

D'après l'épreuve 1 de CENTRALE-SUPÉLEC 2008 - PSI

Partie I. Récurrence en dimension 1

I.A. On peut écrire une boucle :

```
u:=proc(n) local U,k;
  U:=u0;
  for k from 1 to n do U:=a*U+b; od;
  U;
end;
```

On peut écrire une fonction récursive

```
u:=n->if n>0 then a*u(n-1)+b else u0 end;
```

I.B. On a

$$v_{n+1} = u_{n+1} + k = a u_n + k + b = a(v_n - k) + k + b$$

, donc

$$v_{n+1} = a v_n \iff ak = b + k \iff k = \frac{b}{a-1}$$

on peut diviser car $a \neq 1$

$$\boxed{k = \frac{b}{a-1}}$$

I.C. La suite v est géométrique de raison a et de premier terme $v_0 = u_0 + \frac{b}{a-1}$; donc $v_n = a^n \left(u_0 + \frac{b}{a-1} \right)$

$$\boxed{u_n = a^n \left(u_0 + \frac{b}{a-1} \right) - \frac{b}{a-1}}$$

I.D. On étudie la limite de la suite $(u_n z^n)$

• Si $b = 0$ la suite est géométrique nulle ou non

- si $u_0 = 0$ ou $a = 0$, alors $\forall n \in \mathbb{N}^*$, $u_n = 0$ et $R = +\infty$

- si $u_0 \neq 0$, et $a \neq 0$ alors $u_n z^n = (az)^n u_0$ est géométrique de raison az donc $R = \frac{1}{a}$

• Si $b \neq 0$ et $u_0 + \frac{b}{a-1} = 0$ alors $u_n z^n = \frac{b}{1-a} z^n$ et $R = 1$

• Si $b \neq 0$ et $u_0 + \frac{b}{a-1} \neq 0$ on compare les deux termes :

La série $\sum a^n \left(u_0 + \frac{b}{a-1} \right) z^n = \sum \left(u_0 + \frac{b}{a-1} \right) (az)^n$ à un rayon de convergence de $1/|a|$ ($+\infty$ si $a = 0$)

La série $\sum \frac{b}{a-1} z^n$ à un rayon de convergence de 1

- si $|a| \neq 1$ on ajoute deux séries entières de rayon de convergence différents : $R = \min(1, 1/|a|)$

- si $|a| = 1$ (donc $a = -1$ vu le sujet) , le théorème sur la somme dit que $R \geq 1$. mais ici

$$u_n = (-1)^n \left(u_0 - \frac{b}{2} \right) + \frac{b}{2} = \begin{cases} u_0 & \text{si } n \text{ est pair} \\ b - u_0 & \text{si } n \text{ est impair} \end{cases}$$

$\sum u_0 z^{2n}$ à un rayon de convergence de 1 ($u_0 \neq 0$) et $\sum (b - u_0) z^{2n+1}$ à un rayon de 1 ou $+\infty$ (si $b = u_0$) , et donc d'après le cas particulier de la somme des séries d'indices pairs est impairs $R = 1$ (le plus petit)

Synthèse en posant $\frac{1}{0} = +\infty$

$$\boxed{\begin{array}{l} \text{si } b = 0 \text{ et } au_0 = 0 \text{ alors } \rho_S = +\infty \\ \text{si } b = 0 \text{ et } au_0 \neq 0 \text{ alors } \rho_S = 1/|a| \\ \text{si } b \neq 0 \text{ et } u_0 + \frac{b}{a-1} = 0 \text{ alors } \rho_S = 1 \\ \text{si } b \neq 0 \text{ et } u_0 + \frac{b}{a-1} \neq 0 \text{ alors } \rho_S = \min(1, 1/|a|) \end{array}}$$

