

Examen d'accès - 24 Septembre 2014

Aucun document autorisé - Calculatrice fournie par le centre d'examen

Les consignes indiquées ci-dessous sont suffisamment explicites pour ne pas laisser de doute quant à leur interprétation. Les personnes surveillant l'examen ne répondront à aucune question relative à ces consignes durant l'épreuve, la bonne compréhension de ces règles faisant elle aussi partie de l'examen.

Cet examen est un questionnaire à choix multiples constitué de 50 questions. Plusieurs réponses sont proposées pour chaque question (ou ensemble de questions). Le nombre de bonnes réponses à une question peut aller de 0 à 5.

Les réponses sont à inscrire sur la feuille jointe, en cochant pour chaque question la (ou les) case(s) correspondant à la (ou les) bonne(s) réponse(s).

Toute réponse ambiguë sera considérée comme une absence de réponse.

Comptabilisation des points :

- Toute case cochée à tort entraîne une pénalité de 0,5 point. Toute case cochée à raison entraîne une bonification de 1 point (même si d'autres cases dans la même question auraient dû être cochées et ne l'ont pas été). Une case non cochée ne donne ni bonification ni malus. Les seules exceptions à cette règle sont définies au point suivant.
- Certaines sous-questions de type Vrai/Faux ne contiennent que deux propositions de réponse, dont une est forcément exacte. Pour ces questions, une absence de réponse rapporte 0 point. Si la bonne réponse est cochée et que la mauvaise ne l'est pas, +1 point. Si la mauvaise réponse est cochée et que la bonne ne l'est pas, -0,5 point. **Si les deux réponses sont cochées, -0,5 point.** Ces questions de type Vrai/Faux sont clairement indiquées dans le sujet par la mention **Question V/F** les précédant.

Vous disposez après les questions d'une table des valeurs de la fonction de répartition de la loi normale centrée et réduite, ainsi qu'une table du chi 2 (dans laquelle l'abréviation ddl désigne "degrés de liberté").

- Q 1)** On considère deux événements A et B . Parmi les assertions suivantes, lesquelles sont exactes, quels que soient A et B ?
- A) $P(A \cap B) = P(A) + P(B)$
 - B) $P(A \cap B) = P(A)P(B)$,
 - C) $P(A \cap B) \leq P(A)P(B)$,
 - D) $P(A \cup B) \leq P(A) + P(B)$,
 - E) $P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A)P(B)$.
- Q 2)** Dans un aquarium, il y a 30% de poissons bleus, 60% de poissons jaunes, le reste étant composé de poissons clowns. Il y a 6 poissons clowns. Combien y a-t-il de poissons bleus ?
- A) 18
 - B) 2
 - C) 12
 - D) 6
 - E) 5
- Q 3)** On considère deux urnes A et B. Le total des deux urnes contient 10 boules. A chaque instant, on tire une boule au hasard parmi la population, et on la change d'urne. Les tirages sont indépendants, et aucune boule n'est privilégiée par le tirage. Au départ de l'expérience, l'urne A contient toutes les boules et l'urne B est vide. Quelle est la probabilité, au bout de 5 tirages, que l'urne B contienne une seule boule ?
- A) 0,9
 - B) 1/2
 - C) 0
 - D) 0,1
 - E) 0,1216
- Q 4)** (suite) Même question avec 12 456 tirages.
- A) 1
 - B) 1/12456
 - C) 0.202

D) 0.1

E) 0

Q 5) On considère une variable aléatoire θ de loi exponentielle de paramètre α , i.e. de densité $\alpha \exp(-\alpha t) \mathbf{1}_{t \geq 0}$. On considère une variable aléatoire N telle que, sachant que $\theta = t$, N suit une loi de Poisson de paramètre t . L'espérance de N est égale à

A) t

B) α

C) α^{-1}

D) t^{-1}

E) $+\infty$.

Q 6) (suite) La variance de N vaut

A) α^2

B) t

C) $(\alpha + 1)/\alpha^2$

Question V/F : Les variables N et θ sont indépendantes.

D) Vrai

E) Faux

Q 7) Soit N une variable aléatoire de loi de Poisson de paramètre λ . Que vaut $E[1/(N + 1)]$?

A) $\frac{(\exp(\lambda)-1)\exp(-\lambda)}{\lambda}$

B) $\frac{1}{\lambda+1}$

C) $\frac{\exp(2\lambda)}{\lambda+1}$

D) $\lambda + 1$

E) $+\infty$.

Q 8) On considère une variable X de loi exponentielle de paramètre α (voir densité à la question 5). On rappelle que la fonction de répartition d'une variable aléatoire Y est la fonction $F_Y(t) = \mathbb{P}(Y \leq t)$. Quelle est la fonction de répartition de $\exp(X + 2)$ (pour $t \geq \exp(2)$) ?

A) $1 - \frac{\exp(2\alpha)}{t^\alpha}$

- B) $1 - \exp(\alpha \log t + 2)$
- C) $1 - \exp(\alpha \log(t - 2))$
- D) $1 - \log(\alpha(t - 2))$
- E) $\log(\alpha(t - 2))$

Q 9) Soit Y une variable aléatoire de fonction de répartition F_Y (voir définition question précédente). On considère $Z = F_Y(Y)$. On suppose que F_Y est strictement croissante. On a

- A) $Z = 1$,
- B) $Z = 1$ presque sûrement,
- C) $Z > 1$,
- D) Z suit une loi uniforme sur $[0, 1]$,
- E) $Z > 1$ presque sûrement.

