

A 2004 Math PSI 1

ÉCOLE NATIONALE DES PONTS ET CHAUSSÉES.  
ÉCOLES NATIONALES SUPÉRIEURES DE L'AÉRONAUTIQUE ET DE L'ESPACE,  
DE TECHNIQUES AVANCÉES, DES TÉLÉCOMMUNICATIONS,  
DES MINES DE PARIS, DES MINES DE SAINT-ÉTIENNE, DES MINES DE NANCY,  
DES TÉLÉCOMMUNICATIONS DE BRETAGNE.  
ÉCOLE POLYTECHNIQUE (Filière TSI).

CONCOURS D'ADMISSION 2004

**PREMIÈRE ÉPREUVE DE MATHÉMATIQUES**  
**Filière PSI**

(Durée de l'épreuve : 3 heures)

(L'usage d'ordinateur ou de calculatrice est interdit).

Sujet mis à la disposition des concours : Cycle International, ENSTIM, INT, TPE-EIVP.

Les candidats sont priés de mentionner de façon apparente sur la première page de la copie :  
MATHÉMATIQUES 1-Filière PSI.

Cet énoncé comporte 5 pages de texte.

Si, au cours de l'épreuve, un candidat repère ce qui lui semble être une erreur d'énoncé, il le signale sur sa copie et poursuit sa composition en expliquant les raisons des initiatives qu'il est amené à prendre.

Ce problème met en évidence par une méthode originale une propriété et une méthode de calcul de la moyenne et de la variance bien connues en Probabilités.

Soit  $S$  l'ensemble des suites réelles  $U = (u_n)_{n \in \mathbb{N}}$  dont tous les termes  $u_n$  sont positifs ou nuls et la somme égale à 1 :

$$S = \left\{ U \mid U = (u_n)_{n \in \mathbb{N}}, \quad \forall n, u_n \geq 0, \quad \sum_{n=0}^{\infty} u_n = 1 \right\}.$$

Soit  $F$  l'ensemble des fonctions réelles  $f$  qui sont des sommes de série entière de rayon de convergence  $R$  supérieur ou égal à 1 ; ces séries entières sont convergentes lorsque le réel  $x$  est égal à 1 et leur somme vaut 1 en ce point ; toutes les dérivées des fonctions  $f$  en 0 sont positives ou nulles :

$$F = \left\{ f \mid f(x) = \sum_{n=0}^{\infty} a_n x^n, \quad \sum_{n=0}^{\infty} a_n = 1, \quad R \geq 1, \quad \forall n, f^{(n)}(0) \geq 0 \right\}.$$

À une suite  $U = (u_n)_{n \in \mathbb{N}}$ , appartenant à  $S$ , est associée la fonction  $f$  définie par la relation suivante :

$$f(x) = \sum_{n=0}^{\infty} u_n x^n.$$

Soit  $j$  l'application ainsi définie :  $U \mapsto f = j(U)$  ; la fonction  $j(U)$  est notée  $\hat{U}$ .

**Propriétés des fonctions de  $F$  et des suites de  $S$  :**

1. Démontrer que toute fonction  $f$ , qui appartient à l'ensemble  $F$ , est, sur l'intervalle ouvert  $I = ]-1, 1[$ , une fonction indéfiniment dérivable, croissante sur le segment  $[0, 1]$  et convexe sur l'intervalle semi-ouvert  $[0, 1[$ .

2. Démontrer que toute fonction  $f$ , qui appartient à l'ensemble  $F$ , est continue à gauche en 1.

**Exemples :** soient  $G$ ,  $E^q$  et  $V$  les trois suites définies par les relations suivantes :

·  $G$  est la suite géométrique de terme général  $g_n = 1/2^{n+1}$  :

$$G = \left( \frac{1}{2^{n+1}} \right)_{n \in \mathbb{N}} .$$

· Étant donné un entier naturel  $q$ ,  $E^q$  est la suite dont tous les termes sont nuls sauf le terme de rang  $q$  égal à 1 :

$$E^q = (0, \dots, 0, 1, 0, \dots) .$$

·  $V = (v_n)_{n \in \mathbb{N}}$  est la suite de réels définie par les relations suivantes :

$$v_0 = 1/2 ; \text{ pour } n \geq 1, v_n = \frac{a}{n^2} \text{ avec } a = \left( 2 \sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n^2} \right)^{-1} .$$

