



---

## Ahou tcha tcha tcha - Cahier de vacances

(\*) Facile (\*\*) Classique/intermédiaire (\*\*\*) Difficile

---

### Mini exercices / Questions classiques

Les questions de cette partie sont indépendantes et reprennent des techniques, calculs et notions qui balayent l'ensemble du programme de première année. On aura pas non plus la naïveté de croire que leur maîtrise "suffit".

Naturellement, il est indispensable de connaître parfaitement les différentes formules du cours (formule de sommes classiques, formule du binôme, somme des séries usuelles, lois usuelles, etc...)

Le premier programme de colle de l'année scolaire sera entièrement consacré à ces mini-exercices. Chaque étudiant.e en aura toute une série à traiter et il serait très dommage voire pénalisant de ne pas les avoir préparées.

#### Calcul

(1) (\*) Résoudre le système suivant

$$\begin{cases} x + y - 3z - t = 0 \\ 2x + y - 5z + 4t = 4 \\ x - 2y + 3t = -2 \\ -x + y + z - 2t = -1 \end{cases}$$

(2) (\*) Montrer que, pour tous  $n \in \mathbb{N}^*$  et  $k \in \llbracket 0; n \rrbracket$ ,

$$k \binom{n}{k} = n \binom{n-1}{k-1}.$$

(3) (\*\*) Montrer, par la méthode de votre choix, que, pour tout  $p \in \mathbb{N}^*$  et tout  $n \geq p + 1$ ,

$$\sum_{k=p}^{n-1} \binom{k-1}{p-1} = \binom{n-1}{p}.$$

(4) (\*\*) Calculer

$$\sum_{i=1}^n \sum_{j=i}^n \frac{i}{j+1}.$$

## Analyse

- (1) (\*) Montrer que, pour tout  $x > -1$ ,  $\ln(1+x) \leq x$ .
- (2) (\*) Nature de la branche en  $+\infty$  de la fonction  $f$  définie sur  $]0; +\infty[$  par  $f(x) = \frac{1}{2} \ln(\sqrt{e^{3x} + x} - 1)$ .
- (3) (\*/\*\*) Déterminer

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} \left(1 + \frac{1}{n}\right)^n.$$

- (4) (\*/\*\*) Montrer, par convergence monotone, que la suite  $(u_n)$  définie par  $u_0 = 0$  et  $u_{n+1} = (u_n^2 + 1)/2$  est convergente et préciser sa limite.
- (5) (\*\*) Montrer que la fonction  $f$  définie ci-dessous est de classe  $\mathcal{C}^1$  sur  $\mathbb{R}$

$$f(x) = \begin{cases} \frac{e^x - 1}{x}, & \text{si } x \neq 0 \\ 1, & \text{si } x = 0 \end{cases}$$

On commencera par montrer  $f$  est continue en 0. Puis, après avoir justifié que  $f$  dérivable en dehors de 0 on calculera  $f'(x)$ , pour  $x \neq 0$ . On montrera que  $f$  dérivable en 0, à l'aide du développement limité à l'ordre 2 ci-dessous

$$e^x = 1 + x + \frac{x^2}{2} + x^2 \varepsilon(x), \quad \text{où } \lim_{x \rightarrow 0} \varepsilon(x) = 0,$$

et enfin que  $f'$  est continue en 0.

- (6) (\*) Montrer que

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} \sum_{k=1}^n \frac{1}{k(k+1)} = 1.$$

(On essaiera de faire apparaître une somme télescopique.)