Q 10) On considère deux variables U et V qui suivent des lois uniformes sur $[0, 1]$, et on considère C leur fonction de répartition jointe, c'est à dire $C(u, v) = \mathbb{P}(U \leq u \text{ et } V \leq v)$ pour tout (u, v) dans $[0, 1]$. On note $S(u, v) = \mathbb{P}(U > u \text{ et } V > v)$. On a, pour tout $[u, v]$ dans $[0, 1]$,

- A) $S(u, v) = u + v - 1 + C(1 - u, 1 - v)$
- B) $S(u, v) = 1 - C(u, v)$
- C) $S(u, v) = C(1 - u, 1 - v)$
- D) $S(u, v) = 1 - C(1 - u, 1 - v)$
- E) $S(u, v) = 1 - u - v + C(u, v)$

Q 11) On considère un emprunt de 50 000 euros à 2,5% sur 3 ans. La première mensualité n'a lieu qu'au bout d'1 an, et elle est de 10 000 euros. Au bout de 2 ans, une mensualité de 20 000 euros est versée. A la fin de la 3ème année, une dernière mensualité est versée. Le montant de cette dernière mensualité est

- A) 21 525
- B) 21 250 euros
- C) 22 838,29 euros

Le montant total des intérêts s'élève à

- D) 2 838,29 euros

E) 1250 euros

Q 12) On place un capital de 2 000 euros sur un produit rapportant un taux annuel de 3%. Au bout de 2 années, le taux change, passe à $x\%$. On se place 3 ans après le changement de taux. La valeur du placement est alors de 2 218,72 euros. Le taux x est donc de

A) 1,11%

B) 2%

C) 1,5%

D) 1,07 %

E) 1%

Q 13) On considère un emprunt à 2% sur 3 ans, remboursé en 3 annuités égales (paiement à la fin de la 1ère année, de la 2ème et de la 3ème). Le montant de l'annuité est de 8888,02 euros. Le capital emprunté est donc de

A) 25 632 euros

B) 26 393,30 euros

C) 20 000 euros

Les intérêts s'élèvent à

D) 1032,06 euros

E) 791,80 euros

Q 14) On considère un emprunt à 2%. 10 annuités ont été versées, à la fin de chaque année (première annuité au bout d'un an après emprunt). Ces annuités s'élèvent à 1000 euros, et le capital emprunté était de 25 000 euros. Quel est le capital restant dû après versement de la dixième annuité ?

A) 15 500 euros

B) 15 000 euros

C) 19 525,14 euros

On souhaite liquider le capital restant dû en 2 annuités, les deux années suivantes. La première de 10 000 euros. La seconde de

D) 10 113,96 euros

E) 5 100 euros

Q 15) Un particulier place sur un compte à 2,1% une somme de 10 000 euros. Au bout de deux ans, il retire une somme x de ce compte. 2 ans plus tard, la valeur de son placement est de 2187,36 euros. Que vaut x ?

A) 8000 euros

B) 8022,64 euros

C) 8679,47 euros

D) 8326,10 euros

E) 8150 euros

Q 16) On considère une fonction f positive, strictement croissante de $[a, b]$ dans $[c, d]$. On note g la fonction réciproque de f , c'est-à-dire la fonction g de $[c, d]$ dans $[a, b]$ qui à x associe l'unique y tel que $x = f(y)$. On suppose f dérivable et on note f' sa dérivée. La dérivée de g au point x est égale à

A) $\frac{1}{f'(f(x))}$

B) $\frac{1}{f'(g(x))}$

C) $\frac{1}{f'(x)}$

D) $\frac{1}{g(f'(x))}$

E) $\frac{1}{f(f'(x))}$.

Q 17) On considère la fonction

$$f(x) = \frac{x^2 - (3 + \sqrt{2})x + 3\sqrt{2}}{x^2 + x + 1}.$$

Quelles assertions sont vraies ?

A) La limite de f en $+\infty$ et en $-\infty$ est 1

B) La limite de f en $+\infty$ est 1 et, vaut -1 en $-\infty$.

C) f est bornée par 1

D) $|f|$ est bornée par 1

E) f est définie sur \mathbb{R} tout entier

Q 18) (suite de la question précédente) La dérivée de f est égale à (une de ces trois réponses est correcte)

- A) $\frac{4+\sqrt{2}}{14} \frac{14x^2+(20-26\sqrt{2})x-4-13\sqrt{2}}{x^4+x^2+1}$
 B) $\frac{4+\sqrt{2}}{14} \frac{14x^2+(20-26\sqrt{2})x-4-13\sqrt{2}}{x^4+2x^3+3x^2+2x+1}$
 C) $\frac{2x-(3+\sqrt{2})}{2x+1}$

La dérivée de f est

- D) croissante entre $\sqrt{2}$ et 3
 E) change de monotonie entre $\sqrt{2}$ et 3

Q 19) (suite de la question précédente) **Question V/F** La fonction f est convexe.

- A) Vrai
 B) Faux

La fonction f

- C) est positive pour $x < 2^{1/2}$
 D) est négative pour $x < 2^{1/2}$
 E) change de signe entre $-\infty$ et $2^{1/2}$.

Q 20) On considère la fonction

$$h(x) = \frac{14x^2 + (20 - 26\sqrt{2})x - 4 - 13\sqrt{2}}{x^4 + 2x^3 + 3x^2 + 2x + 1}.$$

On note $I = \int_{2^{1/2}}^3 h(x)dx$. On a

- A) $I = \frac{2}{3}$
 B) $I = 1$
 C) $I = \frac{2^{1/2}}{3}$
 D) $I = 0$
 E) $I = \frac{2x}{3}$

Q 21) On présente ici le niveau d'emploi (en milliers de personnes) de la population canadienne (années 80).