3. Montrer que les suites  $G$ ,  $E^q$  et  $V$  sont dans  $S$ . Déterminer les images  $\widehat{G} = j(G)$ ,  $\widehat{E}^q = j(E^q)$  des suites  $G$  et  $E^q$  ; calculer la dérivée  $\widehat{V}'$  de la fonction  $\widehat{V} = j(V)$  image de la suite  $V$  ; puis donner l'expression de  $\widehat{V}'(x)$  à l'aide d'une intégrale.

4. Soit  $f$  une fonction appartenant à l'ensemble  $F$ .

Démontrer que, si la fonction  $f$  est nulle en 0 ( $f(0) = 0$ ), la fonction  $f$  est, soit égale à  $x$  sur le segment  $[0, 1]$ , soit strictement majorée par  $x$  sur l'intervalle ouvert  $]0, 1[$  ( $0 < x < 1 \implies f(x) < x$ ).

Démontrer que, si la fonction  $f$  est strictement positive en 0 ( $f(0) > 0$ ), l'équation

$$f(x) = x$$

a, dans l'intervalle ouvert  $]0, 1[$ , au plus une solution.

5. Démontrer que, pour toute suite  $U$  appartenant à l'ensemble  $S$ , la fonction  $j(U)$  appartient à l'ensemble  $F$ . Démontrer que l'application  $j$  est une application bijective de l'ensemble  $S$  sur l'ensemble  $F$ .

**Une loi de composition dans l'ensemble  $S$  :**

Étant données deux suites  $U = (u_n)_{n \in \mathbb{N}}$  et  $V = (v_n)_{n \in \mathbb{N}}$  appartenant à l'ensemble  $S$ , soit  $U * V$  la suite, dont les termes  $w_n$ ,  $n \in \mathbb{N}$ , sont définis par la relation suivante :

$$w_n = \sum_{p=0}^n u_p v_{n-p} .$$

6. Démontrer que la suite  $U * V = (w_n)_{n \in \mathbb{N}}$  ainsi définie appartient à l'ensemble  $S$ .

7. Démontrer qu'étant données deux suites  $U$  et  $V$  de  $S$ , à la composée  $U * V$  de ces suites correspond par l'application  $j$  le produit des fonctions  $j(U)$  et  $j(V)$  :

$$j(U * V) = j(U) j(V) \quad \text{ou} \quad \widehat{U * V} = \widehat{U} \cdot \widehat{V}.$$

8. Démontrer que la loi de composition  $*$  définie ci-dessus est associative, a un élément neutre et est commutative.

Étant donné un réel  $p$ , strictement compris entre 0 et 1 ( $0 < p < 1$ ) et un réel  $\lambda$  strictement positif, soient  $B^p$ ,  $\Gamma^p$  et  $\Pi^\lambda$  les suites définies de la manière suivante :

·  $B^p$  est la suite dont tous les termes  $\beta_n^p$ ,  $n \in \mathbb{N}$ , sont nuls sauf les deux premiers :  $\beta_0^p = 1 - p$  et  $\beta_1^p = p$  :

$$B^p = (1 - p, p, 0, 0, \dots).$$

·  $\Gamma^p$  est la suite de terme général  $\gamma_n^p = (1 - p) p^n$ ,  $n \in \mathbb{N}$  :

$$\Gamma^p = ((1 - p) p^n)_{n \in \mathbb{N}}.$$

·  $\Pi^\lambda$  est la suite de terme général  $\pi_n^\lambda = \frac{\lambda^n}{n!} e^{-\lambda}$ ,  $n \in \mathbb{N}$  :

$$\Pi^\lambda = \left( \frac{\lambda^n}{n!} e^{-\lambda} \right)_{n \in \mathbb{N}}.$$

**Produit de composition  $*$  de chacune de ces suites  $q$  fois avec elle-même :**

9. Démontrer que les trois suites  $B^p$ ,  $\Gamma^p$  et  $\Pi^\lambda$  appartiennent à l'ensemble  $S$ . Déterminer leurs images  $\widehat{B^p}$ ,  $\widehat{\Gamma^p}$  et  $\widehat{\Pi^\lambda}$  par l'application  $j$ .

