

CONCOURS COMMUN MINES-PONTS 2019

Épreuve de mathématiques II, PSI, trois heures
(corrigé)

I – Quelques exemples

1. C'est un résultat de cours que $x \mapsto e^{-x}$ est intégrable sur $[0, +\infty[$ (elle est bien sûr continue et positive sur cet intervalle), et on a :

$$\int_0^{+\infty} e^{-x} dx = [-e^{-x}]_0^{+\infty} = 1,$$

donc g est une densité sur $[0, +\infty[$.

Nous allons à présent montrer à la fois l'existence des moments d'ordre n pour tout $n \in \mathbb{N}$, et les calculer, grâce à une récurrence sur $n \in \mathbb{N}$. Pour tout $n \in \mathbb{N}$, soit P_n la proposition :

« $x \mapsto x^n g(x)$ est intégrable sur $[0, +\infty[$, et on a : $m_n(g) = n!$. »

Nous venons de justifier P_0 . Montrons l'hérédité de la proposition : soit $n \in \mathbb{N}$ tel qu'on ait P_n . Pour tout $t \geq 0$, l'application $x \mapsto x^{n+1} g(x)$ est continue sur le segment $[0, t]$, en tant que produit d'une application polynomiale et de g ; on intègre par parties, en intégrant g (qui est continue sur $[0, t]$ et de primitive $x \mapsto -e^{-x}$) et en dérivant $x \mapsto x^{n+1}$ (qui est de classe C^1 sur $[0, t]$ et de dérivée de $x \mapsto (n+1)x^n$). On a alors :

$$\begin{aligned} \forall t \geq 0, \quad \int_0^t x^{n+1} g(x) dx &= [-x^{n+1} e^{-x}]_0^t - \int_0^t (n+1)x^n (-e^{-x}) dx \\ &= -t^{n+1} e^{-t} + (n+1) \int_0^t x^n e^{-x} dx. \end{aligned} \quad (1)$$

On a, par croissances comparées : $\lim_{t \rightarrow +\infty} t^{n+1} e^{-t} = 0$. Par hypothèse de récurrence, $\lim_{t \rightarrow +\infty} \int_0^t x^n e^{-x} dx$ existe et est finie, et cette limite est $m_n(g) = n!$. Donc, quand $t \rightarrow +\infty$, la relation (1) implique d'une part que $\lim_{t \rightarrow +\infty} \int_0^t x^{n+1} g(x) dx$ existe et est finie, donc $x \mapsto x^{n+1} g(x)$ est intégrable sur $[0, +\infty[$, et d'autre part que :

$$m_{n+1}(g) = (n+1)n! = (n+1)!,$$

d'où P_{n+1} .

Ayant l'initialisation et l'hérédité, par récurrence nous avons montré que pour tout $n \in \mathbb{N}$, le moment d'ordre n de g est fini, et on a :

$$m_n(g) = n!.$$

2. Soit $n \in \mathbb{N}$. L'application $x \mapsto |x|^n \varphi(x)$ est continue sur \mathbb{R} et au voisinage de $+\infty$ on a :

$$|x|^n \varphi(x) = o_{x \rightarrow +\infty} \left(\frac{1}{x^2} \right).$$

Cela provient du théorème des croissances comparées : on a $\lim_{x \rightarrow +\infty} |x|^{n+2} e^{-\frac{x^2}{2}} = 0$.

Or la fonction de Riemann $x \mapsto \frac{1}{x^2}$ est continue et intégrable au voisinage de $+\infty$ car $2 > 1$, donc l'application $x \mapsto x^n \varphi(x)$ est aussi intégrable au voisinage de $+\infty$ par comparaison des fonctions intégrables.

De plus l'application $x \mapsto |x|^n \varphi(x)$ est paire sur \mathbb{R} , donc les intégrales $\int_{-\infty}^0 |x|^n \varphi(x) dx$ et $\int_0^{+\infty} |x|^n \varphi(x) dx$ sont de même nature, comme on le voit en faisant le changement de variable $x \mapsto -x$. La seconde converge d'après ce qui précède, donc la première converge également.