	Hommes	Femmes
Temps plein	6412	3970
Temps partiel	535	1378
Chômage	547	478

Les hommes au chômage représentent, en pourcentage de la population active

- A) 7,9%
- B) 7,3%
- C) 4,1%
- D) 4,4%
- E) 4,3%

Q 22) (suite de la question précédente) On considère un actif n'étant pas au chômage pris au hasard. Quel est la probabilité qu'il soit un homme ?

- A) 56,5%
- B) 52,2%
- C) 56,2%
- D) 54,1%
- E) 53,2%

Q 23) (suite de la question précédente) On souhaite tester l'hypothèse H_0 : "Dans la population considérée, le sexe n'a pas d'influence sur le niveau d'emploi." On effectue pour cela un test du chi 2. Si on note $x_{i,j}$ la valeur dans la case correspondant à la i -ème ligne et à la j -ème colonne du tableau précédent, x_j la somme sur la j -ème colonne, x_i la somme sur la i -ème ligne, x_{tot} le nombre total d'individu, et $e_{i,j} = x_j x_i / x_{tot}$, la statistique de test communément utilisée est

- A) $\chi^2 = \sum_{i,j} \frac{(x_{i,j} - e_{i,j})^2}{e_{i,j}}$,
- B) $\chi^2 = \sum_{i,j} \frac{(x_{i,j} - e_{i,j})^2}{x_{i,j}^2}$,

qui, lorsque le nombre d'individus est suffisamment grand, suit une loi du χ^2 à

- C) 2 degrés de liberté
- D) 3 degrés de liberté
- E) 4 degrés de liberté.

Q 24) (suite de la question précédente) On effectue le test précédent à un certain niveau α . On note par k le nombre de degrés de liberté correspondant à la deuxième partie de la question précédente, et par χ^2

la valeur de la statistique de test définie à la question précédente. On note s_α la valeur telle que, si X suit une loi du chi 2 à k degrés de liberté, $\mathbb{P}(X > s_\alpha) = \alpha$. **Question V/F** On rejette H_0 si

- A) $\chi^2 > s_\alpha$
- B) $\chi^2 < s_\alpha$.

On suppose que H_0 est rejetée au niveau 5%. Cela implique que

- C) il y a 5% de chances que H_0 soit vraie
- D) il y a 5% de chances que H_0 soit fausse
- E) H_0 est également rejetée au niveau 10%.

Q 25) (suite de la question précédente) Supposons que la valeur de la statistique de test considérée soit 8,12 (ATTENTION ! Cette valeur ne correspond pas aux chiffres du tableau de la question 23). Alors,

- A) On rejette H_0 au niveau 5% et au niveau 1%
- B) On rejette H_0 au niveau 5% mais pas au niveau 1%
- C) On rejette H_0 au niveau 1% mais pas au niveau 5%
- D) Le plus grand niveau auquel on rejette H_0 est compris entre 5 et 2%.
- E) Le plus grand niveau auquel on rejette H_0 est compris entre 10 et 20%.

Q 26) On considère un tableau de données X , de n lignes et p colonnes. Chaque ligne correspond à un individu, pour lequel on a mesuré p variables. On note (X_{i1}, \dots, X_{ip}) la i -ème ligne. Une analyse en composante principale du tableau X est effectuée. La composante principale est $\frac{1}{\sqrt{6}}(1, -1, 2)$. On en déduit que

- A) $n = 3$
- B) $p = 3$
- C) $n + p = 6$
- D) la variable $\frac{1}{\sqrt{6}}(X_{i1} - X_{i2} + 2X_{i3})$ est la meilleure façon de résumer l'information sur i (au sens du coût quadratique) par une seule variable
- E) la variable $\frac{1}{\sqrt{6}}(X_{1i} - X_{2i} + 2X_{3i})$ est la meilleure façon de résumer l'information sur i (au sens du coût quadratique) par une seule variable

- Q 27)** (suite de la question précédente) Pour un individu i , on cherche à expliquer l'impact des caractéristiques (X_{i1}, \dots, X_{ip}) précédentes sur une variable Y_i .
- A) la variable $X_{i1} - X_{i2} + 2X_{i3}$ est la variable la plus significative pour expliquer Y_i .
 - B) la variable $\frac{1}{\sqrt{6}}(X_{i1} - X_{i2} + 2X_{i3})$ est la variable la plus significative pour expliquer Y_i .
 - C) la variable $X_{1i} - X_{2i} + 2X_{3i}$ est la variable la plus significative pour expliquer Y_i .
 - D) la variable $\frac{1}{\sqrt{6}}(X_{1i} - X_{2i} + 2X_{3i})$ est la variable la plus significative pour expliquer Y_i .
 - E) l'analyse en composante principale n'apporte aucune information sur le caractère explicatif des variables.
- Q 28)** On considère un n -échantillon (X_1, \dots, X_n) , c'est à dire un vecteur de variables indépendantes identiquement distribuées. On définit $\hat{m} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i$. On suppose que X_1 suit une loi de Poisson de paramètre λ .
- A) \hat{m} converge vers λ presque sûrement.
 - B) \hat{m} converge vers λ en probabilité.
 - C) \hat{m} converge vers $1/\lambda$ presque sûrement.
 - D) \hat{m} converge vers $1/\lambda$ en probabilité.
 - E) \hat{m}^2 converge vers λ^2 presque sûrement.
- Q 29)** (suite de la question précédente) La variance de \hat{m} est
- A) λ^2/n
 - B) $\lambda^2/(n-1)$
 - C) λ/n
 - D) $\lambda/(n-1)$
 - E) $(\lambda + \lambda^2)/(n-1)$
- Q 30)** (suite de la question précédente) On a trouvé $\hat{m} = 1,86$. La variance empirique ($\hat{\sigma}^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (X_i - \hat{m})^2$) vaut 1,44. La valeur de n est 50. En supposant qu'on peut approcher la loi de \hat{m} par une loi gaussienne, on souhaite tester $H_0 : \lambda = 1,5$ contre $H_1 : \lambda \neq 1,5$. On teste à un niveau α (on rappelle que le niveau correspond à la proportion d'erreur de première espèce tolérée). **Question V/F :**

