# Corrigé du Sujet Ecricome 2025

# Exercice 1

- 1. (a) La série  $\sum_{n\geq 1}\frac{1}{n^2}$  est une série de Riemann de paramètre  $\alpha=2>1$ , elle est donc convergente.
  - (b) Pour tout  $n \in \mathbb{N}^*$ ,  $|\frac{(-1)^n}{n^2}| = \frac{1}{n^2}$ . D'après la question précédente, la série  $\sum_{n \geq 1} \frac{(-1)^n}{n^2}$  est absolument convergente, elle est donc convergente.

$$\frac{1}{(2n+1)^2} \sim_{n \to +\infty} \frac{1}{4} \cdot \frac{1}{n^2}$$

Comme la série  $\sum_{n\geq 1} \frac{1}{n^2}$  converge, par critère d'équivalence **pour les séries à termes positifs** la série  $\sum_{n\geq 1} \frac{1}{(2n+1)^2}$  converge.

2. Les séries étant toutes convergentes

$$A - B = \sum_{n=1}^{+\infty} \frac{1}{n^2} - \sum_{n=1}^{+\infty} \frac{(-1)^n}{n^2}$$

$$= \sum_{k=1}^{+\infty} \frac{1}{(2k)^2} + \sum_{k=0}^{+\infty} \frac{1}{(2k+1)^2} - \sum_{k=1}^{+\infty} \frac{1}{(2k)^2} + \sum_{k=1}^{+\infty} \frac{1}{(2k+1)^2}$$

$$= 2 \cdot \sum_{k=1}^{+\infty} \frac{1}{(2k+1)^2}$$

$$= 2C$$

D'autre part, en reprenant le début du calcul

$$A = \sum_{k=1}^{+\infty} \frac{1}{(2k)^2} + \sum_{k=0}^{+\infty} \frac{1}{(2k+1)^2}$$
$$= \frac{1}{4} \cdot \sum_{k=1}^{+\infty} \frac{1}{k^2} + \sum_{k=0}^{+\infty} \frac{1}{(2k+1)^2}$$
$$= \frac{1}{4} A + C$$

3. (a) Soit  $(\alpha, \beta) \in \mathbb{R}^2$ . Par les formules de trigonométrie classiques,

$$\cos(\alpha + \beta) = \cos(\alpha)\cos(\beta) - \sin(\alpha)\sin(\beta)$$

$$\cos(\alpha - \beta) = \cos(\alpha)\cos(\beta) - +\sin(\alpha)\sin(\beta)$$

En sommant ces deux relations, on obtient donc bien

$$2\cos(\alpha)\cos(\beta) = \cos(\alpha + \beta) + \cos(\alpha - \beta)$$

(b) Soit pour tout  $n \in \mathbb{N}^*$  la propriété :

$$\mathcal{H}(n): \forall t \in [0, \pi[,$$

$$\sum_{k=1}^{n} (-1)^{k} \cdot \cos(kt) = -\frac{1}{2} + (-1)^{n} \cdot \frac{\cos(\frac{2n+1}{2}t)}{2\cos(\frac{t}{2})}$$

• <u>Initialisation</u>: si n = 1, pour tout  $t \in [0, \pi[$ ,

$$-\frac{1}{2} - \frac{\cos(\frac{3}{2}t)}{2\cos(\frac{t}{2})} \text{ possible car } \cos(\frac{t}{2}) \neq 0$$

$$= -\frac{\cos(\frac{t}{2}) + \cos(\frac{3}{2}t)}{2\cos(\frac{t}{2})}$$

$$= -\frac{\cos(t - \frac{t}{2}) + \cos(t + \frac{t}{2})}{2\cos(\frac{t}{2})}$$

$$= -\frac{2\cos(t)\cos(\frac{t}{2})}{2\cos(\frac{t}{2})}$$

$$= -\cos(t)$$

Donc la propriété est vraie pour n=1.

• <u>Hérédité :</u> soit  $n \in \mathbb{N}^*$  un entier fixé tel que la propriété est vraie au rang n.

$$\begin{split} \sum_{k=1}^{n+1} (-1)^k \cdot \cos(kt) &= \sum_{k=1}^n (-1)^k \cdot \cos(kt) + (-1)^{n+1} \cdot \cos((n+1)t) \\ &= -\frac{1}{2} + (-1)^n \cdot \frac{\cos(\frac{2n+1}{2}t)}{2\cos(\frac{t}{2})} + (-1)^{n+1} \cdot \cos((n+1)t) \\ &= -\frac{1}{2} + (-1)^{n+1} \cdot \frac{2\cos((n+1)t)\cos(\frac{t}{2}) - \cos(\frac{2n+1}{2}t)}{2\cos(\frac{t}{2})} \\ &= -\frac{1}{2} + (-1)^{n+1} \cdot \frac{\cos(\frac{2(n+1)+1}{2}t) + \cos(\frac{2n+1}{2}t) - \cos(\frac{2n+1}{2}t)}{2\cos(\frac{t}{2})} \\ &= -\frac{1}{2} + (-1)^n \cdot \frac{\cos(\frac{2(n+1)+1}{2}t)}{2\cos(\frac{t}{2})} \end{split}$$

donc la propriété est vraie au rang n+1.

- Bilan : par récurrence,  $\mathcal{H}(n)$  est vraie pour tout  $n \in \mathbb{N}^*$
- 4. (a) La fonction f est de classe  $\mathcal{C}^1$  sur le segment [a,b]. En particulier, f est continue sur ce segment donc bornée d'après le cours : il existe  $M' \in \mathbb{R}$  tel que pour tout  $x \in [a,b], |f(x)| \leq M$ . De plus, f' est continue également sur le segment [a,b] : il existe  $M'' \in \mathbb{R}$  tel que pour tout  $x \in [a,b], |f'(x)| \leq M''$ . Enfin, en posant M = Max(M',M''), on a bien :  $\forall t \in [a,b], |f(t)| \leq M$  et  $|f'(t)| \leq M$ 
  - (b) Soit  $\lambda > 0$ . Pour tout  $t \in [a, b]$ ,

$$|f'(t).\sin(\lambda.t)| \le |f'(t)| \le M$$

D'où en intégrant entre a et b, les fonctions étant continues et les bornes dans le bon sens :

$$\frac{1}{\lambda} \cdot \left| \int_{a}^{b} f'(t) \sin(\lambda \cdot t) dt \right| \le \frac{1}{\lambda} \cdot M \cdot (b - a)$$

