



ECRICOME

Banque d'épreuves écrites communes aux concours des Ecoles

ESC Bordeaux, ESC Marseille-Provence, ESC Reims, ESC Rouen, ICN Nancy

Durée : 4 heures
Option scientifique

Aucun instrument de calcul n'est autorisé
Aucun document n'est autorisé

EXERCICE 1

On considère sur un espace probabilisé (Ω, \mathcal{A}, P) une suite $(X_n)_{n \geq 1}$ de variables aléatoires indépendantes, de même loi définie pour tout entier $n > 0$ par :

$$P(X_n = -1) = p \quad P(X_n = +1) = 1 - p \quad \text{où } p \text{ est un réel tel que } 0 < p < 1.$$

On définit la suite de variables aléatoires $(Z_n)_{n \geq 1}$ par : $Z_n = \prod_{i=1}^n X_i$

1 - On pose $\forall n \geq 1 \quad \begin{cases} a_n = P(Z_n = -1) \\ b_n = P(Z_n = +1) \end{cases}$

a) Calculer $a_n + b_n$.

b) Montrer que : $\forall n \geq 1 \quad \begin{pmatrix} a_{n+1} \\ b_{n+1} \end{pmatrix} = Q \begin{pmatrix} a_n \\ b_n \end{pmatrix}$ où Q est la matrice $\begin{pmatrix} 1-p & p \\ p & 1-p \end{pmatrix}$

2 - a) Montrer que : $\forall n \geq 1 \quad Q^n = \begin{pmatrix} 1-p_n & p_n \\ p_n & 1-p_n \end{pmatrix}$ où p_n est un réel tel que

$0 < p_n < 1$ et donner une relation de récurrence entre p_{n+1} et p_n .

b) En déduire une expression explicite de p_n en fonction de n et p .

c) Montrer que $\lim_{n \rightarrow +\infty} p_n = \frac{1}{2}$.

Que peut - on en déduire pour la suite de variables aléatoires $(Z_n)_{n \geq 1}$ lorsque n tend vers $+\infty$?

3 - Donner une condition nécessaire et suffisante sur p pour que les variables Z_1 et Z_2 soient indépendantes.

On suppose cette condition réalisée : quelle est alors la loi de Z_n ?

Montrer que :

$$\forall n \geq 1 \quad P(Z_1 = \varepsilon_1, \dots, Z_i = \varepsilon_i, \dots, Z_n = \varepsilon_n) = \frac{1}{2^n} \quad \text{où } \varepsilon_i = \pm 1 \text{ pour tout } i \quad (1 \leq i \leq n)$$

Que peut - on en déduire pour la suite de variables aléatoires $(Z_n)_{n \geq 1}$?

EXERCICE 2

Soit E l'espace vectoriel des fonctions réelles définies et continues sur \mathbb{R} .

A toute fonction f de E , on associe la fonction F définie par :

$$x \rightarrow F(x) = \int_x^{x+1} f(t) dt$$

- 1 - Montrer que F est définie, continue et dérivable sur \mathbb{R} . Calculer $F'(x)$.
- 2 - Déterminer F dans les cas suivants :

a) $x \rightarrow f(x) = \sin 2\pi x$;

b) $x \rightarrow f(x) = \begin{cases} 1-x & \text{si } x < 1 \\ \sqrt{x-1} & \text{si } x \geq 1 \end{cases}$

- 3 - Soit T l'application de E dans lui-même définie par : $f \rightarrow T(f) = F$

a) Montrer que T est linéaire.

b) Est-elle injective ? surjective ?

- 4 - On dit que le réel λ est valeur propre de T s'il existe une fonction non nulle f de E vérifiant $T(f) = \lambda f$; f est appelée fonction propre associée à la valeur propre λ .

a) Montrer que 0 est valeur propre de T .

b) Montrer que pour tout réel a , la fonction $x \rightarrow e^{ax}$ est une fonction propre associée à une valeur propre $\lambda(a)$ que l'on déterminera.

c) Etudier les variations de cette fonction λ sur \mathbb{R} et en déduire que tout réel positif est valeur propre de l'application T .

