^{-\frac{\sigma}{n}} &\geq \left(\left(\frac{\sigma}{\theta}\right)^{\frac{\sigma}{n}} e^{-\frac{\sigma}{\theta}} E(e^{X\theta})\right)^{-\frac{\sigma}{n}} \\ &\geq \frac{e}{\left(\frac{\sigma}{\theta}\right)^{\frac{\sigma}{n}}} E(e^{X\theta})^{-\frac{\sigma}{n}} \\ &\geq \frac{\theta e}{\sigma E(e^{X\theta})^{\frac{\sigma}{n}}} \end{aligned}$$

On admet la fin.

8. def test-skeltjes(U):
 $N = \text{len}(U) - 1$
 $m = 1 + N/2$
 $H = \text{np.zeros}(m, m)$
 for n in range(1, m+1):
 for i in range(0, m):
 $H[i, n-1] = U(i+n-1)$
 $H(n-1, i) = U(i+n-1)$
 valp = np.eigvalsh(H)

 for k in range(0, np.shape(valp)[0]):
 if valp[k] < 0:
 return 0
 return 1

II.2) ~~avec~~

9. ~~$\forall t \in \mathbb{R}_+$~~

$t \mapsto t^n e^{-t} \sin(t)$ et $t \mapsto t^n e^{-t} \cos(t)$ sont
 continues sur \mathbb{R}_+ .

Et:

$$\forall t \in \mathbb{R}_+, |t^n e^{-t} \sin(t)| \leq t^n e^{-t} \quad \text{car } |\sin(t)| \leq 1$$

$$|t^n e^{-t} \cos(t)| \leq t^n e^{-t}, \quad \text{et } |\cos(t)| \leq 1$$

Or $\int_0^{+\infty} t^n e^{-t} dt$ converge et vaut $\Gamma(n+1) = n!$
 (fonction gamma).

Par théorème de comparaison des intégrales de fonctions pos.

positives, $\int_0^{+\infty} t e^{-t} \sin(t) dt$ et $\int_0^{+\infty} t e^{-t} \cos(t) dt$ sont
absolument convergents donc convergent.

10. $S_0 = \int_0^{+\infty} e^{-t} \sin(t) dt$.

Soit $A > 0$.

Par intégration par parties (exp, cos et sin étant e^x sur \mathbb{R}),

$$\int_0^A e^{-t} \sin(t) dt = [-e^{-t} \sin(t)]_0^A - \int_0^A (\cos(t)) (-e^{-t}) dt$$

$$= -e^{-A} \sin(A) + \int_0^A \cos(t) e^{-t} dt$$

car $\lim_{A \rightarrow +\infty} e^{-A} \sin(A) = 0$ car $\sin(A) \in [-1, 1]$ et $e^{-A} \rightarrow 0$.

Or a aussi $\int_0^A e^{-t} \sin(t) dt = [-\cos(t) e^{-t}]_0^A - \int_0^A \cos(t) e^{-t} dt$

~~$= -\cos(A) e^{-A} + 1 - \int_0^A \cos(t) e^{-t} dt$~~

(En effet, $|e^{-A} \sin(A)| \leq e^{-A}$ donc
par théorème d'encadrement, $e^{-A} \sin(A) \xrightarrow{A \rightarrow +\infty} 0$).

D'autre part, $\int_0^A e^{-t} \sin(t) dt = [-\cos(t) e^{-t}]_0^A - \int_0^A \cos(t) e^{-t} dt$

$$= -\cos(A) e^{-A} + 1 - \int_0^A \cos(t) e^{-t} dt$$

De même, $-\cos(A) e^{-A} \xrightarrow{A \rightarrow +\infty} 0$.

Comme toutes les intégrales convergent, on passe à la limite quand $A \rightarrow +\infty$,

car $S_0 = 1 - T_0$

donc $2S_0 = 1$, i.e. $S_0 = \frac{1}{2}$.

u/

11. Soit $n \in \mathbb{N}$.

Soit $A \geq 0$.