10. Étant donné un entier naturel  $q$  strictement positif, déterminer les suites  $B^{p*q}$ ,  $\Gamma^{p*q}$  et  $\Pi^{\lambda*q}$  obtenues respectivement à partir des suites  $B^p$ ,  $\Gamma^p$  et  $\Pi^\lambda$  par composition  $q$  fois avec elle-même. Préciser les termes de ces suites notés respectivement  $\beta_n^{p*q}$ ,  $\gamma_n^{p*q}$  et  $\pi_n^{\lambda*q}$ ,  $n \in \mathbb{N}$ .

**Pour un réel  $\lambda$  donné, limite de la suite  $B^{\frac{\lambda}{q}*q}$  lorsque l'entier  $q$  croît vers l'infini.**

11. Le réel strictement positif  $\lambda$  est donné ; lorsque l'entier  $q$  est suffisamment grand, le rapport  $\lambda/q$  est un réel strictement compris entre 0 et 1.

Déterminer, pour tout entier  $n$  fixé, la limite du terme

$$\beta_n^{\frac{\lambda}{q}*q} \text{ de rang } n \text{ de la suite } B^{\frac{\lambda}{q}*q},$$

lorsque l'entier  $q$  croît vers l'infini. Exprimer cette limite à l'aide du terme  $\pi_n^\lambda$  de rang  $n$  de la suite  $\Pi^\lambda$ .

**Suite d'éléments de  $S$  :**

12. Soit une suite  $(U^q)_{q \in \mathbb{N}}$  d'éléments de l'ensemble  $S$ . Soit  $u_n^q$  le terme de rang  $n$  de la suite  $U^q$  :

$$U^q = (u_n^q)_{n \in \mathbb{N}} .$$

Cette suite d'éléments de  $S$  est supposée telle que chacune des suites des termes de rang  $n$   $(u_n^q)_{q \in \mathbb{N}}$  est, lorsque l'entier  $q$  croît vers l'infini, une suite convergente de limite  $v_n$ .

Démontrer que la série de terme général  $v_n$ ,  $n \in \mathbb{N}$ , est une série de terme général positif ou nul, convergente, de somme inférieure ou égale à 1 :

$$\sum_{n=0}^{\infty} v_n \leq 1.$$

Donner un exemple de suite  $(U^q)_{q \in \mathbb{N}}$  d'éléments de l'ensemble  $S$  telle que chacune des suites  $(u_n^q)_{q \in \mathbb{N}}$  définie par les termes de rang  $n$  soit convergente et de limite  $v_n$  nulle.

Étant donné un réel  $r$  strictement positif ( $r > 0$ ), soit  $S_r$  le sous-ensemble des éléments  $U = (u_n)_{n \in \mathbb{N}}$  de l'ensemble  $S$  tels que la série de terme général  $u_n n^r$ ,  $n \in \mathbb{N}$ , soit convergente.

$$S_r = \left\{ U \mid U \in S, U = (u_n)_{n \in \mathbb{N}}, \sum_{n=1}^{\infty} u_n n^r < \infty \right\}.$$

**Relation d'inclusion entre les sous-ensembles  $S_r$  :**

13. Étant donnés deux réels  $r$  et  $s$  strictement positifs ( $r > 0$ ,  $s > 0$ ), démontrer que, si les réels  $r$  et  $s$  sont distincts l'un de l'autre ( $r \neq s$ ), l'un des deux sous-ensembles  $S_r$  et  $S_s$  est contenu dans l'autre.