Comme  $\lim_{\lambda \to +\infty} \frac{1}{\lambda} M \cdot (b-a) = 0$ , par encadrement  $\lim_{\lambda \to +\infty} \frac{1}{\lambda} \cdot \int_a^b f'(t) \sin(\lambda \cdot t) dt = 0$ 

(c) Posons:

$$\begin{cases} u(t) = f(t) & u'(t) = f'(t) \\ v'(t) = \cos(\lambda . t) & v(t) = \frac{1}{\lambda} . \sin(\lambda . t) \end{cases}$$

Les fonctions u et v sont de classe  $\mathcal{C}^1$  sur [a,b], on peut donc procéder à une intégration par parties.

$$\int_{a}^{b} f(t)\cos(\lambda \cdot t)dt = \left[\frac{1}{\lambda} \cdot \sin(\lambda \cdot t) \cdot f(t)\right]_{a}^{b} - \frac{1}{\lambda} \int_{a}^{b} f'(t)\sin(\lambda t)dt$$
$$= \frac{1}{\lambda} \cdot \sin(\lambda \cdot b) \cdot f(b) - \frac{1}{\lambda} \cdot \sin(\lambda \cdot a) \cdot f(a) - \frac{1}{\lambda} \int_{a}^{b} f'(t)\sin(\lambda t)dt$$

D'une part, on a déjà vu que  $\lim_{\lambda \to +\infty} \frac{1}{\lambda} \int_a^b f'(t) \sin(\lambda t) dt = 0$ . Ensuite,

$$\left|\frac{1}{\lambda} \cdot \sin(\lambda \cdot b) \cdot f(b)\right| \le \frac{1}{\lambda} \cdot \left|f(b)\right|$$

et comme  $\lim_{\lambda \to +\infty} \frac{1}{\lambda} |f(b)| = 0$ , par encadrement  $\lim_{\lambda \to +\infty} \frac{1}{\lambda} \cdot \sin(\lambda \cdot b) \cdot f(b) = 0$ . On montre de même que  $\lim_{\lambda \to +\infty} \frac{1}{\lambda} \cdot \sin(\lambda \cdot a) \cdot f(a) = 0$ .

Bilan : On a bien montré que  $\lim_{\lambda \to +\infty} \int_a^b f(t) \cos(\lambda t) dt = 0$ 

 $\underline{\text{Remarque}:} \text{ il s'agit bien sûr du fameux lemme de Lebesgue (qui était un peu décortiqué cette } \underline{\text{fois}).}$ 

5. (a) Pour tout  $t \in ]0, \pi], \frac{t}{2} \in ]0, \frac{\pi}{2}]$  et donc  $\sin(\frac{t}{2}) \neq 0$ . La fonction  $\varphi$  est ensuite de classe  $\mathcal{C}^1$  sur.  $]0, \pi]$  par quotient de fonctions de classe  $\mathcal{C}^1$  avec le dénominateur qui ne s'annule pas. Pour tout  $t \in ]0, \frac{\pi}{2}],$ 

$$\varphi'(t) = \frac{\sin(\frac{t}{2}) - t \cdot \frac{1}{2}\cos(\frac{t}{2})}{(\sin(\frac{t}{2})^2}$$

- (b) Par équivalence classique,  $\sin(\frac{t}{2}) \sim_{t \to 0} \frac{t}{2}$  donc  $\varphi(t) \sim_{t \to 0} \frac{t}{2} = 2$ . Donc  $\lim_{t \to 0} \varphi(t) = 2$ :  $\varphi$  est prolongeable par continuité en 0 et on peut poser  $\varphi(0) = 2$ .
- (c) On a vu que

$$\varphi'(t) = \frac{\sin(\frac{t}{2}) - t \cdot \frac{1}{2}\cos(\frac{t}{2})}{(\sin(\frac{t}{2})^2)}$$

Par équivalence classique,  $(\sin(\frac{t}{2})^2 \sim_{t\to 0} (\frac{t}{2})^2 \sim_{t\to 0} \frac{t^2}{4}$ . D'autre part, les DL en 0 à l'ordre 3 de  $\sin(x)$  et à l'ordre 2 de  $\cos(x)$  sont :

$$\sin(x) = x - \frac{x^3}{6} + o(x^3)$$

$$\cos(x) = 1 - \frac{x^2}{2} + o(x^2)$$

D'où

$$\sin(\frac{t}{2}) - t \cdot \frac{1}{2}\cos(\frac{t}{2}) = \frac{t}{2} - \frac{t^3}{48} - \frac{t}{2} + \frac{t^3}{16} + o(t^3)$$
$$= \frac{t^3}{24} + o(t^3)$$

donc  $\sin(\frac{t}{2}) - t \cdot \frac{1}{2} \cos(\frac{t}{2}) \sim_{t \to 0} \frac{t^3}{24}$ .

Par conséquent par quotient d'équivalents,

$$\varphi'(t) \sim_{t\to 0} \frac{t}{6} \operatorname{donc} \lim_{t\to 0} \varphi'(t) = 0$$

Par théorème de prolongement des fonctions  $\mathcal{C}^1$ , la fonction  $\varphi$  est alors une fonction de classe  $\mathcal{C}^1$  sur  $[0,\pi]$ .

Remarque : exercice fait dans la fiche de révisions d'Analyse.

- (d) Comme  $\lim_{t\to 0} \varphi(t) = 2$ , on en déduit que  $\lim_{t\to \pi} f(t) = 2$  donc on peut prolonger f par continuité en  $\pi$  en posant encore  $f(\pi) = \varphi(0) = 2$ . Puis comme la fonction  $t \mapsto \pi t$  est de classe  $\mathcal{C}^1$  sur  $[0,\pi]$ , à valeurs dans  $[0,\pi]$  et que la fonction  $\varphi$  est de classe  $\mathcal{C}^1$  sur  $[0,\pi]$ , par composition la fonction f est de classe  $\mathcal{C}^1$  sur  $[0,\pi]$
- (e) Posons

$$\begin{cases} u(t) = \pi - t & u'(t) = -1 \\ v'(t) = \cos(k.t) & v(t) = \frac{1}{k} \cdot \sin(k.t) \end{cases}$$