- (7) (\*\*) Montrer que, pour tout  $n \geq 1$ , l'équation  $x^{3n} + n^n x^n - 1 = 0$  admet une unique solution strictement positive  $a_n$ . Montrer que  $a_n < 1/n$  et en déduire la limite de  $a_n$  lorsque  $n \rightarrow +\infty$ .
- (8) (\*/\*\*) Montrer que la fonction  $f : x \mapsto x \exp(x^2)$  réalise une bijection de  $\mathbb{R}$  sur un intervalle à préciser et donner un développement limité de  $f^{-1}$  en 0.
- (9) Montrer la convergence et calculer la somme des séries ci-dessous

$$(i) \sum_{n \geq 0} \frac{(n+1)^2 (-2)^{n+2}}{5^n}, \quad (ii) \sum_{n \geq 1} \left( \frac{1}{\sqrt{n+3}} - \frac{1}{\sqrt{n}} \right).$$

- (10) (\*\*) Montrer que

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} \int_0^1 t^n dt = 0, \quad \text{et} \quad \lim_{n \rightarrow +\infty} \int_0^1 \frac{t^n}{1+t} dt = 0$$

- (11) (\*\*\*) Montrer que, pour tout  $x \in ]-1; 1[$ ,

$$\sum_{p=1}^n \frac{x^p}{p} = -\ln(1-x) - \int_0^x \frac{t^n}{1-t} dt.$$

- (12) (\*\*/\*\*\*)

(a) Rappeler la valeur de  $I_0 = \int_0^{+\infty} e^{-t} dt$ .

(b) Soit  $n \in \mathbb{N}^*$ . On s'intéresse à la suite d'intégrales  $(I_n)$  définie par

$$I_n = \int_0^{+\infty} t^n e^{-t} dt.$$

Montrer par récurrence, à l'aide d'une intégration par parties, la convergence de  $I_n$  et la relation  $I_n = nI_{n-1}$ . En déduire l'expression de  $I_n$  en fonction de  $n$ .

- (13) (\*SciLab) Écrire un programme qui calcule et affiche petit entier  $N$  tel que  $u_N \geq A$ , où la suite  $(u_n)$  est définie par

$$u_0 = 2, \quad \text{et} \quad u_{n+1} = \exp(u_n) - e \ln(u_n).$$

- (14) (\*\*SciLab) Écrire un programme de dichotomie permettant de donner une valeur approchée à  $10^{-4}$  de la solution de l'équation  $e^x + x = 3$ .

### Algèbre Linéaire

- (1) (\*/\*\*) Déterminer **soigneusement**, par la formule du binôme, les puissances  $A^n$  ( $n \in \mathbb{N}^*$ ) de la matrice

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}.$$

- (2) (\*\*) On note  $R_n(X) = a_n X + b_n$  le reste de la division euclidienne de  $X^n$  par  $X^2 - 3X + 2$ . À l'aide des racines de  $X^2 - 3X + 2$ , déterminer explicitement les coefficients  $a_n$  et  $b_n$ , puis en déduire les puissances  $A^n$  ( $n \in \mathbb{N}^*$ ) de la matrice

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

(On calculera  $P(A)$ .)

- (3) (\*) Soit  $B = \begin{pmatrix} -1 & 1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$ . Calculer  $B^2 + B$  et déduire que  $B$  n'est pas inversible.
- (4) (\*/\*\*) Soit  $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$  une matrice *nilpotente*, c'est à dire pour laquelle il existe un entier  $p \in \mathbb{N}^*$  tel que  $A^p = 0$ .
- (a) Calculer  $(I_n - A)(I_n + A + A^2 + \dots + A^{p-1})$ .
- (b) En déduire que  $I_n - A$  est inversible et préciser son inverse.
- (5) (\*) Montrer que la famille de vecteurs ci-dessous forme une base de  $\mathbb{R}^3$ .

$$\left\{ \begin{pmatrix} -1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 \\ -1 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} -1 \\ 1 \\ -1 \end{pmatrix} \right\}$$

- (6) (\*) Écrire la matrice de l'endomorphisme  $f$  de  $\mathbb{R}^3$  dans la base canonique  $\mathcal{B} = \{e_1, e_2, e_3\}$  puis celle dans la base  $\mathcal{F} = \{-e_1, e_1 - e_2, -e_1 + e_2 + 4e_3\}$ , où

$$f(x, y, z) = (x + 2y - z, -y + z, 3z).$$

- (7) (\*/\*\*) On considère l'endomorphisme  $f$  de  $\mathbb{R}^3$  dont la matrice dans la base canonique est

