

Exercice 1

$$A = \begin{pmatrix} 5 & 5 & -14 \\ 6 & 6 & -16 \\ 5 & 5 & -14 \end{pmatrix} \in \mathcal{M}_3(\mathbb{R}).$$

1.a. $\chi_A(\lambda) = -\lambda(\lambda - 1)(\lambda + 4).$

b. A admet trois valeurs propres distinctes 0, 1, -4 donc A est diagonalisable.

2. a. $P = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 2 & -1 & 1 \\ 1 & 0 & 1 \end{pmatrix}; \det P = -1 \neq 0.$

Donc (v_1, v_2, v_3) est une base de \mathbb{R}^3 .

b. On a : $f(v_1) = v_1; f(v_2) = 0$ et $f(v_3) = -4v_3.$

donc $D = \mathcal{M}_B(f) = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & -4 \end{pmatrix}.$

3. $P \begin{pmatrix} x \\ y \\ z \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} x' \\ y' \\ z' \end{pmatrix} \iff \begin{cases} x + y + z = x' \\ 2x - y + z = y' \\ x + z = z' \end{cases} \iff \begin{cases} x = x' + y' - 2z' \\ y = x' - z' \\ z = -x' - y' + 3z' \end{cases}$

d'où $P^{-1} = \begin{pmatrix} 1 & 1 & -2 \\ 1 & 0 & -1 \\ -1 & -1 & 3 \end{pmatrix}.$

4. a. $\Delta = P^{-1}CP = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 4 & 0 \\ 0 & 0 & -4 \end{pmatrix}.$

b. Les valeurs propres de C sont -4, 0 et 4. donc C est diagonalisable.

5. $Y_{n+2} = DY_{n+1} + \Delta Y_n \iff \begin{pmatrix} a_{n+2} \\ b_{n+2} \\ c_{n+2} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} a_{n+1} \\ 0 \\ -4c_{n+1} \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} 0 \\ 4b_n \\ -4c_n \end{pmatrix}.$

Donc $\begin{cases} a_{n+2} = a_{n+1} \\ b_{n+2} = 4b_n \\ c_{n+2} = -4c_{n+1} - 4c_n \end{cases}.$

b. On a : $a_0 = -1, a_n = -3 \forall n \in \mathbb{N}^*.$

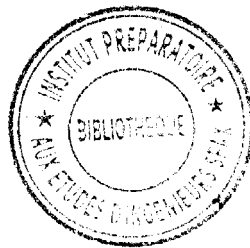
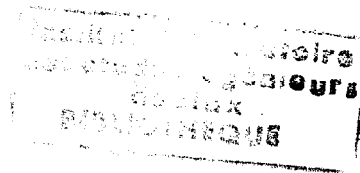
$b_{n+2} = 4b_n \implies b_n = \alpha 2^n + \beta (-2)^n.$

$b_0 = 0$ et $b_1 = -1$ donc $b_n = \frac{1}{4}(-2^n + (-2)^n).$

$c_{n+2} + 4c_{n+1} + 4c_n = 0$ donc $c_n = (\alpha n + \beta)(-2)^n.$

$c_0 = 2$ et $c_1 = 4$ donne $c_n = (-4n + 2)(-2)^n.$

6. $X_{n+2} = AX_{n+1} + CX_n \iff X_{n+2} = PDP^{-1}X_{n+1} + P\Delta P^{-1}X_n.$



On pose : $Y_n = P^{-1}X_n$ donc $Y_{n+2} = DY_{n+1} + \Delta Y_n$.

On a : $Y_0 = P^{-1}X_0$ et $Y_1 = P^{-1}X_1$.

D'où Y_n vérifie les hypothèses de 5. ie $Y_n = \begin{pmatrix} -3 \\ \frac{1}{4}(-2^n + (-2)^n) \\ (-4n+2)(-2)^n \end{pmatrix} \forall n \in \mathbb{N}^*$.

$$X_n = PY_n = \begin{pmatrix} -3 + \frac{1}{4}(-2)^n - \frac{1}{4}2^n - 4n(-2)^n + 2(-2)^n \\ 6 - \frac{1}{4}(-2)^n + \frac{1}{4}2^n - 4n(-2)^n + 2(-2)^n \\ -3 - 4n(-2)^n + 2(-2)^n \end{pmatrix}.$$

Exercice 2

1. Nous devons avoir $k \int_0^1 \int_0^1 (2x + 3y^2) dx dy = 1$.

$$\text{D'où } k \int_0^1 [x^2 + 3y^2x]_0^1 dy = k \int_0^1 (1 + 3y^2) dy = 2k = 1.$$

Par suite $k = 0.5$.

