

**CONCOURS BLANC 4 — ESCP**

La présentation, la lisibilité, l'orthographe, la qualité de la rédaction, la clarté et la précision des raisonnements entreront pour une part importante dans l'appréciation des copies.

Les candidats sont invités à **encadrer** dans la mesure du possible les résultats de leurs calculs.

**Les documents, la calculatrice et tout matériel électronique sont interdits.**

Vous pouvez traiter le sujet dans l'ordre que vous souhaitez tant que le correcteur peut clairement identifier la question à laquelle vous répondez. Il est possible d'admettre le résultat d'une question précédente pour répondre à une question tant que cela est spécifié clairement.

Ce sujet comporte 4 pages et est constitué de 4 exercices. Bon courage!

L'épreuve est constituée de quatre exercices indépendants. Dans les exercices 3 et 4 :

- La probabilité d'un événement  $J$  est notée  $P(J)$ . Si  $C$  est un événement de probabilité non nulle, on note  $P_C(J)$  la probabilité conditionnelle de  $J$  sachant  $C$ .
- On note  $\Omega$  l'univers des résultats observables et si  $T$  est une variable aléatoire, on note  $T(\Omega)$  l'ensemble des valeurs prises par  $T$ .
- Sous réserve d'existence, on note respectivement  $E(T)$  et  $V(T)$  l'espérance et la variance de  $T$ .

**Exercice 1 –**

Soient  $a, b, c$  et  $d$  des réels et soit  $\mathcal{E}$  l'ensemble des matrices carrées  $M = \begin{pmatrix} a & b \\ c & d \end{pmatrix}$  d'ordre 2 qui vérifient les deux conditions  $a + d = 0$  et  $ad - bc = 0$ .

- (a) Les matrices de  $\mathcal{E}$  sont-elles inversibles?
- (b) Vérifier que les deux matrices  $\begin{pmatrix} 1 & 1 \\ -1 & -1 \end{pmatrix}$  et  $\begin{pmatrix} 1 & -1 \\ 1 & -1 \end{pmatrix}$  appartiennent à  $\mathcal{E}$ .
- (c) En déduire que la somme et le produit de deux matrices de  $\mathcal{E}$  n'appartiennent pas nécessairement à  $\mathcal{E}$ .
- (d) Soit  $M = \begin{pmatrix} a & b \\ c & d \end{pmatrix}$  une matrice de  $\mathcal{E}$ .

Déterminer la matrice  $M^2$  et en déduire, pour tout entier  $n \geq 2$ , la matrice  $M^n$ .

Dans toute la suite de l'exercice, on pose  $A = \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ -2 & 5 \end{pmatrix}$  et on note  $I = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$  la matrice identité d'ordre 2.

- (a) Justifier l'inversibilité de la matrice  $A$ .
- (b) On pose  $K = A - 3I$ . Vérifier que la matrice  $K$  appartient à  $\mathcal{E}$ .
- (c) On rappelle que si  $B$  est une matrice carrée d'ordre 2, on pose par convention  $B^0 = I$ .
  - Exprimer pour tout entier naturel  $n$ , la matrice  $A^n$  en fonction de  $n$ ,  $I$  et  $K$
  - Donner l'expression de  $A^n$  sous forme d'un tableau matriciel.
- (a) Établir l'existence d'un unique couple  $(\alpha, \beta) \in \mathbb{R}^2$  que l'on déterminera, pour lequel  $A^2 + \alpha A + \beta I$  est la matrice nulle.

- Retrouver le fait que la matrice  $A$  est inversible et montrer que  $A^{-1} = \frac{2}{3}I - \frac{1}{9}A$ .

- (c) En déduire que  $A^{-1} = \frac{1}{3}I - \frac{1}{9}K$  et vérifier que la formule trouvée à la question 2.c(i) pour tout  $n \in \mathbb{N}$  est encore valide pour tout  $n \in \mathbb{Z}$ .
4. (a) Trouver les racines du polynôme  $x^2 - 6x + 9$ .
- (b) Montrer qu'il existe une matrice colonne non nulle  $X$  solution de l'équation matricielle  $AX = 3X$ .

**Exercice 2 –**

Dans tout l'exercice, on pose  $I_0 = \int_1^e t \, dt$  et pour tout  $n \in \mathbb{N}^*$ ,  $I_n = \int_1^e t(\ln(t)) \, dt$ .