Par intégration par parties:

$$\int_0^A t^{n+1} e^{-t} \sin(t) dt = \left[-\cos(t) e^{-t} t^{n+1} \right]_0^A + \int_0^A \cos(t) (n+1) t^n e^{-t} dt \\ - \int_0^A \cos(t) e^{-t} t^{n+1} dt \quad \text{par} \\ \text{linéarité de} \\ \text{l'intégrale} \\ = -\cos(A) e^{-A} A^{n+1} + (n+1) \int_0^A \cos(t) t^n e^{-t} dt \\ - \int_0^A \cos(t) e^{-t} t^{n+1} dt.$$

Toutes les intégrales présentes convergent et

par théorème d'encadrement et croissance comparée, $-\cos(A) e^{-A} A^{n+1} \xrightarrow{A \rightarrow +\infty} 0$

Par opérations sur les limites, on a par passage à la limite:

$$S_{n+1} = (n+1) T_n - T_{n+1} \quad (\text{par linéarité} \\ \text{de l'intégrale})$$

$$\text{Donc } S_{n+1} + T_{n+1} = (n+1) T_n.$$

Soit $n \in \mathbb{N}$, Soit $A \geq 0$.

Par intégration par parties:

$$\int_0^A t^{n+1} e^{-t} \cos(t) dt = \left[\sin(t) e^{-t} t^{n+1} \right]_0^A - \int_0^A (n+1) t^n e^{-t} \sin(t) dt \\ + \int_0^A t^{n+1} e^{-t} \sin(t) dt \\ = \sin(A) e^{-A} A^{n+1} - (n+1) \int_0^A t^n e^{-t} \sin(t) dt \\ + \int_0^A t^{n+1} e^{-t} \sin(t) dt$$

Copie anonyme - n°anonymat :

Emplacement QR Code	Code épreuve : 282	Nombre de pages : 32	Session : 2023
	Épreuve de : MATHS I LIEC, ESJEC		
<p>Consignes</p> <ul style="list-style-type: none"> • Remplir soigneusement l'en-tête de chaque feuille avant de commencer à composer • Rédiger avec un stylo non effaçable bleu ou noir • Ne rien écrire dans les marges (gauche et droite) • Numéroté chaque page (cadre en bas à droite) • Placer les feuilles A3 ouvertes, dans le même sens et dans l'ordre 			

$\overline{A} \rightarrow \vec{A} \rightarrow \vec{A}_0$ $-(n+1)S_n + S_n$ par récurrence composée et théorème $(A^{n+1}e^{-AA^{n+1}} - \dots)$ d'encadrement $(A \rightarrow \vec{A}_0)$ et questions sur les limites.

Donc $T_{n+1} = -(n+1)S_n + S_{n+1}$

d'où $-T_{n+1} + S_{n+1} = (n+1)S_n$ ✓

12. Soit $n \in \mathbb{N}$.

$$\begin{aligned}
 (n+1)/M \ v_n &= (n+1) \frac{1}{2} \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ -1 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} S_n \\ T_n \end{pmatrix} \\
 &= \frac{n+1}{2} \begin{pmatrix} S_n + T_n \\ -S_n + T_n \end{pmatrix} \\
 &= \frac{1}{2} \begin{pmatrix} (n+1)S_n + (n+1)T_n \\ (n+1)T_n - (n+1)S_n \end{pmatrix} \\
 &= \frac{1}{2} \begin{pmatrix} 2S_{n+1} \\ 2T_{n+1} \end{pmatrix} \text{ d'après 11.} \\
 &= \underline{V_{n+1}} \quad \checkmark
 \end{aligned}$$

13. ; Parons, pour tout $n \in \mathbb{N}$, $A_n := \begin{pmatrix} n \\ n \end{pmatrix} V_n = n! \cdot M^n \cdot v_0$.

- $V_0 = 0! M^0 v_0$ donc A_0 est vraie.
- Soit $n \in \mathbb{N}$. Supposons que A_n est vraie.

$$\begin{aligned} V_{n+1} &= (n+1)M V_n \\ &= (n+1)M (n! V_0 M^n) \text{ d'après } A_n \\ &= (n+1)! M^{n+1} V_0. \end{aligned}$$

Donc A_{n+1} est vraie.

