Banque commune d'épreuves des écoles de management (BCE), France

Session 1997, filière ECG

Mathématiques approfondies EDHEC

Durée : 4 heures

Ce que traite le sujet

- Exercice 1
- Exercice 2
- Exercice 3
- Problème, partie I
- Problème, partie II
- Problème, partie III

Sujet reproduit sans retouche à partir de la page suivante.

Résumé des parties, chapitres de cours liés et autres années :
prepahelp.com/annales/bce/ecg/1997/maths-appro-edhec

Prepa Help ne revendique aucun droit sur le sujet, propriété de l'organisateur du concours.

edhec

ECOLE DE HAUTES ETUDES COMMERCIALES DU NORD
EDHEC GRADUATE SCHOOL OF BUSINESS

ECOLE DE HAUTES ETUDES COMMERCIALES DU NORD

Concours d'admission sur classes préparatoires

MATHEMATIQUES

Option scientifique

Mardi 6 mai 1997, de 8h à 12h

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.

Seules sont autorisées :

Une règle graduée.
Une calculatrice de poche pouvant être programmable et /ou alphanumérique, à fonctionnement autonome, sans imprimante, sans document d'accompagnement et de surface de base maximum de 21 cm de long sur 15 cm de large.

EXERCICE 1

Dans cet exercice, E désigne l'espace vectoriel des fonctions continues de $\mathbb{R}$ dans $\mathbb{R}$.

On note Δ l'application qui à toute fonction f de E associe la fonction $\Delta(f) = g$, définie par :

$\forall x \in \mathbb{R}$, $g(x) = \int_0^x f(t)\,dt$.

1) Montrer que Δ est un endomorphisme de E.
2) a. Vérifier que, pour toute fonction f de E, $\Delta(f)$ est dérivable.
   b. En déduire que Δ n'est pas surjective.
3) Montrer que Δ est injective.
4) On suppose, *dans cette question*, que Δ possède une valeur propre λ non nulle et on désigne par f un vecteur propre associé à λ.
   a. Montrer que la fonction h, définie pour tout réel x, par $h(x) = f(x)\ e^{-\frac{x}{\lambda}}$, est constante.
   b. Déterminer alors $\Delta(f)$.
5) Conclure à l'aide des questions précédentes que Δ n'a aucune valeur propre.
6) Pour toute fonction f de E, on pose : $F_0 = \Delta(f)$ et $\forall n \in \mathbb{N}^*$, $F_n = \Delta(F_{n-1})$.
   a. Montrer que F_n est de classe C^{n+1}.
   b. En déduire que : $\forall x \in \mathbb{R}$, $F_n(x) = \int_0^x \frac{(x-t)^n}{n!} f(t)\,dt$.

EXERCICE 2

On considère la fonction f définie par : $f(x) = \int_x^{2x} \frac{\sin t}{t^2} dt$ si $x \neq 0$ et $f(0) = \ln(2)$.

1) On considère la fonction g définie par $\begin{cases} g(t) = \frac{\sin t - t}{t^2} & \text{si } t \neq 0. \\ g(0) = 0. \end{cases}$

a. Vérifier que g est continue sur $\mathbb{R}$.

b. Montrer que : $\lim_{x \to 0} \int_x^{2x} g(t)\,dt = 0$.

c. En déduire que f est continue en 0.

2) Montrer que f est paire.

3) a. Montrer que f est dérivable sur] $-\infty$, 0 [et sur] 0, $+\infty$ [.

b. Calculer f '(x), pour tout réel x non nul.

c. En déduire que f est dérivable en 0 et donner f '(0).

d. Étudier le signe de f '(x) sur] 0, $+\infty$ [.

4) a. Montrer que : $\forall x \in]0, +\infty[, |f(x)| < \frac{1}{2x}$.

b. En déduire $\lim_{x \to +\infty} f(x)$.