Puisque $\int_{-\infty}^0 |x|^n \varphi(x) dx$ et $\int_0^{+\infty} |x|^n \varphi(x) dx$ convergent, on en déduit que $\int_{-\infty}^{+\infty} |x|^n \varphi(x) dx$ converge et donc l'application $x \mapsto x^n \varphi(x)$ est intégrable sur \mathbb{R} .

On en déduit que φ admet des moments d'ordre n pour tout $n \in \mathbb{N}$.

3. Pour tout $p \in \mathbb{N}$, l'entier $2p+1$ est impair, donc $x \mapsto x^{2p+1}$ est une fonction impaire. De plus φ est paire, donc pour tout $p \in \mathbb{N}$ leur produit $x \mapsto x^{2p+1} \varphi(x)$ est une fonction impaire. On en déduit :

$$\forall p \in \mathbb{N}, \quad m_{2p+1}(\varphi) = \int_{-\infty}^{+\infty} x^{2p+1} \varphi(x) dx = 0.$$

4. Je présume, pour traiter cette question, qu'on admet que φ est effectivement une densité sur \mathbb{R} , et donc que $m_0(\varphi) = 1$.

Soit $p \in \mathbb{N} \setminus \{0\}$. On a :

$$m_{2p}(\varphi) = \int_{-\infty}^{+\infty} x^{2p} \varphi(x) dx = \frac{2}{\sqrt{2\pi}} \int_0^{+\infty} x^{2p} e^{-\frac{x^2}{2}} dx = -\frac{2}{\sqrt{2\pi}} \int_0^{+\infty} x^{2p-1} \left(-x e^{-\frac{x^2}{2}} \right) dx. \quad (2)$$

Nous allons intégrer par parties. Soit $t \geq 0$. L'application $x \mapsto x^{2p-1}$ est de classe C^1 sur $[0, t]$, de dérivée $x \mapsto (2p-1)x^{2p-2}$; l'application $x \mapsto -x e^{-\frac{x^2}{2}}$ est continue sur $[0, t]$, et admet pour primitive $x \mapsto e^{-\frac{x^2}{2}}$. On dérive la première et intègre la première, et la formule de l'intégration par parties donne :

$$\int_0^t x^{2p-1} \left(-x e^{-\frac{x^2}{2}} \right) dx = \left[x^{2p-1} e^{-\frac{x^2}{2}} \right]_0^t - (2p-1) \int_0^t x^{2p-2} e^{-\frac{x^2}{2}} dx = t^{2p-1} e^{-\frac{t^2}{2}} - (2p-1) \int_0^t x^{2p-2} e^{-\frac{x^2}{2}} dx.$$

On a, par croissances comparées : $\lim_{t \rightarrow +\infty} t^{2p-1} e^{-\frac{t^2}{2}} = 0$. Donc, quand $t \rightarrow +\infty$, la relation (2) donne :

$$m_{2p}(\varphi) = \frac{2}{\sqrt{2\pi}} \times (2p-1) \int_0^{+\infty} x^{2p-2} e^{-\frac{x^2}{2}} dx = (2p-1) m_{2p-2}(\varphi). \quad (3)$$

Ainsi la suite $(m_{2p}(\varphi))_{p \in \mathbb{N}}$ vérifie une relation de récurrence. Nous allons montrer, par récurrence sur $p \in \mathbb{N}$, que :

$$\forall p \in \mathbb{N}, \quad m_{2p}(\varphi) = \frac{(2p)!}{2^p p!}.$$

Si $p = 0$, on l'a déjà établi, puisque $m_0(\varphi) = 1$ et $\frac{(2 \cdot 0)!}{2^0 0!} = 1$. Soit $p \in \mathbb{N}$ tel qu'on ait la relation $m_{2p}(\varphi) = \frac{(2p)!}{2^p p!}$. Alors, en utilisant la relation de récurrence (3), on a :

$$m_{2(p+1)}(\varphi) = (2(p+1) - 1)m_{2p}(\varphi) = (2p+1) \frac{(2p)!}{2^p p!} = \frac{(2p+2)}{2(p+1)} (2p+1) \frac{(2p)!}{2^p p!} = \frac{(2(p+1))!}{2^{p+1} (p+1)!},$$

d'où l'égalité au rang $p+1$.