Ainsi, par récurrence, $\forall n \in \mathbb{N}$, $V_{n+1} = (n+1)! M^{n+1} V_0$.

$$14. M^4 = \frac{1}{24} \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ -1 & 1 \end{pmatrix}^2 \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ -1 & 1 \end{pmatrix}^2$$

$$= \frac{1}{16} \begin{pmatrix} 0 & 2 \\ -2 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0 & 2 \\ -2 & 0 \end{pmatrix}$$

~~$$= \frac{1}{16} \begin{pmatrix} 0 & 2 \\ -2 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0 & 2 \\ -2 & 0 \end{pmatrix}$$~~

$$= \frac{1}{16} \begin{pmatrix} -4 & 0 \\ 0 & -4 \end{pmatrix}$$

$$= -\frac{1}{4} I_2.$$

On pose, pour tout $n \in \mathbb{N}$,
 A_n : " $S_{4n+3} = 0$ ".

$$\text{On a } V_3 = 3! M^3 v_0 = \frac{1}{4} \begin{pmatrix} -1 & 1 \\ -1 & -1 \end{pmatrix} \cdot 3! \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 1 \\ 2 \end{pmatrix}$$

$$= \frac{3}{4} \begin{pmatrix} -\frac{1}{2} + \frac{1}{2} \\ -\frac{1}{2} - \frac{1}{2} \end{pmatrix}$$

$$= \frac{3}{4} \begin{pmatrix} 0 \\ -1 \end{pmatrix}.$$

Donc $J_3 = 0$.

Soit $n \in \mathbb{N}$, supposons que A_n est vraie.

$$\text{Or } V_{4(n+1)+3} = V_{4n+7} = (4n+7)! M^{4n+3} M^4 V_0$$

$$= -\frac{1}{4} (4n+7)! M^{4n+3} V_0$$

$$\text{Car } M^4 = -\frac{1}{4} I_2.$$

$$\text{Or } J_{4n+3} = 0.$$

$$\text{Donc } \left[-\frac{1}{4} (4n+7)! M^{4n+3} V_0 \right]_{1,1} = 0$$

$$\text{et ainsi } [V_{4n+7}]_{1,1} = 0.$$

$$\text{Donc } J_{4n+7} = 0.$$

Donc A_{n+1} est vraie.

Ainsi : $\forall n \in \mathbb{N}, J_{4n+3} = 0$.

15. $t \mapsto t^u$ est de classe \mathcal{C}^1 sur \mathbb{R}_+ , strictement croissante sur \mathbb{R}_+ , et bijective de \mathbb{R}_+ dans \mathbb{R}_+ .

Soit $n \in \mathbb{N}$.

Par théorème de changement de variable,

$$\int_0^{+\infty} x^n e^{-x^{\frac{1}{4}}} \sin(x^{\frac{1}{4}}) dx \quad \text{et} \quad \int_0^{+\infty} x^{4n} e^{-x} \sin(x/(4x^3)) dx$$

sont de même nature et sont égales en cas de convergence.

$$\text{Or } \int_0^{+\infty} x^{4n+3} e^{-x} \sin(x) dx \text{ converge d'après 9.}$$

et vaut S_{4n+3} . Par linéarité de l'intégrale,
 $\int_0^{+\infty} x^{4n} e^{-x} \sin(x/(4x^3)) dx$ converge et vaut

$$\underline{4S_{4n+3} = 0.}$$

Ainsi, $\int_0^{+\infty} x^n g(x) dx$ converge et vaut 0.

16. On admet le résultat.

~~17. On déduit de 16. que quand $f =]0, +\infty[$,
Il n'y a pas unicité de la solution de $M^*(J)$. En
effet, g_1 et g_2 sont continues sur \mathbb{R}_+ , positives, et distinctes.~~

Copie anonyme - n°anonymat :

Emplacement QR Code	Code épreuve : 232	Nombre de pages : 32	Session : 2023
	Épreuve de : MATHS I MEC ESSEC		
Consignes <ul style="list-style-type: none">• Remplir soigneusement l'en-tête de chaque feuille avant de commencer à composer• Rédiger avec un stylo non effaçable bleu ou noir• Ne rien écrire dans les marges (gauche et droite)• Numéroté chaque page (cadre en bas à droite)• Placer les feuilles A3 ouvertes, dans le même sens et dans l'ordre			

17. On admet que $\int_0^{+\infty} g_1(x) dx = 1$ et $\int_0^{+\infty} g_2(x) dx = 1$.

$$\text{En posant } f_1 : x \mapsto \begin{cases} g_1(x) & \text{si } x \geq 0 \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}$$

$$\text{et } f_2 : x \mapsto \begin{cases} g_2(x) & \text{si } x \geq 0 \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}$$

f_1 et f_2 sont positives sur \mathbb{R} , continues sur \mathbb{R}^+ ,

$$\text{et vérifient } \int_{-\infty}^{+\infty} f_1(x) dx = \int_{-\infty}^{+\infty} f_2(x) dx = 1.$$

Ce sont donc des densités de probabilité.

