

Algèbre linéaire avancée II

Friedrich Eisenbrand

16 février 2023

Préface

Ceci sont mes notes du cours *Algèbre Linéaire Avancée II*. La qualité de ce texte dépend fortement de la participation des étudiants. Ces sources sont gérées sur *GitHub*, une plateforme importante de collaboration. Si vous trouvez des fautes, des erreurs typographiques, ou même des démonstrations plus élégantes, ou des exemples qui vous aident à comprendre la matière, je vous invite à créer une *branch* des fichiers en question, où dedans vous éditez le texte. Après, vous publiez (*publish*) cette *branch* et vos collègues peuvent discuter vos modifications. Si vous êtes satisfait avec vos modifications, vous me demandez, avec un *Pull Request*, d'accepter vos modifications et finalement, le document peut être changé. Je me réjouis en avance de votre participation.

Contributions

Des corrections et modifications ont été implémentées par :

- Orane Jecker
- Natalia Karaskova
- Dylan Samuelian
- Aziz Benmosbah
- Djian Post
- Robin Mamie
- Alfonso Cevallos
- Kévin Jorand
- Charles Dufour
- Christoph Hunkenschröder
- Adam Cierniak
- Mann-Tchi Dang
- Yasmine Bennis
- Corentin
- Lucas Gehrt
- Jooyoung Kim
- Léo Navarro
- Arthur Serres
- Matthieu Haeberle
- Chady Bensaïd

Le deuxième chapitre est basé, en partie, sur les notes du cours de Daniel Kressner.

Table des matières

1	Polynômes	5
1.1	Notions fondamentales	5
1.2	Divisibilité et racines	10
1.3	Factorisation de polynômes sur un corps	12
1.3.1	L'algorithme d'Euclide	13
1.3.2	Factorisation en irréductibles	14
2	Valeurs propres	17
2.1	Valeurs propres et vecteurs propres	17
2.2	Le polynôme caractéristique	20
2.3	Matrices semblables	24
2.4	Théorème de Hamilton-Cayley	24
3	Formes bilinéaires	27
3.1	Orthogonalité	29
3.2	Matrices congruentes	33
3.3	Le théorème de Sylvester	36
3.4	Le cas réel, défini positif	40
3.5	La méthode des moindres carrées	47
3.6	Formes linéaires, bilinéaires et l'espace dual	49
3.7	Formes sesquilinéaires et produits hermitiens	51
3.8	Espaces hermitiens	56
4	Le théorème spectral et la décomposition en valeurs singulières	59
4.1	Les endomorphismes auto-adjoints	59
4.2	Formes quadratiques réelles et matrices symétriques réelles	63
4.3	La décomposition en valeurs singulières	69
4.4	Encore les systèmes d'équations	72
4.5	Le meilleur sous-espace approximatif	73
5	Systèmes différentiels linéaires	79
5.1	L'exponentielle d'une matrice	83
5.2	Décomposition selon le polynôme caractéristique	85
5.3	La forme normale de Jordan	88
6	Algèbre linéaire sur les entiers	95
6.1	La forme normale d'Hermite	97
6.2	La forme normale de Smith	103

Table des matières

7	Groupes	107
7.1	Groupes abéliens engendrés finis	107

1 Polynômes

1.1 Notions fondamentales

Soit R un anneau. On se souvient que cela signifie que R est un ensemble, muni des opérations binaires $+$: $R \times R \rightarrow R$ et \cdot : $R \times R \rightarrow R$ telles que :

(R1) $a + b = b + a$ pour tout $a, b \in R$.

(R2) $a + (b + c) = (a + b) + c$, pour tout $a, b, c \in R$.

(R3) Il existe un élément $0 \in R$ tel que $0 + a = a$ pour chaque $a \in R$.

(R4) Pour chaque $a \in R$ il existe un élément $-a \in R$ tel que $a + (-a) = 0$.