- A) Pour $\alpha = 0,05$ on accepte H_0 .
- B) Pour $\alpha = 0,05$ on refuse H_0 .

Question V/F :

- C) Pour $\alpha = 0,01$, on accepte H_0 .
- D) Pour $\alpha = 0,01$ on refuse H_0 .

Q 31) (suite de la question précédente) Dans les mêmes conditions que précédemment, on souhaite à présent tester $H_0 : \lambda = 1,5$ contre $H_1 : \lambda < 1,5$.

Question V/F :

- A) Pour $\alpha = 0,05$ on accepte H_0 .
- B) Pour $\alpha = 0,05$ on refuse H_0 .

Dans les mêmes conditions que précédemment, on souhaite à présent tester $H_0 : \lambda > 1,5$ contre $H_1 : \lambda < 1,5$.

- C) Pour $\alpha = 0,05$ on accepte H_0 .
- D) Pour $\alpha = 0,05$ on refuse H_0 .
- E) On ne dispose pas de suffisamment d'information pour conclure à l'acceptation ou au rejet de H_0 .

Q 32) (suite de la question précédente) On se place dans le même cadre que précédemment, mais cette fois-ci, $\hat{m} = 1,62$. On ne dispose pas d'information sur la variance empirique. Toujours en faisant une approximation gaussienne, déterminer un intervalle de confiance à 95% pour le paramètre λ de la loi de Poisson qui a engendré les observations.

- A) [1,44;1,8]
- B) [1,17;2,07]
- C) [1,56;1,68]
- D) [1,57;1,67]
- E) [1,27;1,97]

Q 33) (suite de la question précédente) Même question, mais cette fois-ci, X_1 suit une loi exponentielle de paramètre λ (voir question 5), et $\hat{m} = 1,36$, et on s'intéresse à un intervalle de confiance sur $\theta = 1/\lambda$.

- A) [0,98;1,74]
- B) [1,16;1,56]

C) [1,21;1,51]

D) [1,31;1,41]

E) [1,29;1,43]

Q 34) On considère la matrice

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

La matrice A admet pour valeurs propres

A) 1 et $1/2$

B) $3/2$ et 1

C) 1, $1/2$ et 0

D) 1 uniquement

E) $3/2$, 1 et 0

Q 35) On considère la matrice $A = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 1 & 1 & 0 \\ 1 & 1 & 1 & 1 & 1 \end{pmatrix}$. L'inverse de la ma-

trice A est

A) non définie

B) $A^{-1} = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 & 1 & 1 \\ 0 & 1 & 1 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}.$

C) $A^{-1} = \frac{1}{2} \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 & 1 & 1 \\ 0 & 1 & 1 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}.$

D) $A^{-1} = \frac{1}{2} \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 1 & 1 & 0 \\ 1 & 1 & 1 & 1 & 1 \end{pmatrix}.$

$$\text{E) } A^{-1} = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 1 & 1 & 0 \\ 1 & 1 & 1 & 1 & 1 \end{pmatrix}.$$

Q 36) On considère un vecteur gaussien $X = (X_1, X_2)^T$ (où T désigne la transposition) de loi $\mathcal{N}(0, A)$ où A est définie à la question 34 . On considère la variable $Y = 3 + 4X_1 - 2X_2$. Quelle est la loi de la variable Y ?

- A) La loi de Y n'est pas définie, parce que A n'est pas une matrice de variance-covariance.
- B) La loi de Y est une $\mathcal{N}(3, 12)$
- C) La loi de Y est une $\mathcal{N}(3, 2)$
- D) La loi de Y est une $\mathcal{N}(0, 2)$
- E) La loi de Y n'est pas nécessairement gaussienne, mais a pour variance 2.

Q 37) On effectue la régression linéaire d'une variable Y sur trois variables X_1, X_2 et X_3 , i.e. $Y = \beta_0 + \beta_1x_1 + \beta_2x_2 + \beta_3x_3 + \varepsilon$ où $E[\varepsilon] = 0$. On observe la sortie suivante :

	Coefficient	Erreur std.	Valeur de t	$Pr(> t)$
Constante	84.5483	13.6065	6.214	$1.38e^{-7}$
X_1	1.3150	0.4974	2.644	0.01118
X_2	0.4864	0.1675	2.903	0.00565
X_3	-4.8935	1.0270	-4.765	$1.93e^{-5}$

Si l'on conserve ce modèle, que vaut $E[Y]$ pour $x_1 = 0, x_2 = 1$ et $x_3 = -1$?

- A) 80,14
- B) 89,92
- C) -4,41
- D) 5,38
- E) 79,65

Q 38) (suite de la question précédente) **Question V/F** On souhaite tester $H_0 : \beta_2 = 0$ contre $H_1 : \beta_2 \neq 0$ au niveau 0,001.