On note respectivement X_1 et X_2 des variables aléatoires de densité f_1 et f_2 .

Soit $n \in \mathbb{N}$. D'après le théorème de transfert,

$$\text{comme } \int_{-\infty}^{+\infty} f_1(x) x^n dx = \int_0^{+\infty} x^n g_1(x) dx$$

$$\text{et } \int_{-\infty}^{+\infty} f_2(x) x^n dx = \int_0^{+\infty} x^n g_2(x) dx \text{ convergent,}$$

X_1 et X_2 admettent un moment d'ordre n .

f_1 et f_2 sont nulles sur \mathbb{R}^- et continues sur \mathbb{R}^+ .

Ainsi, X_1 et X_2 sont solutions de $M^*(\mathcal{J})$.

Il n'y a donc pas unicité des solutions de $u''(j)$ quand $f \in [0, +\infty[$.

Partie III

III/A/

18. X est une variable aléatoire à densité.
Ainsi, on (car f est une densité de X ,

$$\int_{-\infty}^{+\infty} f(x) dx = 1, \text{ i.e. } \int_0^1 f(x) dx = 1.$$

f n'est donc pas identiquement nulle sur $[0, 1]$

Par produit, $x \mapsto x^n f(x)$ est continue sur $[0, 1]$

à valeurs positives, et non identiquement nulle sur $[0, 1]$

Par stricte positivité de l'intégral, il vient $\int_0^1 x^n f(x) dx > 0$

(car $f(x) > 0$ et $\int_0^1 x^n f(x) dx$ converge car $E(X^n)$ existe).

Donc $E(X^n) > 0$, i.e. $u_n > 0$

19.

Soit $(i, j) \in \mathbb{N}^2$.

f est à valeurs positives sur $[0, 1]$, est continue, et non identiquement nulle sur J .

Ainsi par produit,

$x \mapsto x^i (1-x)^j f(x)$ est positive, non

identiquement nulle et continue sur J .

Par la suite positivité de l'intégrale,

$$\int_0^1 x^i (1-x)^j f(x) dx > 0$$

$$\text{i.e. } \int_{-\infty}^{+\infty} x^i (1-x)^j f(x) dx > 0 \text{ (car } J =]0, 1[).$$

Par le théorème de transfert, la convergence de

$$\int_{-\infty}^{+\infty} x^i (1-x)^j f(x) dx \text{ assure que } E(x^i (1-x)^j) \text{ existe,}$$

$$\text{et } \underline{E(x^i (1-x)^j) > 0}$$

D'après le binôme de Newton:

$$\forall w \in \mathbb{R}, (1-x(w))^j = \sum_{k=0}^j \binom{j}{k} (-x(w))^k$$

$$\text{donc } (1-x)^j = \sum_{k=0}^j \binom{j}{k} (-x)^k.$$

$$\text{donc } x^i (1-x)^j = \sum_{k=0}^j \binom{j}{k} (-1)^k x^{k+i}$$

Par

linéarité de l'espérance (car X admet des moments de tout ordre), $E\left(\sum_{k=0}^j \binom{j}{k} (-1)^k x^{k+i}\right)$ existe

$$\text{et } E(x^i (1-x)^j) = \sum_{k=0}^j \binom{j}{k} (-1)^k E(x^{k+i})$$

$$\text{Ainsi, } \underline{\sum_{k=0}^j \binom{j}{k} (-1)^k u_{k+i} > 0}$$

20. D'après 19. avec $i=2$ et $j=1$,

$$\text{on a } u_2 - u_3 > 0$$

$$\text{donc } \underline{\frac{1}{3} > u_3}$$

D'après 19. avec $j=2$ et $i=1$,

$$\sum_{k=0}^2 (-1)^k \binom{2}{k} u_{1+k} > 0$$

donc $u_3 - 2u_2 + u_1 > 0$

donc $u_3 - \frac{2}{3} + \frac{1}{2} > 0$

donc $u_3 - \frac{1}{6} > 0$

donc $u_3 > \frac{1}{6}$.