1. (a) Calculer  $I_0$ .
- (b) Montrer que pour tout entier naturel  $n$ , on a  $I_n \geq 0$ .
- (c) Montrer que la suite  $(I_n)_{n \geq 0}$  est décroissante puis qu'elle est convergente.
2. (a) Pour tout entier naturel  $n$ , soit  $f_n$  la fonction définie sur l'intervalle  $[1, e]$  par  $\forall t \in [1, e], f_n(t) = (\ln(t))^{n+1}$ .  
On note  $f'_n$  la dérivée de la fonction  $f_n$ . Pour tout  $t \in [1, e]$ , calculer  $f'_n(t)$ .
- (b) À l'aide d'une intégration par parties, établir pour tout entier naturel  $n$ , la relation (\*) suivante :

$$(*) \quad 2I_{n+1} + (n+1)I_n = e^2.$$

- (c) En déduire la valeur de  $I_1$ .
- (d) En utilisant la relation (\*) et la décroissance de la suite  $(I_n)_{n \geq 0}$ , établir pour tout entier naturel  $n$  l'encadrement suivant :

$$\frac{e^2}{n+3} \leq I_n \leq \frac{e^2}{n+2}.$$

- (e) En déduire les limites respectives des deux suites  $(I_n)_{n \geq 0}$  et  $(nI_n)_{n \geq 0}$ .
- (f) Utiliser la relation (\*) pour compléter le script Scilab suivant afin qu'il calcule et affiche  $I_n$  pour une valeur de  $n$  entrée par l'utilisateur.

```
n=input('Donner une valeur à n :')
I=.....
for k=1:n
    I=.....
end
disp(I)
```

3. (a) Établir pour tout entier naturel  $n$  l'encadrement

$$\frac{(3n+10)e^2}{(n+3)(n+4)} \leq 2I_{n+1} + I_n \leq \frac{(3n+7)e^2}{(n+2)(n+3)}.$$

- (b) Pour tout entier naturel  $n$ , on pose  $w_n = n(e^2 - nI_n)$ . Montrer que  $\lim_{n \rightarrow +\infty} w_n = 3e^2$ .
4. À l'aide d'un raisonnement par récurrence, établir pour tout entier naturel  $n$  l'égalité

$$I_n = \frac{(-1)^n n!}{2^{n+1}} \left( e^2 \sum_{k=0}^n \frac{(-2)^k}{k!} - 1 \right).$$

**Exercice 3 –**

On suppose que l'on dispose d'un stock illimité de boules rouges et de boules blanches indiscernables au toucher. Une urne contient initialement une boule rouge et une boule blanche indiscernables au toucher.

On effectue dans cette urne une succession d'expériences aléatoires selon le protocole suivant : on extrait une boule de l'urne et après chaque tirage, la boule tirée est remise dans l'urne et on ajoute dans l'urne une boule de la même couleur que la boule tirée.

Pour tout entier  $n \geq 1$ , on note  $X_n$  (respectivement  $Y_n$ ) la variable aléatoire égale au nombre de boules rouges (respectivement blanches) contenues dans l'urne à l'issue de la  $n$ -ième expérience, c'est-à-dire après le tirage d'une boule et la remise d'une boule supplémentaire.

Pour tout entier  $k \geq 1$ , on note  $R_k$  (respectivement  $B_k$ ) l'événement : "tirer une boule rouge (respectivement blanche) lors du  $k$ -ième tirage".

1. (a) Justifier que  $X_1(\Omega) = \llbracket 1, 2 \rrbracket$ . Donner la loi de  $X_1$ . Calculer  $E(X_1)$  et  $V(X_1)$ .  
 (b) Exprimer les événements  $[X_2 = 1]$ ,  $[X_2 = 2]$  et  $[X_2 = 3]$  en fonction des événements  $B_1, B_2, R_1$  et  $R_2$ .  
 (c) Montrer que  $X_2$  suit la loi discrète uniforme sur  $\llbracket 1, 3 \rrbracket$ . En déduire  $E(X_2)$  et  $V(X_2)$ .
2. (a) Donner sous forme de tableau la loi conjointe du couple  $(X_1, X_2)$ .  
 (b) Calculer la covariance de  $X_1$  et  $X_2$ .  
 Les variables aléatoires  $X_1$  et  $X_2$  sont-elles indépendantes?
3. (a) Pour tout entier  $n \geq 1$ , exprimer l'événement  $[X_n = 1]$  en fonction des événements  $B_1, B_2, \dots, B_n$ .  
 (b) Montrer que  $P([X_n = 1]) = \frac{1}{n+1}$ . De même, calculer  $P([X_n = n+1])$ .
4. (a) Établir, pour tout entier  $k \in \llbracket 2, n+1 \rrbracket$ , les égalités suivantes :

$$P_{[X_n=k-1]}([X_{n+1} = k]) = \frac{k-1}{n+2} \quad \text{et} \quad P_{[X_n=k]}([X_{n+1} = k]) = \frac{n+2-k}{n+2}.$$

