

Exercices d'oraux de mathématiques

Sélection d'énoncés rapportés d'oraux donnés aux concours et classés par thèmes

Les exercices suivants sont corrigés :

Léandre 46+67 / Tiago 45 / Arthur 119+124 / Damien 125+CCP56 / Erwann 34+CCP6 / Dhyae 28+CCP14
 // Valentin 1+68 // Jules Morel 52+76/ Baptiste V 77 / Céleste 37+CCP2/ Oscar 39+CCP4 / Naoelle 38+CCP5
 / Timothée 5+CCP53 / Jules Métaireau 25+CCP36 / Alexandre 47 / Rami 24+CCP52 / Paul 71+CCP74 / Neji
 73+CCP77 //

1 Algèbre

1.1 Sous-espaces vectoriels & applications linéaires

1. RMS 132 1126 CCINP PSI 2021

Soient E un espace vectoriel de dimension 4 et u un endomorphisme de E . Montrer que :

(a) si $\text{rg}(u) = 2$ et $u^2 = 0$, alors il existe une base dans laquelle u est représenté par
$$\begin{pmatrix} 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix};$$

(b) si $\text{rg}(u) = 3$ et $u^4 = 0$, alors $\text{Ker}(u^2) = \text{Im}(u^2)$ et il existe une base dans laquelle u est représenté par
$$\begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}.$$

SOLUTION —

- (a) De $u^2 = 0$, on déduit que $\text{Im}(u) \subset \text{Ker}(u)$. Et ils ont la même dimension car $\dim \text{Ker}(u) = 4 - 2$ d'après le théorème du rang. Soit (e_1, e_2) une base de $\text{Ker}(u)$. Comme $\text{Ker}(u) = \text{Im}(u)$, il existe $(e_3, e_4) \in E^2$ tel que $u(e_3) = e_1$ et $u(e_4) = e_2$. La famille (e_1, e_2, e_3, e_4) est libre car

$$\begin{aligned} \alpha_1 e_1 + \alpha_2 e_2 + \alpha_3 e_3 + \alpha_4 e_4 = 0_E &\implies \alpha_3 e_1 + \alpha_4 e_2 = 0_E \text{ en appliquant } u \\ &\implies \alpha_3 = \alpha_4 = 0 \text{ car } (e_1, e_2) \text{ est libre} \\ &\implies \alpha_1 e_1 + \alpha_2 e_2 = 0_E \\ &\implies \alpha_1 = \alpha_2 = 0. \end{aligned}$$

Cette famille libre est de cardinal 4, c'est donc une base. De plus, la matrice représentant u dans cette base est de la forme voulue.

- (b) Montrons que $u^2 = 0$ est absurde : si $u^2 = 0$, alors $\text{Im}(u) \subset \text{Ker}(u)$, d'où $3 = \text{rg}(u) \leq \dim \text{Ker}(u)$, ce qui est absurde car $\text{rg}(u) + \dim \text{Ker}(u) = \dim E = 4$ d'après le théorème du rang.

Montrons ensuite que $u^3 = 0$ est absurde : de $u^2 \neq 0$, on déduit qu'il existe un vecteur x tel que $u^2(x) \neq 0$. On vérifie que la famille $(u^2(x), u(x), x)$ est libre car $u^3 = 0$. Il suffit alors d'un vecteur y pour compléter la famille libre $(u^2(x), u(x))$ en une base $(y, u^2(x), u(x))$ de $\text{Im}(u)$ car $3 = \text{rg}(u)$. On vérifie que $(y, u^2(x), u(x), x)$ est alors une famille libre et donc une base de E car son cardinal est égal à la dimension de E . Et la matrice de u dans cette base est de

la forme $N = \begin{pmatrix} a & 0 & 0 & 0 \\ b & 0 & 1 & 0 \\ c & 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}$. De $3 = \text{rg}(u)$, on déduit que $3 = \text{rg}(N)$, d'où $a \neq 0$. Et, de $u^3 = 0$, on déduit que

$N^3 = 0$, d'où $a^3 = 0$. C'est absurde.

Pour finir, de $u^3 \neq 0$, on déduit qu'il existe un vecteur x tel que $u^3(x) \neq 0$. On vérifie que la famille $(u^3(x), u^2(x), u(x), x)$ est libre car $u^4 = 0$. C'est donc une base de E car son cardinal est égal à la dimension de E . Dans cette base, la

matrice M représentant u a la forme voulue : $M = \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}$ car $u^4 = 0$. D'où $M^2 = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}$ est la

matrice représentant u^2 . On en déduit que $\text{Ker}(u^2) = \text{Im}(u^2)$.

2. RMS 2012 275 X ESPCI PC, RMS 2013 305 X ESPCI PC, RMS 2013 869 Centrale PC

Soient A et B dans $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ et $\Phi: M \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R}) \mapsto AMB$. Calculer la trace de Φ .

3. RMS 2007 768 Centrale PSI

Soient E un \mathbb{K} -espace vectoriel, F et G deux sous-espaces vectoriels de E . On suppose que $E = F \oplus G$ et on note p le projecteur sur F parallèlement à G et $q = \text{id}_E - p$. Soit $f \in \mathcal{L}(E)$. Montrer que F est stable par f si et seulement si $q \circ f \circ p = 0$.

4. RMS 2016 969 CCP PC & RMS 2010 814 Centrale PSI

Soit $S: \mathcal{C}^0(\mathbb{R}, \mathbb{R}) \rightarrow \mathcal{C}^0(\mathbb{R}, \mathbb{R})$ l'application qui à f associe $S(f): x \mapsto \frac{1}{2} \int_{x-1}^{x+1} f(t) dt$.

- (a) Montrer que, si $S(f) = 0$, alors f est périodique.
- (b) L'application S est-elle injective ? surjective ?
- (c) Soit $n \geq 2$. Montrer que S induit un endomorphisme sur $\mathbb{R}_n[X]$, noté s .
- (d) L'endomorphisme s est-il bijectif ? diagonalisable ?

5. RMS 2006 1043 CCP PSI

Soient E un espace vectoriel de dimension finie et $f, g \in \mathcal{L}(E)$. Montrer que $\text{Im } f + \text{Ker } g = E \iff \text{Im}(g \circ f) = \text{Im } g$.

SOLUTION — On suppose que $\text{Im } f + \text{Ker } g = E$. L'inclusion $\text{Im}(g \circ f) \subset \text{Im } g$ étant toujours vraie, il suffit de démontrer que $\text{Im } g \subset \text{Im}(g \circ f)$. Soit $y \in \text{Im } g$. Il existe $x \in E$ tel que $y = g(x)$. Par hypothèse, il existe $(x_1, x_2) \in \text{Im } f + \text{Ker } g$ tel que $x = x_1 + x_2$ et, comme $x_1 \in \text{Im } f$, il existe $x_3 \in E$ tel que $x_1 = f(x_3)$. Alors $y = g(x) = g(f(x_3) + x_2) = g(f(x_3))$, puisque $x_2 \in \text{Ker } g$, ce qui prouve que $y \in \text{Im}(g \circ f)$.

Réciproquement, on suppose que $\text{Im}(g \circ f) = \text{Im } g$. Soit $x \in E$. Alors $g(x) \in \text{Im}(g \circ f)$ par hypothèse, donc il existe $y \in E$ tel que $g(x) = g(f(y))$, ou encore $g(x - f(y)) = 0$. On vient de montrer que $z := x - f(y) \in \text{Ker } g$, et l'égalité $x = f(y) + z$ prouve que $\text{Im } f + \text{Ker } g = E$.

6. RMS 2014 639 Mines Ponts PSI

Soient E un \mathbb{K} -espace vectoriel de dimension finie et soit $f \in \mathcal{L}(E)$. Montrer que $f^2 = 0$ si, et seulement si, il existe $g \in \mathcal{L}(E)$ tel que $f \circ g = f$ et $g \circ f = 0$.

7. RMS 2016 324 X ESPCI PC

Mots-clés : caractérisation des matrices non inversibles

Soit $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$. Montrer que $\det A = 0$ si et seulement s'il existe $B \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ non nulle telle que $AB = BA = 0$.

8. RMS 2024 303 X MP MPI

Soient p un projecteur et u un endomorphisme d'un espace vectoriel E de dimension finie tels que $p \circ u + u \circ p = u$. Montrer que $\text{tr}(u) = 0$.

9. RMS 2024 930 Mines Ponts PSI

Soient un espace vectoriel E , un endomorphisme $u \in \mathcal{L}(E)$ et un sous-espace vectoriel F stable par u . On suppose que u est nilpotent et que $E = F + \text{Im}(u)$. Montrer que $E = F$.

10. UPS 20240331

Mots-clés : commutant d'une matrice

Soient $n \in \mathbb{N}^*$, \mathcal{M}_n l'espace vectoriel des matrices carrées à coefficients complexes et \mathcal{T}_n le sous-espace vectoriel des matrices triangulaires supérieures. Pour toute matrice $A \in \mathcal{M}_n$, on pose f_A l'endomorphisme défini sur \mathcal{M}_n par $f_A(M) = AM - MA$.

- (a) On suppose que $A \in \mathcal{T}_n$. Montrer que, pour toute matrice $M \in \mathcal{T}_n$, la matrice $f_A(M)$ est triangulaire supérieure stricte. En déduire que $\dim(\mathcal{T}_n \cap \text{Ker } f_A) \geq n$.
- (b) Soit une matrice quelconque $A \in \mathcal{M}_n$. Montrer que $\dim(\text{Ker } f_A) \geq n$.

11. B2 Centrale

Mots-clés : commutant d'une matrice

Soient $n \geq 2$ et $\mathbb{K} = \mathbb{R}$ ou \mathbb{C} .

- (a) Soient $D = \text{diag}(1, 2, \dots, n) \in \mathcal{M}_n(\mathbb{K})$ et $\varphi: \mathcal{M}_n(\mathbb{K}) \rightarrow \mathcal{M}_n(\mathbb{K})$, $M \mapsto MD - DM$. Montrer que $\text{Im}(\varphi)$ est l'ensemble \mathcal{N}_n des matrices de $\mathcal{M}_n(\mathbb{K})$ à coefficients diagonaux tous nuls.
- (b) Soit u un endomorphisme d'un \mathbb{K} -ev E de dimension n tel que, pour tout $x \in E$, $u(x)$ est colinéaire à x . Montrer que u est une homothétie.
- (c) Montrer que toute matrice de $\mathcal{M}_n(\mathbb{K})$ dont la trace est nulle est semblable à une matrice de \mathcal{N}_n .
- (d) Soit $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{K})$. Montrer que $\text{tr}(A) = 0$ si, et seulement si, il existe $(U, V) \in \mathcal{M}_n(\mathbb{K})^2$ tel que $A = UV - VU$.

12. RMS 2025 535 Mines-Ponts MP-MPI

Soient $n \geq 2$ et $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{C})$ une matrice non nulle et non inversible. Montrer que :

- (a) il existe $p \in \mathbb{N}^*$ tel que $\text{Im}(A^p)$ et $\text{Ker}(A^p)$ sont supplémentaires ;
- (b) il existe $r \in \llbracket 1, n-1 \rrbracket$, $B \in GL_r(\mathbb{C})$ et $N \in \mathcal{M}_{n-r}(\mathbb{C})$ nilpotente tels que A est semblable à $\begin{pmatrix} B & 0 \\ 0 & N \end{pmatrix}$.

13. RMS 2026 983 Mines-Ponts PC

Soit $(A, B, C) \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})^3$. Montrer que :

- (a) $\text{rg}(AB) = \text{rg}(B) - \dim(\text{Ker}(A) \cap \text{Im}(B))$;
- (b) $\text{rg}(ABC) + \text{rg}(B) \geq \text{rg}(AB) + \text{rg}(BC)$.

14. RMS 2026 990 Mines-Ponts PC

Soient A et B deux matrices de $\mathcal{M}_3(\mathbb{R})$ telles que $\det(A) = \det(B) = \det(A+B) = \det(A-B) = 0$.

En étudiant la fonction $s \mapsto \det(A+sB)$, déterminer $\det(xA+yB)$ pour tout $(x,y) \in \mathbb{R}^2$.

15. RMS 2026 274 X MP

Soit E un \mathbb{K} -espace vectoriel de dimension $n \geq 2$.

Soient u et v dans $\mathcal{L}(E)$. On suppose que $c = u \circ v - v \circ u$ est de rang 1.

- (a) Montrer que $c^2 = 0$ et qu'il existe une base de E dans laquelle la matrice de c est égale à $E_{n-1,n}$.
- (b) Montrer que, pour tout $k \in \mathbb{N}$, $u^k(\text{Im } c) \subset \text{Ker } c$.

1.2 Réduction**16. RMS 132 1003 Centrale PSI 2021**

Soit F un sous-espace vectoriel de $\mathcal{M}_n(\mathbb{K})$ tel que toute matrice non nulle de F soit inversible.

- (a) Ici $\mathbb{K} = \mathbb{C}$. Montrer que, si les matrices A et B sont inversibles, alors il existe $\alpha \in \mathbb{C}$ tel que $\alpha A - B$ n'est pas inversible. Qu'en déduire sur la dimension de F ?
- (b) Ici $\mathbb{K} = \mathbb{R}$. Examiner le cas où n est impair. Donner un exemple où la dimension de F est 2. Montrer que, si n est pair, alors $\dim F \leq n$.

17. RMS 2012 1319 CCP PC

Soient E un espace vectoriel de dimension finie et $f \in \mathcal{L}(E)$. On suppose que $f \circ f$ est un projecteur.

Montrer que f est diagonalisable si, et seulement si, $f^3 = f$.

18. RMS 2014 903b Centrale PSI

$$\text{Soit } M = \begin{pmatrix} i & 1 & 0 & 0 \\ 0 & i & 0 & 0 \\ 0 & 0 & -i & 0 \\ 0 & 0 & 0 & -i \end{pmatrix}.$$

- (a) Déterminer le polynôme minimal de la matrice M .
- (b) Montrer qu'il n'existe pas de matrice $B \in \mathcal{M}_4(\mathbb{R})$ semblable à M .

19. A1 CCP MP 2018

Soit une matrice $M \in \mathcal{M}_n(\mathbb{C})$ telle que $M^2 + M^T - I_n = 0$.

- (a) Montrer que la matrice M est diagonalisable.
- (b) Montrer que M est inversible si, et seulement si, 1 n'est pas une valeur propre de M .

20. RMS 2011 1128 CCP PC

- (a) On définit $\varphi \in \mathcal{L}(\mathcal{M}_n(\mathbb{R}))$ par : $\forall M \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R}), \varphi(M) = 2M + {}^tM$. Déterminer un polynôme annulateur de φ . Montrer que l'endomorphisme φ est diagonalisable. Déterminer ses valeurs propres et ses sous-espaces propres.
- (b) Soient $(a,b) \in \mathbb{R}^2$ et $\varphi_{a,b} : M \mapsto aM + b {}^tM$. Montrer que $\varphi_{a,b}$ est inversible si, et seulement si, $a^2 \neq b^2$.

21. RMS 2016 757 Centrale PSI

Soient E un espace vectoriel de dimension finie et f, g des endomorphismes de E tels que $f^2 = g^2 = \text{id}_E$ et $f \circ g + g \circ f = 0$.

- (a) Montrer que la dimension de E est paire.
- (b) Montrer qu'il existe une base de E dans laquelle les matrices de f et g sont $\begin{pmatrix} I_n & 0 \\ 0 & -I_n \end{pmatrix}$ et $\begin{pmatrix} 0 & I_n \\ I_n & 0 \end{pmatrix}$.

22. RMS 2016 472 Mines Ponts PSI

Mots-clés : racine carrée de la dérivation

On note E l'espace $C^\infty(\mathbb{R}, \mathbb{R})$.

- (a) Soient E_1 le sous-espace vectoriel engendré par les fonctions sinus et cosinus et $\phi_1: f \in E_1 \mapsto f' \in E_1$. Montrer qu'il existe un endomorphisme u de E_1 tel que $u \circ u = \phi_1$.
- (b) Soit $\phi: f \in E \mapsto f' \in E$. Quel est le spectre de ϕ ? Existe-t-il un endomorphisme v de E tel que $v \circ v = \phi$?