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \\ 1 & 0 & 1 \end{pmatrix}.$$

**Sans aucun calcul**, déterminer l'image et le noyau de  $f$ . La matrice est-elle inversible?

### Probabilités (élémentaires)

- (1) (\*\*\*) Soient  $n \in \mathbb{N}^*$  et  $A_1, A_2, \dots, A_n$  des évènements d'un espace probabilisé  $(\Omega, \mathcal{A}, P)$ . Montrer, par récurrence sur  $n$  (et à l'aide de la formule du crible) que

$$P(A_1 \cap A_2 \cap \dots \cap A_n) \geq \sum_{k=1}^n P(A_k) - (n-1).$$

- (2) (\*\*) Un voyageur prend l'avion. À chaque voyage, la probabilité que sa valise soit retardée est de  $1/12$  et les incidents de bagages sont indépendants à chaque vol. Montrer **soigneusement** que, presque sûrement, ce voyageur subira un retard de valise lors d'une répétition infinie de trajets en avion.

## Variables aléatoires réelles

- (1) (\*/\*\*) Soit  $X \hookrightarrow \mathcal{U}(\llbracket 1; n \rrbracket)$ . Montrer  $E(X) = (n + 1)/2$ .  
 (2) (\*\*/\*\*\*) Soit  $X \hookrightarrow \mathcal{B}(n, p)$ . Montrer, à l'aide de la formule du binôme, que  $E(X) = np$ .  
 (3) (\*\*/\*\*\*) Soit  $X$  une v.a. finie telle que  $X(\Omega) = \llbracket 1; n \rrbracket$ . Montrer que

$$E(X) = \sum_{j=0}^{n-1} P(X > j).$$

- (4) (\*\*/\*\*\*) On effectue des tirages **sans remise** d'une boule dans une urne contenant  $N - 1$  boules blanches et une boule noire. On note  $X$  le rang d'apparition de la boule noire. Montrer que  $X \hookrightarrow \mathcal{U}(\llbracket 1; N \rrbracket)$ .  
 (5) (\*) Soit  $X \hookrightarrow \mathcal{G}(p)$ . Montrer que  $X$  **admet** une espérance et que  $E(X) = 1/p$ .  
 (6) (\*\*) Soit  $X \hookrightarrow \mathcal{P}(\lambda)$ . Montrer que  $X$  **admet** une espérance et que  $E(X) = \lambda$ .  
 (7) (\*\*\*) Soit  $X \hookrightarrow \mathcal{P}(\lambda)$ . On suppose que, **sachant** ( $X = n$ ), la variable aléatoire  $Y$  suit une loi binomiale  $\mathcal{B}(n, p)$ . Montrer que  $Y \hookrightarrow P(p\lambda)$ .  
 (8) (\*\*\*) Soient  $X$  et  $Y$  deux v.a. indépendantes de même loi géométrique de paramètre  $p$ . Montrer que  $\min(X, Y) \hookrightarrow \mathcal{G}(1 - (1 - p)^2)$ .  
 (Deux variables aléatoires discrètes  $X$  et  $Y$  sont dites indépendantes si, pour tout  $(i, j) \in X(\Omega) \times Y(\Omega)$ , les événements  $(X = i)$  et  $(Y = j)$  sont indépendants.)  
 (9) (\*\*)  
 (a) Soit  $U \hookrightarrow \mathcal{U}([0; 1])$ . Montrer que

$$-\frac{1}{\lambda} \ln(1 - U) \hookrightarrow \mathcal{E}(\lambda).$$

- (b) En déduire une instruction SciLab pour simuler une loi exponentielle de paramètre  $\lambda$  (rentré par l'utilisateur) à l'aide de la commande `rand()`.