Les fonctions u et v sont de classe  $C^1$  sur  $[0;\pi]$ . Par intégration par parties on a alors :

$$\int_{0}^{\pi} (\pi - t) \cos(kt) dt = [(\pi - t) \cdot \frac{1}{k} \cdot \sin(k \cdot t)]_{0}^{\pi} + \frac{1}{k} \cdot \int_{0}^{\pi} \sin(k \cdot t) dt$$

$$= 0 - 0 + \frac{1}{k} \cdot [-\frac{1}{k} \cdot \cos(k \cdot t)]_{0}^{\pi}$$

$$= \frac{1}{k^{2}} \cdot (1 - \cos(k\pi))$$

$$= \begin{cases} 0 \text{ si k est pair} \\ \frac{2}{k^{2}} \text{ si k est impair} \end{cases}$$

(f) On en déduit que pour tout entier naturel N non nul :

$$\int_0^{\pi} \sum_{k=1}^{2N+1} (-1)^k \cdot (\pi - t) \cdot \cos(kt) dt = \sum_{k=1}^{2N+1} (-1)^k \cdot \int_0^{\pi} (\pi - t) \cdot \cos(kt) dt$$

$$= \sum_{n=0}^{N} (-1)^{2n+1} \frac{2}{(2n+1)^2} \text{ d'après le 6.(a)}$$

$$= -2 \cdot \sum_{n=0}^{N} \frac{2}{(2n+1)^2}$$

(g) Soit  $\epsilon \in ]0, \pi[$ . Alors pour tout  $N \in \mathbb{N}^*$ ,

$$\int_{0}^{\pi-\epsilon} \sum_{k=1}^{2N+1} (-1)^{k} \cdot (\pi - t) \cdot \cos(kt) dt$$

$$= \int_{0}^{\pi-\epsilon} (\pi - t) \cdot \sum_{k=1}^{2N+1} (-1)^{k} \cdot \cos(kt) dt$$

$$= \int_{0}^{\pi-\epsilon} (\pi - t) \cdot (-\frac{1}{2} + (-1)^{n} \cdot \frac{\cos(\frac{2n+1}{2}t)}{2\cos(\frac{t}{2})} dt \text{ d'après le 3. (b) (autorisé car } t \neq \pi$$

$$= \left[ \frac{(\pi - t)^{2}}{4} \right]_{0}^{\pi-\epsilon} - \int_{0}^{\pi-\epsilon} (\pi - t) \cdot \frac{\cos(\frac{4N+3}{2}t)}{2\cos(\frac{t}{2})} dt$$

$$= \frac{\epsilon^{2}}{4} - \frac{\pi^{2}}{4} - \int_{0}^{\pi-\epsilon} \cos(\frac{4N+3}{2}t) \cdot f(t) dt$$

Comme la fonction f est continue sur  $[0,\pi],$  on obtient en passant à la limite quand  $\epsilon$  tend vers 0 :

$$\int_0^{\pi} \sum_{k=1}^{2N+1} (-1)^k \cdot (\pi - t) \cdot \cos(kt) dt = -\frac{\pi^2}{4} - \int_0^{\pi} \cos(\frac{4N+3}{2}t) \cdot f(t) dt$$

Comme f est de classe  $\mathcal{C}^1$  sur  $[0,\pi]$ , d'après le 4.(c),  $\lim_{N\to+\infty}\int_0^\pi\cos(\frac{4N+3}{2}t)f(t)dt=0$ . D'où en passant à la limite dans la relation du 6.(b):

$$-2.\sum_{n=0}^{+\infty} \frac{1}{(2n+1)^2} = -\frac{\pi^2}{4}$$

et on en déduit bien que  $\boxed{C = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{1}{(2n+1)^2} = \frac{\pi^2}{8}}$ 

(h) Enfin, 
$$A = \frac{4}{3} \cdot C = \frac{\pi^2}{6}$$
 (résultat classique) et donc  $B = A - 2C = -\frac{\pi^2}{12}$ 

# Exercice 2

Soit 
$$M = \begin{pmatrix} 0 & 3 & 2 \\ 2 & 2 & 4 \\ 5 & 0 & 2 \end{pmatrix}$$
 et  $I_3 = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$ .

# Partie 1

- 1. (a) La famille  $(I_3, M, M^2, M^3, M^4, M^5, M^6, M^7, M^8, M^9)$  est une famille de 10 vecteurs de l'espace vectoriel  $\mathcal{M}_3(\mathbb{R})$  qui est de dimension 9, cette famille est donc nécessairement liée
  - (b) Comme la famille est liée, il existe  $\alpha_0, ..., \alpha_9$  des réels non tous nuls tels que

$$\alpha_0.I_3 + \alpha_1.M. + \dots + \alpha_9.M^9 = 0$$

Posons  $P = \sum_{i=0}^{9} \alpha_i X^i$ . Ce polynôme P est non nul puisque ses coefficients ne sont pas tous nuls, et P(M) = 0. De plus  $\deg(P) \leq 9$ .

Remarque : il s'agit de la preuve de cours sur l'existence d'un polynôme annulateur que l'on  $\overline{\text{nous fait refaire dans le cas particulier de }}\mathcal{M}_3(\mathbb{R}).$ 

- 2. On admet que la fonction  $\varphi$  définie sur  $\mathbb R$  par  $\varphi(x)=x^3-4x^2-12x-28$  est un polynôme annulateur de M.
  - (a) Un programme possible est le suivant :
    - 1. def PolyAnn(M):
    - 2. a,b=np.shape(M) #on récupère la taille de la matrice
    - 3. if np.sum(al.matrix\_power(M,3)-4\*al.matrix\_power(M,2)

- 4. return True
- 5. else:
- 6. return False

A la ligne 6., la commande

al.matrix\_power(M,3)-4\*al.matrix\_power(M,2)-12\*M-28\*np.eye(a)==np.zeros([a,a])

est une matrice remplie de True/False qui teste si chaque case est égale à 0 ou non. Comme True=1 et False=0, la matrice est nulle ssi la somme des True/False vaut 9.

(b) Bien classique! Comme  $\varphi$  est un polynôme annulateur de M.

$$\begin{split} M^3 - 4M^2 - 12M - 28I_3 &= 0 &\Leftrightarrow & M(M^2 - 4M - 12I_3) = 28I_3 \\ &\Leftrightarrow & M(\frac{1}{28}M^2 - \frac{1}{7}M - \frac{3}{7}I_3) = I_3 \end{split}$$

Bilan : la matrice M est inversible et  $M^{-1} = \frac{1}{28}M^2 - \frac{1}{7}M - \frac{3}{7}I_3$ 

3. (a) Il s'agit dans cette question de refaire la preuve de cours sur le lien entre polynôme annulateur et spectre

Soit  $\lambda$  une valeur propre de M et X un vecteur propre associé :  $MX = \lambda.X$  avec  $X \neq 0$ . On a aussi :  $M^2.X = \lambda.MX = \lambda^2.X$  et  $M^3.X = \lambda^3.X$ .