Nous avons démontré l'initialisation et l'hérédité, donc :

$$\forall p \in \mathbb{N}, \quad m_{2p}(\varphi) = \frac{(2p)!}{2^p p!}.$$

5. Prenons la fonction $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ définie par :

$$\forall x \in \mathbb{R}, \quad f(x) = \begin{cases} \frac{1}{4x^2} & \text{si } |x| \geq 1, \\ \frac{1}{4} & \text{si } |x| < 1. \end{cases}$$

La fonction f est continue et positive sur \mathbb{R} , intégrable au voisinage de $+\infty$ et $-\infty$ grâce à l'intégrabilité de la fonction de Riemann $x \mapsto \frac{1}{x^2}$, donc intégrable sur \mathbb{R} . De plus :

$$\int_{-\infty}^{+\infty} f = \frac{1}{2} \left(\int_0^1 dx + \int_1^{+\infty} \frac{dx}{x^2} \right) = \frac{1}{2} \left(1 + \left[-\frac{1}{x} \right]_1^{+\infty} \right) = \frac{1}{2} \times 2 = 1.$$

Tout ceci démontre que f est bien une densité sur \mathbb{R} . Par contre, pour tout x au voisinage de $+\infty$ on a $x \cdot f(x) = \frac{1}{4x}$, et la fonction de Riemann $x \mapsto \frac{1}{x}$ n'est pas intégrable au voisinage de $+\infty$: ainsi f n'admet pas de moment d'ordre 1.

II – Théorème de Stone-Weierstrass

Rappelons la formule du binôme de Newton, qu'on utilisera dans les trois prochaines questions :

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad \forall (x, y) \in \mathbb{R}^2, \quad \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} x^k y^{n-k} = (x+y)^n. \quad (4)$$

6. Soient $x \in [0, 1]$ et $n \in \mathbb{N}$. En prenant $y = 1 - x$ dans (4), on obtient :

$$\sum_{k=0}^n \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} = 1 = (x + (1-x))^n = 1^n = 1,$$

d'où le résultat.

7. Pour $n = 0$ on vérifie immédiatement que l'égalité de l'énoncé est vérifiée. Prenons donc $n \in \mathbb{N} \setminus \{0\}$ (cette distinction de cas est seulement pour ne pas avoir à se soucier d'élever 0 à une puissance négative dans l'égalité ci-dessous, mais c'est en soi dispensable).

En dérivant la relation (4) par rapport à x puis en multipliant le résultat par x , on obtient :

$$\forall (x, y) \in \mathbb{R}^2, \quad \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} k x^k y^{n-k} = n x (x + y)^{n-1}. \quad (5)$$

Pour tout $x \in [0, 1]$, prendre $y = 1 - x$ donne donc :

$$\sum_{k=0}^n k \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} = n x (x + (1-x))^{n-1} = n x \cdot 1^{n-1} = n x,$$

d'où le résultat.

8. Pour $n = 0$ et $n = 1$, la vérification immédiate ne pose pas de problème. Prenons donc un entier $n \geq 2$. En dérivant (5) par rapport à x , et en multipliant le résultat par x , on obtient :

$$\forall (x, y) \in \mathbb{R}^2, \quad \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} k^2 x^k y^{n-k} = n x (x + y)^{n-1} + n(n-1) x^2 (x + y)^{n-2}.$$

Pour tout $x \in [0, 1]$, prendre $y = 1 - x$ donne donc :

$$\sum_{k=0}^n k^2 \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} = n x (x + (1-x))^{n-1} + n(n-1) x^2 (x + (1-x))^{n-2} = n x + n(n-1) x^2,$$

d'où le résultat.

9. Soient $x \in [0, 1]$ et $n \in \mathbb{N}$. Alors :

$$\begin{aligned} & \sum_{k=0}^n (k - nx)^2 \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} \\ &= \sum_{k=0}^n k^2 \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} - 2nx \sum_{k=0}^n k \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} + (nx)^2 \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k}. \end{aligned}$$

On simplifie cette expression grâce aux trois identités démontrées dans les questions précédentes. On a donc :

$$\sum_{k=0}^n (k - nx)^2 \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} = (nx + n(n-1)x^2) - 2(nx)^2 + (nx)^2 = nx(1-x) \leq n,$$

où l'on utilise les majorations $x \leq 1$ et $1-x \leq 1$, valables pour $x \in [0, 1]$; d'où le résultat avec $C = 1$ (en vérité, le maximum de la fonction $x \mapsto x(1-x)$ est $\frac{1}{4}$, on peut donc prendre $C = \frac{1}{4}$).