- (10) (\*\*/\*\*\*) Soient  $X_1$  et  $X_2$  deux v.a. indépendantes de même loi  $\mathcal{U}([0; 1])$ . Montrer que  $E(\max(X_1, X_2)) = 2/3$ .  
 (11) (\*/\*\*) (SciLab) Écrire, uniquement à l'aide de la fonction `rand()` une fonction `X=bino(n,p)` permettant de simuler une loi binomiale de paramètres  $n$  et  $p$ .  
 (12) (\*/\*\*) (SciLab) Écrire, uniquement à l'aide de la fonction `rand()` une fonction `X=Attente(p)` permettant de simuler une loi géométrique de paramètre  $p$ .

## Simple. Basique.

**Exercice 1.** (\*\*SciLab, d'après ESSEC II 2019) On considère un vecteur  $P = (p_0, p_1, \dots, p_n) \in \mathbb{R}^n$  (où  $n$  est arbitraire) dont toutes les composantes sont strictement positives. Écrire (de deux manières différentes) une fonction `function y=h(P)` (où `P` est un vecteur (de longueur) quelconque) renvoyant la quantité

$$h = - \sum_{k=0}^n p_k \frac{\ln(p_k)}{\ln(2)}.$$

On rappelle que l'instruction `length(P)` permet d'obtenir le nombre de composantes d'un vecteur `P` quelconque.

**Exercice 2.** (\*\*Implicitement votre) On considère la fonction  $f$ , dont la courbe est notée  $C_f$ , définie sur  $\mathbb{R}$  par

$$f(x) = e^x - e^{-x}.$$

- (1) **Étude de la fonction  $f$**

- (a) Donner le domaine de définition de  $f$  et étudier la parité de  $f$ . Que peut-on en déduire pour la courbe  $C_f$  ?

(b) Donner les valeurs suivantes :

$$\lim_{x \rightarrow +\infty} f(x), \quad \lim_{x \rightarrow +\infty} \frac{f(x)}{x}.$$

Que peut-on en déduire pour la courbe  $C_f$  ?

(c) Calculer  $f'(x)$  pour  $x$  réel.

(d) Construire le tableau de variation de  $f$ .

(e) Après avoir calculé  $f(0)$ , déterminer le signe de  $f(x)$  selon les valeurs du réel  $x$ .

(f) Déterminer l'équation de la tangente à la courbe  $C_f$  au point d'abscisse 0. On note cette droite  $T$ .

(g) Montrer que la courbe  $C_f$  admet un point d'inflexion que l'on précisera et étudier la convexité de  $f$ .

(h) Construire sur un même schéma  $C_f$  et  $T$ .

(2) **Étude d'une suite implicite.**

Soit  $n \in \mathbb{N}$ . On considère dans cette question l'équation

$$(E_n) : \quad f(x) = n.$$

(a) Montrer que l'équation  $(E_n)$  admet une unique solution notée  $u_n$ .

(b) Préciser la valeur de  $u_0$ .

(c) Soit  $n$  un entier naturel non nul, calculer  $f(\ln(n))$  et en déduire que  $u_n \geq \ln(n)$ ?

(d) Soit  $n$  un entier naturel. Montrer que l'équation :  $x^2 - nx - 1 = 0$  admet deux solutions réelles que l'on déterminera et dont on précisera les signes.

À l'aide du changement de variable  $t = e^x$ , déterminer la solution  $u_n$  de l'équation  $(E_n)$  pour  $n$  entier naturel.

**Exercice 3.** (\*\*Pour en finir avec les accroissements) On considère la fonction  $f$ , dont la courbe est notée  $C_f$ , définie sur  $\mathbb{R}$  par

$$f(x) = x - 2 + \exp(-x).$$

(1) (a) Calculer

$$\lim_{x \rightarrow +\infty} f(x).$$

(b) Montrer que la courbe  $C_f$  admet en  $+\infty$  une droite asymptote  $\Delta$  d'équation  $y = x - 2$ .

(c) Calculer

$$\lim_{x \rightarrow -\infty} f(x), \quad \text{puis} \quad \lim_{x \rightarrow -\infty} \frac{f(x)}{x}.$$

Que pouvez-vous dire sur le comportement asymptotique de la courbe de  $f$  en  $-\infty$  ?

