



On pose :  $Y_n = P^{-1}X_n$  donc  $Y_{n+2} = DY_{n+1} + \Delta Y_n$ .

On a :  $Y_0 = P^{-1}X_0$  et  $Y_1 = P^{-1}X_1$ .

D'où  $Y_n$  vérifie les hypothèses de 5. ie  $Y_n = \begin{pmatrix} -3 \\ \frac{1}{4}(-2^n + (-2)^n) \\ (-4n + 2)(-2)^n \end{pmatrix} \forall n \in \mathbb{N}^*$ .

$$X_n = PY_n = \begin{pmatrix} -3 + \frac{1}{4}(-2)^n - \frac{1}{4}2^n - 4n(-2)^n + 2(-2)^n \\ 6 - \frac{1}{4}(-2)^n + \frac{1}{4}2^n - 4n(-2)^n + 2(-2)^n \\ -3 - 4n(-2)^n + 2(-2)^n \end{pmatrix}.$$

### Exercice 2

1. Nous devons avoir  $k \int_0^1 \int_0^1 (2x + 3y^2) dx dy = 1$ .

$$\text{D'où } k \int_0^1 [x^2 + 3y^2x]_0^1 dy = k \int_0^1 (1 + 3y^2) dy = 2k = 1.$$

Par suite  $k = 0.5$ .

2. a. On a  $F(t, z) = \int_0^t \int_0^z (x + \frac{3}{2}y^2) dx dy = \frac{t^2z}{2} + \frac{z^3}{2}t$  si  $t$  et  $z$  appartiennent à  $[0, 1]$ .

$$\text{b. } F(t, z) = \int_0^1 \int_0^z (x + \frac{3}{2}y^2) dx dy = \frac{z}{2} + \frac{z^3}{2} \text{ si } t > 1 \text{ et } z \text{ appartient à } [0, 1].$$

$$\text{c. } F(t, z) = \int_0^t \int_0^1 (x + \frac{3}{2}y^2) dx dy = \frac{t}{2} + \frac{t^2}{2} \text{ si } t \text{ appartient à } [0, 1] \text{ et } z > 1.$$

$$\text{d. } F(t, z) = \int_0^1 \int_0^1 (x + \frac{3}{2}y^2) dx dy = 1 \text{ si } t > 1 \text{ et } z > 1.$$

3. Les fonctions de répartitions marginales sont définies par

$$F(t, +\infty) = \begin{cases} 0 & \text{si } t \leq 0, \\ \frac{1}{2}(t + t^2) & \text{si } 0 \leq t \leq 1, \\ 1 & \text{si } t > 1. \end{cases}$$

$$F(+\infty, z) = \begin{cases} 0 & \text{si } z \leq 0, \\ \frac{1}{2}(z + z^3) & \text{si } 0 \leq z \leq 1, \\ 1 & \text{si } z > 1. \end{cases}$$

4. Le calcul donne

$$E(X) = \int_0^1 \int_0^1 (x + \frac{3}{2}y^2) x dx dy = \frac{7}{12}.$$

$$E(Y) = \int_0^1 \int_0^1 (x + \frac{3}{2}y^2) y dx dy = \frac{5}{8}.$$

$$E(XY) = \int_0^1 \int_0^1 (x + \frac{3}{2}y^2) xy dx dy = \frac{17}{48}.$$

On en déduit que

$$\text{Cov}(X, Y) = -\frac{1}{96}.$$

## Problème

### Partie I

1.  $I_0 = \frac{\pi}{2}$  et  $I_1 = 1$ .

2. a.  $I_{n+2} = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \cos^{n+2} t \, dt = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \cos^{n+1} t \cos t \, dt$   
 $= [\sin t \cos^{n+1} t]_0^{\frac{\pi}{2}} + (n+1) \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sin^2 t \cos^n t \, dt = (n+1) I_n - (n+2) I_{n+2}.$

Donc  $(n+2) I_{n+2} = (n+1) I_n \implies I_n = \frac{n-1}{n} I_{n-1}.$

b.  $I_{2n} = \frac{2n-1}{2n} \cdots \frac{1}{2} \frac{\pi}{2} = \frac{(2n)!}{2^{2n} (n!)^2} \frac{\pi}{2} = \frac{C_{2n}^n \pi}{4^n \cdot 2}.$

$$I_{2n+1} = \frac{2n}{2n+1} \cdots \frac{2}{1} = \frac{2^{2n} (n!)^2}{(2n+1)!} = \frac{4^n}{(2n+1) C_{2n}^n}.$$

3. a. On a :  $\forall t \in [0, \frac{\pi}{2}]$ ,  $0 \leq \cos^{n+1} t \leq \cos^n t \implies 0 < I_{n+1} \leq I_n \implies \frac{I_{n+1}}{I_n} \leq 1.$

Comme  $0 < I_{n+2} \leq I_{n+1} \leq I_n \implies \frac{n+2}{n+1} = \frac{I_{n+2}}{I_{n+1}} \leq \frac{I_{n+1}}{I_n} \leq 1.$

D'où  $\frac{n}{n+1} \leq \frac{I_{n+1}}{I_n} \leq 1$  ie  $\lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{I_{n+1}}{I_n} = 1.$

b.  $\lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{I_{2n+1}}{I_{2n}} = 1 \iff \lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{4^n}{(2n+1) C_{2n}^n} \left( \frac{C_{2n}^n \pi}{4^n \cdot 2} \right)^{-1} = 1.$

c.  $\lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{4^n}{C_{2n}^n \sqrt{n}} = \sqrt{\pi}$  car  $\frac{2}{2n+1} \sim \frac{1}{n} (n \rightarrow +\infty).$