Comme  $\varphi(M) = 0$ , on a aussi  $\varphi(M) X = 0$  donc:

$$M^{3}.X - 4M^{2}.X - 12M.X - 28X = 0$$

$$\Leftrightarrow \lambda^{3}.X - 4\lambda^{2}.X - 12.\lambda.X - 28X = 0$$

$$\Leftrightarrow \varphi(\lambda).X = 0$$

$$\Leftrightarrow \varphi(\lambda) = 0 \text{ car } X \neq 0$$

Bilan: si  $\lambda$  est une valeur propre de M, alors  $\varphi(\lambda) = 0$ 

Nous avons redémontré dans un cas particulier le théorème du cours qui dit que

$$Sp(M) \subset \{\text{racines du polynôme annulateur}P\}$$

(b) La fonction  $\varphi$  est polynômiale donc dérivable sur  $\mathbb R$ 

$$\forall x \in \mathbb{R}, \quad \varphi'(x) = 3x^2 - 8x - 12$$

On a alors

$$\varphi'(x) = 0 \Leftrightarrow x = x_1 = \frac{4 - 2\sqrt{13}}{2} \text{ ou } x = x_2 = \frac{4 + 2\sqrt{13}}{2}$$

D'où le tableau de variations de  $\varphi$ :

D'ou le tableau de variations de $\varphi$ :							
x	$-\infty$		$x_1$		$x_2$		$+\infty$
$\varphi'(x)$		+	0	_	0	+	
$\varphi(x)$	$-\infty$		$\varphi(x_1)$		$\varphi(x_2)$		+∞

D'après l'énoncé,  $\varphi(x_1) = \varphi\left(\frac{4-2\sqrt{13}}{3}\right) < 0$ . L'équation  $\varphi(x) = 0$  n'a donc pas de solution sur l'intervalle  $]-\infty, x_2]$ . Comme la fonction  $\varphi$  est continue et strictement croissante sur  $]x_2; +\infty[$ , elle est bijective de cet intervalle sur  $]\varphi(x_2), +\infty[$ . Comme  $0 \in ]\varphi(x_2), +\infty[$ , la fonction  $\varphi$  s'annule en un unique réel  $x_0$  et  $x_0 \in ]x_2; \infty[$ . De plus,

$$\varphi(4) = 4^3 - 3^3 - 12 * 4 - 28 < 0$$

donc  $x_0 > 4$ . De plus si  $\lambda$  est une valeur propre de M, alors  $\lambda$  vérifie  $\varphi(\lambda) = 0$ . Bilan: M admet au plus une valeur propre réelle  $\lambda$ , qui vérifie  $\lambda > 4$ .

(c) Supposons M diagonalisable. Alors  $Sp(M) = \{\lambda\}$  (le spectre est non vide et possède au plus un élément) et il existe une matrice inversible P telle que

$$M = P.Diag(\lambda, \lambda, \lambda).P^{-1} = \lambda.P^{-1}.I.P = \lambda.I$$

ce qui est absurde puisque Mn'est pas diagonale !

 $\underline{\text{Bilan}:}$  M n'est pas diagonalisable

### Partie 2

On pose  $S = {}^{t}MM$ .

- 4.  ${}^{t}S = {}^{t}({}^{t}M.M) = {}^{t}M.{}^{t}M = {}^{t}M.M = S$ . Donc la matrice S est bien symétrique.
- 5. Soit  $\lambda$  une valeur propre de S et X un vecteur propre associé :  $SX = \lambda X$  avec  $X \neq 0$ . Alors

$${}^{t}X.S.X = \lambda {}^{t}X.X \Leftrightarrow {}^{t}MX.MX = \lambda . {}^{t}X.X \Leftrightarrow \|MX\|^{2} = \lambda . \|X\|^{2}$$

où  $\|.\|$  désigne la norme canonique sur l'espace  $\mathcal{M}_{3,1}(\mathbb{R})$ . Comme  $\|X\|>0$ , on a alors

$$\lambda = \frac{\|MX\|}{\|X\|} \ge 0$$

De plus, on a vu au 3.(b) que  $0 \notin Sp(M)$ , la matrice M est donc inversible. Par conséquent,  $MX \neq 0$  et  $\frac{\|MX\|}{\|X\|} > 0$ .

Bilan : les valeurs propres de S sont strictement positives

6. La matrice S est symétrique donc orthodiagonalisable : il existe une matrice diagonale D et une matrice orthogonale P telles que  $S = PD^tP$ .

On admet que 
$$D = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 16 & 0 \\ 0 & 0 & 49 \end{pmatrix}$$
.

N. Marconnet - Lycée Saint Just 5 Année 2024-2025

7. (a) Soit  $\Delta$  une matrice diagonale :  $\Delta = Diag(\delta_1, \delta_2, \delta_3)$ . Alors

$$\begin{split} \Delta^2 = D &\Leftrightarrow & \delta_1^2 = 1, \delta_2^2 = 16, \delta_3^2 = 49 \\ &\Leftrightarrow & \delta_1 = \pm 1, \delta_2 = \pm 4, \ \delta_3 = \pm 7 \\ &\Leftrightarrow & \Delta = Diag(\pm 1, \pm 4, \pm 7) \end{split}$$

Il existe donc  $2^3 = 8$  matrices  $\Delta$  diagonales telles que  $\Delta^2 = D$ On note, dans la suite de l'exercice,  $\Delta$  une telle matrice diagonale.

- (b)  $\Delta$  est une matrice diagonale sans 0 sur la diagonale, donc  $\Delta$  est inversible.
- 8. Notons  $R = P.\Delta$ .  ${}^{t}P$ . Alors

$${}^{t}R = {}^{t}(P.\Delta. {}^{t}P) = P. {}^{t}\Delta. {}^{t}P = P.\Delta. {}^{t}P = R$$

$$R^{2} = P.\Delta^{t}P.P.\Delta^{t}P = P.\Delta^{2}$$
,  ${}^{t}P = P.D^{t}P = S$ 

donc R est bien une matrice symétrique réelle telle que  $R^2 = S$ .