(2) Calculer  $f'(x)$  pour tout réel  $x$ . Dresser le tableau des variations de  $f$  en y faisant figurer les limites en  $-\infty$  et en  $+\infty$ .

(3) Justifier que  $C_f$  coupe l'axe des abscisses en exactement deux points d'abscisses  $\alpha$  et  $\beta$ , le premier étant positif, le deuxième étant négatif.

On donne  $e \approx 2,7$ . Prouver que  $\alpha \in ]1, 2[$ .

(4) Tracer l'allure de  $C_f$  et  $\Delta$ . On donne  $\alpha \approx 1,84$  et  $\beta \approx -1,14$ .

(5) On considère la fonction  $g$  définie sur  $\mathbb{R}$  par :  $g(x) = 2 - \exp -x$  et la suite  $(u_n)$  définie par  $u_0 = 1$  et  $u_{n+1} = g(u_n)$  pour tout entier naturel  $n$ .

(a) Montrer que pour tout réel  $x$ , on a :  $g(x) = x$  si et seulement si  $f(x) = 0$ .

(b) Calculer la dérivée de  $g$ . En déduire le sens de variation de  $g$ .

Montrer alors que  $1 \leq u_n \leq 2$  pour tout entier naturel  $n$ .

(c) Établir que pour tout réel  $x$  appartenant à  $[1, 2]$  :  $0 \leq g'(x) \leq \frac{1}{e}$ .

(d) En déduire, en appliquant l'inégalité des accroissements finis que pour tout entier naturel  $n$

$$|u_{n+1} - \alpha| \leq \frac{1}{e}|u_n - \alpha|.$$

(e) Montrer par récurrence que

$$|u_n - \alpha| \leq \frac{1}{\exp(n)}.$$

Calculer  $\lim_{n \rightarrow +\infty} u_n$ .

**Exercice 4.** (\*\*Pour intégrer l'intégration)

Pour tout entier  $n$  on note:

$$I_n = \int_0^1 e^{-x^2} (1-x)^n dx \quad \text{et} \quad J_n = \int_0^1 x e^{-x^2} (1-x)^n dx.$$

- (1) (a) Former le tableau de variation sur  $[0,1]$  de  $x \rightarrow x e^{-x^2}$ .  
 (b) En déduire pour tout  $n$  de  $\mathbb{N}$  :

$$0 \leq J_n \leq \frac{1}{\sqrt{2e}(n+1)}.$$

- (c) Etudier la convergence de la suite  $(J_n)_{n \in \mathbb{N}}$ .  
 (2) (a) A l'aide d'une intégration par parties, établir pour tout  $n$  de  $\mathbb{N}$ :

$$I_n = \frac{1}{n+1} - \frac{2}{n+1} J_{n+1}.$$

(b) En déduire la limite de  $I_n$  et celle de  $n \cdot I_n$  quand  $n$  tend vers  $+\infty$ .

**Exercice 5.** (\*) Un commerçant dispose d'un stock de plantes. Chacune des plantes fleurit une fois par an. Pour chaque plante, la première année, la probabilité de donner une fleur rose vaut  $\frac{3}{4}$ , la probabilité de donner une fleur blanche vaut  $\frac{1}{4}$ . Puis les années suivantes, pour tout entier naturel  $n$  non nul :

- si l'année  $n$ , la plante a donné une fleur rose, alors l'année  $n+1$  elle donnera une fleur rose.
- si l'année  $n$  la plante a donné une fleur blanche, alors elle donnera l'année  $n+1$  de façon équiprobable une fleur rose ou une fleur blanche.

On désigne par  $p_n$  un entier naturel non nul. Pour une plante donnée, on note  $p_n$ , la probabilité de l'événement  $R_n$  "la plante donne une fleur rose la  $n$ ème année".