Ainsi, $u_3 \in]\frac{1}{6}, \frac{1}{3}[$.

21.

Admet le résultat.

(II.2)

$$22. \Delta_{n10} = \sum_{k=0}^0 (-1)^k \binom{0}{k} u_{n+k} = u_{n+0}$$

$$= \sum_{k=0}^0 (-1)^k \binom{0}{k} E(X^{n+k})$$

$$= (-1)^0 \binom{0}{0} E(X^n)$$

$$= E(X^n)$$

$$= u_n.$$

23. Soit $n \in \mathbb{N}$, $j \in \{0, \dots, m\}$.

$$\Delta_{n1j} = \sum_{k=0}^1 (-1)^k \binom{1}{k} u_{n+k-j}$$

$$= \sum_{k=1}^{j+1} (-1)^{k-1} \binom{1}{k-1} u_{n+k-j-1} \quad \text{par changement d'indice}$$

Copie anonyme - n°anonymat :

Code épreuve : 282

Nombre de pages : 32

Session : 2023

Emplacement
QR Code

Épreuve de :

Consignes

- Remplir soigneusement l'en-tête de chaque feuille avant de commencer à composer
- Rédiger avec un stylo non effaçable bleu ou noir
- Ne rien écrire dans les marges (gauche et droite)
- Numéroté chaque page (cadre en bas à droite)
- Placer les feuilles A3 ouvertes, dans le même sens et dans l'ordre

On a ainsi $\Delta_{n,j} = \sum_{k=1}^{j+1} (-1)^{k-1} \binom{j}{k-1} u_{n+2-j-k}$

Comme $\Delta_{n+1,j} = \sum_{k=0}^j (-1)^k \binom{j}{k} u_{n+2-j-k}$,

$\Delta_{n+1,j} = \sum_{k=0}^j (-1)^k \binom{j}{k} u_{n+2-j-k}$

$= \sum_{k=1}^{j+1} (-1)^{k-1} \binom{j}{k-1} u_{n-j+k}$ par changement d'indice.

Donc $\Delta_{n,j} - \Delta_{n+1,j} = \sum_{k=1}^{j+1} u_{n-j+k} (-1)^k \left(\binom{j}{k} + \binom{j}{k-1} \right)$

Or retiré $\rightarrow -u_{n+1} \binom{j}{j+1} + u_{n-j} \binom{j}{0}$

le terme en 0
de $\Delta_{n,j}$
et on ajoute celui
en $j+1$, qui

vaut $\binom{j}{j+1} (-1)^{j+1} u_{n+1} = 0$.

$= \sum_{k=1}^{j+1} u_{n-j+k} (-1)^k \binom{j+1}{k}$

$- \left(\sum_{k=1}^j u_{n-j+k} (-1)^{k+1} + u_{n-j} \right)$ d'après la formule de Pascal

$= \sum_{k=0}^j (u_{n-j+2+k} (-1)^k \binom{j+1}{k+1}) + u_{n-j} (-1)^{j+1} \binom{j+1}{j+1}$
+ u_{n-j}

$$\begin{aligned}
 &= \sum_{k=0}^{j+1} u_{r-j+k} (-1)^k \binom{j+1}{k} + u_{r-j} (-1)^0 \binom{j+1}{0} \\
 & \quad k=0 \\
 &= \sum_{k=0}^{j+1} u_{r-j+k} (-1)^k \binom{j+1}{k} \\
 &= \underline{\Delta_{r+1, j+1}}.
 \end{aligned}$$

24.

def test-hungary(U):

N = len(U) - 1

Delta = np.zeros((N+1, N+1))

info = -1

for k in range(0, N+1):

Delta[k, 0] = U[k]

if ((Delta[k, 0] <= 0) and (info == -1)):

info = k

for j in range(0, N+1):

Delta[k, j] = Delta[k-1, j-1] - Delta[k, j-1]

if ((Delta[k, j] <= 0) and (info == -1)):

info = k

return

return (info, Delta)

25.

[11 3].

Soit $(a, b) \in [0, 1]^2$

26. \downarrow f_1 et f_2 sont de classe C^1 sur J .

Par conséquent, h est C^1 sur J .

Ainsi, h est continue sur le fermé borné $[0, 1]$.

