

Mathématiques

Option Scientifique

Jeudi 14 mai 2009 de 8h00 à 12h00

Durée : 4 heures

*Candidats bénéficiant de la mesure « Tiers-temps » :
8h00 - 13h20*

Aucun document n'est autorisé.

Aucun instrument de calcul n'est autorisé.

L'énoncé comporte 6 pages. (dans la version d'origine, pas celle-ci)

Les candidats sont invités à soigner la présentation de leur copie, à mettre en évidence les principaux résultats, à respecter les notations de l'énoncé et à donner des démonstrations complètes – mais brèves – de leurs affirmations.

EXERCICE 1

$\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ désigne l'ensemble des matrices carrées d'ordre n à coefficients réels.

Pour tout élément $A = (a_{i,j})_{1 \leq i,j \leq n}$ de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$, on appelle « trace de A », et on note $Tr(A)$, la somme des éléments diagonaux, c'est-à-dire :

$$Tr(A) = \sum_{i=1}^n a_{i,i}.$$

On admet que Tr est une application linéaire de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ dans \mathbb{R} telle que :

$$\forall A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R}), \forall B \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R}), Tr(AB) = Tr(BA).$$

On note tA la transposée de la matrice A .

Pour toutes matrices M et N de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$, on pose :

$$\langle M|N \rangle = Tr({}^tMN) = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n m_{i,j}n_{i,j}$$

où $m_{i,j}$ (resp. $n_{i,j}$) désigne le coefficient de M (resp. N) situé à l'intersection de la i -ième ligne et de la j -ième colonne.

Soit A une matrice symétrique, on considère

- l'application Φ_A de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ définie par : $\forall M \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R}), \Phi_A(M) = AM - MA$,
- l'ensemble $\text{Sp}(A)$ formé des valeurs propres de A ,
- l'ensemble $\text{Sp}(\Phi_A)$ formé des valeurs propres de Φ_A ,
- l'ensemble $\Gamma = \left\{ \lambda - \mu, (\lambda, \mu) \in (\text{Sp}(A))^2 \right\}$ formé des différences de deux valeurs propres quelconques de A .

Le but de cet exercice est d'établir que les deux propriétés suivantes sont valables pour toute matrice symétrique à coefficients réels A :

- ★ Φ_A est un endomorphisme diagonalisable,
- ★ les valeurs propres de Φ_A forment l'ensemble Γ c'est-à-dire que $\text{Sp}(\Phi_A) = \Gamma$.

PARTIE I : Étude d'un cas particulier

Dans cette partie uniquement, on suppose que $n = 2$, $A = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}$ et on admet les deux propriétés suivantes :

- Φ_A est un endomorphisme de $\mathcal{M}_2(\mathbb{R})$,
- la famille (V_1, V_2, V_3, V_4) est une base de $\mathcal{M}_2(\mathbb{R})$ où l'on a posé :

$$V_1 = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}, V_2 = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}, V_3 = \begin{pmatrix} 0 & 0 \\ 1 & 0 \end{pmatrix}, V_4 = \begin{pmatrix} 0 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}.$$

1. Justifier que la matrice T de l'endomorphisme Φ_A dans la base (V_1, V_2, V_3, V_4) s'écrit :

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

En déduire la diagonalisabilité de T .

2. Vérifier que $T^3 = 4T$. Qu'en déduit-on sur les valeurs propres de T ?
3. Déterminer une base de l'espace propre associé à 0 de la matrice T .

4. Calculer TX_1 et TX_2 où $X_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ -1 \\ 1 \\ -1 \end{pmatrix}$ et $X_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ -1 \\ -1 \end{pmatrix}$.

5. Expliciter alors une matrice inversible P et une matrice diagonale D telles que $T = PDP^{-1}$ (on ne demande pas le calcul de P^{-1}).

PARTIE II : Réduction de Φ_A dans le cas général

On revient désormais au cas général, A étant une matrice symétrique quelconque de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$.

1. Montrer que Φ_A est un endomorphisme de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$.
2. Prouver que l'application $(M, N) \in (\mathcal{M}_n(\mathbb{R}))^2 \mapsto \langle M|N \rangle$ est un produit scalaire sur $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$.

3. Établir que, pour toutes matrices M, N appartenant à $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$, on a :

$$\langle \Phi_A(M) | N \rangle = \langle M | \Phi_A(N) \rangle.$$

En déduire que Φ_A est un endomorphisme diagonalisable.

4. Soient

- $X \in \mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{R})$ un vecteur propre de A associé à la valeur propre λ ,
- $Y \in \mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{R})$ un vecteur propre de A associé à la valeur propre μ .