I.E. On part de

$$\sum_{n=0}^{+\infty} (u_{n+1} - au_n - b) z^n = 0$$

$$\text{Or } \sum_{n=0}^{+\infty} u_{n+1} z^n = \sum_{n=1}^{+\infty} u_n z^{n-1} = \frac{1}{z} \sum_{n=1}^{+\infty} u_n z^n = \frac{1}{z} (S(z) - u_0) \text{ si } z \neq 0$$

et si $|z| < 1$, $\sum_{n=0}^{+\infty} z^n = \frac{1}{1-z}$

D'après le **I.D** il faut faire attention au cas $b = 0$ et $z \neq 0$

• si $b = 0$ et $z \neq 0$: $\sum_{n=0}^{+\infty} (u_{n+1} - au_n - b) z^n = \sum_{n=0}^{+\infty} u_{n+1} z^n - a \sum_{n=0}^{+\infty} u_n z^n = \frac{1}{z}(S(z) - u_0) - aS$

• si $b \neq 0$ et $z \neq 0$, $\rho_S \leq 1$, donc $|z| < \rho_S \Rightarrow |z| < 1$ et donc $\sum_{n=0}^{+\infty} (u_{n+1} - au_n - b) z^n = \frac{1}{z}(S(z) - u_0) - aS + b \cdot \frac{1}{1-z}$

On remarque que la formule générale est vrai aussi dans le cas particulier (même si $|z| \geq 1$)

Si $|z| < \rho_S$ et $z \neq 0$

$$\frac{1}{z}(S(z) - u_0) - aS + b \cdot \frac{1}{1-z} = 0$$

On multiplie par z

$$S(z) - u_0 - azS(z) + b \frac{z}{1-z} = 0$$

Si $z = 0$, $S(z) =$ "le terme constant" $= u_0$ et l'égalité est encore vérifiée.

$$|z| < \rho_S \Rightarrow S(z) - u_0 - azS(z) + b \frac{z}{1-z} = 0$$

d'où finalement

$$\forall z, |z| < \rho_S \Rightarrow S(z) = \frac{u_0}{1-az} + \frac{bz}{(1-z)(1-az)}$$

Remarque : pour préparer (illustrer) la suite le sujet impose un plan qui n'utilise pas la relation trouvée en I.C. On peut utiliser cette relation pour calculer la somme et ainsi vérifier.

I.F. On a $\sum \frac{u_n z^n}{n!} = \left(u_0 + \frac{b}{a-1}\right) \sum \frac{(az)^n}{n!} - \frac{b}{a-1} \sum \frac{z^n}{n!}$. Les deux séries $\sum \frac{(az)^n}{n!}$ et $\sum \frac{z^n}{n!}$ ont un rayon de convergence infinie. Le produit par un scalaire conserve ce rayon (même si le scalaire est nul) et donc par somme $\rho_G \geq \min(+\infty, +\infty) = +\infty$

On sait que si on dérive termes à termes une série entière, la série obtenue a le même rayon de convergence que la série initiale et sa somme est, sur le disque ouvert de convergence, la somme de la série initiale. D'où le résultat.

Remarque : Mais c'est peut-être une question de cours dont l'examineur attend la démonstration.

I.G. Pour tout x réel (les séries entières ont pour rayon de convergence $+\infty$), on obtient par linéarité :

$$\begin{aligned} 0 &= \sum_{n=0}^{+\infty} (u_{n+1} - au_n - b) \frac{x^n}{n!} \\ &= \sum_{n=0}^{+\infty} u_{n+1} \frac{x^n}{n!} - a \sum_{n=0}^{+\infty} u_n \frac{x^n}{n!} - b \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{x^n}{n!} \\ &= G'(x) - aG(x) - be^x \end{aligned}$$

La fonction G est donc solution sur \mathbb{R} de l'équation différentielle $y' = ay + be^x$,

• l'équation homogène a les solutions sur \mathbb{R} : $y = Ke^{ax}$

• une solution particulière est du type $y = \alpha e^x$ et donc α vérifie $\alpha = a\alpha + b$ soit $\alpha = \frac{b}{1-a}$ (on peut aussi faire une variation de la constante)

d'où les solutions sont de la forme $y = Ke^{ax} + \frac{b}{1-a} e^x$. On dispose de la condition initiale $G(0) = u_0$, d'où $K + \frac{b}{1-a} = u_0$

$$\forall x \in \mathbb{R} \quad G(x) = u_0 e^{ax} + b \frac{e^x - e^{ax}}{1-a}$$

I.H. On a d'après le calcul des coefficients d'une série entière $\frac{u_n}{n!} = \frac{G^{(n)}(0)}{n!}$. et comme, $G^{(n)}(x) = a^n u_0 e^{ax} + b \frac{e^x - a^n e^{ax}}{1-a}$ on retrouve

$$u_n = a^n \left(u_0 + \frac{b}{a-1}\right) - \frac{b}{a-1}$$

et on est content le calcul de G est juste.

