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

Session 2005, filière ECG

Mathématiques 2 approfondies ESCP-HEC

Durée : 4 heures

Ce que traite le sujet

- Partie I : trace et matrices aléatoires
- Partie II, présentation du modèle et II.A : quelques résultats algébriques
- Partie II.B : estimation des paramètres
- Partie II.C : étude d'une suite d'estimateurs

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/2005/maths-appro-2-escp-hec

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

BANQUE COMMUNE D'EPREUVES

Concepteurs : H.E.C. – E.S.C.P. – E.A.P.

CODE EPREUVE :
283
CCIP_M2_S

OPTION : SCIENTIFIQUE

MATHEMATIQUES II

Mardi 10 Mai 2005, de 8 h. à 12 h.

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.
Ils ne doivent faire usage d'aucun document : l'utilisation de toute calculatrice et de tout matériel électronique est interdite.
Seule l'utilisation d'une règle graduée est autorisée.

Dans tout le problème, n et r désignent des entiers strictement positifs. On note $\mathcal{M}_{n,r}(\mathbb{R})$, l'ensemble des matrices rectangulaires à n lignes et r colonnes à coefficients réels. Pour $n = r$, on pose $\mathcal{M}_n(\mathbb{R}) = \mathcal{M}_{n,n}(\mathbb{R})$. Pour tout entier n de $\mathbb{N}^*$, on identifie $\mathbb{R}^n$ et $\mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{R})$.
La transposée d'une matrice A appartenant à $\mathcal{M}_{n,r}(\mathbb{R})$ est notée ${}^tA$. On pourra également la noter A^T.
On étudie dans ce problème, quelques propriétés du *modèle linéaire*, qui constitue l'instrument de base de l'économétrie.

Partie I. Trace et matrices aléatoires

Pour toute matrice M appartenant à $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$, on appelle *trace de* M, notée $\mathrm{tr}(M)$, la somme de ses coefficients diagonaux ; ainsi, si $M = (m_{i,j})_{1\leqslant i,j\leqslant n}$, $\mathrm{tr}(M) = \sum_{i=1}^{n} m_{i,i}$.

On rappelle les trois résultats suivants (que les candidats n'ont pas à démontrer) :

- l'application tr qui, à toute matrice M de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$, associe sa trace, est une application linéaire de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ dans $\mathbb{R}$;
- si A est une matrice de $\mathcal{M}_{n,r}(\mathbb{R})$ et B une matrice de $\mathcal{M}_{r,n}(\mathbb{R})$, alors $\mathrm{tr}(AB) = \mathrm{tr}(BA)$;
- si M et N sont deux matrices semblables de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$, alors $\mathrm{tr}(M) = \mathrm{tr}(N)$.

1. Soit M une matrice de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ possédant q valeurs propres ($1 \leqslant q \leqslant n$) notées $\lambda_1, \lambda_2, \ldots, \lambda_q$. Pour tout entier i de $[\![1, q]\!]$, on désigne par n_i la dimension du sous-espace propre associé à la valeur propre λ_i.

a) On suppose que la matrice M est diagonalisable sur $\mathbb{R}$. Montrer que $\mathrm{tr}(M) = \sum_{i=1}^{q} n_i\lambda_i$.

b) On suppose que la matrice $M = (m_{i,j})_{1\leqslant i,j\leqslant n}$ de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ est symétrique. Montrer les égalités suivantes :

$$\mathrm{tr}({}^tMM) = \mathrm{tr}(M^2) = \sum_{i=1}^{q} n_i\lambda_i^2 = \sum_{i=1}^{n}\sum_{j=1}^{n} m_{i,j}^2$$

2. Pour tout entier i de $[\![1, n]\!]$ et pour tout entier j de $[\![1, r]\!]$, on considère des variables aléatoires réelles $Z_{i,j}$ définies sur un espace probabilisé $(\Omega, \mathcal{A}, \mu)$. On définit la *matrice aléatoire* Z, à n lignes et r colonnes, en associant à tout ω de Ω, la matrice :

$$Z(\omega) = \begin{pmatrix} Z_{1,1}(\omega) & \ldots & Z_{1,r}(\omega) \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ Z_{n,1}(\omega) & \ldots & Z_{n,r}(\omega) \end{pmatrix} = \left(Z_{i,j}(\omega)\right)_{\substack{1\leqslant i\leqslant n \\ 1\leqslant j\leqslant r}}$$

On suppose que les nr variables aléatoires $Z_{i,j}$ admettent une espérance $E(Z_{i,j})$, et on définit *l'espérance de la matrice* Z, notée $E(Z)$, comme la matrice de $\mathcal{M}_{n,r}(\mathbb{R})$ dont les éléments sont les espérances $E(Z_{i,j})$, soit $E(Z) = (E(Z_{i,j}))_{\substack{1\leqslant i\leqslant n\\ 1\leqslant j\leqslant r}}$.