PROBLEME

L'objectif de ce problème est de "prolonger" la fonction factorielle $n \rightarrow (n-1)!$ définie sur \mathbb{N}^* en une fonction définie sur les réels qui ne sont pas des entiers négatifs.

On étudie ensuite quelques propriétés de cette fonction.

\mathbb{R} est l'ensemble des réels, \mathbb{N} l'ensemble des entiers naturels et \mathbb{Z}^- l'ensemble des entiers négatifs ou nuls.

On pose $E = \mathbb{R} - \mathbb{Z}^-$: E est donc l'ensemble des réels qui ne sont pas des entiers négatifs ou nuls.

Partie A

On considère une fonction f définie sur une partie D de \mathbb{R} et à valeurs dans \mathbb{R} .

On dit que f a la propriété \mathcal{P} si et seulement si :

$$\begin{cases} f \text{ est définie en } 1 \text{ et } f(1) = 1 \\ \forall x \in D \quad x+1 \in D \text{ et } f(x+1) = x f(x) \end{cases}$$

1 - a) Montrer qu'une fonction ayant la propriété \mathcal{P} ne peut être définie en x entier négatif ou nul.

b) Montrer que si $D = \mathbb{N}^*$ $n \rightarrow f(n) = (n-1)!$ a la propriété \mathcal{P} .

(On adopte la convention : $0! = 1$)

2 - a) On considère la fonction Γ définie sur \mathbb{R}^{++} par : $x \rightarrow \Gamma(x) = \int_0^{+\infty} t^{x-1} e^{-t} dt$

En utilisant, sans les démontrer, des résultats du cours, montrer que Γ a la propriété \mathcal{P} et rappeler la valeur de $\Gamma(n)$ pour n entier strictement positif.

b) Montrer que pour tout x réel strictement positif et tout n entier strictement positif :

$$\Gamma(x+n) = (x+n-1)(x+n-2) \dots (x+1) x \Gamma(x)$$

3 - Pour tout élément x de E et tout entier n tel que $x+n$ soit strictement positif,

on pose :
$$A_n(x) = \frac{\Gamma(x+n)}{x(x+1) \dots (x+n-1)}$$

a) Montrer que pour $x > 0$ et $n > 0$, $A_n(x)$ ne dépend pas de n .

b) Soit x un réel négatif non entier.

Montrer que $x+n$ est strictement positif à partir d'un rang dépendant de x noté N_x .

Soient n et p deux entiers naturels. Pour n strictement supérieur à N_x , calculer

$A_{n+p}(x)$ en fonction de $A_p(x+n)$.

En déduire que : $\forall n > N_x \quad \forall p \in \mathbb{N} \quad A_{n+p}(x) = A_n(x)$.

c) Le réel $A_n(x)$ étant indépendant de n pour $n > N_x$, on définit sur E une fonction $\tilde{\Gamma}$

par $\tilde{\Gamma}(x) = A_n(x)$ pour $n > N_x$.

Montrer que la fonction $\tilde{\Gamma}$ a la propriété \mathcal{P} , et que pour tout x réel strictement positif

$$\tilde{\Gamma}(x) = \Gamma(x).$$

En déduire que : $\forall x \in E \quad \tilde{\Gamma}(x+n) = (x+n-1)(x+n-2) \dots (x+1) x \tilde{\Gamma}(x)$

On dit que $\tilde{\Gamma}$ prolonge la fonction Γ définie sur \mathbb{R}^{++} .

Par abus de notation, on notera désormais dans tout le problème simplement Γ et non plus $\tilde{\Gamma}$, la fonction ainsi prolongée.