(R5) $a(bc) = (ab)c$, pour tout $a, b, c \in R$.

(R6) Il existe un élément $1 \in R$ tel que $a \cdot 1 = 1 \cdot a = a$ pour chaque $a \in R$.

(R7) $a(b + c) = ab + ac$ et $(b + c)a = ba + ca$ pour tout $a, b, c \in R$.

Si, de plus, on a

(R8) $ab = ba$ pour tous $a, b \in R$.

alors l'anneau R est appelé *anneau commutatif*. Le *centre* de R est l'ensemble $Z(R) = \{r \in R : ra = ar \text{ pour tout } a \in R\}$. Un élément $a \neq 0$ de R est un *diviseur de zéro* s'il existe un $b \neq 0$ tel que $ab = 0$ ou $ba = 0$. Un anneau commutatif sans diviseurs de zéro est appelé *anneau intègre*.

Exemple 1.1. i) Les nombres entiers \mathbb{Z} avec l'addition et la multiplication standard forment un anneau commutatif sans diviseurs de zéro. \mathbb{Z} est donc un anneau intègre.

ii) $5 \cdot \mathbb{Z} = \{5z : z \in \mathbb{Z}\}$ avec l'addition et la multiplication standard n'est pas un anneau. L'axiome (R6) n'est pas satisfait.

iii) L'ensemble des matrices $\mathbb{Z}^{2 \times 2}$ avec l'addition et multiplication des matrices est un anneau non commutatif avec des diviseurs de zéro.

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 2 \end{pmatrix}$$

$$\begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}$$

$$\begin{pmatrix} 0 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$$

1 Polynômes

Un élément $r \in R$ est *inversible* s'il existe un élément $r^{-1} \in R$ tel que

$$r \cdot r^{-1} = r^{-1} \cdot r = 1.$$

On dénote l'ensemble des éléments inversibles par R^* . On se rappelle que (R^*, \cdot) est un groupe, le *groupe des éléments inversibles*. Un anneau intègre tel que $R \setminus \{0\} = R^*$ est un *corps*.

Exercice 1.1. Soit R un anneau et $r \in R^*$. Alors r n'est pas un diviseur de zéro.

Exercice 1.2. Soit R un anneau et $R^{n \times n}$ l'anneau des matrices $n \times n$ sur R . Montrer que le centre de $R^{n \times n}$ est $Z(R^{n \times n}) = \{aI_n : a \in Z(R)\}$.

Exercice 1.3. Soit R un anneau, alors l'élément 1 est unique.

Théorème 1.1. Soit R un anneau, alors il existe un anneau $S \supseteq R$ (R est un sous-anneau de S) et un élément $x \in S \setminus R$ tel que

(i) $ax = xa$ pour chaque $a \in R$.

(ii) Si $a_0 + a_1x + \dots + a_nx^n = 0$ et $a_i \in R$ pour tout i , alors $a_i = 0$ pour tout i .

Ce théorème est démontré dans le cours *anneaux et corps*. Il nous donne une manière formelle d'introduire le concept d'une *indéterminée* (ou *variable*) qui n'est autre que ledit élément $x \in S \setminus R$.

Définition 1.1. Un polynôme sur R est une expression de la forme $p(x) = a_0 + a_1x + \dots + a_nx^n$, où $n \in \mathbb{N}$, $a_i \in R$ pour tout i . L'élément a_i est le i -ème *coefficient* de $p(x)$. L'ensemble des polynômes sur R est dénoté par $R[x]$.

Exemple 1.2. i) $p(x) = 3 + x^2 + 5x^4 \in \mathbb{Z}[x]$.

ii) $p(x) = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} 3 & 3 \\ 2 & 1 \end{pmatrix} x^3 \in \mathbb{Z}^{2 \times 2}[x]$.

Théorème 1.2. $R[x]$ est un anneau. Si R est commutatif, alors $R[x]$ est commutatif. Si R est anneau sans diviseur de zéro alors $R[x]$ est un anneau sans diviseur de zéro.