Si Z et W sont deux matrices aléatoires à n lignes et r colonnes admettant chacune une espérance, et si λ est réel, on remarquera que $E(\lambda Z + W) = \lambda E(Z) + E(W)$.

Dans le cas où $n = r$, on appelle trace de Z, notée $\mathrm{tr}(Z)$, la variable aléatoire définie par $\mathrm{tr}(Z) = \sum_{i=1}^{n} Z_{i,i}$ et si $n = r = 1$, la matrice aléatoire Z coïncide avec la variable aléatoire Z et on a $\mathrm{tr}(Z) = Z$.

Dans le cas où $r = 1$ et n est quelconque, si $T = {}^t(T_1 \ \ldots \ T_n)$ et $W = {}^t(W_1 \ \ldots \ W_n)$ sont deux vecteurs aléatoires de $\mathbb{R}^n$, et si λ est un réel quelconque, on définit le vecteur aléatoire $\lambda T + W$ de $\mathbb{R}^n$ par

$$\lambda T + W = {}^t(\lambda T_1 + W_1 \ \ldots \ \lambda T_n + W_n)$$

a) Soit Z une matrice aléatoire à n lignes et r colonnes admettant une espérance $E(Z)$. On considère une matrice A de $\mathcal{M}_{r,n}(\mathbb{R})$. Montrer que $E(AZ) = AE(Z)$. Soit B un élément de $\mathcal{M}_{r,q}(\mathbb{R})$, avec $q \in \mathbb{N}^*$. Montrer que $E(ZB) = E(Z)B$.

b) Soit Z une matrice aléatoire à n lignes et n colonnes admettant une espérance $E(Z)$. Établir les deux égalités : $E({}^tZ) = {}^t(E(Z))$ et $E(\mathrm{tr}(Z)) = \mathrm{tr}(E(Z))$.

3. Dans cette question, Y désigne un vecteur aléatoire de $\mathbb{R}^n$, noté $Y = \begin{pmatrix} Y_1 \\ \vdots \\ Y_n \end{pmatrix}$, admettant une espérance $E(Y)$ et une matrice de variance-covariance notée $V(Y)$.
On rappelle que $V(Y) = E[(Y - E(Y)) \times {}^t(Y - E(Y))]$.

On admet que la définition et les propriétés de la matrice de variance-covariance $V(Y)$ d'un vecteur aléatoire discret restent valables pour un vecteur aléatoire dont les composantes sont des variables aléatoires quelconques (discrètes ou à densité).
Ainsi, en supposant que pour tout i de $[\![1, n]\!]$ et pour tout j de $[\![1, n]\!]$, la variable aléatoire Y_iY_j possède un moment d'ordre 1 au moins, on définit la covariance de Y_i et Y_j par $\mathrm{cov}(Y_i, Y_j) = E(Y_iY_j) - E(Y_i)E(Y_j)$, et si Y_i et Y_j sont indépendantes, alors $\mathrm{cov}(Y_i, Y_j) = 0$.

a) Montrer que, pour tout vecteur aléatoire Y de $\mathbb{R}^n$, $V(Y) = E(Y{}^tY) - E(Y)E({}^tY)$.

b) Soit B une matrice de $\mathcal{M}_{r,n}(\mathbb{R})$. Justifier l'égalité $V(BY) = BV(Y){}^tB$.

c) Soit A une matrice de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$. On pose $m = E(Y)$ et $J = V(Y)$. Établir les égalités :
$E({}^tYAY) = \mathrm{tr}(A \cdot E(Y{}^tY))$ et $E({}^tYAY) = \mathrm{tr}(AJ) + {}^tmAm$.

Partie II. Le modèle linéaire

Dans les parties II.A et II.B, **n et k sont deux entiers donnés qui vérifient** $1 \leqslant k < n$. L'espace vectoriel $\mathbb{R}^n$ est muni de sa structure euclidienne canonique. Toutes les variables aléatoires considérées sont définies sur un espace probabilisé $(\Omega, \mathcal{A}, \mu)$ et admettent des moments d'ordre au moins 2.
On considère un échantillon de n individus extrait d'une population donnée. Ces individus sont décrits à l'aide de k *variables statistiques* réelles (caractères) $C_1, C_2, \ldots, C_k$.
Pour tout entier j de $[\![1, k]\!]$, chaque caractère C_j fait l'objet de n observations notées $x_{1,j}, \ldots, x_{n,j}$. On définit ainsi une application linéaire f de $\mathbb{R}^k$ dans $\mathbb{R}^n$, dont la matrice dans les bases canoniques de $\mathbb{R}^k$ et $\mathbb{R}^n$ est la matrice $X = (x_{i,j})_{\substack{1\leqslant i\leqslant n\\ 1\leqslant j\leqslant k}}$ de $\mathcal{M}_{n,k}(\mathbb{R})$. On suppose que le *rang de X est égal à k*.