10. Soient $x \in [0, 1]$ et $n \in \mathbb{N}$. Du fait que $1 = \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k}$ d'après la question 6, on peut écrire :

$$\begin{aligned} B_n(x) - f(x) &= \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} f\left(\frac{k}{n}\right) - \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} f(x) \\ &= \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} \left(f\left(\frac{k}{n}\right) - f(x) \right) \\ &= \sum_{k \in X} \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} \left(f\left(\frac{k}{n}\right) - f(x) \right) + \sum_{k \in Y} \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} \left(f\left(\frac{k}{n}\right) - f(x) \right). \end{aligned}$$

D'après la propriété admise dans l'énoncé, il existe $\alpha > 0$ tel que pour tout $(x, y) \in [0, 1]^2$ vérifiant $|x - y| < \alpha$, on ait : $|f(x) - f(y)| < \varepsilon$. Or, par définition de X , pour tout $k \in X$ on a $|x - \frac{k}{n}| < \alpha$. On en déduit, en utilisant l'inégalité triangulaire :

$$\begin{aligned} |B_n(x) - f(x)| &\leq \sum_{k \in X} \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} \left| f\left(\frac{k}{n}\right) - f(x) \right| + \sum_{k \in Y} \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} \left| f\left(\frac{k}{n}\right) - f(x) \right| \\ &\leq \varepsilon \sum_{k \in X} \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} + \sum_{k \in Y} \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} \left| f\left(\frac{k}{n}\right) - f(x) \right|. \end{aligned}$$

Comme nous sommes des termes positifs et que $X \subseteq \llbracket 0, n \rrbracket$, on a :

$$\sum_{k \in X} \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} \leq \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} = 1.$$

De plus, pour tout $k \in Y$ on a :

$$\left| f\left(\frac{k}{n}\right) - f(x) \right| \leq \left| f\left(\frac{k}{n}\right) \right| + |f(x)| \leq 2\|f\|_\infty.$$

On en déduit :

$$|B_n(x) - f(x)| \leq \varepsilon + 2\|f\|_\infty \sum_{k \in Y} \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k}, \tag{6}$$

d'où le résultat.

11. Soit $x \in [0, 1]$. Par définition de Y :

$$\sum_{k \in Y} \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} = \sum_{k \in Y} \frac{|x - \frac{k}{n}|^2}{|x - \frac{k}{n}|^2} \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} \leq \frac{1}{\alpha^2 n^2} \sum_{k \in Y} (nx - k)^2 \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k}.$$

D'après la question 9, il existe une constante $C > 0$ telle que :

$$\sum_{k=0}^n (nx - k)^2 \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} \leq Cn,$$

et donc :

$$\sum_{k \in Y} \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} \leq \frac{1}{\alpha^2 n^2} \sum_{k=0}^n (nx-k)^2 \binom{n}{k} x^k (1-x)^{n-k} \leq \frac{C}{\alpha^2 n}.$$

Or : $\lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{C}{\alpha^2 n} = 0$. Donc, par définition de la limite, pour tout n suffisamment grand on a :

$$0 \leq \frac{C}{\alpha^2 n} \leq \frac{\varepsilon}{2\|f\|_\infty}.$$

En utilisant cette majoration, et la relation (6), on obtient finalement que pour tout n suffisamment grand :

$$\|B_n - f\|_\infty \leq \varepsilon + 2\|f\|_\infty \times \frac{\varepsilon}{2\|f\|_\infty} = 2\varepsilon,$$

ce qu'on voulait démontrer.