23. RMS 2013 585 Mines Ponts PSI, RMS 2013 332 X ESPCI PC, RMS 2016 905 TPE PSI

Mots-clés : valeur propre commune

Soient $A, B \in \mathcal{M}_n(\mathbb{C})$ et χ_A, χ_B leurs polynômes caractéristiques respectifs.

- (a) Montrer que : si A et B ont une valeur propre commune, alors il existe U et V non nuls dans $\mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{C})$ tels que $AU^tV = U^tVB$.
- (b) Soit $M \in \mathcal{M}_n(\mathbb{C})$. Montrer que : si $AM = MB$, alors $\chi_B(A)M = 0$.
- (c) À quelle condition, nécessaire et suffisante, les matrices A et B ont-elles une valeur propre commune?

24. RMS 2014 1198 TPE PSI

- (a) Soient $d \in \mathbb{N}^*$, $a \in \mathbb{C}$ et $u: P \in \mathbb{C}_d[X] \mapsto (X-a)P' \in \mathbb{C}_d[X]$. Trouver les éléments propres de u .
- (b) En déduire l'ensemble des polynômes de $\mathbb{C}[X]$ divisibles par leur dérivée.

SOLUTION —

- (a) Soit λ une valeur propre et P un vecteur propre associé. On note $n = \deg P : P = \alpha_n X^n + \dots$ avec $\alpha_n \neq 0$. D'où $(X-a)P' = \lambda P \iff n\alpha_n X^n + \dots = \lambda\alpha_n X^n + \dots$ ce qui implique que $\lambda = n$. On en déduit que $\text{Sp}(u) \subset \llbracket 0, d \rrbracket$. Réciproquement, soit $n \in \llbracket 0, d \rrbracket$. On remarque que $u((X-a)^n) = n(X-a)^n$ donc $(X-a)^n$ est propre associé à la valeur propre n . Or on sait que $((X-a)^n)_{n \in \llbracket 0, d \rrbracket}$ est une base de $\mathbb{C}_d[X]$, on a donc une base constituée de vecteurs propres de u .
On en déduit que $\text{Sp}(u) = \llbracket 0, d \rrbracket$ et que $\text{Ker}(u - n \text{id}) = \text{Vect}((X-a)^n)$.
- (b) Soit P divisible par P' , $n = \deg P$. Le quotient s'écrit $Q = \frac{1}{n}(X-a)$. On utilise alors (a) avec une valeur de d supérieure à $n : u(P) = (X-a)P' = nQP' = nP$ donc $P \in \text{Ker}(u - n \text{id}) = \text{Vect}((X-a)^n)$.
Les polynômes divisibles par leur dérivée sont donc les $\lambda(X-a)^n$ où $\lambda \in \mathbb{C}, a \in \mathbb{C}, n \in \mathbb{N}$.

25. RMS 2007 934 CCP PC

Soit $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ telle que $A^2 + I_n$ ne soit pas inversible.

- (a) Montrer qu'il existe $X \in \mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{C})$ tel que $AX = iX$ et $X \neq 0$.
- (b) Montrer qu'il existe U et V dans $\mathcal{M}_{1,n}(\mathbb{R})$ libres tels que $AU = -V$ et $AV = U$.

SOLUTION —

- (a) La matrice $A^2 + I_n$ se factorise dans $\mathcal{M}_n(\mathbb{C})$ sous la forme $(A - iI_n)(A + iI_n)$. Comme elle n'est pas inversible, c'est que $\det(A^2 + I_n) = \det(A - iI_n)\det(A + iI_n) = 0$. L'un des deux facteurs de ce produit est donc nul.
Si $\det(A - iI_n) = 0$, c'est que i est une valeur propre complexe de A , donc il existe un vecteur $X \in \mathcal{M}_{1,n}(\mathbb{C})$ non nul tel que $AX = iX$.
Si $\det(A + iI_n) = 0$, alors il existe de même un vecteur $Y \in \mathcal{M}_{1,n}(\mathbb{C})$ non nul tel que $AY = -iY$. D'où $A\bar{Y} = i\bar{Y}$.
- (b) On écrit le vecteur X de la question (a) sous la forme $U + iV$ avec U et V dans $\mathcal{M}_{1,n}(\mathbb{R})$. La relation $AX = iX$ se traduit alors par $A(U + iV) = i(U + iV)$, c'est-à-dire par

$$\begin{aligned} AU &= -V \\ AV &= U. \end{aligned}$$

Il est impossible que U ou V soit nul, sinon U et V le seraient, donc X serait nul, ce qui n'est pas le cas. Par suite, si (U, V) est une famille liée, on peut supposer sans perte de généralité que $U = kV$ avec $k \in \mathbb{R}$. De la première équation ci-dessus, on tire $AV = -V/k$, et de la seconde, $AV = kV$, d'où l'on déduit $(1 + k^2)V = 0$, donc $V = 0$ (puisque k est réel), mais on vient de voir que cela est impossible.

La famille (U, V) est donc libre.

Un exercice en rapport : RMS 2010 991 CCP PSI

Soit $A \in \mathcal{M}_3(\mathbb{R})$ telle que $A \neq 0$ et $A^3 + A = 0$.

(a) La matrice A est-elle diagonalisable ?

(b) Montrer que A est semblable à $\begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \\ 0 & -1 & 0 \end{pmatrix}$.

SOLUTION —

(a) Le polynôme $X^3 + X = X(X + i)(X - i) \in \mathbb{C}[X]$ est scindé à racines simples et annulateur de A , qui est donc diagonalisable.

(b) On note u l'endomorphisme canoniquement associé à A . La matrice A admet nécessairement une valeur propre réelle car sa taille est impaire, donc son polynôme caractéristique est un polynôme de $\mathbb{R}[X]$ de degré impair. Cette valeur propre est parmi les racines de $X^3 + X$, polynôme annulateur de A . Par suite, zéro est valeur propre de A ; soit e_1 un vecteur propre associé. Il s'agit ensuite de montrer qu'il existe e_2 et e_3 tels que (e_1, e_2, e_3) soit une base de \mathbb{R}^3 et tels que $u(e_2) = -e_3$ et $u(e_3) = e_2$.

Analyse. Si ces vecteurs existent, alors $e_3 = -u(e_2)$, et $u^2(e_2) = -e_2$, donc $e_2 \in \text{Ker}(u^2 + \text{id})$.

Synthèse. On commence par montrer que $\text{Ker}(u^2 + \text{id})$ n'est pas réduit à $\{0\}$, c'est-à-dire que $u^2 + \text{id}$ n'est pas un isomorphisme. Si c'était le cas, comme $A^3 + A = 0$ donc $u \circ (u^2 + \text{id}) = 0$, on en déduirait que $u = 0$, ce que l'énoncé exclut. On choisit ensuite un vecteur non nul $e_2 \in \text{Ker}(u^2 + \text{id})$ et on pose $e_3 = -u(e_2)$. On montre enfin que (e_1, e_2, e_3) est une base. Soit $(\lambda_1, \lambda_2, \lambda_3) \in \mathbb{R}^3$ tel que $\sum_{i=1}^3 \lambda_i e_i = 0$. En appliquant u , puis u^2 , et en utilisant la relation $u^2(e_2) = -u(e_3) = -e_2$, on obtient

$$(L_1) \quad -\lambda_2 e_3 - \lambda_3 e_2 = 0$$

$$(L_2) \quad -\lambda_2 e_2 + \lambda_3 e_3 = 0.$$

La combinaison $\lambda_3(L_1) + \lambda_2(L_2)$ conduit à $-(\lambda_2^2 + \lambda_3^2)e_2 = 0$, donc à $\lambda_2 = \lambda_3 = 0$ puisque $e_2 \neq 0$. Il reste $\lambda_1 e_1 = 0$, d'où $\lambda_1 = 0$, puisque e_1 est un vecteur propre.

26. RMS 2010 1043 Petites Mines PC

Soient un entier $n \geq 2$, un réel m et la matrice $A = (a_{i,j})_{1 \leq i,j \leq n} \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ où $a_{i,j} = 1$ si $(i,j) \in \{1, \dots, n\} \times \{1, \dots, n-1\}$ et $a_{i,n} = m$ si $1 \leq i \leq n$.

(a) On suppose que $m \neq 1 - n$. Montrer que A est diagonalisable.

(b) On suppose que $m = 1 - n$. Montrer que la matrice A est semblable à la matrice $B = (b_{i,j})_{1 \leq i,j \leq n}$ dont tous les coefficients sont nuls excepté $b_{1,2} = 1$.

27. RMS 2016 904 CCEM PSI

Soit $a \in \mathbb{R}$. Soit M une matrice carrée dont la première ligne est $(a, 0, \dots, 0)$ la deuxième $(1, \dots, 1)$, et toutes les autres $(1, 0, \dots, 0)$. Trouver une condition nécessaire et suffisante sur a pour que M soit diagonalisable.

28. RMS 2014 1331 TPE PC

Soient $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{C})$ et $\Phi_A: M \in \mathcal{M}_n(\mathbb{C}) \mapsto AM \in \mathcal{M}_n(\mathbb{C})$.

(a) Montrer que Φ_A est un endomorphisme de $\mathcal{M}_n(\mathbb{C})$. Déterminer les $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{C})$ tels que $\Phi_A = 0$.

(b) Si $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{C})$ et $P \in \mathbb{C}[X]$, comparer $\Phi_{P(A)}$ et $P(\Phi_A)$.

(c) Montrer que Φ_A est diagonalisable si et seulement si A est diagonalisable.

SOLUTION —

(a) L'application Φ_A va de $\mathcal{M}_n(\mathbb{C})$ dans lui-même, et sa linéarité résulte de la bilinéarité du produit matriciel, c'est donc un endomorphisme de $\mathcal{M}_n(\mathbb{C})$.

Si $\Phi_A = 0$, alors $\Phi_A(I_n) = AI_n = A = 0$. Réciproquement, il est clair que $A = 0 \implies \Phi_A = 0$.

(b) Une récurrence donne $(\Phi_A)^k = \Phi_{A^k}$ pour $k \in \mathbb{N}^*$, et on constate que $\Phi_{\lambda A + \mu B} = \lambda \Phi_A + \mu \Phi_B$ pour tous $(A, B) \in \mathcal{M}_n(\mathbb{C})^2$ et $(\lambda, \mu) \in \mathbb{R}^2$.

En combinant les deux résultats, on obtient

$$\forall A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{C}), \quad \forall P \in \mathbb{C}[X], \quad \Phi_{P(A)} = P(\Phi_A).$$

(c) Si A est diagonalisable, alors il existe un polynôme scindé à racines simples $P \in \mathbb{C}[X]$ tel que $P(A) = 0$. On déduit de la question précédente que $P(\Phi_A) = \Phi_{P(A)} = \Phi_0 = 0$, donc que Φ_A est diagonalisable.

Réciproquement, si Φ_A est diagonalisable, alors il existe un polynôme scindé à racines simples $P \in \mathbb{C}[X]$ tel que $P(\Phi_A) = 0$. On en déduit que $\Phi_{P(A)} = 0$, donc que $P(A) = 0$ en vertu de la question (a), donc que A est diagonalisable.

29. RMS 2013 970 TPE EIVP PSI

Discuter, dans $\mathcal{M}_3(\mathbb{R})$, la diagonalisabilité et la trigonalisabilité en fonction du paramètre réel a de $\begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \\ 1 & -a & a \end{pmatrix}$.

30. RMS 2011 1079 CCP PSI, RMS 2013 648 Mines Ponts PC, RMS 2014 1225 CCP PSI, RMS 2016 919 ENSEA PSI

Soit $M \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ telle que $M \cdot M^T \cdot M = I_n$. Montrer que M est symétrique. Déterminer M .

31. RMS 2016 898 CCP PSI

Mots-clés : hyperplan stable

- (a) Soient H un hyperplan d'un \mathbb{C} -espace vectoriel E de dimension finie, et u un endomorphisme de E . Montrer que $u(H) \subset H \iff \exists \lambda \in \mathbb{C}, \text{Im}(u - \lambda \text{id}) \subset H$.
- (b) Trouver tous les sous-espaces stables par l'endomorphisme u représenté dans une base B par

$$\begin{pmatrix} 3 & 1 & 2 \\ 1 & 1 & 0 \\ -1 & 1 & 2 \end{pmatrix}.$$

32. RMS 2015 686 Mines Ponts PC

Mots-clés : hyperplan stable

Soient $n \geq 2$, $\Phi \in \mathcal{L}(\mathbb{R}^n, \mathbb{R})$ non nulle et $H = \text{Ker } \Phi$.

Soit $f \in \mathcal{L}(\mathbb{R}^n)$. Montrer que f stabilise H si et seulement s'il existe $\lambda \in \mathbb{R}$ tel que $\Phi \circ f = \lambda \Phi$.

33. RMS 2024 65 ENS MP MPI

Soient $n \in \mathbb{N}^*$, $M = (m_{ij}) \in \mathcal{O}_{n+1}(\mathbb{R})$ la matrice d'une réflexion et $A \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R})$. On pose $B = M \cdot \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & A \end{pmatrix}$.

Montrer que $\chi_B(1) = \chi_A(0) \cdot \chi_A(1) \cdot (1 - m_{11})$.

1.3 Algèbre bilinéaire

34. RMS 2014 659 Mines Ponts PSI v2026

- (a) Étudier $\inf\{\mu \in \mathbb{R}_+ \mid \forall A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R}), (\text{tr } A)^2 \leq \mu \text{tr}(A^T A)\}$.
- (b) En utilisant une inégalité arithmético-géométrique, étudier $\sup\{\mu \in \mathbb{R}_+ \mid \forall A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R}), \mu \sqrt{\det(A^T A)} \leq \text{tr}(A^T A)\}$.

SOLUTION — (Voir aussi l'exercice 41.)

- (a) Comme $\text{tr } A = \langle I_n, A \rangle$ (produit scalaire canonique), par l'inégalité de CAUCHY-SCHWARZ, $(\text{tr } A)^2 \leq \|I_n\|^2 \|A\|^2 = n \text{tr}(A^T A)$. On en déduit que la borne inférieure existe et elle vaut n car il y a égalité si $A = I_n$ (plus généralement, ssi la famille de (A, I_n) est liée).
- (b) La matrice $A^T A$ est symétrique, d'où $\exists P \in \mathcal{O}_n, P^T(A^T A)P = \text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$. De plus, chaque valeur propre λ_i est positive car $A^T A \in S_n^+$. D'où $\sqrt[n]{\prod_{i=1}^n \lambda_i} \leq \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \lambda_i$ d'après l'inégalité arithmético-géométrique. Or $\det(A^T A) = \prod_{i=1}^n \lambda_i$ et $\text{tr}(A^T A) = \sum_{i=1}^n \lambda_i$. D'où l'inégalité si $\mu = n$, qui est la borne supérieure demandée car l'inégalité est une égalité si $A = I_n$.

Un exercice en rapport : RMS 2013 652 Mines Ponts PC

Soient A et B dans $\mathcal{S}_n(\mathbb{R})$. Montrer que $2 \text{tr}(AB) \leq \text{tr}(A^2) + \text{tr}(B^2)$.

SOLUTION — On sait que le produit scalaire canonique sur $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ a pour expression $\langle A, B \rangle = \text{tr}({}^t A B)$. Si A et B appartiennent à $\mathcal{S}_n(\mathbb{R})$, leur produit scalaire et leur norme sont donnés par $\langle A, B \rangle = \text{tr}(AB)$ et $\|A\|^2 = \text{tr}(A^2)$, $\|B\|^2 = \text{tr}(B^2)$. L'inégalité de Cauchy et Schwarz, puis l'inégalité arithmético-géométrique entraînent que

$$\text{tr}(AB) \leq |\text{tr}(AB)| = |\langle A, B \rangle| \leq \|A\| \|B\| \leq \frac{1}{2} (\|A\|^2 + \|B\|^2) = \frac{\text{tr}(A^2) + \text{tr}(B^2)}{2}.$$

35. RMS 2014 913 Centrale PSI

- (a) Montrer que l'intégrale $\int_0^1 P(t) \ln(t) dt$ converge pour tout $P \in \mathbb{R}[X]$.
- (b) Soit $n \in \mathbb{N}$. Montrer qu'il existe un unique $Q \in \mathbb{R}_n[X]$ tel que, pour tout $P \in \mathbb{R}_n[X]$, $\int_0^1 P(t) \ln(t) dt = \int_0^\pi P(t) Q(t) \sin t dt$.