Soit $U = \begin{pmatrix} U_1 \\ \vdots \\ U_n \end{pmatrix}$ un *vecteur aléatoire* de $\mathbb{R}^n$, dont les composantes $U_1, \ldots, U_n$ sont des variables aléatoires réelles définies sur $(\Omega, \mathcal{A}, \mu)$, mutuellement indépendantes et de même loi. On suppose que $E(U) = 0_n$ et $V(U) = \sigma^2 I_n$, où 0_n désigne le vecteur nul de $\mathbb{R}^n$, I_n la matrice identité de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ et σ un réel strictement positif inconnu.

Soit $\alpha = \begin{pmatrix} \alpha_1 \\ \vdots \\ \alpha_k \end{pmatrix}$ un vecteur non nul de $\mathbb{R}^k$ dont les composantes $\alpha_1, \ldots, \alpha_k$ sont inconnues (α est un paramètre vectoriel)

On considère un *vecteur aléatoire* non nul, $Y = \begin{pmatrix} Y_1 \\ \vdots \\ Y_n \end{pmatrix}$ de $\mathbb{R}^n$ tel que, pour tout i de $[\![1, n]\!]$, la variable aléatoire Y_i définie sur $(\Omega, \mathcal{A}, \mu)$ s'écrit $Y_i = \sum_{j=1}^{k} x_{i,j}\alpha_j + U_i$.

Sous forme matricielle, le *modèle linéaire* s'écrit $Y = X\alpha + U$. On s'intéresse dans cette partie II, à l'étude de quelques propriétés de ce modèle, liées à l'estimation des paramètres inconnus $\alpha_1, \alpha_2, \ldots, \alpha_k$ et σ^2.

Pour cela, on désigne par y et on note $y = \begin{pmatrix} y_1 \\ \vdots \\ y_n \end{pmatrix}$, le vecteur non nul de $\mathbb{R}^n$ qui représente la réalisation sur l'échantillon considéré du vecteur aléatoire Y ; ainsi, pour tout i de $[\![1, n]\!]$, y_i est la réalisation de la variable aléatoire Y_i.

Soit $u = \begin{pmatrix} u_1 \\ \vdots \\ u_n \end{pmatrix}$ le vecteur de $\mathbb{R}^n$, dit *vecteur d'écart*, défini par $u = y - X\alpha$.

A. Quelques résultats algébriques

1. On considère l'endomorphisme h de $\mathbb{R}^k$ dont la matrice H, dans la base canonique de $\mathbb{R}^k$, est définie par $H = {}^tXX$.

a) Montrer que H est une matrice symétrique réelle de $\mathcal{M}_k(\mathbb{R})$.

b) En étudiant le noyau de h, montrer que le rang de h est égal à k. En déduire que la matrice H est inversible. On notera H^{-1} son inverse.

2. Dans cette question, on veut trouver, en fonction de y et X, les vecteurs α de $\mathbb{R}^k$ qui minimisent $||u||$.

Montrer que ce problème admet une unique solution $\widehat{\alpha}$ définie par $\widehat{\alpha} = \begin{pmatrix} \widehat{\alpha_1} \\ \vdots \\ \widehat{\alpha_n} \end{pmatrix} = H^{-1}\,{}^tXy$.

3. Soit p le projecteur orthogonal de $\mathbb{R}^n$ sur le sous-espace vectoriel engendré par les colonnes de la matrice X. On note P la matrice de p dans la base canonique de $\mathbb{R}^n$.

a) Montrer que $p(y) = X\widehat{\alpha}$. En déduire que $P = XH^{-1}\,{}^tX$. Vérifier que $P = P^2 = {}^tP$.

b) Établir que le rang de P et la trace de P sont égaux. Quelle est leur valeur commune ?

c) Montrer que les colonnes de X constituent une base de vecteurs propres de la matrice P, associés à la valeur propre 1.

d) Montrer qu'il existe une matrice S de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$, orthogonale, telle que $P = SD{}^tS$, où $D = (d_{i,j})_{1 \leqslant i,j \leqslant n}$ est la matrice diagonale définie par :

$$\begin{cases} d_{i,i} = 1 & \text{si } 1 \leqslant i \leqslant k \\ d_{i,j} = 0 & \text{sinon} \end{cases}$$

Préciser les k premières colonnes de S.

4. Soit $\widehat{u}$ le vecteur de $\mathbb{R}^n$ défini par $\widehat{u} = y - X\widehat{\alpha}$.

a) On pose $Q = I_n - P$. Montrer que $\widehat{u} = Qu$. Vérifier que $Q = Q^2 = {}^tQ$. Calculer la trace de Q.

b) Exprimer ${}^t\widehat{u}\widehat{u}$ et ${}^tyQy$ en fonction de Q et u.