III – Le problème des moments sur $[0, 1]$

12. Pour tout entier $n \in \mathbb{N}$, on a :

$$\int_0^1 (f(x) - g(x))x^n dx = m_n(f) - m_n(g) = 0$$

par hypothèse sur f et g . Or toute fonction polynomiale s'écrit comme combinaison linéaire de fonctions puissances $x \mapsto x^n$, et l'intégrale est une forme linéaire, donc pour toute fonction polynomiale P on a également :

$$\int_0^1 (f(x) - g(x))P(x) dx = 0.$$

13. Pour tout $n \in \mathbb{N}$:

$$\begin{aligned} \left| \int_0^1 (f(x) - g(x))P_n(x) dx - \int_0^1 (f(x) - g(x))^2 dx \right| &= \left| \int_0^1 (f(x) - g(x))(P_n(x) - (f(x) - g(x))) dx \right| \\ &\leq \int_0^1 |f(x) - g(x)| \cdot |P_n(x) - (f(x) - g(x))| dx \\ &\leq \|P_n - (f - g)\|_\infty \int_0^1 |f(x) - g(x)| dx. \end{aligned}$$

Par hypothèse $(P_n)_{n \in \mathbb{N}}$ converge uniformément sur $[0, 1]$ vers $f - g$, donc : $\lim_{n \rightarrow +\infty} \|P_n - (f - g)\|_\infty = 0$.
Donc, d'après le théorème des gendarmes :

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} \int_0^1 (f(x) - g(x))P_n(x) dx = \int_0^1 (f(x) - g(x))^2 dx.$$

14. D'après la question 12, pour tout $n \in \mathbb{N}$ on a :

$$\int_0^1 (f(x) - g(x))P_n(x)dx = 0.$$

Donc : $\lim_{n \rightarrow +\infty} \int_0^1 (f(x) - g(x))P_n(x)dx = 0$. Mais d'après la question précédente, la limite de cette suite d'intégrales est $\int_0^1 (f(x) - g(x))^2 dx$. Par unicité de la limite :

$$\int_0^1 (f(x) - g(x))^2 dx = 0.$$

La fonction $(f - g)^2$ est continue sur $[0, 1]$ parce que f et g sont des densités, positive, et d'intégrale nulle : cela n'est possible que si $(f - g)^2 = 0$, c'est-à-dire :

$$f = g,$$

d'où le résultat.

IV – Transformée de Fourier de la densité gaussienne

15. Nous allons démontrer simultanément l'existence et la continuité de $\hat{\varphi}$ sur \mathbb{R} , grâce au théorème de continuité des intégrales à paramètre. Posons :

$$\forall (\xi, t) \in \mathbb{R} \times \mathbb{R}, \quad \phi(\xi, t) = e^{it\xi} \varphi(t).$$

Pour tout $\xi \in \mathbb{R}$, l'application $t \mapsto \phi(\xi, t)$ est continue (par morceaux) sur \mathbb{R} (par continuité de φ , et par continuité de l'exponentielle complexe en tant que somme de série entière de rayon de convergence infini par exemple), et pour tout $t \in \mathbb{R}$ l'application $\xi \mapsto \phi(\xi, t)$ est continue sur \mathbb{R} pour la même raison. De plus :

$$\forall (\xi, t) \in \mathbb{R} \times \mathbb{R}, \quad |\phi(\xi, t)| = \varphi(t) \leq \varphi(t), \quad (\text{HYPOTHÈSE DE DOMINATION})$$

et l'application φ est continue et intégrable sur \mathbb{R} , puisqu'il s'agit d'une densité sur \mathbb{R} .

Les hypothèses du théorème de continuité des intégrales à paramètre sont donc vérifiées ; on en déduit que pour tout $\xi \in \mathbb{R}$ l'intégrale $\int_{\mathbb{R}} \phi(\xi, t) dt = \int_{\mathbb{R}} e^{it\xi} \varphi(t) dt$ converge absolument, donc converge, et l'application $\hat{\varphi} : \xi \mapsto \int_{\mathbb{R}} e^{it\xi} \varphi(t) dt$ est continue sur \mathbb{R} : ce qu'il fallait démontrer.