9. PAS TRES CLAIR PUISQUE L'ON A CHOISI LA MATRICE R... R est le produit de trois matrices inversible donc R est inversible et

$$R^{-1} = (P.\Delta. {}^{t}P)^{-1} = P.\Delta^{-1}. {}^{t}P$$

10.

$$\begin{tabular}{lll} $^t\!U.U$ & = & $^t\!(R^{-1}).^t\!M.M.R^{-1}$ \\ & = & P.\,^t\!\Delta^{-1}.^t\!P.S.P.\Delta^{-1}.^t\!P \\ & = & P.\Delta^{-1}D.\Delta^{-1}.^t\!P\ \mathrm{car}\ \Delta^{-1}\ \mathrm{est}\ \mathrm{diagonale} \\ & = & P.\Delta^{-1}\Delta^2.\Delta^{-1}.^t\!P \\ & = & I \end{tabular}$$

Bilan: U est une matrice orthogonale

### Partie 3

On admet qu'il existe une matrice  $\Delta$  diagonale vérifiant  $\Delta^2 = D$  et dont les coefficients diagonaux sont strictement positifs. On considère désormais cette matrice  $\Delta$  et les matrices U et R définies dans la partie précédente, associées à cette matrice, c'est-à-dire  $R = P\Delta^t P$  où P est définie à la question  $6, R^2 = S, R$  est symétrique réelle et inversible,  $U = MR^{-1}$  et U est orthogonale.

11. Les matrices R et  $\Delta$  sont semblables donc ont le même spectre d'après le cours (cela est vrai car ces matrices représentent le même endomorphisme dans deux bases différentes). Donc  $Sp(R) = Sp(\Delta) \subset [0; +\infty[$ .

On suppose qu'il existe V une matrice orthogonale et T une matrice symétrique réelle à valeurs propres strictement positives telles que M=VT.

On pose  $N = {}^t PTP$  et  $C_1, C_2$  et  $C_3$  les vecteurs colonnes de P où P est définie à la question 6.

12. M=VT donc  $T=V^{-1}.M={}^tV.M$  puisque V est orthogonale. Donc comme T est symétrique et V est orthogonale,

$$T^{2} = T.T = {}^{t}T.T = {}^{t}({}^{t}V.M.{}^{t}V.M = {}^{t}M.V.{}^{t}V.M = {}^{t}M.M = S$$

De plus, comme P est orthogonale,

$$N^2 = {}^{t}PTP {}^{t}PTP = {}^{t}PT^2P = {}^{t}PSP = D$$

13. Montrons que T et S commutent.

$$ST = T^2 T = T^3 = T T^2 = T S$$

Donc S et T commutent.

- 14. Soit i un entier de [1,3].
  - (a) Tout d'abord la matrice  $PE_i$  est une matrice colonne. Par définition du produit matriciel, pour tout  $j \in [1, 3]$ ,

$$(PE_i)_{j,1} = \sum_{k=1}^{3} (P)_{j,k} \cdot (E_i)_{k,1} = P_{j,i} = (C_i)_{j,1}$$

et donc  $PE_i = C_i$  où  $E_i$  est le vecteur colonne dont tous les coefficients sont nuls sauf celui de la ligne i qui vaut 1.

- (b) Par définition de la matrice P, les vecteurs colonnes de P sont des vecteurs propres de S. On note  $\lambda_i$  la valeur propre associée.
- (c)

$$S.TC_i = T.S.C_i = T.\lambda_i.C_i = \lambda_i.TC_i$$

donc  $TC_i$  appartient au sous-espace propre de S associé à  $\lambda_i$ .

- (d) La matrice S appartient à  $\mathcal{M}_3(\mathbb{R})$  et possède trois valeurs propres distinctes (à savoir 1, 16, 49). D'après le cours, les sous-espaces propres de S sont tous de dimension 1. Comme  $C_i \neq 0$  et  $C_i \in Ker(S \lambda_i.I)$ , on a  $Ker(S \lambda_i.I) = Vect(C_i)$ . Puisque  $TC_i \in Ker(S \lambda_i.I)$ , il existe  $\alpha \in \mathbb{R}$  tel que  $TC_i = \alpha.C_i$ : les vecteurs  $TC_i$  et  $C_i$  sont bien colinéaires.
- 15. Comme  $TC_i = \alpha.C_i : C_i$  est un vecteur propre de T associé à une certaine valeur propre  $\alpha$ . On en déduit que les colonnes de la matrice P forment une base de  $\mathcal{M}_{3,1}(\mathbb{R})$  qui est formée de vecteurs propres de T. D'après le cours, cette matrice P diagonalise T: la matrice  $N = {}^tPTP$  est diagonale. De plus les valeurs propres de T sont strictement positives donc les coefficients diagonaux de N sont strictement positifs.
- 16. N est diagonale et  $N^2 = D = \Delta^2$ . Comme les deux matrices N et  $\Delta$  sont diagonales à coefficients strictement positifs, on a nécessairement  $N = \Delta$ . On a donc ensuite

$$T = P.N.^{t}P = P.\Delta.^{t}P = R.$$

17. Enfin, comme M = VT, et T inversible car  $0 \notin Sp(T)$ , on a

$$V = M T^{-1} = M R^{-1} = U$$

#### Remarques:

- Vous pouvez reconnaître la méthode "de diagonalisation simultanée" (cf ex. de révision d'algèbre et ex. correspondant dans le chapitre sur la réduction).
- Cf aussi ex.9 du chapitre 9 : dans la partie 2 on écrit la "décomposition polaire" de la matrice M : M=R.U où U est une matrice orthogonale et R est une matrice symétrique.
- Dans la Partie 3, on montre l'unicité de cette décomposition polaire : si M=R.U et M=V.T alors R=V et U=T.