Démonstration. Il faut montrer que pour deux polynômes $f(x) = a_0 + a_1x + \dots + a_nx^n$ et $g(x) = b_0 + b_1x + \dots + b_mx^m$ sur R , on a :

i) $f - g \in R[x]$ et

ii) $f \cdot g \in R[x]$.

La somme s'écrit comme

$$f(x) + g(x) = \sum_{i=1}^{\max\{m,n\}} (a_i + b_i) x^i \in R[x], \quad (1.1)$$

où $a_i = 0$ pour $i > n$ et $b_i = 0$ pour $i > m$. Alors $R[x]$ est stable pour $+$. L'inverse de $g(x)$ est $-g(x) = -b_0 - b_1x - \dots - b_mx^m \in R[x]$. Alors on a $f - g \in R[x]$.

Le produit de f et g s'écrit comme

$$p(x) \cdot q(x) = a_0 b_0 + (a_0 b_1 + a_1 b_0)x + (a_0 b_2 + a_1 b_1 + a_2 b_0)x^2 + \dots \quad (1.2)$$

Bref, on a la formule

$$f(x) \cdot g(x) = \sum_{i=1}^{m+n} \left(\sum_{j+k=i} a_j b_k \right) x^i \in R[x]. \quad (1.3)$$

C'est à dire que $R[x]$ est stable pour l'opération \cdot de S . Alors, $R[x]$ est un sous-anneau de S et donc $R[x]$ est un anneau. La formule (1.3) implique que $R[x]$ est commutatif, si R est commutatif.

Finalement, si $f(x) = a_0 + a_1 x + \dots \neq 0$ et $g(x) = b_0 + b_1 x + \dots \neq 0$ sont deux polynômes non-nuls et si R est un anneau sans diviseur de zéro, il faut montrer que $f(x) \cdot g(x) \neq 0$. Soit $n = \max\{i: a_i \neq 0\}$ et $m = \max\{i: b_i \neq 0\}$. Le coefficient de x^{m+n} du polynôme $f \cdot g$ est $a_n \cdot b_m$. Ce coefficient n'est pas nul dès que R est un anneau sans diviseur de zéro. \square

Exemple 1.3.

$$\begin{aligned} f(x) &= 3x^3 + x + 2 \\ g(x) &= 2x^4 + 2x^2 + 1 \\ f(x) \cdot g(x) &= 6x^7 + 8x^5 + 4x^4 + 5x^3 + 4x^2 + x + 2 \end{aligned}$$

Proposition 1.3. *Deux polynômes*

$$p(x) = a_0 + a_1 x + a_2 x^2 + \dots \quad \text{et} \quad q(x) = b_0 + b_1 x + b_2 x^2 + \dots \quad (1.4)$$

sont égaux si et seulement si $a_i = b_i$ pour tout $i \in \mathbb{N}$. Dans ce cas, on écrit $p(x) = q(x)$.

Exercice 1.4. Démontrez la proposition 1.3.

Définition 1.2. Le *degré* de $p(x) = a_0 + a_1 x + a_2 x^2 + \dots \neq 0$ est

$$\deg(p) = \max\{i: a_i \neq 0\}$$

et $\deg(0) = -\infty$. Si $p \neq 0$, le coefficient $a_{\deg(p)}$ est le *coefficient dominant* de p . Un polynôme de degré zéro est une *constante*.

Exemple 1.4. Soit $f(x) = 2 + 3x + 5x^3 \in \mathbb{Z}[x]$, alors $\deg(f) = 3$ et le coefficient dominant de f est 5.

Théorème 1.4. Soit R un anneau, $f, g \in R[x] \setminus \{0\}$ tel que le coefficient dominant de f ou de g n'est pas un diviseur de zéro. Alors, $\deg(f \cdot g) = \deg(f) + \deg(g)$.