Pour programmer le calcul de u_n , on peut écrire la procédure

U:=proc(n):

 a^n*(u0-b/(1-a))+b/(1-a)

end;

II.A.
II.B.

Pour $|z| < \rho$ et $z \neq 0$, un calcul analogue à celui de la question **I.E.** conduit aux équations

$$\frac{1}{z} (S(z) - u_0) - a S(z) - b T(z) = 0 \quad ; \quad \frac{1}{z} (T(z) - v_0) - c S(z) - d T(z) = 0 ,$$

c'est-à-dire au système linéaire

$$\begin{cases} (1 - az)S(z) - bzT(z) = u_0 \\ -czS(z) + (1 - dz)T(z) = v_0 \end{cases}$$

. Le déterminant de ce système est

$$\begin{aligned} \Delta(z) &= \begin{vmatrix} (1 - az) & -bz \\ -cz & (1 - dz) \end{vmatrix} = (1 - az)(1 - dz) - bcz^2 \\ &= 1 - (a + d)z + (ad - bc)z^2 = z^2 \left(\left(\frac{1}{z}\right)^2 - (a + d)\left(\frac{1}{z}\right) + (ad - bc) \right) \text{ pour } z \neq 0 \end{aligned}$$

Or comme on admet $|z| < \min\left(\frac{1}{|\lambda|}, \frac{1}{|\mu|}\right)$, on a $\frac{1}{|z|} > \max(|\lambda|, |\mu|)$ et donc $\frac{1}{z} \notin \{\lambda, \mu\}$ et donc $\frac{1}{z}$ n'est pas racine de $X^2 - (a + d)X + (ad - bc)$.

Donc le déterminant du système est non nul pour $z \neq 0$ (et aussi pour $z = 0$) et on peut utiliser les formules de Cramer pour résoudre.

$$\boxed{S(z) = \frac{1 - dz}{\Delta(z)} u_0 + \frac{bz}{\Delta(z)} v_0 \quad ; \quad T(z) = \frac{cz}{\Delta(z)} u_0 + \frac{1 - az}{\Delta(z)} v_0}$$

II.C. D'après l'hypothèse admise à la question précédente $\sum u_n z^n$ converge si $|z| < \rho$, et donc pour $z \in]0, \rho[$, $(u_n z^n)$ est

bornée. et donc $|u_n| = O\left(\frac{1}{z^n}\right)$

On en déduit que pour tout x réel

$$\left| \frac{u_n x^n}{n!} \right| = (u_n |z|^n) \cdot \frac{(|x/z|)^n}{n!} = O\left(\frac{|x/z|}{n!}\right)$$

Or la série $\sum \frac{|x/z|}{n!}$ converge pour tout x réel donc par "O" la série $\sum \left| \frac{u_n x^n}{n!} \right|$ converge. et donc $R_G = +\infty$.

C'est la *principe du lemme d'Abel*.

L'étude pour H est symétrique.

II.D. Les fonctions G et H sont des séries entières définies et de classe C^2 sur \mathbb{R} (le disque ouvert de convergence) et leurs dérivées s'obtiennent par dérivation terme à terme. Les relations évidentes

$$\sum_{n=0}^{+\infty} (u_{n+1} - au_n - bv_n) \frac{x^n}{n!} = 0 \quad \text{et} \quad \sum_{n=0}^{+\infty} (v_{n+1} - cu_n - dv_n) \frac{x^n}{n!} = 0$$

donnent le système différentiel linéaire (même calculs qu'au I)

$$\begin{cases} G'(x) = aG(x) + bH(x) \\ H'(x) = cG(x) + dH(x) \end{cases}$$

II.E. La combinaison linéaire proposée donne la relation

$$dG'(x) - bH'(x) = (ad - bc)G(x)$$

Or λ et μ sont les racines de $X^2 - (a + d)X + (ad - bc) = 0$, donc (produit des racines) $\lambda\mu = ad - bc$ et donc

$$dG'(x) - bH'(x) = \lambda\mu G(x)$$

On en déduit

$$G'' = aG' + bH' = aG' + dG' - (dG' - bH') = (a + d)G' - \lambda\mu G = (\lambda + \mu)G' - \lambda\mu G .$$

Calcul et résultat analogues pour H .