- A) On rejette H_0 .
- B) On ne rejette pas H_0 .

Question V/F Même question avec un niveau 0,006.

- C) On rejette H_0 .
- D) On ne rejette pas H_0 .

Q 39) On considère un modèle de régression linéaire à 3 variables, dont le R^2 est de 0,6819. La taille d'échantillon est $n = 100$. Lesquelles des assertions suivantes sont vraies ?

- A) Il y a environ 68% des prédictions effectuées par ce modèle qui sont vraies.
- B) On rajoute une 4ème variable et le R^2 passe à 0,69. Le modèle à 4 variables est préférable.
- C) Il y a environ 32% de chances que le modèle ne soit pas correct.
- D) On retranche une variable non significative. Le R^2 augmente nécessairement.
- E) On retranche une variable non significative, et on obtient un modèle qui a un $R^2 = 0,71$. Ce nouveau modèle est préférable au modèle initial.

Q 40) On considère deux modèles de régression. Le premier s'écrit $E[Y] = \alpha + \beta X$. Le second s'écrit $E[Y] = \alpha' + \beta' X^2$. Le R^2 du premier modèle est 0,76. Le R^2 du second modèle est 0,80.

- A) Du point de vue du R^2 , le second modèle est préférable.
- B) Du point de vue du R^2 , le premier modèle est préférable.
- C) Les deux modèles ne sont pas comparables en terme de R^2 .
- D) Le modèle 1 comporte moins de paramètres et est donc préférable.
- E) Si la différence entre β et β' n'est pas significative, alors on préférera le second modèle.

Q 41) Soit X et Y des variables discrètes dont les distributions sont définies par

$$\begin{aligned}
 P(X = 1, Y = 1) &= 0.1 \\
 P(X = 1, Y = 2) &= 0.3 \\
 P(X = 2, Y = 1) &= 0.4 \\
 P(X = 2, Y = 2) &= 0.2.
 \end{aligned}$$

L'espérance de X^2 vaut

- A) 1
- B) 1,25
- C) 2,8

L'espérance de Y^3 vaut

- D) 4,5
- E) 3,2

Q 42) Soit X et Y des variables discrètes dont les distributions sont définies par

$$\begin{aligned}P(X = 1, Y = 1) &= 0.1 \\P(X = 1, Y = 2) &= 0.3 \\P(X = 2, Y = 1) &= 0.1 \\P(X = 2, Y = 2) &= 0.2 \\P(X = 1, Y = 3) &= 0.1 \\P(X = 2, Y = 3) &= 0.2.\end{aligned}$$

La quantité $E[X|Y \geq 2]$ est égale à

- A) 1,2
- B) 1,5
- C) 1,4

La quantité $Var(X|Y \geq 2)$ est égale à

- D) 2,5
- E) 0,25

Q 43) On note $\phi_X(t) = E[\exp(itX)]$ la fonction caractéristique d'une variable aléatoire X . On suppose que X suit une loi de Poisson de paramètre λ . La fonction $\phi_X(t)$ vaut

- A) $\exp(\lambda t - 1)$
- B) λt
- C) $\exp(\lambda(\exp(it) - 1))$
- D) $\lambda \exp(it)$

E) $\lambda \exp(it)$

Q 44) (suite de la question précédente) On note $\phi'_X(t)$ (resp. $\phi''_X(t)$) la dérivée de ϕ_X (resp. sa dérivée seconde) calculée au point t . On a

A) $\phi'_X(0) = i\lambda$

B) $\phi'_X(0) = \lambda$

C) $\phi'_X(0) = 0$

D) $\phi''_X(0) = -\lambda$

E) $\phi''_X(0) = -(\lambda + \lambda^2)$

Q 45) On considère une variable log-normale, i.e. $Y = e^X$ avec $X \sim \mathcal{N}(m, \sigma^2)$. L'espérance de Y vaut

A) $\exp(m)$

B) $\exp(m + \sigma^2)$

C) $\exp(m + \sigma^2/2)$

La variance de Y vaut

D) $(\exp(\sigma^2) - 1) \exp(2\mu + \sigma^2)$

E) $(\exp(\sigma^2) - 1) \exp(\sigma^2)$.

Q 46) On considère la suite de fonctions, pour n entier naturel positif, définies sur les réels positifs, $f_n(x) = (1 - \frac{x}{n})^n$ pour $0 \leq x \leq n$, et $f_n(x) = 0$ sinon.

A) Pour tout x , $f_n(x)$ converge vers $\exp(-x)$.

B) Pour tout x , $f_n(x)$ converge vers 0.

C) Pour tout $x \leq n$, $f_n(x)$ converge vers 0.

D) Pour tout $x \leq n$, $f_n(x)$ converge vers $\exp(-x)$.

E) $f_n(x)$ converge vers $+\infty$ pour tout x .

Q 47) On suppose que le temps d'attente (en minutes) à un arrêt d'autobus T suit une loi exponentielle d'espérance m . J'ai déjà attendu x minutes. En moyenne, combien de temps vais-je encore attendre (en fonction de x) ?

A) $\frac{m}{x}$ minutes.

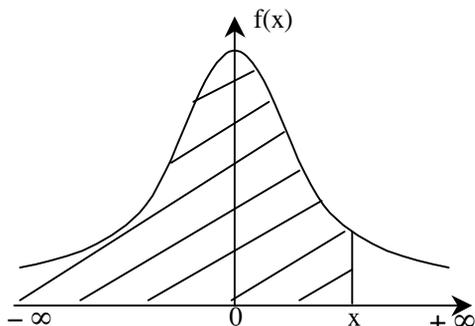
B) $m - x$ minutes.