36. RMS 2006 CCP PC, RMS 2010 1055 Télécom Sud Paris PC

Soient $(E, \langle \cdot, \cdot \rangle)$ un espace euclidien de dimension n , p un projecteur orthogonal de rang r et (e_1, \dots, e_n) une base orthonormale de E . Montrer que $\sum_{i=1}^n \|p(e_i)\|^2 = r$.

37. RMS 2011 1126 CCP PC

Soit $(E, \langle \cdot, \cdot \rangle)$ un espace euclidien, H_1 et H_2 deux hyperplans distincts, e_1 et e_2 deux vecteurs unitaires respectivement orthogonaux à H_1 et H_2 . On pose

$$s_1 : x \mapsto x - 2\langle x, e_1 \rangle e_1 \quad \text{et} \quad s_2 : x \mapsto x - 2\langle x, e_2 \rangle e_2.$$

- (a) Vérifier que le plan $\text{Vect}(e_1, e_2)$ est stable par $s_2 \circ s_1$.
 (b) Montrer que $x \in E$ est fixe par $s_2 \circ s_1$ si et seulement si $x \in H_1 \cap H_2$.

SOLUTION — On reconnaît en s_k la symétrie orthogonale par rapport à l'hyperplan H_k .

(a)

$$\begin{aligned} (s_2 \circ s_1)(e_1) &= s_2(-e_1) = -e_1 + 2\langle e_1, e_2 \rangle e_2 \\ (s_2 \circ s_1)(e_2) &= s_2(e_2 - 2\langle e_1, e_2 \rangle e_1) = -e_2 - 2\langle e_1, e_2 \rangle (e_1 - 2\langle e_1, e_2 \rangle e_2). \end{aligned}$$

On lit ci-dessus que les images par $s_2 \circ s_1$ de e_1 et e_2 appartiennent à $\text{Vect}(e_1, e_2)$ qui est donc stable par $s_2 \circ s_1$.

- (b) Sens direct. Si x est fixe par $s_2 \circ s_1$, alors $s_2(s_1(x)) = x$, donc $s_1(x) = s_2(x)$, en composant à gauche par s_2 et en utilisant l'égalité $s_2^2 = \text{id}_E$. D'où $x - 2\langle x, e_1 \rangle e_1 = x - 2\langle x, e_2 \rangle e_2$, donc

$$\langle x, e_1 \rangle e_1 = \langle x, e_2 \rangle e_2.$$

Comme H_1 et H_2 sont deux hyperplans distincts, e_1 et e_2 ne sont pas colinéaires, et on en déduit que $\langle x, e_1 \rangle = \langle x, e_2 \rangle = 0$, donc que $x \in H_1 \cap H_2$.

Sens réciproque. Si $x \in H_1 \cap H_2$, alors $s_1(x) = x$ car $x \in H_1$, puis $s_2(s_1(x)) = s_2(x) = x$, car $x \in H_2$. Finalement, x est fixe par $s_2 \circ s_1$.

38. RMS 2016 761 Centrale PSI

Soient p et q deux projections orthogonales définies sur un espace euclidien E . Soit $u = p + q$.

- (a) Soit x un vecteur de norme 1. Encadrer $\langle x | p(x) \rangle$ et $\langle x | q(x) \rangle$. En déduire que $\text{Sp}(u) \subset [0, 2]$.
 (b) Montrer que $\text{Ker}(u) = \text{Ker}(p) \cap \text{Ker}(q)$.
 (c) Déterminer $\text{Ker}(u - 2 \text{id})$.

SOLUTION —

- (a) (Faire un dessin.) Pour tout $x \in E$ unitaire, $\langle x | p(x) \rangle = \|p(x)\|^2 \leq \|x\|^2$, d'où $\langle x | p(x) \rangle \in [0; 1]$ et, de même, $\langle x | q(x) \rangle \in [0; 1]$

En particulier si λ est valeur propre de u et si x est un vecteur propre unitaire associé :

$$\lambda = \langle x | u(x) \rangle = \langle x | p(x) \rangle + \langle x | q(x) \rangle \in [0; 2].$$

- (b) Si $x \in E_0(u)$, on a $0 = \langle x | u(x) \rangle = \langle x | p(x) \rangle + \langle x | q(x) \rangle$ avec $\langle x | p(x) \rangle \geq 0$ et $\langle x | q(x) \rangle \geq 0$, donc nécessairement $\langle x | p(x) \rangle = \langle x | q(x) \rangle = 0$, ce qui prouve $x \in \text{Ker}(p) \cap \text{Ker}(q)$. Réciproquement $\text{Ker}(p) \cap \text{Ker}(q) \subset \text{Ker}(u)$, d'où l'égalité.
 (c) On remplace p et q par $\text{id} - p$ et $\text{id} - q$, qui sont aussi des projections orthogonales. Donc $\text{Ker}(u - 2 \text{id}) = \text{Im}(p) \cap \text{Im}(q)$.

39. RMS 2008 975 CCP PSI, RMS 2015 715 Mines Ponts PC, RMS 2015 1033, TPE PC, RMS 2016 558 Mines Ponts PC

Soit $A = (a_{i,j})_{1 \leq i, j \leq n} \in O_n(\mathbb{R})$. Montrer que

$$\left| \sum_{1 \leq i, j \leq n} a_{i,j} \right| \leq n = \sum_{1 \leq i, j \leq n} a_{i,j}^2 \leq \sum_{1 \leq i, j \leq n} |a_{i,j}| \leq n^{3/2}.$$

SOLUTION — La norme euclidienne canonique de chaque colonne de A vaut 1. En sommant sur les n colonnes de A , on obtient

$$\sum_{1 \leq i, j \leq n} a_{i,j}^2 = n$$

Soit $U \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ le vecteur colonne dont toutes les composantes valent 1. Si $\langle \cdot, \cdot \rangle$ désigne le produit scalaire canonique sur $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$, on constate que ${}^t U A U = \langle U, A U \rangle = \sum_{1 \leq i, j \leq n} a_{i, j}$. Comme A est orthogonale, elle conserve la norme donc $\|A U\| = \|U\| = \sqrt{n}$. L'inégalité de Cauchy-Schwarz donne alors :

$$\left| \sum_{1 \leq i, j \leq n} a_{i, j} \right| = |\langle U, A U \rangle| \leq \|U\| \|A U\| = \|U\|^2 = n.$$

Comme $A \in O_n(\mathbb{R})$, tous ses éléments appartiennent à $[-1, 1]$. Par suite, $a_{i, j}^2 \leq |a_{i, j}|$ pour tout (i, j) . Alors

$$n = \sum_{j=1}^n \left(\sum_{i=1}^n a_{i, j}^2 \right) \leq \sum_{1 \leq i, j \leq n} |a_{i, j}|.$$

Enfin, on note $S = (s_{i, j})_{1 \leq i, j \leq n}$ la matrice de signes définie par $s_{i, j} = \text{signe}(a_{i, j}) \in \{-1, 1\}$, avec un choix arbitraire si $a_{i, j} = 0$. Alors $\sum_{1 \leq i, j \leq n} |a_{i, j}| = \text{tr}({}^t A S)$. Comme on sait que $(A, B) \in (\mathcal{M}_n(\mathbb{R}))^2 \mapsto \text{tr}({}^t A B)$ est un produit scalaire, l'inégalité de Cauchy et Schwarz donne

$$\sum_{1 \leq i, j \leq n} |a_{i, j}| = \text{tr}({}^t A S) \leq \sqrt{\text{tr}({}^t A A)} \sqrt{\text{tr}({}^t S S)} = \sqrt{\text{tr}(I_n)} \sqrt{\text{tr}(nJ)} = \sqrt{n} \sqrt{n^2} = n^{3/2}.$$

40. RMS 2009 1027 Centrale PC

Soit $(E, \langle \cdot, \cdot \rangle)$ un espace euclidien.

- (a) Soit $g \in \mathcal{L}(E)$ autoadjoint tel que $\langle g(z), z \rangle = 0$ pour tout $z \in E$. Montrer que $g = 0$.
- (b) Soit $g \in \mathcal{L}(E)$ autoadjoint tel que $\langle g(z), z \rangle = \|g(z)\|^2$ pour tout $z \in E$. Montrer que g est un projecteur.

41. RMS 2013 986 CCP PSI, RMS 2015 992 CCP PSI, RMS 2016 918 CCEM PSI v2026

- (a) Soit $A \in \mathcal{S}_n(\mathbb{R})$. Montrer que $(\text{tr } A)^2 \leq \text{rg } A \cdot \text{tr}(A^2)$.
- (b) Étudier $\inf\{\lambda \in \mathbb{R}_+ \mid \forall A \in \mathcal{M}_2(\mathbb{R}), |\det A| \leq \lambda \text{tr}({}^t A A)\}$.

42. OdT 2013 19 149 TPE PSI

Mots-clés : matrice symétrique semblable à sa diagonale

Soit S symétrique réelle et D diagonale dont les coefficients sont ceux de la diagonale de S . On suppose S et D semblables. Calculer $\text{tr}(S^2)$ de deux manières et en déduire que $S = D$.

43. RMS 2010 1028 TPE PSI

Soit $(a, b, c) \in \mathbb{R}^3$ tel que $a^2 + b^2 + c^2 = 1$. Écrire la matrice dans la base canonique de la rotation d'angle π et d'axe dirigé par le vecteur (a, b, c) .

44. RMS 2014 180 ENS PC

Soient $n \in \mathbb{N}^*$, $A \in S_n^{++}(\mathbb{R})$. On munit \mathbb{R}^n de sa structure euclidienne canonique et on note \mathcal{S} la sphère unité de \mathbb{R}^n . Montrer que l'application $\Phi: (t, X_0) \in \mathbb{R} \times \mathcal{S} \mapsto e^{tA} X_0 \in \mathbb{R}^n \setminus \{0\}$ est bijective.

45. RMS 2024 314 X MP MPI

Soient p et q deux projecteurs orthogonaux dans un espace euclidien E . Montrer que :

- (a) l'endomorphisme $p \circ q \circ p$ est autoadjoint positif ;
- (b) $E = \text{Im } p + \text{Ker } q + (\text{Im } q \cap \text{Ker } p)$;
- (c) l'endomorphisme $p \circ q$ est diagonalisable ;
- (d) le spectre de $p \circ q$ est inclus dans $[0, 1]$.

SOLUTION —

- (a) Les projecteurs p et q sont autoadjoints (car orthogonaux), d'où $(p \circ q \circ p)^* = p^* \circ q^* \circ p^* = p \circ q \circ p$ et, pour tout vecteur $x \in E$, $\langle p \circ q \circ p(x) | x \rangle = \langle q \circ p(x) | p^*(x) \rangle = \langle q(y) | y \rangle$ en notant $y = p(x) = p^*(x)$. Or $\langle q(y) | y \rangle = \|q(y)\|_2^2$ car $y - q(y) \perp q(y)$. D'où $\langle p \circ q \circ p(x) | x \rangle \geq 0$. Donc $p \circ q \circ p \in S^+(E)$.
- (b) Pour tous $sev F$ et G , $(F+G)^\perp = F^\perp \cap G^\perp$. En particulier, si $F = \text{Im } p$ et $G = \text{Ker } q$, alors $(\text{Im } p + \text{Ker } q)^\perp = \text{Ker } p \cap \text{Im } q$ car $F^\perp = \text{Ker } p$ et $G^\perp = \text{Im } q$.

- (c) Le *sev* $\text{Im } p$ est stable par $p \circ q$ et $\forall x \in \text{Im } p$, $p \circ q(x) = p \circ q \circ p(x)$ car $p^2 = p$. Or l'endomorphisme $p \circ q \circ p$ est diagonalisable car autoadjoint d'après la première question. Sa restriction au *sev* stable $\text{Im } p$ l'est donc aussi \triangleright **proposition IV.40**. Il existe ainsi une base de $\text{Im } p$ formée de vecteurs propres de $p \circ q$. D'après la deuxième question, on peut compléter cette base de $\text{Im } p$ en une base de E en y adjoignant de nouveaux vecteurs pris dans le *sev* $\text{Ker } q + (\text{Im } q \cap \text{Ker } p)$. Or ces nouveaux vecteurs sont tous des vecteurs propres de $p \circ q$ associés à la valeur propre 0. On obtient ainsi une base de l'*ev* E formée de vecteurs propres de $p \circ q$, ce qui prouve que $p \circ q$ est diagonalisable.
- (d) En répondant à la troisième question, on a constaté que les vecteurs propres de $p \circ q$ associés à des valeurs propres autres que 0 appartiennent tous au *sev* $\text{Im } p$ et que leurs valeurs propres sont aussi des valeurs propres de $p \circ q \circ p$. Elles sont donc positives d'après la première question. D'où $\text{Sp}(p \circ q) \subset \mathbb{R}_+$. Enfin, pour tout $x \in E$, $\|q(x)\|_2 \leq \|x\|_2$ car le projecteur q est orthogonal. De même, $\|p(q(x))\|_2 \leq \|q(x)\|_2$. Par transitivité, $\|p \circ q(x)\|_2 \leq \|x\|_2$. D'où $|\lambda| \leq 1$ pour tout $\lambda \in \text{Sp}(p \circ q)$.

46. RMS 2026 602 Mines Ponts MP MPI

- (a) Montrer que $\mathcal{S}_n^+(\mathbb{R})$ est convexe.
- (b) Soient $U, V \in \mathcal{S}_n^+(\mathbb{R})$. Montrer qu'il existe $R \in \mathcal{S}_n^+(\mathbb{R})$ tel que $U = R^2$ et en déduire $\text{tr}(UV) \geq 0$.
- (c) Soient $k \in \mathbb{N}$, I un intervalle ouvert de \mathbb{R} , $f : I \rightarrow \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ dérivable et $\alpha : t \mapsto \text{tr}(f(t)^k)$.
Montrer que : $\forall t \in I$, $\alpha'(t) = k \text{tr}(f'(t)f(t)^{k-1})$.
- (d) Soient $A, B \in \mathcal{S}_n^+(\mathbb{R})$ telles que $B - A \in \mathcal{S}_n^+(\mathbb{R})$. Montrer que : $\text{tr}(e^A) \leq \text{tr}(e^B)$. (On pourra utiliser la fonction $f : t \in [0, 1] \mapsto (1-t)A + tB = A + t(B-A)$.)

SOLUTION —

- (a) Soient $A, B \in \mathcal{S}_n^+(\mathbb{R})$. Alors, pour tout $t \in [0, 1]$, $f(t) = (1-t)A + tB = A + t(B-A) \in \mathcal{S}_n(\mathbb{R})$ car $\mathcal{S}_n(\mathbb{R})$ est un *sev* de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$. Pour tout $X \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$, $X^T f(t) X = (1-t)X^T A X + tX^T B X \geq 0$. En effet, $X^T A X \geq 0$ car $A \in \mathcal{S}_n^+(\mathbb{R})$ et $1-t \geq 0$ et, de même, $X^T B X \geq 0$ et $t \geq 0$. Donc $f(t) \in \mathcal{S}_n^+(\mathbb{R})$.
- (b) Par le théorème spectral, on dispose de $P \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R})$ tel que

$$U = P \text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_n) P^T$$

avec $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ les valeurs propres positives de U . Ainsi, en posant

$$R = P \text{diag}(\sqrt{\lambda_1}, \dots, \sqrt{\lambda_n}) P^T,$$

R est bien symétrique positive (à spectre dans \mathbb{R}_+) et $R^2 = U$.

Alors $\text{tr}(UV) = \text{tr}(R^2V) = \text{tr}(RV R)$. La matrice $RV R$ est symétrique positive. En effet,

$$\forall x \in \mathbb{R}^n, \quad x^T (RV R)x = (Rx)^T V (Rx) \geq 0.$$

La trace d'une matrice symétrique positive étant positive (car somme de valeurs propres positives), on peut conclure.