Les fonctions G et H sont donc solutions de l'équation différentielle linéaire du second ordre à coefficients constants

$$y'' - (\lambda + \mu) y' + \lambda\mu y = 0 .$$

II.F. L'équation précédente est une équation différentielle linéaire du second ordre à **coefficients constants**. On utilise l'équation caractéristique pour résoudre

L'équation caractéristique est $r^2 - (\lambda + \mu) r + \lambda\mu = 0$ de racines λ et μ :

- Si $\lambda \neq \mu$, les solutions sont les combinaisons linéaires de $x \mapsto e^{\lambda x}$ et de $x \mapsto e^{\mu x}$. On a donc

$$\exists (A, B, C, D) \in \mathbb{R}^4, G(x) = A e^{\lambda x} + B e^{\mu x}, H(x) = C e^{\lambda x} + D e^{\mu x}$$

Les conditions initiales $G(0) = u_0, G'(0) = u_1 = au_0 + bv_0$ donnent :

$$\begin{cases} A + B = u_0 \\ \lambda A + \mu B = au_0 + bv_0 \end{cases}$$

qui est un système de Cramer car $\Delta = \mu - \lambda \neq 0$. On peut le résoudre par quotient de déterminants

$$A = \frac{\mu u_0 - (au_0 + bv_0)}{\mu - \lambda}, B = \frac{(au_0 + bv_0) - \lambda u_0}{\mu - \lambda}$$

$$G(x) = \left(\frac{(\mu - a) e^{\lambda x} - (\lambda - a) e^{\mu x}}{\mu - \lambda} \right) u_0 + \left(\frac{b (e^{\mu x} - e^{\lambda x})}{\mu - \lambda} \right) v_0$$

et de même pour H :

$$H(x) = \frac{c (e^{\mu x} - e^{\lambda x})}{\mu - \lambda} u_0 + \frac{(\mu - d) e^{\lambda x} - (\lambda - d) e^{\mu x}}{\mu - \lambda} v_0$$

- Si $\lambda = \mu$ les solutions sont les combinaisons linéaires de $x \mapsto e^{\lambda x}$ et de $x \mapsto x e^{\lambda x}$. On a donc

$$\exists (A, B, C, D) \in \mathbb{R}^4, G(x) = (Ax + B) e^{\lambda x}, H(x) = (Cx + D) e^{\lambda x}$$

Les conditions initiales $G(0) = u_0, G'(0) = u_1 = au_0 + bv_0$ donnent :

$$\begin{cases} B = u_0 \\ A + \lambda B = au_0 + bv_0 \end{cases}$$

Soit

$$B = u_0, A = (a - \lambda)u_0 + bv_0$$

et donc

$$G(x) = ((a - \lambda)x + 1) e^{\lambda x} u_0 + b x e^{\lambda x} v_0$$

et

$$H(x) = c x e^{\lambda x} u_0 + ((d - \lambda)x + 1) e^{\lambda x} v_0$$

Partie III. Transformation de Laplace

III.A. Si f est $\text{CDI}(\alpha)$, je pose $M = \sup_{\mathbb{R}^+} (|f(t)| e^{-\alpha t})$. Si $\Re(p) > \alpha$ on a :

$$\begin{cases} |f(t) e^{-pt}| = |f(t)| e^{-\Re(p)t} = |f(t)| e^{-\alpha t} e^{-(\Re(p)-\alpha)t} \leq M e^{-(\Re(p)-\alpha)t} \\ t \mapsto f(t) e^{-pt} \text{ continue sur } \mathbb{R}^+ \end{cases}$$

La fonction $t \mapsto e^{-(\Re(p)-\alpha)t}$ est intégrable sur \mathbb{R}^+ car $(\Re(p) - \alpha) > 0$. On en déduit par majoration l'intégrabilité sur \mathbb{R}^+ de la fonction $t \mapsto f(t) e^{-pt}$ et donc la convergence de l'intégrale impropre $Lap(f)(p)$.

