

Programme de colle : semaine 18
du 11 au 15 février 2019

Convergences et approximations en probabilités

1. Convergence en probabilité

Définition, exemples. Inégalités de Markov et Bienaymé-Tchebychev. Loi faible des grands nombres, cas particulier d'une suite de variables de Bernoulli, interprétation. Composition par une fonction continue (admis).

2. Convergence en loi

Définition, caractérisation dans le cas d'une suite de variables à valeurs entières, exemples. Théorème central limite (admis), interprétation. Lemme de Slutsky (admis), composition par une fonction continue (admis).

3. Approximations

Approximation de la loi binomiale par la loi de Poisson (cas des événements rares) ou la loi normale. Approximation de la loi de Poisson par la loi normale. *Les conditions pratiques de validité des approximations doivent être rappelées aux étudiants.*

Endomorphismes et matrices symétriques

1. Endomorphismes et matrices symétriques

Endomorphismes symétriques : définition, caractérisation matricielle, endomorphismes symétriques parmi les projecteurs, si u symétrique stabilise F alors il stabilise F^\perp . Réduction des endomorphismes symétriques. Réduction des matrices symétriques réelles.

2. Application à l'étude du signe d'une forme quadratique (*à partir de jeudi*)

Formes quadratiques sur \mathbb{R}^n : définition, représentation matricielle. Forme polaire, matrice symétrique et endomorphisme symétrique associés à une forme quadratique. Inégalité $\alpha \|x\|^2 \leq q(x) \leq \beta \|x\|^2$ où α et β désignent les plus petite et grande valeur propre de la matrice symétrique associée à q , avec cas d'égalité. Étude du signe d'une forme quadratique en fonction des valeurs propres de la matrice symétrique associée, application à la caractérisation des formes bilinéaires positives et définies-positives.