- C) m minutes.
- D) $m + x$ minutes.
- E) $m - \frac{1}{x}$ minutes.

- Q 48)** Achille fait la course avec une tortue. Bon prince, il laisse à la tortue 100 mètres d'avance. Achille se déplace à une vitesse constante de 10 mètres par secondes, et 100 fois plus vite que la tortue, qui elle aussi se déplace à vitesse constante. Au bout de combien de temps Achille rattrape-t-il la tortue ?
- A) Il ne la rattrape jamais : à chaque fois qu'il a atteint le point où se trouvait précédemment la tortue, celle-ci a repris de l'avance (paradoxe).
 - B) Il la rattrape au bout de 10,10 secondes (arrondi au centième).
 - C) Il la rattrape au bout de 10 secondes (arrondi au centième).
 - D) Il la rattrape au bout de 20 secondes (arrondi au centième).
 - E) Il la rattrape au bout de 11,09 secondes (arrondi au centième).
- Q 49)** Un sac contient 5 jetons indiscernables au touché numérotés 1, 2, 3, 4 et 5 . On tire successivement et avec remise 2 jetons. Calculer la probabilité de l'événement : " la somme des numéros obtenus sur les jetons est 5 "
- A) $3/25$
 - B) $2/25$
 - C) $1/5$
 - D) $2/5$
 - E) $4/25$
- Q 50)** On considère une variable aléatoire X de loi exponentielle de paramètre λ (voir question 5). On considère une variable Y , indépendante de X , qui prend la valeur 1 avec probabilité $1/2$, et la valeur -1 avec probabilité $1/2$. On note $Z = XY$. La probabilité que Z soit supérieure à t (pour $t \geq 0$) est égale à
- A) $\exp(-\lambda t)/2$
 - B) $\exp(-\lambda t)/2 + 1/2$
 - C) $\exp(-\lambda t)$
 - D) 0
 - E) $\exp(-\lambda t)/2 + \exp(\lambda t)/2$

Loi Normale centrée réduite

Probabilité de trouver une valeur inférieure à x.



$$F(x) = \int_{-\infty}^x \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{u^2}{2}} du$$

X	0,00	0,01	0,02	0,03	0,04	0,05	0,06	0,07	0,08	0,09
0,0	0,5000	0,5040	0,5080	0,5120	0,5160	0,5199	0,5239	0,5279	0,5319	0,5359
0,1	0,5398	0,5438	0,5478	0,5517	0,5557	0,5596	0,5636	0,5675	0,5714	0,5753
0,2	0,5793	0,5832	0,5871	0,5910	0,5948	0,5987	0,6026	0,6064	0,6103	0,6141
0,3	0,6179	0,6217	0,6255	0,6293	0,6331	0,6368	0,6406	0,6443	0,6480	0,6517
0,4	0,6554	0,6591	0,6628	0,6664	0,6700	0,6736	0,6772	0,6808	0,6844	0,6879
0,5	0,6915	0,6950	0,6985	0,7019	0,7054	0,7088	0,7123	0,7157	0,7190	0,7224
0,6	0,7257	0,7291	0,7324	0,7357	0,7389	0,7422	0,7454	0,7486	0,7517	0,7549
0,7	0,7580	0,7611	0,7642	0,7673	0,7704	0,7734	0,7764	0,7794	0,7823	0,7852
0,8	0,7881	0,7910	0,7939	0,7967	0,7995	0,8023	0,8051	0,8078	0,8106	0,8133
0,9	0,8159	0,8186	0,8212	0,8238	0,8264	0,8289	0,8315	0,8340	0,8365	0,8389
1,0	0,8413	0,8438	0,8461	0,8485	0,8508	0,8531	0,8554	0,8577	0,8599	0,8621
1,1	0,8643	0,8665	0,8686	0,8708	0,8729	0,8749	0,8770	0,8790	0,8810	0,8830
1,2	0,8849	0,8869	0,8888	0,8907	0,8925	0,8944	0,8962	0,8980	0,8997	0,9015
1,3	0,9032	0,9049	0,9066	0,9082	0,9099	0,9115	0,9131	0,9147	0,9162	0,9177
1,4	0,9192	0,9207	0,9222	0,9236	0,9251	0,9265	0,9279	0,9292	0,9306	0,9319
1,5	0,9332	0,9345	0,9357	0,9370	0,9382	0,9394	0,9406	0,9418	0,9429	0,9441
1,6	0,9452	0,9463	0,9474	0,9484	0,9495	0,9505	0,9515	0,9525	0,9535	0,9545
1,7	0,9554	0,9564	0,9573	0,9582	0,9591	0,9599	0,9608	0,9616	0,9625	0,9633
1,8	0,9641	0,9649	0,9656	0,9664	0,9671	0,9678	0,9686	0,9693	0,9699	0,9706
1,9	0,9713	0,9719	0,9726	0,9732	0,9738	0,9744	0,9750	0,9756	0,9761	0,9767
2,0	0,9772	0,9778	0,9783	0,9788	0,9793	0,9798	0,9803	0,9808	0,9812	0,9817
2,1	0,9821	0,9826	0,9830	0,9834	0,9838	0,9842	0,9846	0,9850	0,9854	0,9857
2,2	0,9861	0,9864	0,9868	0,9871	0,9875	0,9878	0,9881	0,9884	0,9887	0,9890
2,3	0,9893	0,9896	0,9898	0,9901	0,9904	0,9906	0,9909	0,9911	0,9913	0,9916
2,4	0,9918	0,9920	0,9922	0,9925	0,9927	0,9929	0,9931	0,9932	0,9934	0,9936
2,5	0,9938	0,9940	0,9941	0,9943	0,9945	0,9946	0,9948	0,9949	0,9951	0,9952
2,6	0,9953	0,9955	0,9956	0,9957	0,9959	0,9960	0,9961	0,9962	0,9963	0,9964
2,7	0,9965	0,9966	0,9967	0,9968	0,9969	0,9970	0,9971	0,9972	0,9973	0,9974
2,8	0,9974	0,9975	0,9976	0,9977	0,9977	0,9978	0,9979	0,9979	0,9980	0,9981
2,9	0,9981	0,9982	0,9982	0,9983	0,9984	0,9984	0,9985	0,9985	0,9986	0,9986
3,0	0,9987	0,9987	0,9987	0,9988	0,9988	0,9989	0,9989	0,9989	0,9990	0,9990
3,1	0,9990	0,9991	0,9991	0,9991	0,9992	0,9992	0,9992	0,9992	0,9993	0,9993
3,2	0,9993	0,9993	0,9994	0,9994	0,9994	0,9994	0,9994	0,9995	0,9995	0,9995
3,3	0,9995	0,9995	0,9995	0,9996	0,9996	0,9996	0,9996	0,9996	0,9996	0,9997
3,4	0,9997	0,9997	0,9997	0,9997	0,9997	0,9997	0,9997	0,9997	0,9997	0,9998
3,5	0,9998	0,9998	0,9998	0,9998	0,9998	0,9998	0,9998	0,9998	0,9998	0,9998