16. Cette fois-ci, nous utilisons le théorème de dérivation des intégrales à paramètre. Avec les notations de la question précédente :

— pour tout $t \in \mathbb{R}$, l'application $\xi \mapsto \phi(\xi, t)$ est manifestement de classe C^1 sur \mathbb{R} , et on a :

$$\forall t \in \mathbb{R}, \forall \xi \in \mathbb{R}, \quad \frac{\partial \phi}{\partial \xi}(\xi, t) = ite^{it\xi}\varphi(t);$$

— pour tout $\xi \in \mathbb{R}$, les applications $t \mapsto \phi(\xi, t)$ et $t \mapsto \frac{\partial \phi}{\partial \xi}(\xi, t)$ sont continues (par morceaux) sur \mathbb{R} par continuité des exponentielles et applications polynomiales, et l'application $t \mapsto \phi(\xi, t)$ est intégrable sur \mathbb{R} d'après la question précédente ;

— pour tout $(\xi, t) \in \mathbb{R} \times \mathbb{R}$, on a :

$$\left| \frac{\partial \phi}{\partial \xi}(\xi, t) \right| = t\varphi(t), \quad (\text{HYPOTHÈSE DE DOMINATION})$$

et l'application $t \mapsto t\varphi(t)$ est continue (par morceaux) et intégrable sur \mathbb{R} d'après la question 2 (où nous montrions en particulier l'existence d'un moment d'ordre 1).

Les hypothèses du théorème de dérivation des intégrales à paramètre sont donc vérifiées ; on en déduit que pour tout $\xi \in \mathbb{R}$ l'application $t \mapsto \frac{\partial \phi}{\partial \xi}(\xi, t)$ est intégrable sur \mathbb{R} , et l'application $\hat{\varphi} : \xi \mapsto \int_{\mathbb{R}} e^{it\xi}\varphi(t)dt$ est de classe C^1 sur \mathbb{R} . De plus :

$$\forall \xi \in \mathbb{R}, \quad \hat{\varphi}'(\xi) = \int_{\mathbb{R}} \frac{\partial \phi}{\partial \xi}(\xi, t)dt = \int_{\mathbb{R}} ite^{it\xi}\varphi(t)dt = \frac{i}{\sqrt{2\pi}} \int_{\mathbb{R}} e^{it\xi}te^{-\frac{t^2}{2}} dt.$$

17. Soit $\xi \in \mathbb{R}$. Nous allons intégrer par parties. Soient $a, b \in \mathbb{R}$. L'application $t \mapsto e^{it\xi}$ est de classe C^1 sur le segment $[a, b]$, de dérivée $t \mapsto i\xi e^{it\xi}$; l'application $t \mapsto te^{-\frac{t^2}{2}}$ est continue sur $[a, b]$, et admet pour primitive $t \mapsto -e^{-\frac{t^2}{2}}$. On dérive la première et intègre la seconde ; d'après la formule de l'intégration par parties on a donc :

$$\int_a^b e^{it\xi}te^{-\frac{t^2}{2}} dt = \left[e^{it\xi} \cdot \left(-e^{-\frac{t^2}{2}} \right) \right]_a^b + i\xi \int_a^b e^{it\xi}e^{-\frac{t^2}{2}} dt = -e^{ib\xi}e^{-\frac{b^2}{2}} + e^{ia\xi}e^{-\frac{a^2}{2}} + i\xi \int_a^b e^{it\xi}e^{-\frac{t^2}{2}} dt.$$

On a $\lim_{b \rightarrow +\infty} \left| e^{ib\xi}e^{-\frac{b^2}{2}} \right| = \lim_{b \rightarrow +\infty} e^{-\frac{b^2}{2}} = 0$, et de même : $\lim_{a \rightarrow -\infty} \left| e^{ia\xi}e^{-\frac{a^2}{2}} \right| = 0$. Donc, quand $a \rightarrow -\infty$ et $b \rightarrow +\infty$ on obtient :

$$\int_{\mathbb{R}} e^{it\xi}te^{-\frac{t^2}{2}} dt = i\xi \int_{\mathbb{R}} e^{it\xi}e^{-\frac{t^2}{2}} dt.$$

Après multiplication par $\frac{i}{\sqrt{2\pi}}$, on obtient :

$$\hat{\varphi}'(\xi) = -\xi\varphi(\xi),$$

donc $\hat{\varphi}$ vérifie l'équation différentielle linéaire du premier ordre : $\forall \xi \in \mathbb{R}, y'(\xi) = -\xi y(\xi)$.