- (c) La trace étant linéaire et f dérivable, α est dérivable de dérivée :

$$\alpha' : t \mapsto \text{tr} \left(\sum_{j=0}^{k-1} f(t)^j f'(t) f(t)^{k-1-j} \right) = \sum_{j=0}^{k-1} \text{tr} (f'(t) f(t)^{k-1}) = k \text{tr} (f'(t) f(t)^{k-1}).$$

Par linéarité, on obtient plus généralement pour $P \in \mathbb{R}[X]$:

$$\alpha'(t) = \text{tr}(f'(t)P'(f(t)))$$

- (d) Soient $A, B \in \mathcal{S}_n^+(\mathbb{R})$ telles que $B - A \in \mathcal{S}_n^+(\mathbb{R})$. On considère

$$f : t \in [0, 1] \mapsto (1-t)A + tB = A + t(B-A) \in \mathcal{S}_n^+(\mathbb{R})$$

(puisque c'est une partie convexe).

On applique la question précédente avec $P_k = \sum_{j=0}^k \frac{X^j}{j!}$. Ainsi, $\alpha_k : t \mapsto \text{tr}(P_k(f(t)))$ est dérivable de dérivée

$$\alpha'_k : t \mapsto \text{tr}(f'(t)P'_k(f(t))) = \text{tr}((B - A)P'_k(f(t)))$$

Or $f(t) \in \mathcal{S}_n^+(\mathbb{R})$ et P'_k est à coefficients positifs; on en déduit que $P'_k(f(t)) \in \mathcal{S}_n^+(\mathbb{R})$. Donc, par la première question, pour tout $t \in [0, 1]$, $\alpha'_k(t) \geq 0$; ainsi

$$\text{tr}(P_k(A)) = \alpha_k(0) \leq \alpha_k(1) = \text{tr}(P_k(B)).$$

Comme la trace est continue car linéaire en dimension finie, on peut faire tendre k vers l'infini et on obtient $\text{tr}(e^A) \leq \text{tr}(e^B)$.

47. RMS 2026 448 X ESPCI PC, RMS 2016 885 ENSAM PSI

Soient $n \geq 2$ et les deux matrices de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ définies par

$$J = \begin{pmatrix} 0 & \cdots & \cdots & 0 & 1 \\ 1 & \ddots & & & 0 \\ 0 & \ddots & \ddots & & \vdots \\ \vdots & \ddots & \ddots & \ddots & \vdots \\ 0 & \cdots & 0 & 1 & 0 \end{pmatrix} \quad \text{et} \quad A = \begin{pmatrix} a_0 & a_{n-1} & \cdots & a_2 & a_1 \\ a_1 & \ddots & \ddots & & a_2 \\ a_2 & \ddots & \ddots & \ddots & \vdots \\ \vdots & \ddots & \ddots & \ddots & a_{n-1} \\ a_{n-1} & \cdots & a_2 & a_1 & a_0 \end{pmatrix}.$$

- La matrice J est-elle diagonalisable dans $\mathcal{M}_n(\mathbb{C})$? Quel est son spectre?
- La matrice A est-elle diagonalisable dans $\mathcal{M}_n(\mathbb{C})$? Quel est son spectre?
- Montrer que $\Sigma = \{(a_1, \dots, a_n) \in \mathbb{R}^n \mid \sum_{i=1}^n a_i = 0 \text{ et } \sum_{i=1}^n a_i^2 = 1\}$ est un compact de \mathbb{R}^n .
- Montrer que la fonction $f : (a_1, \dots, a_n) \in \Sigma \mapsto a_1 a_2 + a_2 a_3 + \cdots + a_{n-1} a_n + a_n a_1$ possède un maximum, égal à $\cos \frac{2\pi}{n}$. (On pourra commencer par déterminer le spectre de la matrice $\frac{1}{2}(J + J^T)$.)

SOLUTION —

- (Si on remarque que $J^n = I_n$, alors on peut d'emblée affirmer que la matrice J est diagonalisable dans $\mathcal{M}_n(\mathbb{C})$ car le polynôme $X^n - 1$ est annulateur, scindé à racines simples dans \mathbb{C} .) Sinon, on peut reconnaître une matrice compagnon et on effectue $L_1 \leftarrow L_1 + zL_2 + \cdots + z^{n-1}L_n$ pour calculer

$$\chi_J(z) = \begin{vmatrix} z & \cdots & \cdots & 0 & -1 \\ -1 & z & \ddots & & 0 \\ 0 & \ddots & \ddots & & \vdots \\ \vdots & \ddots & \ddots & \ddots & \vdots \\ 0 & \cdots & 0 & -1 & z \end{vmatrix} = \begin{vmatrix} 0 & \cdots & \cdots & 0 & z^n - 1 \\ -1 & z & \ddots & & 0 \\ 0 & \ddots & \ddots & & \vdots \\ \vdots & \ddots & \ddots & \ddots & \vdots \\ 0 & \cdots & 0 & -1 & z \end{vmatrix} = z^n - 1$$

en développant selon L_1 .

La matrice J est diagonalisable dans $\mathcal{M}_n(\mathbb{C})$ car χ_J possède n racines distinctes deux à deux, à savoir les racines n -ièmes de l'unité : $e^{ik2\pi/n}$, avec $k \in \llbracket 0, n-1 \rrbracket$.

- La matrice J^k est obtenue à partir de J en décalant les deux rangées de 1 de $k-1$ crans vers le bas.

Donc $P(J) = A$ si $P = a_0 + a_1 X + \cdots + a_{n-1} X^{n-1}$.

Les valeurs propres de A sont les $P(\omega)$ où $\omega \in \mathbb{U}_n$ et la matrice A est diagonalisable car les vecteurs propres de J sont aussi des vecteurs propres de A , or les vecteurs propres de J forment une base.

- On introduit les deux fonctions g et h définies par

$$g(a_1, \dots, a_n) = \sum_{i=1}^n a_i \quad \text{et} \quad h(a_1, \dots, a_n) = \sum_{i=1}^n a_i^2.$$

Elles sont continues, donc les ensembles $G = g^{-1}(\{0\})$ et $H = h^{-1}(\{1\})$ sont des fermés. Donc l'ensemble $\Sigma = G \cap H$ est aussi un fermé.

- (d) Si $X = (a_0, \dots, a_{n-1})$, alors $X^T J X = a_0 a_1 + \dots + a_{n-1} a_0 =: S$. Pour traiter avec une matrice symétrique, il est préférable d'écrire $S = \frac{1}{2} X^T (J + J^T) X$.
 Puisque les valeurs propres de J sont les $\omega_k := e^{\frac{2ik\pi}{n}}$. Celles de $M = \frac{1}{2} (J + J^T) = \frac{1}{2} (J + J^{-1})$ sont les $c_k := \cos \frac{2k\pi}{n}$. Comme M est symétrique réelle, il existe une base orthonormée de vecteurs propres pour M . Comme $G_0 = \frac{1}{\sqrt{n}}(1, \dots, 1)^T$ est vecteur propre associé à la valeur propre simple c_0 , on peut le prendre comme premier vecteur d'une telle base (G_0, \dots, G_{n-1}) . Il s'agit de maximiser $X^T M X$ lorsque X décrit les vecteurs de norme 1 tels que $\sum_{j=0}^{n-1} x_j = 0$. Cette dernière condition équivaut à $\langle X, G_0 \rangle = 0$. Les vecteurs X concernés sont ceux qui s'écrivent

$$X = \sum_{j=1}^{n-1} y_j G_j, \text{ avec } \sum_{j=1}^{n-1} y_j^2 = 1,$$

et alors

$$X^T M X = \sum_{j=1}^{n-1} c_j y_j^2 \leq c_1$$

avec égalité si (mais pas seulement si, puisque $c_{n-1} = c_1$) $X = G_1$. Par suite, le maximum cherché est $c_1 = \cos \frac{2\pi}{n}$.

1.4 Espaces vectoriels normés

48. RMS 2009 1031 Centrale PC

Mots-clés : continuité d'une application linéaire

Soit $E = \mathcal{C}^1([0, 1], \mathbb{R})$. Si $f \in E$, on pose $\|f\|_2 = \sqrt{\int_0^1 f^2}$ et $\|f\|_\infty = \sup_{t \in [0, 1]} |f(t)|$. On fixe un réel α dans $[0, 1]$.

- (a) On pose $f_n : x \in [0, 1] \mapsto \frac{1}{\sqrt{1 + [n(x - \alpha)]^2}}$. Montrer que $\|f_n\|_2$ tend vers zéro.
 (b) L'application $\Phi : f \in E \mapsto f(\alpha) \in \mathbb{R}$ est-elle continue pour la norme $\|\cdot\|_2$?
 (c) Existe-t-il un réel $C > 0$ tel que $\forall f \in E, \|f\|_\infty \leq C \|f\|_2$?
 (d) Soit $n \in \mathbb{N}$. Existe-t-il $C > 0$ tel que $\forall P \in \mathbb{R}_n[X], \|P\|_\infty \leq C \|P\|_2$?

49. RMS 2024 102 ENS MP MPI

Soit f la fonction de \mathbb{R}_+^* vers \mathbb{R} nulle sur $\mathbb{R} \setminus \mathbb{Q}$ et définie par $f\left(\frac{p}{q}\right) = \frac{1}{p+q}$ si $p \in \mathbb{N}$ et $q \in \mathbb{N}^*$ sont premiers entre eux.

Quels sont les points de continuité de f ?

50. RMS 2025 635 Mines-Ponts MP-MPI

Soient E un espace vectoriel normé et f une forme linéaire continue non nulle. Soit $x_0 \in E$ tel que $f(x_0) \neq 0$.

- (a) Montrer que : $\|f\|_{op} = \frac{|f(x_0)|}{d(x_0, \text{Ker} f)}$.
 (b) Montrer que les deux propriétés (i) $\exists a \in E, \|f\|_{op} = \frac{|f(a)|}{\|a\|}$ et (ii) $\exists y \in \text{Ker} f, d(x_0, \text{Ker} f) = \|x_0 - y\|$ sont équivalentes.

51. UPS 20250506

Soit E le \mathbb{R} -espace vectoriel des fonctions bornées de \mathbb{R}_+ vers \mathbb{R} , muni de la norme $\|\cdot\|_\infty$. Soit A , resp. B , l'ensemble des fonctions de E lipschitziennes, resp. uniformément continues.

- (a) Vérifier que $A \subset B$ mais que $B \not\subset A$.
 (b) Montrer que B est l'adhérence de A : $\bar{A} = B$. (On pourra considérer une fonction $f \in B$ et la suite des fonctions f_n définies par : $\forall n \in \mathbb{N}^*, \forall x \in \mathbb{R}_+, f_n(x) = n \int_0^{1/n} f(t+x) dt$.)

52. RMS 2025 638 Mines-Ponts MP MPI

- (a) Montrer que $GL_n(\mathbb{R})$ est dense dans $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$.
 (b) On suppose que $\|\cdot\|$ est une norme sur l'ev $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ telle que $\|MN\| = \|NM\|$ si les matrices M et N sont semblables. Montrer que $\forall A, B \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R}), \|AB^2A\| = \|BA^2B\|$.
 (c) Existe-t-il une telle norme?

SOLUTION.

- (a) \triangleright [exo 26 du chap. XI](#)

(b) Si A est inversible d'abord, alors AB et BA sont semblables car $BA = A^{-1}(AB)A$. D'où $\|AB^2A\| = \|BA^2B\|$. Si la matrice A est quelconque ensuite, alors : par densité, c'est la limite d'une suite de matrices A_k inversibles. D'où $\|A_k B^2 A_k\| = \|BA_k^2 B\|$ pour tout k . Par continuité du produit matriciel, $A_k B^2 A_k \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{} AB^2A$ et $BA_k^2 B \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{} BA^2B$. Par continuité de la norme, $\|AB^2A\| = \|BA^2B\|$.

(c) Choisissons $A = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$ de sorte que $A^2 = 0$ et $B = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}$ de sorte que $AB^2A \neq 0$. Alors $\|AB^2A\| \neq \|BA^2B\|$. Ce contre-exemple prouve qu'il n'existe pas de norme satisfaisant la propriété voulue.

53. RMS 2026 282 X MP

Soit $M \in \mathcal{M}_d(\mathbb{C})$ dont le rayon spectral est défini par $\rho(M) = \max\{|\lambda|, \lambda \in \text{Sp}(M)\}$.

- (a) Soient un vecteur $x \in \mathcal{M}_{d,1}(\mathbb{C})$ et une suite de matrices $A_n \in \mathcal{M}_d(\mathbb{C})$. Montrer que : si la suite (A_n) converge, alors la suite $(A_n x)$ converge.
- (b) Montrer que : si $\rho(M) \geq 1$, alors la série $\sum M^n$ diverge.
- (c) Soient $\lambda \in \mathbb{C}$, $\alpha \in \llbracket 1, d \rrbracket$ et $N \in \mathcal{M}_\alpha(\mathbb{C})$ une matrice nilpotente. Montrer que : $(\lambda I_\alpha + N)^n = O_{n \rightarrow \infty}(n^{\alpha-1} \lambda^n)$.
- (d) En déduire que : $M^n = O_{n \rightarrow \infty}(n^{d-1} \rho(M)^n)$.
- (e) Soit $\sum a_n z^n$ une série entière de rayon de convergence $R > 0$. Montrer que : si $\rho(M) < R$, alors la série $\sum a_n M^n$ converge.

1.5 Algèbre générale

54. RMS 2015 384 X ESPCI PC, RMS 2014 1165 CCP PSI

- (a) Soit $P \in \mathbb{R}[X]$ scindé à racines simples.
 - i. Calculer $\frac{P'(x)}{P(x)}$ pour tout x appartenant à \mathbb{R} privé des racines de P . En déduire que $\forall x \in \mathbb{R}, P(x)P''(x) \leq P'(x)^2$.
 - ii. Montrer que, si $\deg P \geq 2$, alors P' est aussi scindé à racines simples. En déduire que, si $P = \sum_{k=0}^n a_k X^k$, alors $a_k a_{k+2} \leq a_{k+1}^2$ pour tout $k \in \llbracket 0, n-2 \rrbracket$.
- (b) Soit $P \in \mathbb{R}[X]$ scindé. Le polynôme P' l'est-il aussi ?

55. RMS 2014 892 Centrale PSI

- (a) Soient un réel a et une fonction f continue sur $[a, +\infty[$ et dérivable sur $]a, +\infty[$. On suppose que f s'annule en a et tend vers 0 en $+\infty$: qu'en déduire ? (On pourra utiliser la fonction $x \mapsto f(a + \frac{1}{x} - 1)$ pour le prouver.)
- (b) Soient $P \in \mathbb{R}[X]$ et $Q = \sum_{k=0}^{+\infty} P^{(k)}$. Montrer que, si P n'a pas de racine réelle, alors Q non plus. (On pourra utiliser la fonction $x \mapsto Q(x)e^{-x}$.)

56. RMS 2013 288 X ESPCI PC

Soit $P \in \mathbb{R}[X]$ tel que $P(X^2 + 1) = P(X)^2 + 1$ et $P(0) = 0$. Soit la suite réelle $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ définie par $a_0 = 0$ et $\forall n \in \mathbb{N}, a_{n+1} = a_n^2 + 1$. Calculer $P(a_n)$ pour tout $n \in \mathbb{N}$. Conclure.

57. RMS 2012 272 X ESPCI PC

Soit $n \in \mathbb{N}$. Montrer qu'il existe un unique $P_n \in \mathbb{R}[X]$ tel que : $\forall t \in \mathbb{R}, P_n(\sin^2 t) = \cos(2nt)$ et le déterminer.

58. RMS 2013 1048 TPE EIVP PC

Soient a, b dans \mathbb{C} , $n \in \mathbb{N}^*$ et $P = (X - a)^n (X - b)^n$.

Donner une expression de la dérivée n -ième de P et en déduire $\sum_{i=0}^n \binom{n}{i}^2$ en fonction de n .

59. RMS 2010 606 Mines Ponts PC

Déterminer les polynômes $P \in \mathbb{R}[X]$ tels que $(X + 4)P(X) = XP(X + 1)$.

60. RMS 2012 268 X ESPCI PC

Mots-clés : nombre de diviseurs d'un entier

- (a) Soit n un entier strictement positif dont la décomposition en facteurs premiers est $\prod_{j=1}^r p_j^{\alpha_j}$. Déterminer le nombre de diviseurs de n .
- (b) Quels sont les entiers $n \in \mathbb{N}^*$ ayant un nombre impair de diviseurs ?