5. Par définition, on dit qu'une matrice A symétrique réelle d'ordre n est *positive*, si pour tout vecteur z de $\mathbb{R}^n$, on a ${}^tzAz \geqslant 0$.

a) Montrer que A, symétrique réelle, est positive si et seulement si ses valeurs propres sont positives ou nulles.

b) Soit L une matrice appartenant à $\mathcal{M}_{n,k}(\mathbb{R})$. Établir que ${}^tLL$ est symétrique réelle positive.

B. Estimation des paramètres $\alpha_1, \alpha_2, \ldots, \alpha_k$ et σ^2

1. Soit $\widehat{G}$ le vecteur aléatoire de $\mathbb{R}^k$ défini par : $\widehat{G} = H^{-1}\,{}^tXY$.

a) Établir que $E(Y) = X\alpha$, et que $V(Y) = \sigma^2 I_n$. En déduire que $E(\widehat{G}) = \alpha$ ($\widehat{G}$ est un *estimateur* sans biais de α, tandis que $\widehat{\alpha}$ est une *estimation* sans biais de α).

b) Montrer que $V(\widehat{G}) = \sigma^2 H^{-1}$.

2. On veut montrer dans cette question, que dans l'ensemble des estimateurs sans biais du paramètre α, de la forme ${}^tBY$, où B est une matrice quelconque, non nulle de $\mathcal{M}_{n,k}(\mathbb{R})$, l'estimateur $\widehat{G}$ est *optimal* dans le sens suivant : tout autre estimateur G^* sans biais du paramètre α, de la forme ${}^tBY$ est tel que la matrice $V(G^*) - V(\widehat{G})$ est positive.

Soit B une matrice non nulle de $\mathcal{M}_{n,k}(\mathbb{R})$. On considère le vecteur aléatoire $\widehat{C} = {}^tBY$

a) Quelle condition doit satisfaire la matrice B pour que, pour tout vecteur α de $\mathbb{R}^k$, $\widehat{C}$ soit un estimateur sans biais de α ?

b) En supposant cette condition vérifiée, on pose ${}^tF = {}^tB - H^{-1}\,{}^tX$. Calculer ${}^tFX$, et montrer que la matrice $V(\widehat{C}) - V(\widehat{G})$ est positive.

3. On désigne par $\widehat{U}$ le *vecteur aléatoire* de $\mathbb{R}^n$ défini par $\widehat{U} = \begin{pmatrix} \widehat{U_1} \\ \vdots \\ \widehat{U_n} \end{pmatrix} = Y - X\widehat{G}$.

a) Montrer que $\widehat{U} = QU$.

b) Déterminer $E(\widehat{U})$ et $V(\widehat{U})$. Les variables aléatoires $\widehat{U_1}, \ldots, \widehat{U_n}$ sont-elles indépendantes ?

c) Montrer que ${}^t\widehat{U}\widehat{U} = \sum_{i=1}^{n} \widehat{U_i}^2 = {}^tUQU = {}^tYQY$.

d) Calculer $E({}^t\widehat{U}\widehat{U})$. En déduire que la variable aléatoire s_n définie par $s_n = \dfrac{{}^t\widehat{U}\widehat{U}}{n-k} = \dfrac{{}^tYQY}{n-k}$ est un estimateur sans biais de σ^2.

C. Étude d'une suite d'estimateurs

Dans cette partie, k est fixé dans $\mathbb{N}^*$. On veut montrer que la suite d'estimateurs $(s_n)_{n\geqslant k+1}$ de σ^2, est convergente.

On suppose que, pour tout i de $[\![1, n]\!]$, la variable aléatoire U_i possède des moments d'ordre 3 et 4 avec $E(U_i^3) = 0$ et $E(U_i^4) = 3\sigma^4$. On pose $Q = (q_{i,j})_{1\leqslant i,j\leqslant n}$.

1. Établir que ${}^tUQU = \sum_{i=1}^{n}\sum_{j=1}^{n} q_{i,j}U_iU_j$.

2. Montrer que $E[({}^tUQU)^2] = \sigma^4[(\mathrm{tr}(Q))^2 + 2\,\mathrm{tr}(Q^2)]$. En déduire que $E[({}^tUQU)^2] = \sigma^4(n-k)(n-k+2)$.

3. Calculer la variance $V(s_n)$ de la variable aléatoire s_n. Conclure.

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 sur les variables aléatoires réelles
- Couples de variables aléatoires discrètes finies
- Calcul matriciel et systèmes linéaires
- Algèbre bilinéaire
- Éléments propres et réduction
- Statistiques bivariées et régression

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