Table pour les grandes valeurs de x :

x	3	3,2	3,4	3,6	3,8	4	4,2	4,4	4,6	4,8
F(x)	0,99865003	0,99931280	0,99966302	0,99984085	0,99992763	0,99996831	0,99998665	0,99999458	0,99999789	0,99999921

Loi de Khi-deux

Le tableau donne x tel que $P(K > x) = p$

p	0,999	0,995	0,99	0,98	0,95	0,9	0,8	0,2	0,1	0,05	0,02	0,01	0,005	0,001
ddl														
1	0,0000	0,0000	0,0002	0,0006	0,0039	0,0158	0,0642	1,6424	2,7055	3,8415	5,4119	6,6349	7,8794	10,8276
2	0,0020	0,0100	0,0201	0,0404	0,1026	0,2107	0,4463	3,2189	4,6052	5,9915	7,8240	9,2103	10,5966	13,8155
3	0,0243	0,0717	0,1148	0,1848	0,3518	0,5844	1,0052	4,6146	6,2514	7,8147	9,8374	11,3449	12,8382	16,2662
4	0,0908	0,2070	0,2971	0,4294	0,7107	1,0636	1,6488	5,9886	7,7949	9,4877	11,6678	13,2767	14,8603	18,4668
5	0,2102	0,4117	0,5543	0,7519	1,1455	1,6103	2,3425	7,2893	9,2364	11,0705	13,3882	15,0863	16,7496	20,5150
6	0,3811	0,6757	0,8721	1,1344	1,6354	2,2041	3,0701	8,5581	10,6446	12,5032	15,0332	16,8119	18,5476	22,4577
7	0,5985	0,9893	1,2390	1,5643	2,1623	2,8331	3,8223	9,8032	12,0170	14,0671	16,6224	18,4753	20,2777	24,3219
8	0,8571	1,3444	1,6465	2,0325	2,7326	3,4895	4,5936	11,0301	13,3616	15,5073	18,1682	20,0902	21,9550	26,1245
9	1,1519	1,7349	2,0879	2,5324	3,3251	4,1682	5,3801	12,2421	14,6837	16,9190	19,6751	21,6660	23,5894	27,8772
10	1,4787	2,1559	2,5582	3,0591	3,9403	4,8652	6,1791	13,4420	15,9872	18,3070	21,1608	23,2093	25,1882	29,5883
11	1,8339	2,6032	3,0535	3,6087	4,5748	5,5778	6,9887	14,6314	17,2750	19,6751	22,6179	24,7250	26,7568	31,2641
12	2,2142	3,0738	3,5706	4,1783	5,2260	6,3038	7,8073	15,8120	18,5493	21,0261	24,0540	26,2170	28,2995	32,9095
13	2,6172	3,5650	4,1069	4,7654	5,8919	7,0415	8,6339	16,9848	19,8119	22,3620	25,4715	27,6882	29,8195	34,5282
14	3,0407	4,0747	4,6604	5,3682	6,5706	7,7895	9,4673	18,1508	21,0641	23,6848	26,8728	29,1412	31,3193	36,1233
15	3,4827	4,6009	5,2293	5,9849	7,2609	8,5468	10,3070	19,3107	22,3071	24,9958	28,2595	30,5779	32,8013	37,6973
16	3,9416	5,1422	5,8122	6,6142	8,0716	9,3122	11,1521	20,4651	23,5418	26,2962	29,6332	31,9999	34,2672	39,2524
17	4,4161	5,6972	6,4078	7,2550	8,6718	10,0852	12,0023	21,6146	24,7690	27,5871	30,9950	33,4087	35,7185	40,7902
18	4,9048	6,2648	7,0149	7,9062	9,3905	10,8649	12,8570	22,7595	25,9894	28,8693	32,3462	34,8053	37,1565	42,3124
19	5,4068	6,8440	7,6327	8,5670	10,1170	11,6509	13,7158	23,9004	27,2036	30,1435	33,6874	36,1909	38,5823	43,8202
20	5,9210	7,4338	8,2604	9,2367	10,8508	12,4426	14,5784	25,0375	28,4120	31,4104	35,0196	37,5662	39,9968	45,3147
21	6,4467	8,0337	8,8972	9,9146	11,5913	13,2396	15,4446	26,1711	29,6151	32,6706	36,3434	38,9322	41,4011	46,7970
22	6,9830	8,6427	9,5425	10,6000	12,3380	14,0415	16,3140	27,3015	30,8133	33,9244	37,6595	40,2894	42,7957	48,2679
23	7,5292	9,2604	10,1957	11,2926	13,0905	14,8480	17,1865	28,4288	32,0069	35,1725	38,9683	41,6384	44,1813	49,7282
24	8,0849	9,8862	10,8564	11,9918	13,8484	15,6587	18,0618	29,5533	33,1962	36,4150	40,2704	42,9798	45,5585	51,1786
25	8,6493	10,5197	11,5240	12,6973	14,6114	16,4734	18,9398	30,6752	34,3816	37,6525	41,5661	44,3141	46,9279	52,6197