61. RMS 2024 14 ENS MP MPI

Mots-clés : formule de Grassmann

Soit G un groupe fini. Si X et Y sont des parties non vides de G , alors on pose $X^{-1} = \{x^{-1}, x \in X\}$ et $XY = \{xy, (x, y) \in X \times Y\}$. Dans la suite, X désigne une partie non vide de G .

- (a) On suppose que $|XX| < 2|X|$. Soit $(a, b) \in X^2$. Montrer que $Xa \cap Xb \neq \emptyset$. En déduire que $XX^{-1} = X^{-1}X$.
- (b) On suppose que $|XX^{-1}| < \frac{3}{2}|X|$. Montrer que $X^{-1}X$ est un sous-groupe de G .

62. RMS 2024 424 X ESPCI PC

On veut montrer que, pour tout entier $n \in \mathbb{N}^*$, il existe $m \in \mathbb{N}^*$ et $(\varepsilon_1, \dots, \varepsilon_m) \in \{-1; +1\}^m$ tel que $n = \sum_{k=1}^m \varepsilon_k k^2$.

- (a) Prouver la propriété pour tout $n \in \{1; 2; 3\}$.
- (b) Développer les polynômes $(X + 3)^2 - (X + 1)^2$ et $(X + 4)^2 - (X + 2)^2$ et conclure.

63. RMS 2024 519 Mines Ponts MP MPI

Déterminer tous les couples $(m, n) \in \mathbb{N}^2$ tels que $3^m = 8 + n^2$. (On pourra commencer par montrer que n est impair et que m est pair.)

64. RMS 2024 12 ENS MP MPI

Soient un entier $n \in \mathbb{N}^*$ et une transposition (ab) telle que $1 \leq a < b \leq n$.

- (a) Soit un entier $n \in \mathbb{N}^*$. Montrer que la transposition (12) et le cycle $c = (12 \dots n)$ engendrent le groupe symétrique S_n .
- (b) Montrer que la transposition $\tau = (13)$ et le cycle $c = (1234)$ n'engendrent pas le groupe symétrique S_4 . (On pourra s'intéresser à la parité de $\tau(i) - i$ et de $c(i) - i$ pour tout $i \in \llbracket 1, 4 \rrbracket$.)
- (c) Montrer que la transposition (ab) et le cycle $c = (12 \dots n)$ engendrent S_n si, et seulement si, $b - a$ et n sont premiers entre eux.

65. B5 X

Mots-clés : sous-groupes finis de $GL_n(\mathbb{C})$

Soient E un \mathbb{C} -ev de dimension finie et G un sous-groupe fini de l'ensemble $GL(E)$ des automorphismes de E . Montrer que :

- (a) tout endomorphisme de G est diagonalisable et que ses valeurs propres sont des racines de l'unité.
- (b) $p = \frac{1}{\text{Card}(G)} \sum_{f \in G} f$ est un projecteur et en déduire que la trace moyenne $\frac{1}{\text{Card}G} \sum_{f \in G} \text{tr} f$ est égale à la dimension de l'ensemble $\{x \in E \mid \forall g \in G, g(x) = x\}$ des vecteurs invariants.

66. RMS 2025 1197 Centrale MP MPI

Mots-clés : sous-groupes finis de $GL_n(\mathbb{Z})$

Soit $n \in \mathbb{N}^*$. On note $\mathcal{M}_n(\mathbb{Z})$ l'ensemble des matrices de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ à coefficients entiers et $GL_n(\mathbb{Z})$ l'ensemble des matrices $M \in GL_n(\mathbb{R})$ telles que M et M^{-1} sont à coefficients entiers.

- (a) Soit $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{Z})$. Montrer que $A \in GL_n(\mathbb{Z})$ ssi $\det(A) = \pm 1$. (On pourra utiliser la comatrice.) Montrer que : $A^k \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{} 0$ ssi A est nilpotente.
- (b) Soit $M \in \mathcal{M}_n(\mathbb{C})$. On note $A = \frac{1}{3}(M - I_n)$. On suppose que $\exists k \in \mathbb{N}^*, M^k = I_n$ et que $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{Z})$. Montrer que A est diagonalisable et que $M = I_n$.
- (c) Soient G un sous-groupe fini de $GL_n(\mathbb{Z})$. On note $\varphi : G \rightarrow GL_n(\mathbb{Z}/3\mathbb{Z})$ le morphisme qui, à $M = (m_{ij})$ associe $\varphi(M) = (\tilde{m}_{ij})$ où \tilde{m}_{ij} est la classe d'équivalence de m_{ij} modulo 3. Montrer que $\ker(\varphi) = \{I_n\}$.
- (d) Montrer que $|GL_n(\mathbb{Z}/3\mathbb{Z})| = (3^n - 1)(3^n - 3) \dots (3^n - 3^{n-1})$. En déduire un majorant des cardinaux des sous-groupes finis de $GL_n(\mathbb{Z})$.

2 Analyse

2.1 Suites & séries numériques

67. RMS 2006 1124 CCP PC

Soit $\sum_{n \geq 0} u_n$ une série convergente à termes strictement positifs. Montrer que les séries $\sum_{n \geq 1} \frac{\sqrt{u_n}}{n}$ et $\sum_{n \geq 0} e^{-1/u_n}$ convergent.

SOLUTION. — On applique l'inégalité $\forall (a, b) \in \mathbb{R}^2, ab \leq \frac{1}{2}(a^2 + b^2)$ avec $a = \sqrt{u_n}$ et $b = \frac{1}{n}$. On obtient

$$\forall n \in \mathbb{N}^*, \quad 0 \leq \frac{\sqrt{u_n}}{n} \leq \frac{1}{2} \left(u_n + \frac{1}{n^2} \right).$$

Comme les deux séries de termes généraux u_n et $\frac{1}{n^2}$ convergent, $\sum_{n \geq 1} \frac{\sqrt{u_n}}{n}$ converge aussi.

On sait que $\lim_{-\infty} xe^x = 0$. Comme la série $\sum_{n \geq 0} u_n$ est convergente, alors la suite (u_n) converge vers zéro. Comme de plus $u_n > 0$ pour tout n , la suite de terme général $-\frac{1}{u_n}$ diverge vers $-\infty$. Par croissances comparées, la suite de terme général $-\frac{e^{-1/u_n}}{u_n}$ converge vers zéro, donc $e^{-1/u_n} = o(u_n)$. Comme la série $\sum_{n \geq 0} u_n$ converge absolument, $\sum_{n \geq 0} e^{-1/u_n}$ converge aussi.

68. RMS 2014 668 Mines Ponts PSI

Soit la suite définie par $a_0 > 0$ et $a_{n+1} = 1 - e^{-a_n}$.

- (a) Étudier la limite de cette suite.
- (b) Déterminer la nature de la série de terme général $(-1)^n a_n$.
- (c) Déterminer la nature de la série de terme général a_n^2 .
- (d) Étudier la série de terme général $\ln\left(\frac{a_{n+1}}{a_n}\right)$. En déduire la nature de la série de terme général a_n .

SOLUTION. —

- (a) Pour tout réel x , $e^x \geq 1 + x$, d'où $a_{n+1} \leq a_n$ pour tout n , donc (a_n) est décroissante et, par récurrence, est minorée par 0, donc (a_n) converge. Sa limite vérifie $\ell = 1 - e^{-\ell}$ donc $\ell = 0$.
- (b) La série $\sum (-1)^n a_n$ est alternée et vérifie les hypothèses du CSSA : elle converge.
- (c) On effectue un développement limité : puisque $a_n \rightarrow 0$, $a_{n+1} = a_n - \frac{a_n^2}{2} + o(a_n^2)$ donc $a_n^2 \sim 2(a_n - a_{n+1})$ dont la série converge car ses sommes partielles sont télescopiques et la suite (a_n) converge.
- (d) $S_n = \sum_{k=0}^n \ln \frac{a_{k+1}}{a_k} = \ln a_{n+1} - \ln a_0 \rightarrow -\infty$ donc la série diverge.

En reprenant le développement limité précédent, on a $\ln \frac{a_{n+1}}{a_n} \sim -\frac{a_n}{2} (< 0)$. On en déduit que $\sum a_n$ diverge.

69. RMS 2013 688 Mines Ponts PC

Soit $f \in \mathcal{C}^0(\mathbb{R}_+, \mathbb{R}_+)$ bornée et intégrable sur \mathbb{R}_+ . On pose $\alpha = \sup_{\mathbb{R}_+} f$.

- (a) Soit $n \in \mathbb{N}^*$. Montrer que f^n est intégrable. Soit $u_n = \int_0^{+\infty} f^n$.
- (b) Si $\alpha < 1$, montrer que la série de terme général u_n est convergente.
- (c) Si $\alpha > 1$, montrer que la série de terme général u_n est divergente.

70. RMS 2012 1327 CCP PC

Soit $f \in \mathcal{C}^0(\mathbb{R}, \mathbb{C})$ 1-périodique et, pour $n \in \mathbb{N}^*$, $u_n = \int_n^{n+1} \frac{f(t)}{t} dt$.

Montrer que la série de terme général u_n converge si, et seulement si, $\int_0^1 f(t) dt = 0$.

71. RMS 132 1163 CCP PSI 2021, RMS 130 1236 CCP PSI 2019

Soient deux suites réelles (a_n) positive et (u_n) définie par $u_0 \geq 0$ et $u_{n+1} = \frac{1}{2} \left(u_n + \sqrt{u_n^2 + a_n^2} \right)$ pour tout $n \in \mathbb{N}$.

- (a) Comparer $u_{n+1} - u_n$ et $\frac{1}{2}a_n$ pour tout $n \in \mathbb{N}$.
- (b) Déterminer un équivalent de a_n dans le cas où $u_n = \frac{n}{n+1}$.
- (c) La convergence de la suite (u_n) implique-t-elle la convergence de la série $\sum a_n$? Et réciproquement?

SOLUTION. —

- (a) Pour tout $n \in \mathbb{N}$, $u_{n+1} - u_n = \frac{1}{2} \left(\sqrt{u_n^2 + a_n^2} - u_n \right)$. Et $u_n^2 + a_n^2 \leq (u_n + a_n)^2$ car u_n et a_n sont positifs, donc $u_{n+1} - u_n \leq \frac{1}{2}a_n$.
- (b) Si $u_n = \frac{n}{n+1}$, alors $a_n = 2\sqrt{u_n} \sqrt{u_{n+1} - u_n} \sim \frac{2}{n}$.
- (c) La deuxième question prouve par un contre-exemple, que la convergence de la suite (u_n) n'implique pas la convergence de la série $\sum a_n$.

Réciproquement : supposons que la série $\sum a_n$ converge. Les suites $u_{n+1} - u_n$ et a_n sont positives et, d'après la première question, $u_{n+1} - u_n \leq \frac{1}{2}a_n$. Par comparaison de séries à termes positifs, on en déduit que la série $\sum (u_{n+1} - u_n)$ converge. D'où la suite $S_n = \sum_{k=0}^n (u_{k+1} - u_k)$ des sommes partielles converge. Donc $u_{n+1} = u_0 + S_n$ converge.

72. RMS 2007 912 CCP PSI

Soient, pour tout réel $t \geq 1$, $f(t) = \frac{t}{t^2+t+1}$ et, pour tout entier $n \geq 1$, $u_n = \int_{n\pi}^{(n+1)\pi} f(t) \sin t dt$.

Étudier le sens de variation de la fonction f , le sens de variation de la suite $(|u_n|)$ et la nature de la série $\sum u_n$.

73. RMS 2008 980 Télécom Sud Paris PSI, RMS 2013 657 Mines Ponts PC, RMS 2014 751 Mines Ponts PC

On considère la suite (u_n) définie par $u_0 \in \mathbb{R}$ et $\forall n \in \mathbb{N}^*$, $u_n = \frac{(-1)^n \cos(u_{n-1})}{n}$. Nature de la série de terme général u_n ?

SOLUTION. — Pour $n \geq 1$, on a $|u_n| \leq \frac{1}{n}$, donc la suite de terme général u_n tend vers zéro, donc on dispose du développement limité $\cos(u_{n-1}) = 1 - \frac{u_{n-1}^2}{2} + o(u_{n-1})^2$. Par suite

$$u_n = \frac{(-1)^n}{n} - \frac{(-1)^n u_{n-1}^2}{2n} + o\left(\frac{u_{n-1}^2}{n}\right) = x_n + y_n + o(y_n),$$

avec des notations évidentes pour les suites (x_n) et (y_n) . La série $\sum x_n$ converge, par application du théorème des séries alternées. Comme $|y_n| \leq \frac{1}{2n(n-1)^2}$ pour tout $n \geq 2$, d'où $y_n + o(y_n) = O(\frac{1}{n^2})$ et $\frac{1}{n^2}$ ne change pas de signe, donc la série $\sum (y_n + o(y_n))$ converge absolument. Finalement, la série $\sum u_n$ converge.

74. RMS 2012 328 X ESPCI PC

Mots-clés : transformation d'Abel

Soit $(u_n) \in \mathbb{R}^{\mathbb{N}}$. On suppose que (u_n) est décroissante et que la série de terme général u_n converge.

- (a) Montrer que $\sum_{k=0}^n u_k = (n+1)u_n + \sum_{k=1}^n k(u_{k-1} - u_k)$ pour tout $n \in \mathbb{N}^*$.
 (b) Montrer que la suite de terme général $(n+1)u_n$ converge. En déduire que $nu_n \rightarrow 0$ quand $n \rightarrow +\infty$.

75. RMS 2013 344 X ESPCI PC

- (a) Soient deux réels a et b tels que $b > a$. Étudier la limite de la suite des réels $(b + \sqrt[3]{n})^3 - (a + \sqrt[3]{n})^3$.
 (b) Montrer que l'ensemble $E = \{\sqrt[3]{m} - \sqrt[3]{n}, (m, n) \in \mathbb{N}^2\}$ est dense dans \mathbb{R} .

76. RMS 2024 722 Mines Ponts MP MPI

Soient (u_n) une suite décroissante de réels positifs et (v_n) la suite définie par $v_n = \frac{1}{1+n^2 u_n}$ pour tout $n \in \mathbb{N}$. Montrer que : si la série $\sum u_n$ converge, alors la série $\sum v_n$ diverge.

SOLUTION. — $0 \leq \frac{n}{2} u_n \leq \sum_{\frac{n}{2} \leq k \leq n} u_k$ car la suite (u_n) est positive et décroissante. Si la série $\sum u_n$ converge, alors $\sum_{\frac{n}{2} \leq k \leq n} u_k = S_n - S_{\lceil \frac{n}{2} \rceil}$ tend vers 0 car les sommes partielles S_n et $S_{\lceil \frac{n}{2} \rceil}$ convergent vers la même limite finie. D'après le théorème des gendarmes, $\frac{n}{2} u_n$ tend donc vers 0.

D'où $0 \leq nu_n$ est inférieur à 1 à partir d'un certain rang. D'où $v_n = \frac{1}{1+n^2 u_n} \geq \frac{1}{1+n}$ à partir du même rang. Donc la série $\sum v_n$ diverge.

77. UPS 20260508 Mines Ponts PSI 2025, ENS Lyon 2024

- (a) Montrer que $\int_x^{+\infty} e^{-t^2} dt \underset{x \rightarrow +\infty}{\sim} \frac{e^{-x^2}}{2x}$.
 (b) Soit (u_n) la suite définie par $u_0 = 0$ et $u_{n+1} = u_n + \int_{u_n}^{+\infty} e^{-t^2} dt$. Montrer que : $e^{u_{n+1}^2} - e^{u_n^2} \sim 1$.
 (c) En déduire un équivalent de u_n .

SOLUTION. —

- (a) Pour tout $x > 0$, $F(x) = \int_x^{+\infty} e^{-t^2} dt$ est bien défini car l'intégrale est convergente car $e^{-t^2} \leq e^{-t}$ pour tout $t \geq 1$. On intègre par parties : $F(x) = \int_x^{+\infty} (-2te^{-t^2}) \frac{1}{2t} dt = \frac{e^{-x^2}}{2x} - \frac{1}{2} \int_x^{+\infty} \frac{e^{-t^2}}{t^2} dt$ car les fonctions $t \mapsto e^{-t^2}$ et $t \mapsto \frac{1}{2t}$ sont \mathcal{C}^1 et $\frac{e^{-t^2}}{2t} \xrightarrow[t \rightarrow +\infty]{} 0$.