18. Une primitive de $\xi \mapsto -\xi$ est $\xi \mapsto -\frac{\xi^2}{2}$, donc la théorie des équations différentielles linéaires du premier ordre nous assure qu'il existe $\lambda \in \mathbb{C}$ tel que :

$$\forall \xi \in \mathbb{R}, \quad \widehat{\varphi}(\xi) = \lambda e^{-\frac{\xi^2}{2}}.$$

Pour déterminer la valeur de cette constante, nous devons déterminer $\widehat{\varphi}$ en un réel. Or :

$$\widehat{\varphi}(0) = \int_{\mathbb{R}} \varphi(t) dt = 1$$

parce que φ est une densité sur \mathbb{R} . On en déduit $\lambda = 1$, et donc :

$$\forall \xi \in \mathbb{R}, \quad \widehat{\varphi}(\xi) = e^{-\frac{\xi^2}{2}}.$$

V – Le problème des moments sur $[0, +\infty[$

19. L'application f est positive sur $[0, +\infty[$. Vérifions qu'elle est continue sur ce même intervalle. Tout d'abord :

$$\lim_{x \rightarrow 0} \frac{e^{-\frac{1}{2}(\ln(x))^2}}{x\sqrt{2\pi}} = \lim_{u \rightarrow -\infty} \frac{e^{-\frac{u^2}{2}-u}}{\sqrt{2\pi}} = 0$$

par composition de limites, étant donné que : $\lim_{u \rightarrow -\infty} \left(-\frac{u^2}{2} - u\right) = -\infty$. Or $f(0) = 0$, donc f est bien continue en 0, et par suite sur $[0, +\infty[$ (la vérification est facile sur $]0, +\infty[$).

Il reste à justifier que f est intégrable sur $[0, +\infty[$ et de masse 1. Pour cela, on note que si l'on fait le changement de variable $u = e^x$ (c'est-à-dire : $x = \ln(u)$) dans l'intégrale $\int_{\mathbb{R}} \varphi = \int_{\mathbb{R}} \frac{e^{-\frac{x^2}{2}}}{\sqrt{2\pi}} dx$, changement de variable licite parce que l'application $x \mapsto e^x$ est de classe C^1 et strictement croissante de \mathbb{R} dans \mathbb{R}_+^* , alors $du = e^x dx$, et la formule du changement de variable ne change pas la nature des intégrales, donc :

$$\int_{\mathbb{R}} \varphi(x) dx = \int_{\mathbb{R}} \frac{e^{-\frac{x^2}{2}}}{\sqrt{2\pi}} \frac{e^x dx}{e^x} = \int_{\mathbb{R}_+^*} \frac{e^{-\frac{(\ln(u))^2}{2}}}{\sqrt{2\pi}u} du$$

converge également, et on a bien :

$$\int_{\mathbb{R}_+} f = \int_{\mathbb{R}_+^*} \frac{e^{-\frac{(\ln(u))^2}{2}}}{\sqrt{2\pi}u} du = \int_{\mathbb{R}} \varphi(x) dx = 1.$$

On a bien démontré que f est une densité sur $]0, +\infty[$.

20. Tout d'abord, l'intégrale $\int_{\mathbb{R}} e^{i(2\pi-in)u} e^{-\frac{1}{2}u^2} du$ converge : il s'agit de $\widehat{\varphi}(2\pi - in)$; la définition de $\widehat{\varphi}$ sur \mathbb{R} fut démontrée à la question 15, et l'énoncé nous incite à admettre que les résultats de la partie IV valent aussi sur \mathbb{C} (voir l'énoncé de la question 18).

Ensuite :

$$\operatorname{Im} \left(\frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{\mathbb{R}} e^{i(2\pi-in)u} e^{-\frac{1}{2}u^2} du \right) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{\mathbb{R}} \operatorname{Im} \left(e^{2i\pi u} e^{nu} e^{-\frac{1}{2}u^2} \right) du = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{\mathbb{R}} \sin(2\pi u) (e^u)^n e^{-\frac{1}{2}u^2} du$$

En faisant le changement de variable $x = e^u$, licite d'après la question précédente (où l'on a simplement inversé les notations...), on obtient :

$$\begin{aligned} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{\mathbb{R}} \sin(2\pi u) (e^u)^n e^{-\frac{1}{2}u^2} du &= \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_0^{+\infty} \sin(2\pi \ln(x)) x^n e^{-\frac{(\ln(x))^2}{2}} \frac{dx}{x} \\ &= \int_0^{+\infty} \sin(2\pi \ln(x)) x^n f(x) dx, \end{aligned}$$

intégrale égale à I_n par définition. On a donc montré :

$$I_n = \operatorname{Im} \left(\frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{\mathbb{R}} e^{i(2\pi-in)u} e^{-\frac{1}{2}u^2} du \right).$$