2. a. On a $F(t, z) = \int_0^t \int_0^z (x + \frac{3}{2}y^2) dx dy = \frac{t^2z}{2} + \frac{z^3}{2}t$ si t et z appartiennent à $[0, 1]$.

$$\text{b. } F(t, z) = \int_0^1 \int_0^z (x + \frac{3}{2}y^2) dx dy = \frac{z}{2} + \frac{z^3}{2} \text{ si } t > 1 \text{ et } z \text{ appartient à } [0, 1].$$

$$\text{c. } F(t, z) = \int_0^t \int_0^1 (x + \frac{3}{2}y^2) dx dy = \frac{t}{2} + \frac{t^2}{2} \text{ si } t \text{ appartient à } [0, 1] \text{ et } z > 1.$$

$$\text{d. } F(t, z) = \int_0^1 \int_0^1 (x + \frac{3}{2}y^2) dx dy = 1 \text{ si } t > 1 \text{ et } z > 1.$$

3. Les fonctions de répartitions marginales sont définies par

$$F(t, +\infty) = \begin{cases} 0 & \text{si } t \leq 0, \\ \frac{1}{2}(t + t^2) & \text{si } 0 \leq t \leq 1, \\ 1 & \text{si } t > 1. \end{cases},$$

$$F(+\infty, z) = \begin{cases} 0 & \text{si } z \leq 0, \\ \frac{1}{2}(z + z^3) & \text{si } 0 \leq z \leq 1, \\ 1 & \text{si } z > 1. \end{cases}.$$

4. Le calcul donne

$$E(X) = \int_0^1 \int_0^1 (x + \frac{3}{2}y^2) x dx dy = \frac{7}{12}.$$

$$E(Y) = \int_0^1 \int_0^1 (x + \frac{3}{2}y^2) y dx dy = \frac{5}{8}.$$

$$E(XY) = \int_0^1 \int_0^1 (x + \frac{3}{2}y^2) xy dx dy = \frac{17}{48}.$$

On en déduit que

$$\text{Cov}(X, Y) = -\frac{1}{96}.$$

Problème

Partie I

1. $I_0 = \frac{\pi}{2}$ et $I_1 = 1$.

2. a. $I_{n+2} = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \cos^{n+2} t \, dt = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \cos^{n+1} t \cos t \, dt$
 $= [\sin t \cos^{n+1} t]_0^{\frac{\pi}{2}} + (n+1) \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sin^2 t \cos^n t \, dt = (n+1) I_n - (n+2) I_{n+2}.$

Donc $(n+2) I_{n+2} = (n+1) I_n \Rightarrow I_n = \frac{n-1}{n} I_{n-1}.$

b. $I_{2n} = \frac{2n-1}{2n} \cdots \frac{1}{2} \frac{\pi}{2} = \frac{(2n)!}{2^{2n} (n!)^2} \frac{\pi}{2} = \frac{C_{2n}^n \pi}{4^n \cdot 2}.$

$$I_{2n+1} = \frac{2n}{2n+1} \cdots \frac{2}{3} \frac{1}{1} = \frac{2^{2n} (n!)^2}{(2n+1)!} = \frac{4^n}{(2n+1) C_{2n}^n}.$$

3. a. On a : $\forall t \in [0, \frac{\pi}{2}], 0 \leq \cos^{n+1} t \leq \cos^n t \Rightarrow 0 < I_{n+1} \leq I_n \Rightarrow \frac{I_{n+1}}{I_n} \leq 1.$

Comme $0 < I_{n+2} \leq I_{n+1} \leq I_n \Rightarrow \frac{n+2}{n+1} = \frac{I_{n+2}}{I_{n+1}} \leq \frac{I_{n+1}}{I_n} \leq 1.$

D'où $\frac{n}{n+1} \leq \frac{I_{n+1}}{I_n} \leq 1$ ie $\lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{I_{n+1}}{I_n} = 1.$

b. $\lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{I_{2n+1}}{I_{2n}} = 1 \Leftrightarrow \lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{4^n}{(2n+1) C_{2n}^n} \left(\frac{C_{2n}^n \pi}{4^n \cdot 2} \right)^{-1} = 1.$

c. $\lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{4^n}{C_{2n}^n \sqrt{n}} = \sqrt{\pi}$ car $\frac{2}{2n+1} \sim \frac{1}{n} (n \rightarrow +\infty).$

C_{2n}^n est équivalent à $\frac{4^n}{\sqrt{\pi n}}$ quand $n \rightarrow +\infty.$

Partie II

1. a. On a : $\frac{C_{2n}^n}{C_{2n+2}^{n+1}} = \frac{(n+1)^2}{(2n+2)(2n+1)} \rightarrow \frac{1}{4}$ donc $R = \frac{1}{4}.$

b. $C_{2n}^n \left(\frac{1}{4} \right)^n \sim \frac{4^n}{\sqrt{\pi n}} \frac{1}{4^n} = \frac{1}{\sqrt{\pi n}} (n \rightarrow +\infty)$

Or $\sum \frac{1}{\sqrt{n}}$ diverge donc $\sum C_{2n}^n \left(\frac{1}{4} \right)^n$ diverge.

c. $\sum C_{2n}^n \left(-\frac{1}{4} \right)^n$ est une série alternée.