Or $\int_x^{+\infty} \frac{e^{-t^2}}{t^2} dt \leq \frac{F(x)}{x^2}$ car $\frac{1}{t^2} \leq \frac{1}{x^2}$ pour tout $t \geq x$. Donc $F(x) = \frac{e^{-x^2}}{2x} + O(F(x)/x^2) = \frac{e^{-x^2}}{2x} + o(F(x))$ quand x tend vers $+\infty$. D'où l'équivalent recherché. AUTRE MÉTHODE : $\frac{e^{-t^2}}{t^2} = o(e^{-t^2})$ et e^{-t^2} ne change pas de signe et $F(x)$ est le reste d'une intégrale convergente, d'où $\int_x^{+\infty} \frac{e^{-t^2}}{t^2} dt = o(F(x))$ par intégration des relations de comparaison.

- (b) La suite (u_n) est croissante car $u_{n+1} - u_n = F(u_n) \geq 0$, elle possède donc une limite. Cette limite est $+\infty$ car ce n'est pas un réel ℓ . Par l'absurde : si $u_n \rightarrow \ell$, alors $\ell - \ell = F(\ell)$ car la fonction F est continue (car $F(x) = \int_0^{+\infty} e^{-t^2} dt - \int_0^x e^{-t^2} dt$ et le second terme est une primitive d'une fonction continue). D'où $F(\ell) = 0$, ce qui est absurde d'après le théorème de l'intégrale nulle car la fonction $t \mapsto e^{-t^2}$ est continue et ne change pas de signe).

De $u_n \rightarrow +\infty$ et de l'équivalent de $F(x)$ quand $x \rightarrow +\infty$, on tire que $u_{n+1} - u_n \sim \frac{e^{-u_n^2}}{2u_n}$. D'où $u_{n+1} = u_n + \frac{e^{-u_n^2}}{2u_n} + o\left(\frac{e^{-u_n^2}}{2u_n}\right)$ et, en élevant au carré : $u_{n+1}^2 = u_n^2 + e^{-u_n^2} + o\left(e^{-u_n^2}\right)$. Donc $e^{u_{n+1}^2} - e^{u_n^2} \sim 1$.

- (c) Or 1 ne change pas de signe et la série $\sum 1$ diverge, d'où les sommes partielles sont équivalentes :

$$\sum_{k=0}^{n-1} (e^{u_{k+1}^2} - e^{u_k^2}) \sim \sum_{k=0}^{n-1} 1. \text{ D'où } e^{u_n^2} - 1 \sim n, \text{ donc } e^{u_n^2} \sim n.$$

Par suite $e^{u_n^2} = n + o(n)$, d'où $u_n^2 = \ln(n) + \ln(1 + o(1))$, $u_n = \sqrt{\ln(n) + \ln(1 + o(1))}$, donc $u_n \sim \sqrt{\ln(n)}$.

2.2 Intégrales

78. RMS 2014 1249 ENSAM PSI

Soit $f \in \mathcal{C}^0(\mathbb{R}_+, \mathbb{R}_+)$ et F sa primitive qui s'annule en 0.

- (a) Montrer que : si $\int_0^{+\infty} \frac{F(t)}{(1+t)^2} dt$ converge, alors $\int_x^{+\infty} \frac{F(t)}{(1+t)^2} dt \geq \frac{F(x)}{1+x}$ pour tout $x \geq 0$.
- (b) Montrer que les deux intégrales $\int_0^{+\infty} \frac{f(t)}{1+t} dt$ et $\int_0^{+\infty} \frac{F(t)}{(1+t)^2} dt$ sont de même nature et comparer leur valeur.

79. RMS 2013 376 X ESPCI PC, RMS 2014 761 Mines Ponts PC

Mots-clés : théorème de Cesàro pour les fonctions

- (a) Soit F une fonction continue sur \mathbb{R}_+ admettant une limite finie L en $+\infty$. Montrer que $\frac{1}{x} \int_0^x F(t) dt \xrightarrow{x \rightarrow +\infty} L$.
- (b) Soit f une fonction continue sur \mathbb{R}_+ telle que $\int_0^{+\infty} f(x) dx$ est convergente. Montrer que $\frac{1}{x} \int_0^x t f(t) dt \xrightarrow{x \rightarrow +\infty} 0$.

80. RMS 2011 1140 Télécom Sud Paris PC, RMS 2015 1003 CCP PSI

- (a) Montrer que l'intégrale $\int_0^{+\infty} [x] e^{-x} dx$ est convergente et qu'elle vaut $\frac{1}{e-1}$.
- (b) Existence et calcul de $\int_0^{+\infty} x e^{-[x]} dx$.

81. RMS 2014 781 Mines Ponts PC & RMS 2016 852 Centrale PC

Soit $F: x \mapsto \int_0^{+\infty} \frac{e^{-t}}{x+t} dt$.

- (a) Montrer que la fonction F est de classe \mathcal{C}^1 sur \mathbb{R}_+^* .
- (b) Former une équation différentielle vérifiée par F et en déduire la limite de F en 0^+ .
- (c) Déterminer un équivalent de F en $+\infty$.

82. RMS 2013 917 Centrale PC

Soit $F: x \mapsto \int_0^{+\infty} \frac{te^{-t}}{t+x} dt$.

- (a) Montrer que F est définie et continue sur \mathbb{R}_+ , dérivable sur \mathbb{R}_+^* .
- (b) Calculer les intégrales $\int_0^{+\infty} te^{-t} dt$ et $\int_0^{+\infty} t^2 e^{-t} dt$. Étudier la limite de $1 - xF(x)$ quand x tend vers $+\infty$. Conclure.

83. RMS 2016 795 Centrale PSI

Mots-clés : transformée de Laplace

On considère la fonction $F: x \mapsto \int_0^{+\infty} e^{-xt} \cdot \frac{\text{sh } t}{t} dt$.

- (a) Déterminer l'ensemble de définition de F .
- (b) Déterminer la limite de F en $+\infty$.

2.3 Suites & séries de fonctions

84. CCP PSI 2021

- (a) Prouver que, pour tout $n \in \mathbb{N}^*$, l'intégrale $J_n = \int_0^{+\infty} \frac{n^{1/3} \sin\left(\frac{t}{n^{1/3}}\right)}{1+t^3} dt$ est convergente.
- (b) Montrer que la suite des réels J_n converge vers le réel $K = \int_0^{+\infty} \frac{t}{1+t^3} dt$.
- (c) À l'aide d'un changement de variable, prouver que $K = \int_0^{+\infty} \frac{1}{1+t^3} dt$ et en déduire la valeur du réel K .

85. RMS 2013 1005 CCP PSI, RMS 2008 982 TPE PSI, RMS 2013 1005 CCP PSI, RMS 2015 748 Mines Ponts PC & RMS 2016 849 Centrale PC

Mots-clés : primitives itérées

Soient $(a, b) \in \mathbb{R}^2$ avec $a < b$, $f \in \mathcal{C}^0([a, b], \mathbb{R})$ et $(f_n)_{n \in \mathbb{N}}$ la suite de fonctions définie par $f_0 = f$, et, pour tout $n \in \mathbb{N}$ et tout $x \in [a, b]$, $f_{n+1}(x) = \int_a^x f_n(t) dt$. Montrer que la série de fonctions de terme général f_n converge normalement sur $[a, b]$ et déterminer sa somme $S = \sum_{n=0}^{+\infty} f_n$ en résolvant une équation différentielle.

86. RMS 2009 1050 Centrale PC

Quel est l'ensemble de définition de $f: x \mapsto \sum_{n=0}^{\infty} \frac{x^n}{1+x^n}$? Cette fonction est-elle continue?

87. RMS 2016 937 CCP PSI

Montrer que $S(x) = \sum_{n=1}^{\infty} \frac{x^n}{n^2(1+x^{2n})}$ est défini pour tout réel x et que, pour tout $x \neq 0$, $S(x) = S(\frac{1}{x})$. Étudier la limite de S en $+\infty$.

88. RMS 2016 513 Mines Ponts PSI

Soit $S: x \in \mathbb{R}_+^* \mapsto \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{(-1)^n}{n!(x+n)}$.

- Montrer que S est définie et de classe \mathcal{C}^1 sur \mathbb{R}_+^* . Étudier le sens de variation de S .
- Étudier les limites de S en 0 et en $+\infty$.
- Montrer que $\forall x \in \mathbb{R}_+^*$, $xS(x) - S(x+1) = \frac{1}{e}$.
- Déterminer un équivalent de S en 0^+ et en $+\infty$.

89. RMS 2013 606 Mines Ponts PSI, RMS 2016 512 Mines Ponts PSI & RMS 2016 583 Mines Ponts PC

Pour tout $n \in \mathbb{N}^*$, on pose $f_n: x \in \mathbb{R} \mapsto \frac{2x}{x^2+n^2}$. Montrer que la fonction $f: x \mapsto \sum_{n=1}^{+\infty} f_n(x)$ est définie sur \mathbb{R} . Étudier la limite de f en $+\infty$ et en $-\infty$. Montrer que la fonction f est continue mais que la série de fonctions $\sum f_n$ ne converge pas uniformément sur \mathbb{R} .

90. RMS 2016 371 X ESPCI PC

Soit, pour chaque $n \in \mathbb{N}$, la fonction $f_n: x \in \mathbb{R} \mapsto e^{-n^2x}$.

- Montrer que la fonction $f = \sum_{n=0}^{+\infty} f_n$ est définie et continue sur $]0, +\infty[$.
- Étudier la limite de f en $+\infty$.
- Montrer que $\lim_{0^+} f = +\infty$. La série $\sum f_n$ converge-t-elle uniformément sur $]0, +\infty[$?

91. RMS 2016 938 CCP PSI & RMS 2015 666 Mines Ponts PSI

On pose $f(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} \ln(1 + e^{-nx})$.

- Montrer que f est définie et continue sur $]0, +\infty[$.
- Étudier la limite de f en $+\infty$.
- Étudier la limite de f en 0^+ . (On pourra vérifier que $\forall t \in [0, 1]$, $\ln(1+t) \geq \frac{t}{2}$.)

92. RMS 2008 987 ENSAM PSI

Soient deux fonctions $f \in \mathcal{C}^0([0, 1], \mathbb{R})$ et g continue et intégrable sur \mathbb{R}_+ . Montrer que :

$$n \int_0^1 f(t)g(nt) dt \xrightarrow{n \rightarrow \infty} f(0) \int_0^{+\infty} g(t) dt.$$

93. RMS 2015 1013 CCP PSI

Pour tout $n \in \mathbb{N}$, on pose $U_n = \int_0^1 \frac{x^n}{1+x^n} dx$. Montrer que $U_n \underset{n \rightarrow +\infty}{\sim} \frac{\ln 2}{n}$.

94. RMS 2010 849 Centrale PSI

- Étudier la convergence de $\int_0^1 \frac{\ln x}{x^2-1} dx$.
- Montrer que $\int_0^1 \frac{\ln x}{x^2-1} dx = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{1}{(2n+1)^2}$.

95. RMS 2016 951 TPE PSI

Après avoir justifié l'existence de l'intégrale, montrer que $\int_0^{+\infty} e^{-x} \cos \sqrt{x} dx = \sum_{n=0}^{+\infty} (-1)^n \frac{n!}{(2n)!}$.

96. RMS 2011 1150, CCP PC, RMS 2014 1262 Écoles des Mines PSI

Justifier l'existence de $I = \int_0^1 \frac{\ln t \ln(1-t)}{t} dt$. Montrer que $I = \sum_{n=1}^{+\infty} \frac{1}{n^3}$.

97. RMS 2025 993 Mines-Ponts MP-MPI

Soit $f(x) = \sum_{n=0}^{\infty} \frac{\sin(2^n x)}{2^n}$.

Montrer que la fonction f est définie et continue sur \mathbb{R} et qu'elle n'est pas dérivable en 0.

98. B4 Centrale

- Montrer qu'il existe une unique fonction $f:]0, +\infty[\rightarrow \mathbb{R}$ telle que $f(x) \xrightarrow{x \rightarrow +\infty} 0$ et $\forall x > 0$, $f(x) + f(x+1) = \frac{1}{x^2}$.
- Montrer que cette fonction f est continue sur $]0, +\infty[$ et intégrable sur $[1, +\infty[$. Calculer $\int_1^{+\infty} f(x) dx$.

2.4 Séries entières

99. RMS 2015 ENSAM PSI

Soit $(a_n) \in (\mathbb{R}_+)^{\mathbb{N}^*}$ avec $a_1 \geq 1$. On pose $P_n : x \mapsto \sum_{k=1}^n a_k x^k$.

- Montrer qu'il existe un unique $x_n \in [0, 1]$ tel que $P_n(x_n) = 1$.
- Montrer que $P_{n+1}(x_n) \geq 1$. En déduire que la suite (x_n) est décroissante et qu'elle converge.
- On note $\ell = \lim x_n$ et on suppose que $\ell > 0$. Montrer que le rayon de convergence de la série entière $\sum a_n x^n$ est supérieur à ℓ .

100. RMS 2013 1017 CCP PSI

- Déterminer le rayon de convergence R de la série entière $\sum \frac{(-1)^n}{2n+1} x^{2n+1}$ et calculer $f(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{(-1)^n}{2n+1} x^{2n+1}$ pour tout $x \in]-R, +R[$.
- Montrer que, pour $x \in]-\frac{\pi}{4}, \frac{\pi}{4}[$, $\tan(2x) = \frac{2 \tan x}{1 - \tan^2 x}$.
- Montrer que $\pi = 8 \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{(-1)^n}{2n+1} (\sqrt{2} - 1)^{2n+1}$.
- Majorer l'erreur commise en approchant π par la somme partielle d'ordre N de la série précédente.

101. RMS 2009 989 Centrale PSI

Soit (a_n) une suite de réels. On note R le rayon de convergence de la série de terme général $a_n x^n$ et R' celui de la série de terme général $\sin(a_n) x^n$.

Montrer que $R' \geq R$ et qu'il y a égalité si $R > 1$.

102. RMS 2015 749 Mines Ponts PC

Soit (a_n) une suite complexe. On suppose que $\sum a_n z^n$ a un rayon de convergence $R > 0$, que $\sum a_{2n} z^n$ a un rayon de convergence $R_1 > 0$ et que $\sum a_{2n+1} z^n$ a un rayon de convergence $R_2 > 0$. Exprimer R en fonction de R_1 et R_2 .

103. RMS 132-709 Mines-Ponts PSI 2021

On considère une série entière $\sum a_n z^n$ de rayon de convergence R strictement positif.

- Déterminer le rayon de convergence de la série entière $\sum \frac{a_n}{n!} z^n$.
- On pose $b_n = \frac{a_n}{1+|a_n|}$. Montrer que la série entière $\sum b_n z^n$ a un rayon de convergence R' supérieur ou égal à 1. Puis prouver que $R' = \max(1, R)$.

104. RMS 2013 379 X ESPCI PC

Soient $a_0 = 1$ et, pour tout $n \in \mathbb{N}^*$, $a_n = \prod_{k=1}^n \left(\frac{2k-1}{2k}\right)$.

- Montrer que le rayon de convergence R de la série entière $\sum a_n x^n$ vaut 1.
- Soit $f(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} a_n x^n$ pour tout $x \in]-1, +1[$. Trouver une équation différentielle vérifiée par f sur $] -1, +1[$.
- Calculer $f(x)$ pour tout $x \in]-1, +1[$.

105. RMS 2011 1145 CCP PC, RMS 2012 1333 CCP PC, RMS 2013 1062 CCP PC & RMS 2016 782 Centrale PSI

Mots-clés : nombre de dérangements

Soit $(d_n)_{n \geq 0}$ définie par $d_0 = 1$, $d_1 = 0$ et $\forall n \in \mathbb{N}$, $d_{n+2} = (n+1)(d_{n+1} + d_n)$.