21. D'après la question précédente et la définition de $\widehat{\varphi}$ (étendue à \mathbb{C} , comme le suggère l'énoncé à la fin de la question 18), on a : $I_n = \operatorname{Im}(\widehat{\varphi}(2\pi - in))$. Donc, d'après la question 18 :

$$I_n = \operatorname{Im} \left(e^{-\frac{(2\pi-in)^2}{2}} \right) = \operatorname{Im} \left(e^{-\frac{(2\pi)^2-n^2}{2}} e^{2\pi in} \right) = \underbrace{\operatorname{Im} \left(e^{-\frac{(2\pi)^2-n^2}{2}} \right)}_{\in \mathbb{R}} = 0,$$

ce qu'il fallait démontrer.

22. Nous avons déjà établi que f est une densité. Vérifions pour quelles valeurs de $\alpha \in \mathbb{R}$ l'application g_α est une densité aussi : elle est bien continue sur $[0, +\infty[$ indépendamment de la valeur de α (du moins, si on pose $g_\alpha(0) = 0$, comme l'énoncé l'a fait pour f : attention au problème de définition du logarithme en 0). Pour juger si elle est positive sur $[0, +\infty[$, notons que pour tout $\alpha \in \mathbb{R}$, on a $e^{-\frac{1}{4}} \in [0, +\infty[$ et :

$$g_\alpha \left(e^{-\frac{1}{4}} \right) = f \left(e^{-\frac{1}{4}} \right) \left(1 + \alpha \sin \left(-\frac{\pi}{2} \right) \right) = f \left(e^{-\frac{1}{4}} \right) (1 - \alpha).$$

Pour que cette quantité soit positive, il faut $\alpha \leq 1$. Réciproquement, pour tout réel $\alpha \leq 1$ on a $1 + \alpha \sin \geq 0$, donc g_α est positive.

Alors, pour tout $\alpha \leq 1$, on a $|g_\alpha| \leq 2|f|$ et f est intégrable sur $[0, +\infty[$ d'après la question 19, donc par comparaison l'application g_α est intégrable sur $[0, +\infty[$. Enfin :

$$\forall \alpha \leq 1, \quad \int_0^{+\infty} g_\alpha = \int_0^{+\infty} f + \alpha \underbrace{\int_0^{+\infty} f(x) \sin(2\pi \ln(x)) dx}_{=I_0=0} = \int_0^{+\infty} f = 1,$$

donc pour tout $\alpha \leq 1$ la fonction g_α est une densité. On remarque que pour tout $n \in \mathbb{N}$:

$$m_n(g_\alpha) = m_n(f) + \alpha I_n,$$

et d'après la question précédente $I_n = 0$ pour tout $n \in \mathbb{N}$.

On en déduit que pour tout $\alpha \in]-\infty, 1] \setminus \{0\}$, les fonctions f et g_α sont deux densités sur $[0, +\infty[$, clairement distinctes vu que $\sin \neq 0$, et on a :

$$\forall n \in \mathbb{N}, \quad m_n(g_\alpha) = m_n(f).$$

Or $] - \infty, 1] \setminus \{0\}$ est indénombrable vu que $] - \infty, 0[$ l'est : cet intervalle est en effet en bijection avec \mathbb{R} via l'application $t \mapsto \ln(-t)$, et \mathbb{R} est indénombrable. D'où le résultat.

Remarque. En principe, aucune connaissance sur les ensembles indénombrables n'est au programme de PSI. Mais il ne me paraît pas raisonnable d'attendre des élèves qu'ils démontrent la non dénombrabilité de $] - \infty, 1] \setminus \{0\}$ en partant d'aucun résultat standard et sans la moindre indication, d'autant que cette considération me semble les éloigner de la préoccupation du sujet. C'est pourquoi je me suis permis d'utiliser la non dénombrabilité de \mathbb{R} , contre-exemple probablement nommé dans la plupart des cours sur les ensembles dénombrables.