- (1) A l'aide de la formule des probabilités totales, montrer que la suite  $(p_n)_{n \geq 1}$  est une suite arithmético-géométrique qui vérifie :

$$p_{n+1} = \frac{1}{2} p_n + \frac{1}{2}$$

- (2) En déduire l'expression de  $p_n$  en fonction de  $n$  et de  $p_1$ .  
 (3) Que vaut  $p_1$  ? En déduire  $p_n$ , ainsi que la valeur de  $\lim_{n \rightarrow +\infty} p_n$ .  
 (4) (a) Quelle est la probabilité pour que la plante ne donne que des fleurs roses pendant les  $n$  premières années ?  
 (b) Quelle est la probabilité pour que la plante ne donne que des fleurs blanches pendant les  $n$  premières années ?

**Exercice 6.** (\*) Dans  $\mathbb{R}^4$ , on note  $\mathcal{B} = \{e_1, e_2, e_3, e_4\}$  la base canonique et on considère l'endomorphisme  $f: \mathbb{R}^4 \rightarrow \mathbb{R}^4$  défini par

$$f(e_1) = e_1 + e_2 + e_4, \quad f(e_2) = f(e_1) - e_3, \quad f(e_3) = -e_1 + e_2, \quad \text{et} \quad f(e_4) = -3e_1 - 2e_2 + e_3 - 2e_4.$$

- (1) Écrire la matrice  $K$  de  $f$  dans la base  $\mathcal{B}$ .  
 (2) Déterminer  $\text{Ker}(f)$ . En déduire  $\text{Im}(f)$ . Que peut-on dire de l'inversibilité de  $K$ ?  
 (3) Déterminer la matrice de  $f^2 = f \circ f$  dans la base canonique.  
 (4) On introduit alors les vecteurs

$$v_1 = e_1, \quad v_2 = f(e_1), \quad v_3 = e_3, \quad v_4 = f(e_3).$$

- (a) Montrer que la famille  $\mathcal{C} = \{v_1, v_2, v_3, v_4\}$  forme une base de  $\mathbb{R}^4$ .
- (b) Exprimer, pour  $i = 1, 2, 3, 4$ ,  $f(v_i)$  en fonction de  $v_1, v_2, v_3$  et  $v_4$ . En déduire la matrice de  $f$ , notée  $L$ , dans la base  $\mathcal{C}$ .
- (5) On introduit la matrice  $P$  dont les colonnes sont les vecteurs de la base  $\mathcal{C}$ .
- (a) Montrer que  $P$  est inversible et calculer  $P^{-1}$ .
- (b) Que vaut  $P^{-1}KP$ ?

**Exercice 7.** (\*/\*\*) On considère l'endomorphisme  $f$  de  $\mathbb{R}^4$  dont la matrice dans la base canonique  $\mathcal{B} = \{e_1, e_2, e_3, e_4\}$  est donnée par

$$A = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 & 1 \\ 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}.$$

- (1) Justifier, **sans aucun calcul** que  $f$  est un automorphisme. La matrice  $A$  est-elle inversible ?
- (2) Vérifier que  $f \circ f \circ f \circ f = \text{Id}$  (sans aucun calcul non plus) et en déduire l'expression de  $A^{-1}$  en fonction de  $A$ .

## Probabilités continues

(\*\*/\*\*\*) On considère deux variables aléatoires  $X$  et  $Y$ , définies sur un espace probabilisé  $(\Omega, \mathcal{A}, P)$ , et indépendantes. On suppose que  $X$  est une variable à densité et on note  $F_X$  sa fonction de répartition. On suppose par ailleurs que la loi de  $Y$  est donnée par

$$P(Y = 1) = P(Y = -1) = \frac{1}{2}.$$

L'indépendance de  $X$  et  $Y$  se traduit par les égalités suivantes, valables pour tout réel  $x$ ,

$$P([X \leq x] \cap [Y = 1]) = P(X \leq x) P(Y = 1)$$

et

$$P([X \leq x] \cap [Y = -1]) = P(X \leq x) P(Y = -1).$$

On pose  $Z = XY$  et on admet que  $Z$  est, elle-aussi, une variable aléatoire définie sur  $(\Omega, \mathcal{A}, P)$ .