III.B. Soit $x \in \mathbb{R}^{+*}$. Soit p un nombre complexe tel que $\Re(p) > \alpha$. Une intégration par parties donne

$$\int_0^x f'(t) e^{-pt} dt = [f(t) e^{-pt}]_0^x + p \int_0^x f(t) e^{-pt} dt = f(x) e^{-px} - f(0) + p \int_0^x f(t) e^{-pt} dt$$

Du calcul précédent on déduit que $|f(x) e^{-px}| \leq M e^{-(\Re(p)-\alpha)x}$ donc tend vers 0 en $+\infty$. (toujours car $-(\Re(p) - \alpha) < 0$)

et que l'intégrale impropre $\int_0^{+\infty} f(t) e^{-pt} dt$ converge, le second membre de l'égalité précédente a une limite finie lorsque x tend vers $+\infty$. On en déduit que l'intégrale impropre $Lap(f')(p)$ converge et l'égalité

$$\boxed{Lap(f')(p) = p \cdot Lap(f)(p) - f(0)}$$

III.C. On a

$$Lap(G)(p) = \int_0^{+\infty} \left(\sum_{n=0}^{+\infty} u_n \frac{t^n}{n!} \right) e^{-pt} dt = \sum_{n=0}^{+\infty} u_n \int_0^{+\infty} \frac{t^n}{n!} e^{-pt} dt .$$

En posant $I_n = \int_0^{+\infty} t^n e^{-pt} dt$ (ces intégrales impropres sont bien convergentes dès que $\Re(p) > 0$), une intégration par parties donne la relation de récurrence $I_n = \frac{n}{p} I_{n-1}$ pour $n \geq 1$, donc $I_n = \frac{n!}{p^{n+1}}$. Finalement,

$$Lap(G)(p) = \frac{1}{p} \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{u_n}{p^n} = \frac{1}{p} S\left(\frac{1}{p}\right)$$

III.D. On a l'équation différentielle $G'(x) - aG(x) = b \exp(x)$. La linéarité de la transformation de Laplace donne

$$Lap(G')(p) - a \cdot Lap(G)(p) = b \cdot Lap(\exp)(p) .$$

Or, $Lap(\exp)(p) = \int_0^{+\infty} e^{(1-p)t} dt = \frac{1}{p-1}$ si $p > 1$. On obtient donc, en utilisant **III.B.** :

$$(p-a) \cdot Lap(G)(p) - G(0) = \frac{b}{p-1}$$

Pour appliquer le résultat précédent il suffit d'avoir en se limitant à une variable réelle ::

- : $p > 0$
- la convergence des intégrales. c'est vérifié G est $CDI(\alpha)$ et $p > \alpha$, Or d'après l'expression de G trouvé au **I** G est $CDI(\alpha)$ si $\alpha > a$ et $\alpha > 0$. On prend $p > \max(0, a)$,
- le droit d'intégrer termes à termes. Or d'après le calcul de I_n :

$$\int_0^{+\infty} \left| u_n \frac{t^n}{n!} e^{-pt} \right| dt = |u_n| \frac{1}{p^{n+1}}$$

Or (partie **I**) la série entière $\sum u_n x^n$ à un rayon de convergence $\rho_S > 0$. donc si $\left| \frac{1}{p} \right| < \rho_S$ la série $\sum \left(\int_0^{+\infty} \left| u_n \frac{t^n}{n!} e^{-pt} \right| dt \right)$ converge et on peut intégrer termes à termes les intégrales étant convergentes. Toutes les hypothèses du **III.C** sont vérifiées. On a donc :

$$\frac{p-a}{p} S\left(\frac{1}{p}\right) - u_0 = \frac{b}{p-1}$$

On pose $x = \frac{1}{p}$. Pour $x > 0, x < \rho_S$ et $x < \frac{1}{a}$ on a

$$(1-ax)S(x) = u_0 + \frac{bx}{1-x}$$

Soit

$$S(x) = \frac{u_0}{1-ax} + \frac{bx}{(1-x)(1-ax)}$$

ce qui est la même expression qu'en **I.E.**

Partie IV. Une récurrence explosive

IV.A.1. On a

$$u^2 + v^2 - 2uv = (u-v)^2 \geq 0 \quad \text{et} \quad u^2 + v^2 + 2uv = (u+v)^2 \geq 0 .$$

d'où le résultat.