On pose alors :

$$M_{X,Y} = X {}^t Y \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R}).$$

(a) Justifier que $M_{X,Y} \neq 0$ puis que ${}^t Y A = \mu {}^t Y$.

(b) Établir que $\Phi_A(M_{X,Y}) = (\lambda - \mu)M_{X,Y}$ puis que $\Gamma \subset \text{Sp}(\Phi_A)$.

5. Soit $M \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ un vecteur propre de Φ_A associé à la valeur propre α .

(a) On suppose que pour tout vecteur propre Z de A , on a $MZ = 0$.

Montrer alors que $M = 0$.

En déduire qu'il existe au moins un vecteur propre Z_0 de A tel que $MZ_0 \neq 0$.

On note μ la valeur propre associée à Z_0 .

(b) En revenant à l'expression de $\Phi_A(M)$, justifier que MZ_0 est un vecteur propre de A pour une valeur propre dont on précisera l'expression à l'aide de α et μ .

(c) Conclure.

EXERCICE 2

Le but de l'exercice est l'étude de la fonction f définie par la formule suivante :

$$f(x) = \int_0^{+\infty} e^{-2t} \sqrt{1 + x^2 e^{2t}} dt.$$

1. Domaine de définition de f :

(a) Justifier que pour tout réel $a > 0$, l'intégrale $\int_0^{+\infty} e^{-at} dt$ est convergente et donner sa valeur.

(b) Soit x un réel fixé. Établir la convergence de l'intégrale $\int_0^{+\infty} e^{-2t} \sqrt{1 + x^2 e^{2t}} dt$.

Par conséquent, f est définie sur \mathbb{R} et elle est clairement paire. On va donc l'étudier sur $[0, +\infty[$.

2. Branche infinie de la courbe représentative de f :

(a) Vérifier l'encadrement suivant, pour tout réel x strictement positif et pour tout réel t positif ou nul :

$$xe^t \leq \sqrt{1 + x^2 e^{2t}} \leq xe^t + \frac{e^{-t}}{2x}.$$

(b) Prouver que, pour tout réel x strictement positif, on a :

$$x \leq f(x) \leq x + \frac{1}{6x}.$$

(c) Préciser alors la nature de la branche infinie de la courbe représentative de f au voisinage de $+\infty$.

3. Dérivabilité et monotonie de f :

(a) À l'aide du changement de variable $u = xe^t$, que l'on justifiera, prouver la formule suivante lorsque x est un réel strictement positif :

$$f(x) = x^2 \int_x^{+\infty} \frac{\sqrt{1 + u^2}}{u^3} du.$$

- (b) Montrer que la fonction f est de classe C^1 sur $]0, +\infty[$ et que sa dérivée est donnée, pour tout réel x strictement positif, par :

$$f'(x) = \frac{2f(x) - \sqrt{1+x^2}}{x}.$$

- (c) Justifier, pour tout réel strictement positif, l'égalité suivante :

$$2f(x) = \sqrt{1+x^2} + x^2 \int_x^{+\infty} \frac{du}{u\sqrt{1+u^2}}.$$

En déduire que f est strictement croissante sur $]0, +\infty[$.

4. Étude locale de f et f' en 0 :

- (a) Justifier que la formule suivante est valable pour tout réel x strictement positif :

$$\int_x^{+\infty} \frac{du}{u\sqrt{1+u^2}} = -\frac{\ln(x)}{\sqrt{1+x^2}} + \int_x^{+\infty} \frac{u \ln(u)}{(1+u^2)^{3/2}} du$$

et que l'intégrale $\int_0^{+\infty} \frac{u \ln(u)}{(1+u^2)^{3/2}} du$ est convergente.

- (b) À l'aide des questions précédentes, démontrer que l'on a :

$$f'(x) \underset{x \rightarrow 0^+}{\sim} -x \ln(x) \quad \text{et} \quad f(x) - \frac{1}{2} \underset{x \rightarrow 0^+}{\sim} -\frac{x^2 \ln(x)}{2}.$$

- (c) En déduire que f est une fonction de classe C^1 sur $[0, +\infty[$ et préciser la valeur de $f'(0)$.

PROBLÈME

Dans tout le problème, a et b désignent des entiers naturels tous deux non nuls et l'on note $N = a+b$. On considère une urne contenant initialement a boules blanches et b boules noires, dans laquelle on effectue des tirages successifs, au « hasard » et « avec remise » d'une boule en procédant de la façon suivante :

- lorsque la boule tirée est blanche, elle est remise dans l'urne avant de procéder au tirage suivant,
- lorsque la boule tirée est noire, elle n'est pas remise dans l'urne, mais est remplacée dans cette urne par une boule blanche et l'on procède alors au tirage suivant.