- (b) En déduire pour tout  $k \in \llbracket 2, n+1 \rrbracket$ , une relation entre  $P([X_{n+1} = k])$ ,  $P([X_n = k])$  et  $P([X_n = k-1])$ .
  - (c) À l'aide d'un raisonnement par récurrence, montrer que pour tout entier  $n \geq 1$ , la variable aléatoire  $X_n$  suit la loi discrète uniforme sur  $\llbracket 1, n+1 \rrbracket$ .
5. Compléter le programme Scilab suivant afin qu'il simule une réalisation de la variable aléatoire  $X_n$  où l'entier  $n$  est entré au clavier.

```
n=input('Donner une valeur à n :')
r=1; b=1
for k=1:n
    if rand()<r/(r+b) then .....
                                else .....
    end
end
x=.....
disp(x)
```

6. (a) Justifier que les variables aléatoires  $X_n$  et  $Y_n$  sont de même loi.  
 (b) Pour tout entier  $n \geq 1$ , que vaut  $X_n + Y_n$ ?  
 (c) Quel est le coefficient de corrélation linéaire  $\rho(X_n, Y_n)$  de  $X_n$  et  $Y_n$ ?

**Exercice 4 –**

Dans tout l'exercice,  $\lambda$  désigne un réel strictement positif.

1. Soit  $Z$  une variable aléatoire qui suit la loi exponentielle de paramètre  $\lambda$  dont une densité  $g$  est donnée par :

$$\forall x \in \mathbb{R}, \quad g(x) = \begin{cases} \lambda e^{-\lambda x} & \text{si } x \geq 0, \\ 0 & \text{si } x < 0. \end{cases}$$

Rappeler les valeurs respectives de  $E(Z)$  et  $V(Z)$ . En déduire la valeur de  $E(Z^2)$ .

2. Soit  $f$  la fonction définie sur  $\mathbb{R}$  par

$$\forall x \in \mathbb{R}, \quad f(x) = \lambda x g(x) = \begin{cases} \lambda^2 x e^{-\lambda x} & \text{si } x \geq 0, \\ 0 & \text{si } x < 0. \end{cases}$$

- (a) Vérifier que  $f$  est une densité de probabilité.

Dans toute la suite de l'exercice, on note  $U$  une variable aléatoire de densité  $f$ .

- (b) Montrer que la variable aléatoire  $U$  admet une espérance dont on donnera la valeur.
3. (a) À l'aide d'une intégration par parties, montrer que pour tout réel  $A > 0$ , on a

$$\int_0^A x^3 e^{-\lambda x} dx = -\frac{A^3}{\lambda} e^{-\lambda A} + \frac{3}{\lambda} \int_0^A x^2 e^{-\lambda x} dx.$$

- (b) En déduire l'égalité  $\int_0^{+\infty} x^3 e^{-\lambda x} dx = \frac{6}{\lambda^4}$  ainsi que l'existence de la variance de  $U$ .

- (c) Calculer  $V(U)$ .

4. On note  $F$  la fonction de répartition de la variable aléatoire  $U$ .

On rappelle que  $\forall x \in \mathbb{R}, \quad F(x) = \int_{-\infty}^x f(t) dt.$

- (a) Établir la relation  $\forall x \in \mathbb{R}, \quad F(x) = \begin{cases} 1 - (1 + \lambda x) e^{-\lambda x} & \text{si } x \geq 0, \\ 0 & \text{si } x < 0. \end{cases}$

- (b) Justifier l'égalité  $P(|U - E(U)| \leq E(U)) = P\left(0 \leq U \leq \frac{4}{\lambda}\right).$

- (c) Sachant que  $e^4 \approx 54.6$ , établir l'inégalité  $P(|U - E(U)| \leq E(U)) > 0.9.$