5) a. Montrer que $f(\pi / 2) > 0$ et que $f(\pi) < 0$.

b. Montrer que $f(2\pi) = \int_{2\pi}^{3\pi} (\frac{1}{t^2} - \frac{1}{(t+\pi)^2}) \sin(t)\,dt$. En déduire que $f(2\pi) > 0$.

c. Tracer, dans un repère orthonormé, les hyperboles d'équations respectives $y = \frac{1}{2x}$ et $y = -\frac{1}{2x}$, ainsi que l'allure de la courbe représentative de la restriction de f à [-2π, 2π].

EXERCICE 3

Soit f une application linéaire de $\mathbb{R}^3$ dans $\mathbb{R}^2$ et g une application linéaire de $\mathbb{R}^2$ dans $\mathbb{R}^3$. On note A la matrice de f relativement aux bases canoniques de $\mathbb{R}^3$ et $\mathbb{R}^2$, A est donc une matrice de $\mathcal{M}_{2,3}(\mathbb{R})$, c'est-à-dire une matrice à 2 lignes et 3 colonnes, à coefficients réels. On note B la matrice de g relativement aux bases canoniques de $\mathbb{R}^2$ et $\mathbb{R}^3$, B est donc une matrice de $\mathcal{M}_{3,2}(\mathbb{R})$, c'est-à-dire une matrice à 3 lignes et 2 colonnes, à coefficients réels.

1) Vérifier que gof $\in \mathcal{L}(\mathbb{R}^3)$.

2) a. Montrer que Im gof $\subset$ Im g.

b. Montrer que dim Im g ≤ 2.

c. Déduire des questions précédentes que dim Im gof ≤ 2.

d. Conclure que gof n'est ni surjective, ni injective.

3) En déduire une valeur propre de BA.

On suppose maintenant que $AB = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & 0 \end{pmatrix}$.

4) Soit $X = \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix}$, x et y étant deux réels tels que $(x, y) \neq (0, 0)$.

a. Montrer que $BX \neq 0$.
b. Montrer que si λ est valeur propre de AB alors λ est valeur propre de BA.
c. En déduire que BA est diagonalisable.

PROBLÈME

Dans tout le problème, n est un entier naturel non nul.

Partie I

Une variable aléatoire Z, à valeurs dans $\mathbb{N}$, étant définie sur un espace probabilisé $(\Omega, \mathcal{A}, P)$, A étant un événement de $\mathcal{A}$, de probabilité non nulle, on définit la variable aléatoire $T = Z / A$ (Z sachant que A est réalisé) par : $\forall k \in \mathbb{N}$, $P(T = k) = P([Z = k] / A)$.

On considère un événement A vérifiant $P(A) \neq 0$ et $P(A) \neq 1$.

Montrer que si Z a une espérance, alors Z / A et $Z / \overline{A}$ ont aussi une espérance et que :

$E(Z) = P(A)\, E(Z / A) + P(\overline{A})\, E(Z / \overline{A})$.

Partie II

On dispose de deux urnes, U et V. Initialement, l'urne U est vide et l'urne V contient 2n boules numérotées de 1 à 2n.

On effectue une suite d'épreuves, chacune consistant à choisir, aléatoirement et de manière équiprobable, un nombre compris entre 1 et 2n, puis à transférer la boule portant le numéro choisi, de l'urne dans laquelle elle se trouve dans l'autre urne.

Pour tout entier k élément de $[\![0, 2n]\!]$, on dit que U est dans l'état E_k lorsque U contient k boules et on dit que U accède à l'état E_k lorsque U contient k boules **pour la première fois**.

On note X_k la variable aléatoire égale au nombre d'épreuves qu'il faut effectuer pour que U accède à l'état E_k et égale à 0 si l'état E_k n'est jamais atteint.

On admettra que X_k a une espérance, notée m_k.

Enfin, pour tout entier j, élément de $[\![0, 2n -1]\!]$, on pose $N_j = X_{j+1} - X_j$.

Le but de cette partie est d'évaluer le nombre moyen d'épreuves nécessaires pour que U accède à l'état E_k, c'est-à-dire d'évaluer le nombre m_k.

1) Montrer que X_0 et X_1 sont des variables certaines et en déduire leurs espérances.
2) a. Donner, pour tout j élément de $[\![0, 2n -1]\!]$, une interprétation de la variable N_j.
   b. Montrer que N_j a une espérance que l'on notera μ_j dans la suite.