PARTIE I

Soient (Ω, \mathcal{A}, p) un espace probabilisé et $Y : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ la variable aléatoire égale au nombre de tirages nécessaires à l'obtention d'une première boule blanche.

1. Préciser soigneusement l'ensemble des valeurs prises par la variable Y .
2. Pour tout entier k compris entre 1 et $b+1$, calculer la valeur de la probabilité $P(Y = k)$.
3. Vérifier que

$$P(Y = b+1) = \frac{b!}{N^b},$$

et que, pour tout entier k compris entre 1 et b , la formule suivante est vraie :

$$P(Y = k) = \frac{b!}{(b - (k-1))! N^{k-1}} - \frac{b!}{(b-k)! N^k}.$$

4. Soient M un entier naturel non nul et a_0, a_1, \dots, a_M une famille de réels. Établir que :

$$\sum_{k=1}^M k(a_{k-1} - a_k) = \left(\sum_{k=0}^{M-1} a_k \right) - M a_M.$$

5. En déduire que $E(Y) = \sum_{k=0}^b \frac{b!}{(b-k)! N^k}$.

PARTIE II

Dans cette partie on note :

- pour tout entier $n \geq 1$, q_n la probabilité de l'événement, note N_n : « la n -ième boule tirée est noire »,
- pour tout entier $n \geq 0$, X_n le nombre aléatoire de boules noires obtenues au cours des n premiers tirages. Par convention $X_0 = 0$.

- pour tous entiers $n \geq 0$ et $k \geq 0$, $p_{n,k}$ la probabilité de l'événement : « au cours des n premiers tirages, on a obtenu exactement k boules noires ».

On remarquera que $p_{0,0} = 1$ et que $p_{n,k} = 0$ si $k > n$ ou si $k > b$.

1. Soit $n \in \mathbb{N}$, calculer $p_{n,0}$ puis $p_{n,n}$. Que vaut la somme $\sum_{k=0}^n p_{n,k}$?

2. Démontrer la formule suivante, valable pour tous les entiers naturels n et k non nuls :

$$(\mathcal{A}) : N.p_{n,k} = (a+k)p_{n-1,k} + (b+1-k)p_{n-1,k-1}.$$

3. Calcul de l'espérance de X_n :

(a) À l'aide de la formule (\mathcal{A}) obtenue dans la question **II.2.**, démontrer la formule pour $n \geq 1$:

$$N.E(X_n) = \sum_{k=0}^{n-1} [b+k(N-1)] p_{n-1,k}$$

puis justifier que :

$$E(X_n) = \left(1 - \frac{1}{N}\right) E(X_{n-1}) + \frac{b}{N}.$$

(b) À l'aide de la formule ci-dessus, écrire une fonction en Pascal fournissant le calcul de $E(X_{2009})$ lorsque $b = 10$ et $N = 100$.

(c) En utilisant la dernière formule établie à la question **II.3.a**, prouver que, pour tout entier naturel n , on a :

$$E(X_n) = b \left[1 - \left(1 - \frac{1}{N}\right)^n\right].$$

4. Calcul de q_n :

(a) En utilisant une formule des probabilités totales, établir la formule suivante valable pour tout entier naturel n :

$$N.q_{n+1} = \sum_{k=0}^n (b-k)p_{n,k}.$$

(b) Pour tout entier naturel n , exprimer alors q_{n+1} en fonction de $E(X_n)$ et en déduire l'expression de q_{n+1} en fonction de n, b, N .

5. Calcul de la variance de X_n : On introduit la suite $(u_n)_{n \geq 0}$ définie pour tout entier naturel n par :

$$u_n = E(X_n(X_{n-1})).$$

(a) À l'aide la formule (\mathcal{A}) obtenue dans la question **II.2.** montrer que l'on a :

$$N.u_n = \sum_{k=1}^{n-1} [k(k-1)(a+b-2) + 2(b-1)k] p_{n-1,k}.$$

(b) En déduire que la suite $(u_n)_{n \geq 0}$ satisfait à la relation de récurrence suivante :

$$\forall n \geq 1 \quad u_n = \left(1 - \frac{2}{N}\right) u_{n-1} + \frac{2b(b-1)}{N} \left[1 - \left(1 - \frac{1}{N}\right)^{n-1}\right].$$

(c) À l'aide d'une récurrence, démontrer que la formule suivante est valable pour tout entier naturel n :

$$u_n = b(b-1) \left[1 + \left(1 - \frac{2}{N}\right)^n - 2 \left(1 - \frac{1}{N}\right)^n\right].$$

(d) Donner alors la valeur de $V(X_n)$ puis préciser sa limite lorsque n tend vers $+\infty$.