D'après le théorème de compacité, h admet un maximum sur $[0, 1]$ et un minimum sur $[0, 1]$.

Or les ordres k_1 et k_2 respectivement.

On pose $K = \max(|k_1|, |k_2|)$.

Or ainsi: $\forall x \in J, |h'(x)| \leq K$.

h est dérivable et continue sur $[0, 1]$ donc sur $[a, b]$.

D'après l'inégalité des accroissements finis:

$$|h(b) - h(a)| \leq K|b-a|.$$

Ainsi : $\forall (x, y) \in J^2, |h(x) - h(y)| \leq K|x-y|.$

27.

(a) $\forall \alpha \in \mathbb{R}, \mathcal{M}_\alpha(\mathbb{R}) \subset [0, m]$ donc $\mathcal{Z}_\alpha(\mathbb{R}) \subset [0, 1]$

~~Soit x~~

Ainsi, d'après 26 :

$\forall u \in \mathbb{R},$

~~$0 \leq \mathcal{Z}_\alpha \leq 1$ et 1 admet une expérience~~

$$|h(x) - h(\mathcal{Z}_\alpha(u))| \leq K|x - \mathcal{Z}_\alpha(u)|$$

d'où

$$-K|x - \mathcal{Z}_\alpha| \leq h(x) - h(\mathcal{Z}_\alpha) \leq K|x - \mathcal{Z}_\alpha|.$$

Par continuité puis linéarité de \mathbb{Q} expérience,

$$-K E(|x - \mathcal{Z}_\alpha|) \leq h(x) - E(h(\mathcal{Z}_\alpha)) \leq K E(|x - \mathcal{Z}_\alpha|)$$

$$\text{donc } |h(x) - E(h(\mathcal{Z}_\alpha))| \leq K E(|x - \mathcal{Z}_\alpha|).$$

* Justification de l'existence des expériences :

h est continue sur $[0, 1]$ donc h est bornée sur $[0, 1]$, d'après le théorème de compacité.

Ainsi : $\exists M \in \mathbb{R}^+ / |h(\mathcal{Z}_\alpha)| \leq M.$

La variable $\alpha \in M$ admet une expérience donc par domination, certaine égale à

$h(\mathcal{Z}_\alpha)$ admet une expérience.

$$\bullet \quad 0 \leq \mathcal{Z}_\alpha \leq 1$$

$$\bullet \quad -x \leq \mathcal{Z}_\alpha - x \leq 1 - x$$

$$\bullet \quad 0 \leq |\mathcal{Z}_\alpha - x| \leq \max(x, 1-x).$$

Par existence de l'expérience par domination, $|\mathcal{Z}_\alpha - x|$ admet

Copie anonyme - n°anonymat :

Code épreuve : 282

Nombre de pages : 32

Session : 2023

Emplacement
QR Code

Épreuve de : MATHS APPROFONDIES IIEC/ESSEC

Consignes

- Remplir soigneusement l'en-tête de chaque feuille avant de commencer à composer
- Rédiger avec un stylo non effaçable bleu ou noir
- Ne rien écrire dans les marges (gauche et droite)
- Numéroté chaque page (cadre en bas à droite)
- Placer les feuilles A3 ouvertes, dans le même sens et dans l'ordre

bien une expérience.

(b) Or on a vu précédemment que $|2a-x| = \sqrt{(2a-x)^2}$ admettait une expérience.

Or remarque que on a aussi $0 \leq (2a-x)^2 \leq (a+(x-a))^2$
donc par domination, $|2a-x|$ admet un

moment d'ordre 2 donc une variance.

$$\text{Donc } V(|2a-x|) = E((2a-x)^2) - E(\sqrt{(2a-x)^2})^2 \geq 0$$

$$\text{donc } E((2a-x)^2) \geq E(\sqrt{(2a-x)^2})^2 \geq 0$$

28. donc par croissance de $x \mapsto \sqrt{x}$ sur \mathbb{R}_+ ,

$$\sqrt{E((2a-x)^2)} \geq E(|2a-x|) \geq 0.$$

Ainsi, on a $\sqrt{E((2a-x)^2)} \geq |h(x) - E(h(2a))|$ par
produit, dans l'inégalité obtenue en 27.(a)
de termes positifs

28.