3) Soit j un élément de [| 1, 2n -1 |].

a. Soit A_j l'événement : " U accède à l'état E_{j+1} depuis l'état E_j, en une seule épreuve". Calculer $P(A_j)$.

b. Montrer que N_j / A_j est la variable certaine égale à 1 et que $N_j / \overline{A}_j = 1 + N_{j-1} + N_j$.

c. Montrer, en utilisant la partie I, que : $\forall j \in [| 1, 2n -1 |]$, $\mu_j = \dfrac{2n + j\,\mu_{j-1}}{2n - j}$.

d. En déduire que : $\forall j \in [| 0, 2n -1 |]$, $\mu_j = 2n \int_0^1 x^{2n-j-1} (2-x)^j \, dx$

4) Soit k un élément de [| 1, 2n |].

a. Écrire, en la justifiant, la relation liant X_k et $N_0, N_1, \ldots, N_{k-1}$.

b. En déduire la relation liant m_k et $\mu_0, \mu_1, \ldots, \mu_{k-1}$.

c. Vérifier que : $\forall x \neq 1$, $\sum_{j=0}^{k-1} x^{2n-j-1} (2-x)^j = x^{2n-k} \left(\dfrac{x^k - (2-x)^k}{2(x-1)}\right)$.

d. Montrer que l'intégrale $\int_0^1 x^{2n-k} \left[\dfrac{x^k - (2-x)^k}{2(x-1)}\right] dx$ est convergente.

5) En déduire que : $\forall k \in [| 0, 2n |]$, $m_k = n \int_0^1 (1-t)^{2n-k} \left[\dfrac{(1+t)^k - (1-t)^k}{t}\right] dt$.

Partie III : étude de deux cas particuliers.

1) Évaluation du nombre moyen d'épreuves nécessaires pour que U accède à l'état E_n, c'est-à-dire pour que, pour la première fois les urnes U et V contiennent le même nombre de boules.

a. Montrer que l'intégrale $\int_0^1 \dfrac{1-(1-t)^{2n}}{t} dt$ converge et vaut $\sum_{k=1}^{2n} \dfrac{1}{k}$ (on pourra utiliser la formule donnant la somme des premiers termes d'une suite géométrique).

b. Montrer que l'intégrale $\int_0^1 \dfrac{1-(1-t^2)^n}{t} dt$ converge et vaut $\dfrac{1}{2} \sum_{k=1}^{n} \dfrac{1}{k}$.

c. En déduire alors que : $m_n = n \sum_{k=1}^{n} \dfrac{1}{2k-1}$.

2) Évaluation du nombre moyen d'épreuves nécessaires pour que U accède à l'état E_{2n}, c'est-à-dire pour que, pour la première fois l'urne V soit vide.

a. Pour tout entier naturel p, on pose : $I_p = \int_0^1 \dfrac{(1+t)^p - (1-t)^p}{t} dt$.

Vérifier que I_p est une intégrale convergente puis calculer $I_p - I_{p-1}$.

b. En déduire que $m_{2n} = n \sum_{k=1}^{2n} \dfrac{2^k}{k}$.

Travailler les chapitres de ce sujet

Prepa Help suit le programme d'ECG chapitre par chapitre : cours détaillé, méthodes, pièges, exercices et problèmes corrigés pas à pas, tirés des concours. L'essai gratuit donne accès aux chapitres offerts de ta filière, sans carte bancaire.

Chapitres liés à ce sujet

- Compléments d'algèbre linéaire
- Logique, ensembles et applications
- Éléments propres et réduction
- Fonctions réelles : limites et continuité
- Dérivation (et convexité en ECT1)
- Calcul matriciel et systèmes linéaires
- Compléments sur les variables aléatoires réelles
- Probabilités sur un univers fini

Ouvrir l'essai gratuit

Scanne le code ou clique sur le bouton.

prepahelp.com/#essai

Une question sur le concours ou sur ta filière : **écrire sur WhatsApp**

Les autres années et épreuves : prepahelp.com/annales/bce/ecg