4 - a) On pose $I = \int_0^1 \frac{\ln t}{\sqrt{t}} dt$ et $J = \int_1^{+\infty} t \ln t e^{-t} dt$

Montrer que I et J sont des intégrales absolument convergentes.

b) Soit h la fonction de deux variables définie sur $\mathbb{R}^{+*} \times \mathbb{R}$ par :

$$(t, x) \rightarrow h(t, x) = t^{x-1}$$

En appliquant l'inégalité des accroissements finis à la fonction $x \rightarrow u_t(x) = h(t, x)$,

montrer que :

$$\forall t \in]0, 1[\quad \forall x \in]\frac{1}{2}, \frac{3}{2}[\quad |h(t, x) - h(t, 1)| \leq |x - 1| \frac{|\ln t|}{\sqrt{t}} \quad (1)$$

et que : $\forall t \in [1, +\infty[\quad \forall x \in]\frac{1}{2}, \frac{3}{2}[\quad |h(t, x) - h(t, 1)| \leq |x - 1| t \ln t \quad (2)$

c) Montrer qu'il existe une constante K telle que :

$$\forall x \in]\frac{1}{2}, \frac{3}{2}[\quad |\Gamma(x) - \Gamma(1)| \leq K |x - 1| \quad (3)$$

En déduire que la fonction Γ est continue au point 1.

5 - En utilisant la question précédente, montrer que $\Gamma(x) \sim \frac{1}{x}$ au voisinage de 0.

En déduire un équivalent simple de $\Gamma(x)$ au voisinage de $x = -n$ ($n \in \mathbb{N}^*$).

6 - On admet l'équivalence suivante :

$$\Gamma(x) \underset{x \rightarrow +\infty}{\sim} x^{x-1} e^{-x} \sqrt{2\pi x} \quad (*)$$

a) Calculer pour x réel fixé $\lim_{n \rightarrow +\infty} (1 + \frac{x}{n})^n$.

b) Montrer que si x est un entier naturel n, l'équivalence (*) permet de retrouver la

formule de Stirling : $n! \underset{n \rightarrow +\infty}{\sim} n^n e^{-n} \sqrt{2\pi n}$

c) Montrer que : $\forall x \in E \quad \lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{\Gamma(x+n)}{n^x \Gamma(n)} = 1$

d) En déduire que : $\forall x \in E \quad \Gamma(x) = \lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{n! n^x}{x(x+1) \dots (x+n)}$

Partie B

On se propose dans cette partie de donner une autre expression de la fonction Γ sur E .

1 - Pour n strictement positif, on pose $g_n(x) = \frac{e^{x/n}}{1+x/n}$ et $G_n(x) = \prod_{k=1}^n g_k(x)$.

Montrer que pour tout réel x positif, la série de terme général $u_n(x) = \ln g_n(x)$ est convergente.

En déduire, pour tout réel x positif, l'existence de $\lim_{n \rightarrow +\infty} G_n(x)$.

On appelle $G(x)$ cette limite. On définit ainsi une fonction G sur \mathbb{R}^+ .

2 - Montrer que la suite $(G_n(x))_{n \in \mathbb{N}^*}$ est convergente pour x réel négatif non entier. (On remarquera que pour tout x fixé, $g_n(x)$ est strictement positif pour n suffisamment grand).

On a donc une fonction G définie sur E par : $x \rightarrow G(x) = \lim_{n \rightarrow +\infty} G_n(x)$.

3 - Vérifier que : $\ln G_n(1) = \sum_{k=1}^n \frac{1}{k} - \ln(n+1)$ et retrouver le résultat suivant :

la suite de terme général $v_n = \sum_{k=1}^n \frac{1}{k} - \ln n$ a une limite finie strictement positive γ

quand n tend vers $+\infty$. γ s'appelle la constante d'Euler.

(On pourra utiliser, en le justifiant, le résultat : $\forall x > 0 \quad e^x > x + 1$)

4 - Montrer que : $\forall x \in E \quad G_n(x) = x \Gamma(x) \frac{n! \exp(x \sum_{k=1}^n 1/k)}{(x+n)\Gamma(x+n)}$.

5 - En utilisant la question A- 6-c), montrer que : $\forall x \in E \quad \Gamma(x) = \frac{e^{-\gamma x}}{x} G(x)$.