# Problème

#### Partie 1

- 1. Soit x et y deux réels.
  - (a) Comme  $\lim_{t\to 0} (1-t)^{y-1} = 1$  (pour tout y), on a

$$t^{x-1}(1-t)^{y-1} \sim_{t\to 0} t^{x-1} = \frac{1}{t^{1-x}}$$

(b) La fonction  $t\mapsto t^{x-1}(1-t)^{y-1}$  est continue sur  $]0,\frac{1}{2}]$ , l'intégrale  $\int_0^{\frac{1}{2}}t^{x-1}(1-t)^{y-1}$  dt est donc impropre en 0 uniquement. Comme  $t^{x-1}(1-t)^{y-1}\sim_{t\to 0}\frac{1}{t^{1-x}}$  et comme l'intégrale  $\int_0^{\frac{1}{2}}\frac{1}{t^{1-x}}dx$  est une intégrale de Riemann qui converge si et seulement si  $1-x<1\Leftrightarrow x>0$ , par critère d'équivalence pour les intégrales de fonctions positives,

l'intégrale 
$$\int_0^{\frac{1}{2}} t^{x-1} (1-t)^{y-1} dt$$
 converge si et seulement si  $x>0$ 

(c) Posons s=1-t. Il s'agit d'un changement de variables affine non constant donc autorisé. Comme ds=-dt, et au niveau des bornes :

$$\begin{cases} t = \frac{1}{2} \\ t = 1 \end{cases} \rightarrow \begin{cases} s = \frac{1}{2} \\ s = 0 \end{cases}$$

d'après le cours l'intégrale

$$\int_{\frac{1}{2}}^{1} t^{x-1} (1-t)^{y-1} \, \mathrm{d}t$$

est de même nature que

$$\int_{\frac{1}{2}}^{0} (1-s)^{x-1}.s^{y-1}(-\ \mathrm{d} s) = \int_{0}^{\frac{1}{2}} s^{y-1}.(1-s)^{x-1}\ \mathrm{d} s$$

(d) En réutilisant le 1.(b), cette dernière intégrale converge si y>0. Finalement, comme  $\int_0^1 t^{x-1} (1-t)^{y-1} dt$  converge si et seulement si les deux intégrales  $\int_0^{\frac{1}{2}} t^{x-1} (1-t)^{y-1} dt$  et  $\int_1^1 t^{x-1} (1-t)^{y-1} dt$  convergent, on en déduit le résultat souhaité.

$$\underline{\text{Bilan :}} \left[ \ \int_0^1 t^{x-1} (1-t)^{y-1} \ \mathrm{d}t \text{ converge si et seulement si } x>0 \text{ et } y>0 \right]$$

On note désormais, pour tout couple (x,y) de réels strictement positifs,

$$B(x,y) = \int_0^1 t^{x-1} (1-t)^{y-1} dt$$

2. Posons encore s=1-t. Il s'agit d'un changement de variable affine non constant donc autorisé. On obtient par ce changement de variable que

$$B(x,y) = \int_{1}^{0} (1-s)^{x-1} s^{y-1} (-dt) = \int_{0}^{1} s^{y-1} \cdot (1-s)^{x-1} ds = B(y,x)$$

3. Soit x > 0,

$$B(x,1) = \int_0^1 t^{x-1} dt = \left[\frac{1}{x} \cdot t^x\right]_0^1 = \frac{1}{x}$$

4. (a)  $\forall (x, y) \in ]0, +\infty[^2,$ 

$$B(x+1,y) + B(x,y+1) = \int_0^1 t^x (1-t)^{y-1} dt + \int_0^1 t^{x-1} (1-t)^y dt$$
$$= \int_0^1 t^{x-1} (1-t)^{y-1} . (t+1-t) dt$$
$$= B(x,y)$$

(b) Soit  $(x,y) \in ]0,+\infty[^2$  et  $B(x,y+1)=\int_0^1 t^{x-1}(1-t)^y \, \mathrm{d}t$ . Cette intégrale est possiblement doublement impropre en 0 et en 1, nous devons fixer des bornes avant d'intégrer par parties. Soit a et b deux réels tels que 0 < a < b < 1.

Posons

$$\left\{ \begin{array}{l} u(t) = (1-t)^y \\ v'(t) = t^{x-1} \end{array} \right. \rightarrow \left\{ \begin{array}{l} u'(t) = -y.(1-t)^(y-1) \\ v(t) = \frac{1}{x}.t^x \end{array} \right.$$

Les fonctions u et v sont de classe  $\mathcal{C}^1$  sur [a,b], on peut donc intégrer par parties. On obtient :

$$\int_{a}^{b} t^{x-1} (1-t)^{y} dt = [(1-t)^{y} \cdot \frac{1}{x} t^{x}]_{a}^{b} + \frac{y}{x} \int_{a}^{b} t^{x} \cdot (1-t)^{y-1}$$
$$= \frac{1}{x} (1-b)^{y} \cdot b^{x} - \frac{1}{x} \cdot (1-a)^{y} \cdot a^{x} + \frac{y}{x} \int_{a}^{b} t^{x} \cdot (1-t)^{y-1}$$

En passant à la limite quand  $a \to 0$  et  $b \to 1$ , on trouve que :

$$\int_0^1 t^{x-1} (1-t)^y \, dt = \frac{y}{x} \int_0^1 t^x \cdot (1-t)^{y-1}$$

Bilan: 
$$\forall (x,y) \in ]0, +\infty [^2, xB(x,y+1) = yB(x+1,y)]$$

(c) En injectant le résultat du (b) dans celui du (a), on obtient :

$$B(x+1,y) + \frac{y}{x}B(x+1,y) = B(x,y)$$

$$\Leftrightarrow \frac{x+y}{x}B(x+1,y) = B(x,y)$$

$$\Leftrightarrow B(x+1,y) = \frac{x}{x+y}B(x,y)$$

5. Puisque l'énoncé nous propose le résultat, on peut travailler par récurrence ! La méthode "de descente" fonctionne aussi. Soit  $q \in \mathbb{N}^*$  un entier fixé. Notons, pour tout  $p \in \mathbb{N}^*$ :

$$\mathcal{H}(p): B(p,q) = \frac{(p-1)!(q-1)!}{(p+q-1)!}$$

- <u>Initialisation</u>: si p=1,  $B(1,q)=B(q,1)=\frac{1}{q}=\frac{0!.(q-1)!}{q!}$  donc  $\mathcal{H}(1)$  est vraie.
- <u>Hérédité</u>: soit  $p \in \mathbb{N}^*$  un entier tel que  $\mathcal{H}(p)$  est vraie.

$$B(p+1,q) = \frac{p}{p+q} \cdot B(p,q)$$

$$= \frac{p}{(p+q)} \cdot \frac{(p-1)!(q-1)!}{(p+q-1)!} = \frac{p! \cdot (q-1)!}{(p+q)!}$$

donc le résultat est vrai au rang p+1.

• <u>Conclusion</u>:  $\forall (p,q) \in (\mathbb{N}^*)^2, B(p,q) = d \frac{(p-1)!(q-1)!}{(p+q-1)!}$ 

## Partie 2

6. On définit la fonction  $\Gamma$  sur  $\mathbb{R}_+^*$  par  $\forall \nu \in ]0, +\infty[$ ,  $\Gamma(\nu) = \int_0^{+\infty} t^{\nu-1} e^{-t} dt$ .