31. Par ~~Heine~~ ^{passage à la limite} ~~et~~ ~~exactement~~ dans l'inégalité obtenue en 30. (car $\frac{k}{2\sqrt{\pi}} \int_0^1 |h(x)| dx \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} 0$ et $\int_0^1 h^2(x) dx \geq 0$ (par positivité de l'intégrale),

$\int_0^1 h^2(x) dx = 0$. h^2 est par opérations continues, et positive sur $[0, 1]$.

Par le théorème de l'intégrale nulle: $\forall t \in [0, 1], h^2(t) = 0$
 $h(t) = 0$.

$$f_1(t) = f_2(t).$$

Ainsi, $f_1 = f_2$.

Par conséquent, si des solutions de $M^*(J)$ sont à densités de classe \mathcal{C}^1 (avec $J = [0, 1]$), ~~et~~ elles sont la même loi.

Donc une unique loi est solution de $M^*(J)$ si une densité associée est \mathcal{C}^1 sur J .

III.4.

32. On pose $h: x \mapsto \frac{e^x - 1 - x}{x^2}$.

h est e^x sur $[-1, 1] \setminus \{0\}$.

$$\forall x \in [-1, 1] \setminus \{0\}, h'(x) = \frac{(e^x - 1)x^2 - 2x(e^x - 1 - x)}{x^4}$$

$$= \frac{x^2 e^x + x^2 + 2x - 2x e^x}{x^4}$$

e^x est e^2 sur $[-1, 1]$.

$\forall x \in [-1, 1], e^{x(2)}(x) = e^x \geq 0$.

e^x est convexe, donc e^x est en particulier au-dessus de sa tangente en 0.

Ainsi: $\forall x \in [-1, 1], e^x \geq e^0(x-0) + e^0 = x + 1$

$$e^x - 1 - x \geq 0$$

$\forall x \in [-1, 1], |e^{x(2)}(x)| \leq (e^x) = e^x$

$\leq e^1$ qui est une borne de e^x sur \mathbb{R}

Soit $x \in [-1, 1]$.

D'après l'inégalité de Taylor-Lagrange appliquée à e^x entre 0 et x à l'ordre 1,

$$|e^x - e^0 - (x-0)e^0| \leq e^{\frac{|x^2-0|}{2!}}$$

donc $|e^x - 1 - x| \leq \frac{e}{2} x^2$.

En posant $C = \frac{e}{2}$, on a:

$$\forall x \in [-1, 1], 0 \leq e^x - 1 - x \leq C x^2$$

33. col.

(b) soit $(d_1, d_2) \in \mathbb{R}^2$.
~~Soit $t \mapsto e^{d_1 t + e^{d_2 t^2}}$ est~~

continue, positive et non identiquement nulle donc par stricte positivité de l'intégrale,

$$\int_0^1 e^{d_1 t + e^{d_2 t^2}} dt > 0$$

donc $R_0(d_1, d_2) > 0$.

F_R est bien définie.

Comme quotient de fonctions bien définies de classe dérivable ~~par support~~ admettant une dérivée partielle par rapport à leur première et seconde variable, F_R admet également ses dérivées partielles par rapport à toutes ses variables.

Par dérivation : $\partial_1 F_R(d_1, d_2) = \frac{\partial_1 R_2(d_1, d_2) R_0(d_1, d_2) - \partial_1 R_0(d_1, d_2) R_2(d_1, d_2)}{(R_0(d_1, d_2))^2}$

$$= \frac{R_{2+1}(d_1, d_2) R_0(d_1, d_2) - R_0(d_1, d_2) R_{2+1}(d_1, d_2)}{(R_0(d_1, d_2))^2}$$

$$= \frac{R_1(d_1, d_2) R_2(d_1, d_2) - R_0(d_1, d_2) R_3(d_1, d_2)}{(R_0(d_1, d_2))^2} \quad \text{d'après 33. ca)}$$

$$= F_{2+1}(d_1, d_2) - \frac{R_1(d_1, d_2) R_2(d_1, d_2)}{R_0(d_1, d_2) R_0(d_1, d_2)}$$

$$= F_{2+1}(d_1, d_2) - F_1(d_1, d_2) F_2(d_1, d_2)$$

Donc $\partial_1 F_R = F_{2+1} - F_1 F_2$

Copie anonyme - n°anonymat :