À une suite  $U = (u_n)_{n \in \mathbb{N}}$  appartenant à l'ensemble  $S_1$ , est associé le réel  $M(U)$ , appelé moyenne de  $U$ , défini par la relation suivante :

$$M(U) = \sum_{n=1}^{\infty} n u_n.$$

À une suite  $U = (u_n)_{n \in \mathbb{N}}$  appartenant à l'ensemble  $S_2$ , est associé le réel  $V(U)$ , appelé variance de  $U$ , défini par la relation suivante :

$$V(U) = \sum_{n=1}^{\infty} n^2 u_n - M(U)^2.$$

Dans toute la suite du problème l'élément  $U$  de  $S$  appartient au sous-ensemble  $S_2$ .

**Positivité de la variance :**

14. Un résultat préliminaire : soient  $N$  un entier strictement positif et  $A = (a_i)_{1 \leq i \leq N}$  une suite de  $N$  réels strictement positifs ( $1 \leq i \leq N$ ,  $a_i > 0$ ). Démontrer que l'application  $\varphi$  qui, à deux vecteurs de  $\mathbb{R}^N$ ,  $X = (x_i)_{1 \leq i \leq N}$  et  $Y = (y_i)_{1 \leq i \leq N}$  associe le réel

$$\varphi(X, Y) = \sum_{i=1}^N a_i x_i y_i,$$

est un produit scalaire dans  $\mathbb{R}^N$ .

15. Pour tout élément  $U$  de  $S_2$ , démontrer l'existence des deux grandeurs  $M(U)$  et  $V(U)$ . Démontrer que la variance  $V(U)$  est positive ou nulle :

$$V(U) \geq 0.$$

Indication : comparer, pour tout entier  $N$ , les deux expressions suivantes :

$$\left( \sum_{n=1}^N n u_n \right)^2 \quad \text{et} \quad \left( \sum_{n=1}^N u_n \right) \cdot \left( \sum_{n=1}^N n^2 u_n \right).$$

**Une expression approchée de la fonction  $\widehat{U}$  à l'aide de la moyenne et de la variance :**

16. Démontrer que les dérivées première  $\widehat{U}'$  et seconde  $\widehat{U}''$  de  $\widehat{U}$  admettent une limite lorsque le réel  $x$  tend vers 1 par valeurs inférieures. Déterminer ces deux limites, notées  $\widehat{U}'(1)$  et  $\widehat{U}''(1)$ , en fonction de  $M(U)$  et  $V(U)$ .

17. Soit  $x \mapsto \varepsilon(x)$  la fonction définie sur l'intervalle ouvert  $] -1, 1[$  par la relation suivante :

$$\varepsilon(x) = \widehat{U}'(1) - \widehat{U}'(x).$$

Démontrer, pour tout réel  $x$  compris strictement entre 0 et 1, l'inégalité suivante :

$$\left| \widehat{U}(x) - 1 - M(U)(x-1) - \frac{1}{2} \left( V(U) + M(U)^2 - M(U) \right) (x-1)^2 \right| \leq \frac{1}{2} (x-1)^2 \varepsilon(x).$$

**Moyenne et variance des trois suites  $B^p$ ,  $\Gamma^p$  et  $\Pi^\lambda$  :**

18. Démontrer, lorsque  $p$  est un réel strictement compris entre 0 et 1 et  $\lambda$  un réel strictement positif, que les trois suites  $B^p$ ,  $\Gamma^p$  et  $\Pi^\lambda$  définies ci-dessus, appartiennent à l'ensemble  $S_2$ .

19. Calculer pour chacune de ces suites  $B^p$ ,  $\Gamma^p$  et  $\Pi^\lambda$  la moyenne et la variance. C'est-à-dire les six grandeurs :

$$M(B^p), V(B^p), M(\Gamma^p), V(\Gamma^p), M(\Pi^\lambda), V(\Pi^\lambda).$$

FIN DU PROBLÈME