On rappelle que cette fonction est bien définie sur  $\mathbb{R}_+^*$  et que pour tout réel  $\nu$  strictement positif,  $\Gamma(\nu+1)=\nu\Gamma(\nu)$ .

(a) On montre par une récurrence très facile (mais à rédiger!) que pour tout  $n \in \mathbb{N}$ ,  $\Gamma(n+1) = n!$ .

Remarque : ce sujet demandait beaucoup de preuve de cours.

(b) Le calcul de  $\Gamma\left(\frac{1}{2}\right)$  est classique : cf ex. de cours (à savoir refaire en colle) !!! On obtient  $\left[\Gamma\left(\frac{1}{2}\right) = \sqrt{\pi}\right]$ 

Soit 
$$(a,b) \in ]0,+\infty[^2$$
, on définit  $f_{a,b}:t\longmapsto \begin{cases} \frac{b^a}{\Gamma(a)}t^{a-1}\mathrm{e}^{-bt} & \text{si }t>0\\ 0 & \text{si }t\leqslant 0 \end{cases}$ 

7. (a)  $\int_{-\infty}^{+\infty} f_{a,b}(t) dt = \int_{0}^{+\infty} f_{a,b}(t) dt$ .

La fonction  $f_{a,b}$  est continue sur  $]0;+\infty[$ , l'intégrale est donc impropre uniquement en 0 et en  $+\infty$ . Posons le changement de variables u=bt qui est affine non constant donc autorisé. On a

$$du=bdt.$$
 D'après le cours, l'intégrale  $\int_0^{+\infty} f_{a,b}(t)\mathrm{d}t$  est de même nature que :

$$\int_0^{+\infty} \frac{b^a}{\Gamma(a)} \left(\frac{u}{b}\right)^{a-1} e^{-u} \cdot \frac{1}{b} \cdot du$$

$$= \frac{b^{a-1}}{\Gamma(a)} \cdot \frac{1}{b^{a-1}} \cdot \int_0^{+\infty} u^{a-1} \cdot e^{-u} du$$

$$= \frac{1}{\Gamma(a)} \cdot \Gamma(a)$$

$$= 1$$

et l'intégrale définissant la fonction  $\Gamma$  est bien convergente puisque a>0. Par conséquent  $\boxed{\int_{a}^{+\infty} f_{a,b}(t) dt \text{ converge}}$ 

(b) La fonction  $f_{a,b}$  est positive sur  $\mathbb{R}$  et continue sur  $\mathbb{R}^*$ . De plus nous venons de voir que  $\int_{-\infty}^{+\infty} f_{a,b}(t) dt = 1$ .

Bilan :  $f_{a,b}$  est une densité de probabilité

- 8. (a) Si b=1,  $f_{a,1}(t)=\frac{1}{\Gamma(a)}.t^{a-1}.e^{-t}$  si t>0 et 0 sinon. Donc  $X\hookrightarrow\gamma(a)$ D'après le cours. E(X)=a et V(X)=a.
  - (b) Si a=1,  $f_{1,b}(t)=b.e^{-bt}$  si t>0 et 0 sinon. Par conséquent  $X\hookrightarrow \mathcal{E}(b)$  D'après le cours  $E(X)=\frac{1}{b}$ . On a aussi  $V(X)=\frac{1}{b^2}$ .

Remarque : l'énoncé demande de refaire la preuve de cours pour V(X)...

- 9. Soit X une variable aléatoire à densité de densité  $f_{a,b}$ 
  - (a) Tout d'abord,  $(bX)(\Omega) = ]0; +\infty[$ . Donc si  $x \leq 0, F_{bX}(x) = 0$ . Si x > 0,

$$F_{bX}(x) = P(bX \le x) = F_X(\frac{x}{b})$$

D'où en dérivant : pour tout x > 0

$$f_{bX}(x) = \frac{1}{b} f_X(\frac{x}{b}) = \frac{b^{a-1}}{\Gamma(a)} (\frac{x}{b})^{a-1} e^{-x} = \frac{1}{\Gamma(a)} x^{a-1} e^{-x}$$

donc bX suit la loi  $\gamma(a)$ .

- (b) On a donc E(bX)=a et V(bX)=a. Par linéarité de l'espérance,  $E(X)=\frac{a}{b}$  et  $b^2.V(X)=a$  donc  $V(X)=\frac{a}{b^2}$
- 10. Soit X<sub>1</sub> et X<sub>2</sub> deux variables aléatoires à densité indépendantes de densités respectives f<sub>a1,b</sub> et f<sub>a2,b</sub>, où a<sub>1</sub>, a<sub>2</sub> et b sont trois réels strictement positifs.
  - (a) Notons, pour tout  $x \in \mathbb{R}$ ,

$$h(x) = \int_{-\infty}^{+\infty} f_{X_1}(t) \cdot f_{X_2}(x-t) dt$$

D'après le cours,  $X_1+X_2$  est à densité si et seulement si la fonction h est définie sur  $\mathbb R$  et continue sauf en quelques points. Si c'est le cas, h est une densité de  $X_1+X_2$ . Soit  $x\in\mathbb R$  et  $t\in\mathbb R$ .

$$f_{X_1}(t).f_{X_2}(x-t) \neq 0$$
  
 $\Leftrightarrow t > 0 \text{ et } x - t > 0 \Leftrightarrow t > 0 \text{ et } t < x$ 

Si  $x \le 0$ , cela est impossible donc h(x) = 0. Supposons maintenant x > 0. Alors

$$f_{X_2}(t).f_{X_2}(x-t) \neq 0 \Leftrightarrow 0 < t < x$$

donc

$$h(x) = \int_0^x \frac{b^{a_1}}{\Gamma(a_1)} \cdot t^{a_1 - 1} \cdot e^{-bt} \cdot \frac{b^{a_2}}{\Gamma(a_2)} \cdot (x - t)^{a_2 - 1} \cdot e^{-b(x - t)} dt$$
$$= \frac{b^{a_1 + a_2}}{\Gamma(a_1) \cdot \Gamma(a_2)} \cdot e^{-bs} \cdot \int_0^x t^{a_1 - 1} \cdot (x - t)^{a_2 - 1} dt$$