Emplacement GR Code	Code épreuve : 282	Nombre de pages : 32	Session : 2023
	Épreuve de : MATHS I MEC/ESSEC		
Consignes <ul style="list-style-type: none"> • Remplir soigneusement l'en-tête de chaque feuille avant de commencer à composer • Rédiger avec un stylo non effaçable bleu ou noir • Ne rien écrire dans les marges (gauche et droite) • Numéroté chaque page (cadre en bas à droite) • Placer les feuilles A3 ouvertes, dans le même sens et dans l'ordre 			

De même, par dérivation :

$$J_2 F_2(d_1, d_2) = \frac{J_2 F_2(d_1, d_2) / R_0(d_1, d_2) - J_2 R_0(d_1, d_2) F_2(d_1, d_2)}{(R_0(d_1, d_2))^2}$$

$$= \frac{F_{2+2}(d_1, d_2)}{R_0(d_1, d_2)} - \frac{R_2(d_1, d_2) F_2(d_1, d_2)}{R_0(d_1, d_2) R_0(d_1, d_2)}$$

$$= F_{2+2}(d_1, d_2) - F_2(d_1, d_2) F_2(d_1, d_2)$$

Donc : $\forall i \in \llbracket 1, 2 \rrbracket, J_i F_2 = F_{2+i} - F_2 F_i$.

(c) Soit $i \in \llbracket 1, 2 \rrbracket$. Soit $(d_1, d_2) \in \mathbb{R}^2$.

$$F_{2+i}(d_1, d_2) - (F_2 F_i)(d_1, d_2) = \frac{1}{R_0(d_1, d_2)} \int_0^1 t^{2+i} e^{d_1 t + d_2 t^2} dt$$

$$- \frac{1}{R_0(d_1, d_2)^2} \left(\int_0^1 t^2 e^{d_1 t + d_2 t^2} dt \int_0^1 t^i e^{d_1 t + d_2 t^2} dt \right)$$

On remarque que $(\int_0^1 e^{d_1 t + d_2 t^2} dt) / R_0(d_1, d_2) = 1$.

Donc par linéarité de l'intégrale, $\int_0^1 F_2(d_1, d_2) F_i(d_1, d_2) e^{d_1 t + d_2 t^2} dt$

$$= F_2(d_1, d_2) F_i(d_1, d_2) R_0(d_1, d_2)$$

De même, il vient par linéarité

$$- \int_0^1 t^i F_2(d_1, d_2) e^{dt + d_2 t^2} dt = -F_2(d_1, d_2) P_i(d_1, d_2) \quad (1)$$

$$\text{et } - \int_0^1 t^j F_1(d_1, d_2) e^{dt + d_2 t^2} dt = -F_1(d_1, d_2) P_j(d_1, d_2) \quad (2)$$

En divisant par $P_0(d_1, d_2)$ les deux membres de droites de (1) et (2) devraient respectivement $-F_2(d_1, d_2)$

$$\text{et } -F_1(d_1, d_2)$$

En additionnant (0), (1), (2), et $F_1 F_2(d_1, d_2) \int_0^1 t^i t^j e^{dt + d_2 t^2} dt$
 $P_0(d_1, d_2)$

on aboutit à $F_1 F_2(d_1, d_2) - 2(F_1 F_2)(d_1, d_2) +$

$$(F_1 F_2)(d_1, d_2) = \frac{1}{P_0(d_1, d_2)} \int_0^1 (1 - F_1(d_1, d_2))(1 - F_2(d_1, d_2)) e^{dt + d_2 t^2} dt$$

par linéarité de l'intégrale,

d'où le résultat demandé en remplaçant le membre de gauche par $d_1 F_2(d_1, d_2)$, en accord avec

33. (a).

$$\forall (d_1, d_2) \in \mathbb{R}^2 \quad d_1 G(d_1, d_2) = F_1(d_1, d_2) - u_1$$

$$d_2 G(d_1, d_2) = F_2(d_1, d_2) - u_2$$

$$\text{d'où } d_{1,1}^2 G(d_1, d_2) = F_2(d_1, d_2) - (F_1(d_1, d_2))^2$$

$$\text{et } d_{2,2}^2 G(d_1, d_2) = F_1(d_1, d_2) - (F_2(d_1, d_2))^2$$

d'après 33. (b).