$C_{2n}^n$  est équivalent à  $\frac{4^n}{\sqrt{\pi n}}$  quand  $n \rightarrow +\infty.$

### Partie II

1. a. On a :  $\frac{C_{2n}^n}{C_{2n+2}^{n+1}} = \frac{(n+1)^2}{(2n+2)(2n+1)} \rightarrow \frac{1}{4}$  donc  $R = \frac{1}{4}.$

b.  $C_{2n}^n \left(\frac{1}{4}\right)^n \sim \frac{4^n}{\sqrt{\pi n}} \frac{1}{4^n} = \frac{1}{\sqrt{\pi n}} (n \rightarrow +\infty)$

Or  $\sum \frac{1}{\sqrt{n}}$  diverge donc  $\sum C_{2n}^n \left(\frac{1}{4}\right)^n$  diverge.

c.  $\sum C_{2n}^n \left(-\frac{1}{4}\right)^n$  est une série alternée.

Comme  $C_{2n}^n \left(\frac{1}{4}\right)^n \sim \frac{1}{\sqrt{n\pi}} \rightarrow 0$  ( $n \rightarrow +\infty$ ) et  $\frac{C_{2n+2}^{n+1} \left(\frac{1}{4}\right)^{n+1}}{C_{2n}^n \left(\frac{1}{4}\right)^n} = \frac{2n+1}{2n+2} < 1$ .

donc la suite  $\left(C_{2n}^n \left(\frac{1}{4}\right)^n\right)$  est positive décroissante vers 0, d'où d'après le critère de séries alternées :  $\sum C_{2n}^n \left(-\frac{1}{4}\right)^n$  converge.

2.a.  $\forall x \in \left]-\frac{1}{4}, \frac{1}{4}\right[$ ,  $S'(x) = \sum_{n=1}^{+\infty} n C_{2n}^n x^{n-1}$ .

Donc  $\sum_{n=1}^{+\infty} -2n C_{2n}^n x^n + \frac{1}{2} n C_{2n}^n x^{n-1} = S(x)$ ,  $\forall x \in \left]-\frac{1}{4}, \frac{1}{4}\right[$ .  $\Rightarrow S(x) = \frac{-2x+1}{S'(x)}$

↳ donc  $\exists k \in \mathbb{R}$  tel que  $\forall x \in \left]-\frac{1}{4}, \frac{1}{4}\right[$ ,  $S(x) = \frac{k}{\sqrt{\left|x - \frac{1}{4}\right|}}$ .

Or  $S(0) = 1$  d'où  $S(x) = \frac{1}{\sqrt{1-4x}}$ .

**Partie III**

1. (E) :  $(1-x^2)y' - xy = 1$ .

a.  $y(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} a_{2n+1} x^{2n+1}$

$y'(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} (2n+1) a_{2n+1} x^{2n}$

donc  $(1-x^2)y'(x) - xy(x) = 1 \iff \begin{cases} a_1 = 1, \\ \forall n \in \mathbb{N}^*, a_{2n+1} = \frac{2n}{2n+1} a_{2n-1} \end{cases}$

d'où  $a_{2n+1} = \frac{4^n}{(2n+1) C_{2n}^n}$ .

b.  $\frac{a_{2n+1}}{a_{2n+3}} = \frac{2n+3}{2n+1} \rightarrow 1$  ( $n \rightarrow +\infty$ ).

Donc le rayon de convergence de la série entière  $\sum_{n \geq 0} a_{2n+1} x^{2n+1}$  est 1.

donc  $y(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{4^n}{(2n+1) C_{2n}^n} x^{2n+1}$  est une solution de (E) définie sur  $]-1, 1[$ .

2. a. Le domaine de définition de  $f$  est  $]-1, 1[$ .

b.  $f(x) = \frac{\text{Arc sin } x}{\sqrt{1-x^2}}$  donc  $f$  est développable en série entière en 0, comme produit de fonctions développables en série entière.

3. a.  $\sqrt{1-x^2}f(x) = \text{Arcsin } x.$

$$\implies \frac{-x}{\sqrt{1-x^2}}f(x) + \sqrt{1-x^2}f'(x) = \frac{1}{\sqrt{1-x^2}}.$$

$$\implies (1-x^2)f'(x) - xf(x) = 1.$$

b.  $f$  est une fonction impaire définie sur  $] -1, 1[$  vérifiant l'équation différentielle (E) et développable en série entière à l'origine.

$$\text{Donc } f(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{4^n}{(2n+1)C_{2n}^n} x^{2n+1}$$

$$\text{On a : } g'(x) = 2f(x) \text{ donc } g(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{4^n}{(2n+1)(n+1)C_{2n}^n} x^{2n+2}.$$

#-2-a)

$$\sum_{n=1}^{+\infty} -2n C_{2n}^n x^n + \frac{1}{2} n C_{2n}^n x^{n-1}$$

$$= \sum_{n=0}^{+\infty} \left( -2n C_{2n}^n + \frac{n+1}{2} C_{2n+2}^{n+1} \right) x^n$$

$$= \sum_{n=0}^{+\infty} \left( -2n C_{2n}^n + \frac{n+1}{2} \frac{(2n+2)!}{(n+1)! (n+1)!} \frac{(2n)!}{(n!)^2} \right) x^n$$

$$= \sum_{n=0}^{+\infty} \left( -2n C_{2n}^n + (n+1) C_{2n}^n \right) x^n$$

$$= \sum_{n=0}^{+\infty} C_{2n}^n x^n = S(x)$$