On effectue le changement de variables  $u = \frac{1}{x}t$  dans cette dernière intégrale. Il s'agit encore une fois d'un changement de variables affine donc autorisé. On a alors (sous réserve de convergence)

$$\int_0^x t^{a_1-1} \cdot (x-t)^{a_2-1} dt = \int_0^1 (xu)^{a_1-1} \cdot (x-xu)^{a_2-1} \cdot x du$$

$$= x^{a_1+a_2-1} \cdot \int_0^1 u^{a_1-1} \cdot (1-u)^{a_2-1} du$$

$$= x^{a_1+a_2-1} \cdot B(a_1, a_2)$$

On en déduit que l'intégrale définissant h(x) est bien convergente pour x>0 et que

$$h(x) = \frac{b^{a_1 + a_2} B(a_1, a_2)}{\Gamma(a_1) \Gamma(a_2)} x^{a_1 + a_2 - 1} e^{-bx}$$

La fonction h est définie sur  $\mathbb{R}$  et continue sur  $\mathbb{R}^*$  donc  $X_1 + X_2$  est à densité, de densité h.

$$\underline{\text{Bilan:}} \ X_1 + X_2 \text{ admet pour densit\'e la fonction } x \longmapsto \begin{cases} \frac{b^{a_1 + a_2} B\left(a_1, a_2\right)}{\Gamma\left(a_1\right) \Gamma\left(a_2\right)} x^{a_1 + a_2 - 1} \mathrm{e}^{-bx} & \text{ si } x > 0 \\ 0 & \text{ si } x \leqslant 0 \end{cases}$$

(b) On en déduit, comme  $\int_0^{+\infty} f_{X_1+X_2}(x)dx = 1$ , que

$$\frac{\Gamma(a_1).\Gamma(a_2)}{B(a_1, a_2)} = b^{a_1 + a_2}. \int_0^{+\infty} x^{a_1 + a_2 - 1}.e^{-bx} dx$$

et en posant (encore !!) u = bx, on obtient que

$$\frac{\Gamma(a_1).\Gamma(a_2)}{B(a_1, a_2)} = \Gamma(a_1 + a_2)$$

$$\underline{\text{Bilan}:} \quad \forall (x,y) \in \left]0,+\infty\right[^2, \quad B(x,y) = \frac{\Gamma(x)\Gamma(y)}{\Gamma(x+y)}$$

(c) 
$$B(\frac{1}{2}, \frac{1}{2}) = \frac{\Gamma(1/2)^2}{\Gamma(1)} = \pi$$

### Partie 3

On suppose dans cette partie et pour les questions d'informatique que les bibliothèques suivantes sont importées ainsi :

import numpy as np
import numpy.random as rd

- 11. Soit (x, y) un couple de réels strictement positifs.
  - (a) Soit U une variable aléatoire de loi uniforme sur ]0,1[. La variable  $U^{x-1}(1-U)^{y-1}$  est bornée (elle est à valeur dans [0,1] donc admet une espérance. D'après le théorème de transfert,

$$E(U^{x-1}(1-U)^{y-1}) = \int_{-\infty}^{+\infty} t^{x-1} \cdot (1-t)^{y-1} \cdot f_U(t) = \int_0^1 t^{x-1} \cdot (1-t)^{y-1} dt = B(x,y)$$

On admet que  $U^{x-1}(1-U)^{y-1}$  admet une variance.

- (c) Comme les variables (U<sub>k</sub>) sont mutuellement indépendantes, par coalition les variables U<sub>k</sub><sup>x-1</sup>.(1-U<sub>k</sub>)<sup>y-1</sup> sont également indépendantes. Ces variables suivent toutes la même loi, admettent la même espérance et la même variance. D'après la loi faible des grands nombres,

$$R_n = \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n U_k^{x-1} \cdot (1 - U_k)^{y-1} \stackrel{P}{\to} E(U^{x-1} \cdot (1 - U)^{y-1}) = B(x, y)$$

N. Marconnet - Lycée Saint Just

11

Année 2024-2025

N. Marconnet - Lycée Saint Just

12

Année 2024-2025

- (e) On voit que pour une grande valeur de  $n, R_n \simeq 3, 1$ . Or nous savons que  $R_n$  converge en probabilités vers  $B(\frac{1}{2}, \frac{1}{2})$ . Ceci illustre le fait que  $B(\frac{1}{2}, \frac{1}{2}) = \pi$  que nous avons prouvé à la fin de la Partie 2.
- 12. Soit a un réel supérieur ou égal à 1 .
  - (a) Soit X une variable aléatoire suivant une loi exponentielle de paramètre 1. D'après le théorème de transfert, sous réserve d'existence,

$$E(X^{a-1}) = \int_0^{+\infty} t^{a-1} \cdot e^{-t} dt = \Gamma(a)$$

Donc  $E(X^{a-1})$  existe et  $E(X^{a-1}) = \Gamma(a)$ . De même, sous réserve d'existence,

$$E((X^{a-1})^2) = E(X^{2a-2}) = \int_0^{+\infty} t^{2a-2} e^{-t} dt = \Gamma(2a-1)$$

Donc  $X^{a-1}$  admet un moment d'ordre 2 puisque  $2a-1 \ge 1 > 0$ . On a alors

$$V(X) = E((X^{a-1})^2) - E(X^{a-1})^2 = \Gamma(2a-1) - \Gamma(a)^2$$

(b) Soit  $(X_n)_{n\geqslant 1}$  une suite de variables aléatoires indépendantes et de même de loi exponentielle de paramètre 1. On définit, pour tout entier naturel non nul  $n, M_n = \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n X_k^{a-1}$ .

D'une part, par linéarité de l'espérance,

$$E(M_n) = \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^{n} E(X_k^{a-1}) = \frac{1}{n} \cdot n \cdot \Gamma(a) = \Gamma(a)$$

D'autre part, comme les variables  $(X_k)^{a-1}$  sont indépendantes (par coalition) de même espérance, variance, d'après la loi faible des grands nombres,

$$M_n \stackrel{P}{\to} E(X^{a-1}) = \Gamma(a)$$

Bilan :  $M_n$  est un estimateur convergent et sans biais de  $\Gamma(a)$ 

(c) Expliquer ce que renvoie la fonction Myst suivante :

def Myst(n):

U = rd.random(n)

X = -np.log(1-U)

return(X)

Cette fonction renvoie n simulations de la variable -ln(1-U) où U suit la loi uniforme sur [0,1].

- De façon classique, on montre que cette variable suit la loi exponentielle de paramètre 1 (à faire !).
- (d) En utilisant les questions précédentes , la fonction suivante renvoie une valeur approchée de  $\Gamma(a)$ :

def Approx(n, a):
X = Myst(n)
return (1/n)\*np.sum(Myst(n)\*\*(a-1)