- Calculer d_2 et d_3 . Montrer que $\forall n \geq 2$, $\frac{n!}{3} \leq d_n \leq n!$ et en déduire le rayon de convergence R de la série entière de terme général $\frac{d_n}{n!} x^n$.
- Pour tout $x \in]-R, R[$, on pose $S(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{d_n}{n!} x^n$. Montrer que $\forall x \in]-R, R[$, $(1-x)S'(x) = xS(x)$.
- En déduire une expression de $S(x)$ en fonction de x et exprimer d_n comme une somme en fonction de n .

106. RMS 2016 939 ENSEA PSI, RMS 2016 941 CCP PSI

Soit (a_n) dans $\mathbb{R}^{\mathbb{N}}$ telle que $a_1 \geq a_0 > 0$ et $\forall n \geq 2$, $a_n = a_{n-1} + \frac{2}{n} a_{n-2}$.

- Montrer que la suite (a_n) est croissante et que la suite $(\frac{a_n}{n^2})_{n \in \mathbb{N}^*}$ est décroissante. En déduire le rayon de convergence de la série entière $\sum a_n x^n$.
- Former une équation différentielle vérifiée par la somme et calculer cette somme dans le cas où $a_0 = a_1 = 1$.

107. RMS 2016 593 Mines Ponts PC, RMS 2013 607 Mines Ponts PSI, RMS 2014 770 Mines Ponts PC

Soit, pour $n \in \mathbb{N}^*$, $H_n = \sum_{k=1}^n \frac{1}{k}$. Soient $f : x \mapsto \sum_{n=1}^{+\infty} H_n x^n$ et $g : x \mapsto \sum_{n=1}^{+\infty} (\ln n) x^n$.

- Montrer que la suite $(H_n - \ln n)$ est convergente.

(b) Montrer que les fonctions f et g sont définies sur $] -1, +1[$.

(c) Montrer que, pour tout $x \in] -1, +1[$, $f(x) = -\frac{\ln(1-x)}{1-x}$.

(d) Montrer que $f(x) \sim g(x)$ ($x \rightarrow 1^-$).

108. RMS 2013 670 Mines Ponts PC, RMS 2006 1132 CCP PC, RMS 2011 1144 CCP PC, RMS 2013 1019 CCP PSI

Pour tout $n \in \mathbb{N}$, on pose $a_n = \int_0^1 \left(\frac{1+t^2}{2}\right)^n dt$.

Montrer que, pour tout $n \in \mathbb{N}$, $a_n \geq \frac{1}{n+1}$ et étudier la limite de la suite (a_n) .

Quel est l'ensemble de définition de la fonction $f: x \mapsto \sum_{n=0}^{+\infty} a_n x^n$?

109. UPS 20260409 Centrale PC 2025

Soit $S(x) = \sum_{n=0}^{\infty} e^{-n} e^{inx}$. Montrer que :

(a) la fonction S est définie et de classe \mathcal{C}^∞ sur \mathbb{R} ;

(b) $U_k = \sum_{n=0}^{\infty} n^k e^{-n}$ est un $O(k!)$ quand k tend vers ∞ ;

(c) la fonction S est développable en série entière sur un intervalle à préciser.

2.5 Équations différentielles & calcul différentiel

110. RMS 2014 1308 CCP PSI

Soit $(S) \begin{cases} x'(t) = y(t) - z(t) \\ y'(t) = z(t) - x(t) \\ z'(t) = x(t) - y(t), \end{cases}$ avec $x(0) = 1, y(0) = z(0) = 0$.

(a) Montrer que la trajectoire de toute solution est incluse dans une sphère et dans un plan.

(b) Résoudre directement (S) .

111. RMS 2010 1026 CCP PSI

Mots-clés : raccordement de solutions, théorème de la limite de la dérivée

Soit $(E) : (1+x)y' - 2y = 0$.

(a) Déterminer les solutions sur \mathbb{R} de (E) . Donner une base de l'ensemble des solutions.

(b) Donner une base de l'ensemble des solutions de classe \mathcal{C}^2 sur \mathbb{R}

112. RMS 2013 921 Centrale PC

Déterminer les fonctions $f: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ dérivables telles que $\forall x \in \mathbb{R}, f'(x) + f(-x) = e^x$.

113. RMS 2016 525 Mines Ponts PSI

L'application $H: \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}$ définie par $H(x, y) = \frac{x^4 y}{x^4 + y^2}$ si $(x, y) \neq (0, 0)$, et $H(0, 0) = 0$, est-elle continue ? de classe \mathcal{C}^1 ?

114. RMS 2009 998 Centrale PSI

Trouver les extrema de $(x, y) \mapsto \sin(x) \sin(y) \sin(x+y)$ sur $\{(x, y) \in \mathbb{R}^2, 0 \leq x \leq \pi, 0 \leq y \leq \pi, 0 \leq x+y \leq \pi\}$.

115. RMS 2016 612 Mines Ponts PC

Déterminer les solutions f de classe \mathcal{C}^1 sur $U = \mathbb{R}_+^* \times \mathbb{R}$ de l'équation $x \frac{\partial f}{\partial x} + y \frac{\partial f}{\partial y} = \frac{y}{x}$.

116. RMS 2013 396 X ESPCI PC

On munit \mathbb{R}^n de sa structure euclidienne canonique. Soit $f: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ différentiable dont toutes les dérivées partielles sont bornées entre -1 et 1. Montrer que $\forall (x, y) \in (\mathbb{R}^n)^2, |f(x) - f(y)| \leq \sqrt{n} \|x - y\|$. (On pourra utiliser la fonction $\varphi: t \mapsto f(tx + (1-t)y)$.)

117. RMS 2012 357 X ESPCI PC

Soit $f: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$ différentiable telle que $\forall (x, y) \in (\mathbb{R}^n)^2, \|f(x) - f(y)\| \geq \|x - y\|$. Montrer que f est injective. Et que, pour tout $x_0 \in \mathbb{R}^n, df(x_0)$ est bijective.

118. RMS 2009 1062 Centrale PC

Soit f une fonction de \mathbb{R}^2 vers \mathbb{R} différentiable. On suppose que $\forall (x, y) \in (\mathbb{R}^2)^2, |f(x) - f(y)| \leq \|x - y\|^2$. Montrer que f est constante.

119. RMS 2024 876 Mines Ponts MP MPI

Soit $f: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$ différentiable telle que $\|f(x)\| \xrightarrow{\|x\| \rightarrow +\infty} +\infty$ et que, pour tout $x \in \mathbb{R}^n, df(x)$ est surjective. Soient $a \in \mathbb{R}^n$ et $g: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}, x \mapsto \|f(x) - a\|^2$.

- (a) Montrer que la fonction g est différentiable et exprimer $dg(x)$ pour tout $x \in \mathbb{R}^n$.
 (b) Montrer que la fonction g admet un minimum global.
 (c) En déduire que la fonction f est surjective.

SOLUTION. —

- (a) Soit $x \in \mathbb{R}^n$: pour tout $h \in \mathbb{R}^n$, $g(x+h) = \|f(x+h) - a\|^2 = \|f(x) + df(x) \cdot h + o(h) - a\|^2 = \|f(x) - a\|^2 + 2\langle f(x) - a, df(x) \cdot h \rangle + o(h)$, d'où g est différentiable en x et $dg(x)$ est l'application linéaire $h \mapsto 2\langle f(x) - a, df(x) \cdot h \rangle$.
 (b) D'une part, $g(x) = \|f(x) - a\|^2 \geq (\|f(x)\| - \|a\|)^2$ d'après l'inégalité triangulaire inversée. Or $\|f(x)\|$ tend vers $+\infty$ quand $\|x\|$ tend vers $+\infty$ par hypothèse. D'où $g(x)$ tend vers $+\infty$ quand $\|x\|$ tend vers $+\infty$. Il existe donc $R > 0$, tel que $\|x\| > R \implies g(x) \geq g(0)$.

D'autre part, la fonction g est continue car différentiable. Et la boule fermée B de centre 0 et de rayon R est compacte. La fonction $g|_B$ est continue sur le compact B , elle possède donc un minimum global m . Et $m \leq g(0)$ car $0 \in B$. Donc m est le minimum global de g sur \mathbb{R}^n .

- (c) Soit $a \in \mathbb{R}^n$: la fonction g est différentiable et elle possède un minimum global en un point x de l'ouvert \mathbb{R}^n , d'où $dg(x) = 0$. D'où $\langle f(x) - a, df(x) \cdot h \rangle = 0$ pour tout $h \in \mathbb{R}^n$. Or l'application $h \mapsto df(x) \cdot h$ est surjective par hypothèse, d'où $\langle f(x) - a, k \rangle = 0$ pour tout $k \in \mathbb{R}^n$. D'où $f(x) - a = 0$. Donc f est surjective.

120. B1 Centrale

Mots-clés : extrema liés

Soient $n \geq 2$, la fonction $g :]0, +\infty[^n \rightarrow \mathbb{R}$, $(x_1, \dots, x_n) \mapsto \sum_{i=1}^n \ln(x_i)$ et l'ensemble $C = \left\{ (x_1, \dots, x_n) \in]0, +\infty[^n \mid \sum_{i=1}^n x_i = 1 \right\}$.

- (a) Montrer que : $\forall x \in C$, $g(x) \leq \frac{1}{n} \ln(n)$.
 (b) Étudier les extrema locaux de la fonction $g|_C$, restriction de g à C .

121. C1 Mines Ponts

Mots-clés : groupe symplectique, espace tangent

Soient un entier $n \in \mathbb{N}^*$ et la matrice $J = \begin{pmatrix} 0 & I_n \\ -I_n & 0 \end{pmatrix} \in \mathcal{M}_{2n}(\mathbb{R})$ définie par blocs.

- (a) On note Sp_{2n} l'ensemble des matrices symplectiques, défini par : $Sp_{2n} = \{M \in \mathcal{M}_{2n}(\mathbb{R}) \mid M^T J M = J\}$. Montrer que Sp_{2n} est un sous-groupe de $GL_{2n}(\mathbb{R})$.
 (b) On note H_{2n} l'ensemble des matrices hamiltoniennes, défini par : $H_{2n} = \{A \in \mathcal{M}_{2n}(\mathbb{R}) \mid A^T J + J A = 0\}$. Montrer que H_{2n} est un *sev* de $\mathcal{M}_{2n}(\mathbb{R})$. Quelle est sa dimension ? (On pourra écrire la matrice $A \in \mathcal{M}_{2n}(\mathbb{R})$ par blocs.)
 (c) Soit $A \in H_{2n}$. Montrer que : $\forall t \in \mathbb{R}$, $e^{tA} \in Sp_{2n}$.
 (d) En déduire que H_{2n} est inclus dans l'espace tangent à Sp_{2n} en I_{2n} . Cette inclusion est-elle une égalité ?

122. RMS 2026 1233 Centrale MP MPI

Soit U un ouvert d'un espace vectoriel normé E de dimension finie, soient a et b deux points distincts de U tels que le segment $[a, b]$ est inclus dans U .

- (a) Soit $g : U \rightarrow \mathbb{R}$ différentiable. Montrer qu'il existe $c \in]a, b[$ tel que $g(b) - g(a) = dg(c) \cdot (b - a)$. (On pourra utiliser la fonction $\varphi : t \mapsto g(tb + (1-t)a)$.)
 (b) Soit $f : U \rightarrow F$, où F est un espace euclidien. On suppose que la fonction f est différentiable sur U et que sa différentielle $df : x \mapsto df(x)$ est bornée sur U . Montrer que $\|f(b) - f(a)\| \leq \sup_{x \in [a, b]} \|df(x)\|_{\text{op}} \times \|b - a\|$. (On pourra utiliser un vecteur $v \in F$ et la fonction $x \in U \mapsto \langle f(x), v \rangle \in \mathbb{R}$.)

123. RMS 2026 800 Mines-Ponts MP MPI

Soit $f : x \in \mathbb{R}^n \mapsto (f_1(x), \dots, f_n(x)) \in \mathbb{R}^n$.

- (a) On suppose f de classe \mathcal{C}^2 . Montrer que $J_f(x)$ est antisymétrique pour tout $x \in \mathbb{R}^n$ si, et seulement si, il existe $A \in \mathcal{A}_n(\mathbb{R})$ et $b \in \mathbb{R}^n$ tels que $f(x) = Ax + b$ pour tout $x \in \mathbb{R}^n$.
 (b) On suppose f de classe \mathcal{C}^1 . Montrer que $J_f(x)$ est symétrique pour tout $x \in \mathbb{R}^n$ si, et seulement si, il existe $g : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ de classe \mathcal{C}^2 telle que $f = \nabla g$. (On pourra étudier le gradient de la fonction $x = (x_1, \dots, x_n) \in \mathbb{R}^n \mapsto \sum_{k=1}^n x_k \int_0^1 f_k(tx) dt$.)

3 Probabilités

124. RMS 2017 482 X ESPCI PC & RMS 2018 518 X ESPCI PC

On place aléatoirement $n \geq 3$ boules dans n urnes. Calculer la probabilité qu'une seule urne soit vide.

SOLUTION. — L'univers est l'ensemble Ω des applications de $\llbracket 1, n \rrbracket$ (l'ensemble des boules) dans $\llbracket 1, n \rrbracket$ (l'ensemble des urnes) et il y a équiprobabilité. On a

$$\text{Card } \Omega = n^n.$$

Construire un résultat favorable à l'événement V qui nous intéresse, c'est :

- choisir une urne qui sera vide, il y a n manières ;
- choisir une urne qui contiendra deux boules, il y a $n - 1$ manières ;
- choisir les deux boules que contiendra cette urne, il y a $\binom{n}{2} = \frac{n(n-1)}{2}$ choix ;
- placer une des $n - 2$ boules restantes dans chacune des $n - 2$ urnes restantes, il y a $(n - 2)!$ manières.

Le nombre de résultats favorables est donc $n \cdot (n - 1) \cdot (n - 2)! \cdot \binom{n}{2} = n! \binom{n}{2}$. La probabilité cherchée vaut donc

$$P(V) = \frac{\text{Card } V}{\text{Card } \Omega} = \binom{n}{2} \frac{n!}{n^n}.$$

REMARQUE. — La formule de Stirling donne l'équivalent $P(V) \sim \sqrt{\frac{\pi}{2}} n^{5/2} e^{-n}$ quand n tend vers l'infini.

125. RMS 2017 900 Mines Ponts PC, RMS 2016 615 Mines Ponts PC

On lance deux dés équilibrés. Soient U_1 et U_2 deux variables aléatoires correspondant aux résultats des lancers des dés 1 et 2. On pose $X = \min\{U_1, U_2\}$ et $Y = \max\{U_1, U_2\}$.

- Déterminer $P(X \geq k)$ et $P(Y \geq k)$ pour chaque $k \in \llbracket 1, 6 \rrbracket$.
- Calculer XY en fonction de U_1 et U_2 et en déduire que $E(XY) = (\frac{7}{2})^2$.

SOLUTION. — \triangleright **Stratégie du max** : $(Y \leq k) = (U_1 \leq k) \cap (U_2 \leq k)$. Voir aussi l'exercice 136.

- La variable X est à valeurs dans $\llbracket 1, 6 \rrbracket$ et, pour $k \in \llbracket 1, 6 \rrbracket$, on a $(X \geq k) = (U_1 \geq k) \cap (U_2 \geq k)$. Par indépendance et équiprobabilité, on en déduit que $P(X \geq k) = [P(U_1 \geq k)]^2 = (\frac{6-k+1}{6})^2 = (\frac{7-k}{6})^2$.
De $(Y \geq k) = (U_1 \geq k) \cup (U_2 \geq k)$, on déduit que $P(Y \geq k) = P[(U_1 \geq k) \cup (U_2 \geq k)] = P(U_1 \geq k) + P(U_2 \geq k) - P[(U_1 \geq k) \cap (U_2 \geq k)] = P(U_1 \geq k) + P(U_2 \geq k) - P(X \geq k)$.
- On a $XY = U_1 U_2$ et, par indépendance, $E(U_1 U_2) = [E(U_1)]^2 = (\frac{7}{2})^2$.

126. RMS 2017 1353 CCP PSI

Deux joueurs jouent avec des pièces équilibrées. Ils lancent chacun n fois une pièce. Celui qui gagne est celui qui obtient le plus grand nombre de fois pile. Quelle est la probabilité qu'il y ait un gagnant ? On pourra utiliser (et éventuellement démontrer) l'égalité $\sum_{i=0}^n \binom{n}{i}^2 = \binom{2n}{n}$.