IV.A.2. Si un $\omega(n)$ est nul alors u_n et v_n sont nuls. (somme de réels positifs nulle). On reporte dans le système

$$\begin{cases} au_{n-1} + bv_{n-1} = 0 \\ cu_{n-1} + dv_{n-1} = 0 \end{cases}$$

de déterminant $adn^2 - bc$. L'hypothèse " $\frac{bc}{ad}$ n'est pas le carré d'un entier" assure que ce déterminant est non nul. Le système est donc de Cramer est $u_{n-1} = v_{n-1} = 0$. Une récurrence descendante rapide donne $u_0 = v_0 = 0$. Ce qui absurde vu le sujet.

$$\boxed{\forall n \in \mathbb{N}, \omega(n) > 0}$$

On calcule

$$\begin{aligned}\omega(n+1) &= u_{n+1}^2 + v_{n+1}^2 = (anu_n + bv_n)^2 + (cu_n + dv_n)^2 \\ &= n^2 (a^2 u_n^2 + d^2 v_n^2) + 2(ab + cd) n u_n v_n + b^2 v_n^2 + c^2 u_n^2.\end{aligned}$$

Comme $2|u_n v_n| \leq u_n^2 + v_n^2 = \omega(n)$, on peut majorer :

$$\omega(n+1) \leq n^2 \omega(n) \max\{a^2, d^2\} + |ab + cd| n \omega(n) + \omega(n) \max\{b^2, c^2\}$$

donc comme $n^2 \omega(n) > 0$

$$\frac{\omega(n+1)}{n^2 \omega(n)} \leq \max\{a^2, d^2\} + \frac{|ab + cd|}{n} + \frac{\max\{b^2, c^2\}}{n^2}$$

De même, $\omega(n+1) \geq n^2 \omega(n) \min\{a^2, d^2\} - |ab + cd| n \omega(n) + \omega(n) \min\{b^2, c^2\}$ et donc

$$\frac{\omega(n+1)}{n^2 \omega(n)} \geq \min\{a^2, d^2\} - \frac{|ab + cd|}{n} + \frac{\min\{b^2, c^2\}}{n^2}$$

IV.B.1. On a comme $b \neq 0$ $\sum v_n z^n = \frac{1}{b} \left(\sum u_{n+1} z^n - a \sum n u_n z^n \right)$. On sait (théorème de dérivation) que la série $\sum n u_n z^n$ a le même rayon de convergence que la série $\sum u_n z^n$. D'autre part $\sum u_{n+1} z^n = \sum u_n z^{n-1}$ à le même rayon de convergence que $\sum u_n z^n$, donc par le théorème sur la somme le rayon de convergence de $\sum v_n z^n$ est supérieur ou égal à celui de $\sum u_n z^n$.

La seconde relation donne (symétriquement) l'autre inégalité. Les deux séries ont même rayon de convergence ρ'
Selon l'indice du sujet introduisons $\omega(n)$:

Si $|z| < \rho'$, $\sum u_n z^n$ et $\sum v_n z^n$ converge donc $\sum (|u_n| + |v_n|) z^n$ converge ;

Mais $u_n^2 + v_n^2 = |u_n|^2 + |v_n|^2 \leq (|u_n| + |v_n|)^2$, donc la série $\sum \sqrt{w(n)} z^n$ converge.

Mais pour cette série la règle de D'Alembert donne pour $z \neq 0$

$$\lim \left(\left| \frac{\sqrt{\omega(n+1)} z^{n+1}}{\sqrt{w(n)} z^n} \right| \right) = \lim \left(n \sqrt{\frac{w(n+1)}{n^2 w(n)}} |z| \right) \geq \lim \left(n \sqrt{\alpha(n)} |z| \right) = +\infty$$

car le minorant $\alpha(n)$ tend vers une limite strictement positive.

Donc elle ne peut pas converger pour $z \neq 0$. Donc :

les deux séries $\sum u_n z^n$ et $\sum v_n z^n$ ont des rayons de convergence nuls