Comme $C_{2n}^n \left(\frac{1}{4}\right)^n \sim \frac{1}{\sqrt{n\pi}} \rightarrow 0$ ($n \rightarrow +\infty$) et $\frac{C_{2n+2}^{n+1} \left(\frac{1}{4}\right)^{n+1}}{C_{2n}^n \left(\frac{1}{4}\right)^n} = \frac{2n+1}{2n+2} < 1$.

donc la suite $\left(C_{2n}^n \left(\frac{1}{4}\right)^n\right)$ est positive décroissante vers 0, d'où d'après le critère de séries alternées : $\sum C_{2n}^n \left(-\frac{1}{4}\right)^n$ converge.

2.a. $\forall x \in \left]-\frac{1}{4}, \frac{1}{4}\right[$, $S'(x) = \sum_{n=1}^{+\infty} n C_{2n}^n x^{n-1}$.

Donc $\sum_{n=1}^{+\infty} -2n C_{2n}^n x^n + \frac{1}{2} n C_{2n}^n x^{n-1} = S(x)$, $\forall x \in \left]-\frac{1}{4}, \frac{1}{4}\right[$. $\Rightarrow S(x) = \frac{-2x+1}{S'(x)}$

donc $\exists k \in \mathbb{R}$ tel que $\forall x \in \left]-\frac{1}{4}, \frac{1}{4}\right[$, $S(x) = \frac{k}{\sqrt{\left|x - \frac{1}{4}\right|}}$.

Or $S(0) = 1$ d'où $S(x) = \frac{1}{\sqrt{1-4x}}$.

Partie III

1. (E) : $(1-x^2)y' - xy = 1$.

a. $y(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} a_{2n+1} x^{2n+1}$

$y'(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} (2n+1) a_{2n+1} x^{2n}$

donc $(1-x^2)y'(x) - xy(x) = 1 \iff \begin{cases} a_1 = 1, \\ \forall n \in \mathbb{N}^*, a_{2n+1} = \frac{2n}{2n+1} a_{2n-1} \end{cases}$

d'où $a_{2n+1} = \frac{4^n}{(2n+1) C_{2n}^n}$.

b. $\frac{a_{2n+1}}{a_{2n+3}} = \frac{2n+3}{2n+1} \rightarrow 1$ ($n \rightarrow +\infty$).

Donc le rayon de convergence de la série entière $\sum_{n \geq 0} a_{2n+1} x^{2n+1}$ est 1.

donc $y(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{4^n}{(2n+1) C_{2n}^n} x^{2n+1}$ est une solution de (E) définie sur $]-1, 1[$.

2. a. Le domaine de définition de f est $]-1, 1[$.

b. $f(x) = \frac{\text{Arc sin } x}{\sqrt{1-x^2}}$ donc f est développable en série entière en 0, comme produit de fonctions développables en série entière.

3. a. $\sqrt{1-x^2}f(x) = \text{Arcsin } x.$

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

$$\Rightarrow (1-x^2)f'(x) - xf(x) = 1.$$

b. f est une fonction impaire définie sur $] -1, 1[$ vérifiant l'équation différentielle (E) et développable en série entière à l'origine.

$$\text{Donc } f(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{4^n}{(2n+1)C_{2n}^n} x^{2n+1}$$

$$\text{On a : } g'(x) = 2f(x) \text{ donc } g(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{4^n}{(2n+1)(n+1)C_{2n}^n} x^{2n+2}.$$

#-2-a)

$$\sum_{n=1}^{+\infty} -2n C_{2n} x^n + \frac{1}{2} n C_{2n} x^{n-1}$$

$$= \sum_{n=0}^{+\infty} \left(-2n C_{2n} + \frac{n+1}{2} C_{2n+2} \right) x^n$$

$$= \sum_{n=0}^{+\infty} \left(-2n C_{2n} + \frac{n+1}{2} \frac{(2n+2)!}{(n+1)! 2^{n+1}} \frac{(2n)!}{(n)! 2^n} \right) x^n$$

$$= \sum_{n=0}^{+\infty} \left(-2n C_{2n} + (n+1) C_{2n} \right) x^n$$

$$= \sum_{n=0}^{+\infty} C_{2n} x^n = S(x)$$