On se propose d'établir deux résultats utiles pour la suite dans la partie 1, puis d'en déduire la loi de la variable aléatoire  $Z$  en fonction de la loi de  $X$  dans les parties 2 et 3.

### Partie 1 : Expression de la fonction de répartition de $Z$ en fonction de celle de $X$ .

- (1) Rappeler l'expression des fonctions de répartition d'une variable aléatoire suivant une loi uniforme sur  $[a, b]$  (avec  $a < b$ ) et d'une variable aléatoire suivant une loi exponentielle de paramètre  $\lambda$  (avec  $\lambda > 0$ ).
- (2) En utilisant le système complet d'événements  $\{(Y = 1), (Y = -1)\}$ , montrer que la fonction de répartition  $F_Z$  de la variable aléatoire  $Z$  est donnée par :

$$\forall x \in \mathbb{R}, F_Z(x) = \frac{1}{2} (F_X(x) - F_X(-x) + 1).$$

### Partie 2 : Étude de deux premiers exemples.

- (1) On suppose que la loi de  $X$  est la loi normale centrée réduite. Reconnaitre la loi de  $Z$ .
- (2) On suppose que la loi de  $X$  est la loi uniforme sur  $[0, 1]$ .
- (a) Déterminer l'expression de  $F_X(-x)$  selon les valeurs prises par  $x$ .
- (b) Déterminer  $F_Z(x)$  pour tout réel  $x$ , puis reconnaître la loi de  $Z$ .

**Partie 3 : Étude du cas où la loi de  $X$  est la loi exponentielle de paramètre 1.**

- (1) (a) Montrer que la fonction de répartition  $F_Z$  de la variable aléatoire  $Z$  est définie par :

$$F_Z(x) = \begin{cases} 1 - \frac{1}{2}e^{-x}, & \text{si } x \geq 0 \\ \frac{1}{2}e^x, & \text{si } x < 0 \end{cases}$$

- (b) En déduire que  $Z$  est une variable aléatoire à densité.  
 (c) Établir alors qu'une densité de  $Z$  est la fonction  $f_Z$  définie pour tout réel  $x$  par

$$f_Z(x) = \frac{1}{2}e^{-|x|}.$$

- (d) Donner la valeur de l'intégrale

$$\int_0^{+\infty} xe^{-x} dx.$$

- (e) Montrer que  $f_Z$  est une fonction paire et en déduire l'existence et la valeur de  $E(Z)$ .

- (2) (a) Donner la valeur de l'intégrale

$$\int_0^{+\infty} x^2 e^{-x} dx.$$

- (b) En déduire l'existence et la valeur de  $E(Z^2)$ , puis donner la valeur de la variance de  $Z$ .

- (3) (a) Déterminer  $E(X)E(Y)$  et comparer avec  $E(Z)$ . Quel résultat retrouve-t-on ainsi ?

- (b) Exprimer  $Z^2$  en fonction de  $X$ , puis en déduire de nouveau la variance de  $Z$ .

- (4) Soit  $U$  et  $V$  des variables aléatoires suivant respectivement la loi de Bernoulli de paramètre  $1/2$  et la loi uniforme sur  $[0, 1[$ .

- (a) On pose  $Q = -\ln(1 - V)$  et on admet que  $Q$  est une variable aléatoire. Déterminer la fonction de répartition de  $Q$  et en déduire la loi suivie par la variable aléatoire  $Q$ .

- (b) On pose  $R = 2U - 1$  et on admet que  $R$  est une variable aléatoire. Déterminer  $R(\Omega)$  et donner la loi suivie par la variable  $R$ .

- (c) Informatique.

En tenant compte des résultats des questions 5a) et 5b), écrire en **SciLab** une déclaration de fonction dont l'entête est `function y=Z()` pour qu'elle simule la loi de  $Z$ .