26	9,2221	11,1602	12,1981	13,4086	15,3792	17,2919	19,8202	31,7946	35,5632	38,8851	42,8558	45,6417	48,2899	54,0520
27	9,8028	11,8076	12,8785	14,1254	16,1514	18,1139	20,7030	32,9117	36,7412	40,1133	44,1400	46,9629	49,6449	55,4760
28	10,3909	12,4613	13,5647	14,8475	16,9279	18,9392	21,5880	34,0266	37,9159	41,3371	45,4188	48,2782	50,9934	56,8923
29	10,9861	13,1211	14,2565	15,5745	17,7084	19,7677	22,4751	35,1394	39,0875	42,5570	46,6927	49,5879	52,3356	58,3012
30	11,5880	13,7867	14,9535	16,3062	18,4927	20,5992	23,3641	36,2502	40,2560	43,7730	47,9618	50,8922	53,6720	59,7031
40	17,9164	20,7065	22,1643	23,8376	26,5093	29,0505	32,3450	47,2685	51,8051	55,7585	60,4361	63,6907	66,7660	73,4020
50	24,6739	27,9907	29,7067	31,6639	34,7643	37,6886	41,4492	58,1638	63,1671	67,5048	72,6133	76,1539	79,4900	86,6608
60	31,7383	35,5345	37,4849	39,6994	43,1880	46,4589	50,6406	68,9721	74,3970	79,0819	84,5799	88,3794	91,9517	99,6072
70	39,0364	43,2752	45,4417	47,8934	51,7393	55,3289	59,8978	79,7146	85,5270	90,5312	96,3875	100,4252	104,2149	112,3169
80	46,5199	51,1719	53,5401	56,2128	60,3915	64,2778	69,2069	90,4053	96,5782	101,8795	108,0693	112,3288	116,3211	124,8392
90	54,1552	59,1963	61,7541	64,6347	69,1260	73,2911	78,5584	101,0537	107,5650	113,1453	119,6485	124,1163	128,2989	137,2084
100	61,9179	67,3276	70,0649	73,1422	77,9295	82,3581	87,9453	111,6667	118,4980	124,3421	131,1417	135,8067	140,1695	149,4493
120	77,7551	83,8516	86,9233	90,3667	95,7046	100,6236	105,8056	132,8063	140,2326	146,5674	153,9182	158,9502	163,6482	173,6174
140	93,9256	100,6548	104,0344	107,8149	113,6593	119,0293	125,5781	153,8537	161,8270	168,6130	176,4709	181,8403	186,8468	197,4508
160	110,3603	117,6793	121,3456	125,4400	131,7561	137,5457	144,7834	174,8283	183,3106	190,5165	198,8464	204,5301	209,8239	221,0190
180	127,0111	134,8844	138,8204	143,2096	149,9688	156,1526	163,8682	195,7434	204,7037	212,3039	221,0772	227,0561	232,6198	244,3705
200	143,8428	152,2410	156,4320	161,1003	168,2786	174,8353	183,0028	216,6088	226,0210	233,9943	243,1869	249,4451	255,2642	267,5405
250	186,5541	196,1606	200,9386	206,2490	214,3916	221,8059	231,0128	268,5986	279,0504	287,8388	304,9396	311,3462	316,8444	324,8324
300	219,9634	230,6634	245,9725	251,8637	260,8781	269,0679	279,2143	320,3971	331,7885	341,3951	352,4246	359,9064	366,8444	381,4252
400	288,2596	300,9028	317,1553	334,0781	354,6410	364,2074	376,0218	423,5895	436,6490	447,6325	460,2108	468,7245	476,6064	493,1318
500	407,9470	422,3034	429,3875	437,2194	449,1468	459,9261	473,2099	526,4014	540,9303	553,1268	567,0698	576,4928	585,2066	603,4460
600	498,6229	514,5289	522,3651	531,0191	544,1801	556,0560	570,6680	628,9433	644,8004	658,0936	673,2703	683,5156	692,9816	712,7712
700	590,0480	607,3795	615,9675	625,3175	639,6130	651,3979	668,3308	731,8205	748,3305	762,6607	778,9721	789,5735	800,1314	821,3468
800	682,0665	700,7250	709,8969	720,0107	735,3623	749,1852	766,1555	833,4557	851,6712	866,9114	884,2789	895,9843	906,7862	929,3289
900	774,5698	794,4750	804,2517	815,0267	831,3702	846,0746	864,1125	935,4987	954,7819	970,9036	989,2631	1001,6296	1013,0364	1036,8260