127. RMS 2021 132 1190 CCP PSI 2021, RMS 2018 129 207 CCP PSI 2018

Soient X et Y deux variables aléatoires à valeurs dans \mathbb{N} , indépendantes, de même loi et admettant une variance. On suppose que la variable aléatoire $Z = X + Y + 1$ suit une loi géométrique de paramètre $p \in]0, 1[$.

- Déterminer l'espérance et la variance de X .
- Calculer la fonction génératrice de X sur $]0, 1[$.
- En déduire la loi de X .

128. RMS 2016 964 CCP PSI

On considère une urne contenant $n - 1$ boules noires et une boule blanche.

- On effectue une succession de tirages avec remise dans cette urne et on note T la variable aléatoire donnant le rang du premier tirage amenant la boule blanche. Donner les valeurs prises par T , sa loi, son espérance et sa variance.
- On effectue maintenant des tirages sans remise.
 - Soit X la variable aléatoire donnant le rang du premier tirage amenant la boule blanche. Donner les valeurs prises par X , sa loi, son espérance et sa variance.
 - Soit Y la variable aléatoire donnant le nombre de boules noires restantes dans l'urne après le tirage de la boule blanche. Exprimer Y en fonction de X et n . Donner l'espérance de Y ainsi que sa variance.

129. RMS 2016 614 Mines Ponts PC v2026

- (a) Soit X une variable aléatoire suivant une loi géométrique de paramètre $p \in]0, 1[$.
Montrer que $\frac{1}{X}$ est d'espérance finie et calculer $E(\frac{1}{X})$.
- (b) Soit A l'ensemble des v.a. non constantes et strictement positives telles que $X \in L^1$ et $\frac{1}{X} \in L^1$.
Étudier $\inf_{X \in A} E(X)E(\frac{1}{X})$.

130. RMS 2017 1358 CCP PSI

Soit $n \geq 2$. On effectue des tirages avec remise dans une urne contenant n boules numérotées de 1 à n . On note X_n le rang du premier tirage où l'on obtient une boule différente de la première boule tirée.

- (a) Établir la loi de la variable aléatoire X_n .
(b) Justifier l'existence de l'espérance de X_n et la calculer.

131. RMS 2016 967 ENSEA PSI

Soit X une variable aléatoire telle que $X \leftrightarrow \mathcal{P}(\lambda)$. Montrer que $E(|X - \lambda|) = 2e^{-\lambda} \frac{\lambda^{N+1}}{N!}$, avec $N = \lfloor \lambda \rfloor$.

132. RMS 2017 1357 CCP PSI

Dans un casino, une machine renvoie un entier naturel N non nul selon la loi de probabilité : $\forall n \in \mathbb{N}^*$, $P(N = n) = \frac{1}{2^n}$. Le joueur gagne N jetons si N est pair ; il perd N jetons si N est impair.

- (a) Quelle est la probabilité de gagner ?
(b) Déterminer l'espérance de la variable aléatoire G égale au gain algébrique du joueur.

133. RMS 2017 901 Mines Ponts PC

On lance une pièce qui a une probabilité p de donner pile. On note X le nombre de lancers nécessaires pour obtenir deux fois pile. Déterminer la loi de X et la fonction génératrice G_X de X . Calculer $E(X)$.

134. RMS 2016 803 Centrale PSI

Trois individus jouent au ballon :

- si A possède la balle, il l'envoie à B avec probabilité $\frac{1}{3}$ et à C avec probabilité $\frac{2}{3}$,
- si B possède la balle, il l'envoie à A avec probabilité $\frac{1}{3}$ et à C avec probabilité $\frac{2}{3}$,
- si C possède la balle, il l'envoie à B avec probabilité $\frac{2}{3}$ et à A avec probabilité $\frac{1}{3}$.

On note A_n l'événement : le joueur A reçoit le ballon au n -ième lancer, et on définit de même B_n, C_n . Étudier la limite des suites $P(A_n), P(B_n)$ et $P(C_n)$.

135. RMS 2017 1355 CCP PSI

Mots-clés : la loi du 0 - 1 de Borel

Soit (A_n) une suite d'événements indépendants.

- (a) Soient $n, p \in \mathbb{N}$. Montrer que la probabilité qu'aucun des événements A_n, \dots, A_{n+p} ne se réalise est inférieure ou égale à $\exp(-\sum_{k=n}^{n+p} P(A_k))$.
- (b) On suppose que la série de terme général $P(A_n)$ est divergente. Montrer qu'il est presque impossible qu'il n'y ait qu'un nombre fini d'entiers n pour lesquels A_n est réalisé.
- (c) Montrer que, si la série de terme général $P(A_n)$ converge, alors il est presque certain qu'il n'y ait qu'un nombre fini d'entiers n pour lesquels A_n est réalisé.

136. RMS 2016 630 Mines Ponts PC, RMS 2017 914 Mines Ponts PC

Mots-clés : maximum de lois géométriques indépendantes

Soient X et Y deux variables aléatoires indépendantes suivant une loi géométrique de paramètre $p \in]0, 1[$. Soit $Z = \max(X, Y)$. Déterminer l'espérance de Z .

137. RMS 2017 192 ENS PC

- (a) Pour tout $\lambda > 0$, soit X_λ une variable aléatoire suivant une loi de Poisson de paramètre λ . Soit $c > 0$: montrer que $P(|X_\lambda - \lambda| \geq c\lambda) \rightarrow 0$ lorsque $\lambda \rightarrow +\infty$.
- (b) Soient, pour tout $\lambda > 0$, des variables aléatoires indépendantes $A_\lambda, B_\lambda, C_\lambda$ suivant une loi de Poisson de paramètre λ .
Étudier l'espérance de $\Delta_\lambda = B_\lambda^2 - 4A_\lambda C_\lambda$.
- (c) Soit $E_\lambda(c) = (|A_\lambda - \lambda| < c\lambda) \cap (|B_\lambda - \lambda| < c\lambda) \cap (|C_\lambda - \lambda| < c\lambda)$. Montrer que $E_\lambda(\frac{1}{3}) \subset (\Delta_\lambda < 0)$.
- (d) Déterminer la limite, lorsque $\lambda \rightarrow +\infty$, de la probabilité que le polynôme $A_\lambda X^2 + B_\lambda X + C_\lambda$ ait toutes ses racines réelles.

138. RMS 2017 1077 Centrale PSI

Mots-clés : marche aléatoire dans \mathbb{Z}^2

On munit \mathbb{R}^2 de son repère orthonormé que l'on note (O, \vec{i}, \vec{j}) . Un marcheur, initialement en O , se déplace à chaque onstant n d'un pas dans l'une des quatre directions (nord, sud, est, ouest) de manière équiprobable. On note $A_n = (X_n, Y_n)$ sa position à l'instant n . On note aussi Z_n la distance du marcheur au point O à l'instant n .

- (a) Déterminer l'espérance et la variance de X_n .
- (b) Les deux variables aléatoires X_n et Y_n sont-elles indépendantes ? Déterminer leur covariance.
- (c) Montrer que $E(Z_n) \leq \sqrt{n}$.

139. RMS 2024 172 ENS MP MPI

Soient X et Y deux variables aléatoires réelles discrètes telles que $X(\Omega)$ et $Y(\Omega)$ sont finis.

- (a) Soit $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ une fonction convexe. Comparer $E(f(X))$ et $f(E(X))$.
- (b) On dit que $X \leq_c Y$ si, pour toute fonction $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ convexe, $E(f(X)) \leq E(f(Y))$.
 - i. Donner un exemple de couple (X, Y) tel que $X \neq Y$ et $X \leq_c Y$.
 - ii. Montrer que, si $X \leq_c Y$, alors $E(X) = E(Y)$ et $V(X) \leq V(Y)$.

140. UPS 20240116

Mots-clés : inégalité de Cantelli

Soit X une variable aléatoire discrète réelle possédant une espérance $\mu = E(X)$ et une variance $\sigma^2 = V(X)$. Montrer que, pour tout $a > 0$, $P(X - \mu \geq a) \leq \frac{\sigma^2}{\sigma^2 + a^2}$. (On pourra utiliser l'événement $(X - \mu + t)^2 \geq (a + t)^2$, où $t \in \mathbb{R}_+$).

141. B3 X

Soient X et Y deux variables aléatoires discrètes, indépendantes, à valeurs dans \mathbb{N} . Soit $p \in]0, 1[$.

- (a) On suppose que $X \sim \mathcal{B}(n_1, p)$ et $Y \sim \mathcal{B}(n_2, p)$ où $n_1, n_2 \in \mathbb{N}^*$. Qu'en déduire sur la v.a. $X + Y$?
- (b) On suppose que $X + Y \sim \mathcal{B}(n, p)$ où $n \in \mathbb{N}^*$. Qu'en déduire sur les v.a. X et Y ?

142. RMS 2025 824 Mines-Ponts MP MPI

Soient X et Y deux v.a. strictement positives, de même loi et d'espérance finie.

- (a) On suppose que X et Y sont indépendantes et que $\frac{1}{X}$ est d'espérance finie. Montrer que $\frac{X}{Y}$ est d'espérance finie et que $E\left(\frac{X}{Y}\right) \geq 1$.
- (b) On suppose que $\ln(X)$ et $\frac{X}{Y}$ sont d'espérance finie. Montrer que $E\left(\frac{X}{Y}\right) \geq 1$.

143. RMS 2026 1238 Centrale MP MPI

Mots-clés : loi de Poisson et transformée de Laplace

Soit $(X_n)_{n \geq 1}$ une suite de variables aléatoires indépendantes suivant toutes la loi de Poisson de paramètre $\lambda > 0$. On pose, pour tout $n \in \mathbb{N}^*$, $S_n = \sum_{k=1}^n X_k$.

- (a) Montrer que $S_n \sim \mathcal{P}(n\lambda)$. et que, pour tout $\varepsilon > 0$, $\mathbf{P}(|S_n - n\lambda| \geq n\varepsilon) \leq \frac{\lambda}{n\varepsilon^2}$.
- (b) Soit $x > 0$. Montrer que $\lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{k=0}^{\lfloor nx \rfloor} e^{-\lambda n} \frac{(n\lambda)^k}{k!} = \begin{cases} 0 & \text{si } 0 < x < \lambda, \\ 1 & \text{si } x > \lambda. \end{cases}$
- (c) Soit $f : \mathbb{R}^+ \rightarrow \mathbb{C}$ une fonction continue et nulle en dehors d'un segment. Montrer que la fonction $\mathcal{L}(f) : x \in \mathbb{R}^+ \mapsto \int_0^{+\infty} f(t)e^{-xt} dt$ est de classe \mathcal{C}^∞ et que, pour tout $x \geq 0$, $\lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{k=0}^{\lfloor nx \rfloor} (-1)^k \frac{n^k}{k!} \mathcal{L}(f)^{(k)}(n) = \int_0^x f$.

144. RMS 2026 163 ENS MP MPI

On munit $\mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{R})$ du produit scalaire canonique. Soit $X = (X_1 \dots X_n)^T$ un vecteur aléatoire tel que la v.a. $\|X\|^2$ est d'espérance finie.

- (a) Justifier que la matrice de covariance $C(X) = (\text{Cov}(X_i, X_j))_{1 \leq i, j \leq n}$ est bien définie. À quelle condition cette matrice est-elle diagonale ?
- (b) Soient le vecteur $v \in \mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{R})$ et la v.a. $Y = \langle v, X \rangle$. Montrer que $\mathbf{V}(Y) = v^T C(X) v$.
- (c) Montrer que $C(X) \in S_n^+$ et que, réciproquement, toute matrice $A \in S_n^+$ est la matrice de covariance d'un vecteur aléatoire X . (On pourra exhiber une matrice M telle $A = MM^T$ et un vecteur aléatoire Z tel que $C(Z) = I_n$.)

Commentaires :

1. Laissez entrevoir à l'examinateur dès le début de l'oral ce que vous avez su faire ou non de tous les exercices, par des formules du type « J'ai résolu, sauf erreur, le deuxième exercice et les questions 1 et 3 du premier exercice. Dans la question 2, je n'ai pas encore conclu mais je pense à un équivalent ou, peut-être à une comparaison série-intégrale. » Cela permettra à l'examinateur de vous relancer sur une des pistes. Et vous évitera la frustration, pris par le temps, de devoir sortir de la salle en fin d'oral en donnant l'impression de ne pas avoir touché à une question que vous aviez pourtant abordée.
2. Pensez à donner la définition des termes techniques (le *sup* est le plus petit des majorants, etc) ou énoncer les théorèmes que vous allez utiliser (avec leurs hypothèses), éventuellement dès le début en présentant l'exercice.
3. À l'oral, au contraire de l'écrit, on annonce le résultat ou la conclusion **puis** on en fait le calcul ou la preuve. Parce que :
 - il est chronophage de prouver un résultat erroné ;
 - l'examinateur vous dispensera parfois de développer le calcul d'un résultat, s'il constate que vous avez obtenu le bon résultat. Rien ne vous interdit d'ailleurs, après lui avoir exposé le résultat, de lui demander : « Voulez-vous que je détaille le calcul (ou la preuve) ? »
4. Ne pas dire « On voit que » et ne surtout pas dire « On voit directement que » ni « clairement » ni « facilement » ni « immédiatement ».
5. On évitera de répéter « du coup » ou « de base ».
6. Si vous écrivez gros, ou en désordre, divisez votre tableau dès le début de l'oral. N'oubliez pas d'appuyer sur la craie.
7. Une indication de l'examinateur n'est pas un piège, ne pas en tenir compte est une bêtise et les bêtises font perdre des points.
8. On ne se précipite pas pour répondre à une question de l'examinateur : « Il faut tourner sept fois sa langue dans sa bouche avant de parler. »
9. Faire un dessin :
 - s'il est question de projection orthogonale ou de Pythagore ;
 - si vous voulez décrire une rotation autour d'un axe (cela vaut mieux que de faire des gestes) ;
 - si vous voulez décrire les propriétés d'une fonction comme « $\forall x \in \mathbb{R}, |\text{Arctan}(x)| \leq \pi/2$ », « $\forall x \geq 0, \sin(x) \leq x$ », « $\forall x > -1, \ln(1+x) \leq x$ » ou « $\forall x \in \mathbb{R}, e^x \geq 1+x$ » ;
 - si vous comparez série et intégrale ;
 - si vous voulez discuter la convergence d'une série entière en indiquant R et $-R$.
10. Ne pas dire « L'intégrale converge **quand** $x > 0$ » mais dire « **si** » ou « **si, et seulement si** ».
11. « Il faut que » ne signifie pas « il faut et il suffit que ».
12. $x < 0$ se dit « x est strictement inférieur à 0 » ou « x est strictement négatif » mais pas « x est inférieur à 0 » ni « x est négatif »
13. Ne pas dire « Chacun de ces événements est indépendant » mais « Ces événements sont indépendants » ou (ce n'est pas la même chose) « indépendants deux à deux ».
14. Ne pas dire : « ça converge » (l'intégrale, la suite, la série ?). Ne pas dire « La suite de fonctions converge » car une suite de fonctions converge simplement, voire uniformément. Ne pas dire « La série de fonctions converge » car une série de fonctions converge simplement voire uniformément voire normalement.
15. « L'union $\cup_{n \in \mathbb{N}} F_n$ est disjointe » ne signifie pas « $\forall n \in \mathbb{N}, F_n \cap F_{n+1} = \emptyset$ » mais signifie « $\forall i \neq j, F_i \cap F_j = \emptyset$ », autrement dit « les événements sont disjoints deux à deux » et non pas « chaque événement est disjoint de son successeur ».
16. « Soit i est une valeur propre, soit $-i$ l'est » est une manière (maladroite) de dire que « Ou bien i est une valeur propre, ou bien $-i$ l'est ». À ne pas confondre avec « i est une valeur propre ou $-i$ l'est ».
17. On compare les fonctions (positives) et non les intégrales pour conclure sur la convergence voire sur la comparaison des intégrales. Idem pour les suites et les séries.
18. En proba : d'abord les événements (est-ce une intersection ? d'événements indépendants ? ou une union ? disjointe ?), ensuite leur proba.
19. Les « éléments propres » d'une matrice = ses valeurs propres et ses sous-espaces propres.