1 Polynômes

Démonstration. Soient $f(x) = a_0 + \dots + a_n x^n$ et $g(x) = b_0 + \dots + b_m x^m$ tels que $a_n, b_m \neq 0$. Le coefficient de x^{n+m} est $a_n \cdot b_m \neq 0$. Les coefficients de x^k , $k > n + m$ sont tous nuls. \square

Un polynôme $p(x) = a_0 + a_1 x + \dots + a_n x^n \in R[x]$ induit une application $f_p : R \rightarrow R$, $f_p(r) = a_0 + a_1 r + \dots + a_n r^n$. Nous écrivons aussi $p(r)$ pour $f_p(r)$ et on parle de l'évaluation de p sur r .

Exemple 1.5. Soit $p(x) = x \in R[x]$ et $q(x) = (x + a) \in R[x]$, alors $p(x)q(x) = x^2 + ax$. Quand est-ce que l'on a $p(r)q(r) = (p \cdot q)(r)$? C'est le cas si et seulement si

$$r^2 + ra = r^2 + ar$$

c'est-à-dire si et seulement si $ra = ar$. On attire l'attention sur le fait que cet exemple traite de l'évaluation en $r \in R$ de polynômes. Ici, $p(r)q(r)$ dénote l'évaluation de p et q en r puis d'en multiplier les résultats. Tandis que $(p \cdot q)(r)$ représente la multiplication de p et q puis on évalue ce produit en r .

Théorème 1.5. Soit R un anneau et $\alpha \in Z(R)$ un élément du centre de R . L'application

$$\begin{aligned} \Phi: R[x] &\rightarrow R \\ f(x) &\mapsto f(\alpha) \end{aligned}$$

est un morphisme d'anneaux surjectif.

Exercice 1.5. Démontrer le théorème 1.5.

Deux polynômes différents p et q peuvent induire la même application f_p et f_q , même s'ils sont des polynômes sur un corps K .

Exemple 1.6. Soit $K = \mathbb{Z}_2$, $p(x) = x + x^2$ et $q(x) = x^2 + x^3$ deux polynômes sur K . Il est clair que $p \neq q$. Mais $f_p : K \rightarrow K$ et $f_q : K \rightarrow K$ sont les mêmes applications car pour tout $x \in \mathbb{Z}_2$ on a $p(x) = q(x) = 0$.

Par contre, si K est un corps infini, deux polynômes différents induisent deux applications différentes. Nous allons voir les détails de ce fait maintenant.

Théorème 1.6. Soit K un corps, $r_0, \dots, r_n \in K$ des éléments distincts (c.-à-d. $r_i \neq r_j$ pour $i \neq j$) et $y_0, \dots, y_n \in K$. Il existe exactement un seul polynôme $f(x) \in K[x]$ de degré au plus n tel que

$$f(r_i) = y_i \text{ pour tout } i \in \{0, \dots, n\}.$$

Démonstration. Un polynôme $f(x) = a_0 + a_1 x + \dots + a_n x^n$ satisfait $f(r_i) = y_i$ pour tout i si et seulement si les coefficients a_0, \dots, a_n satisfont

$$\begin{pmatrix} 1 & r_0 & \dots & r_0^n \\ 1 & r_1 & \dots & r_1^n \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ 1 & r_n & \dots & r_n^n \end{pmatrix} \begin{pmatrix} a_0 \\ a_1 \\ \vdots \\ a_n \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} y_0 \\ y_1 \\ \vdots \\ y_n \end{pmatrix} \quad (1.5)$$

La matrice $V_{r_0, \dots, r_n} \in K^{(n+1) \times (n+1)}$ à gauche de (1.5) est connue sous le nom de *matrice de Vandermonde* des éléments r_0, \dots, r_n . Le théorème sera prouvé une fois que nous aurons démontré que $\det(V_{r_0, \dots, r_n}) \neq 0$.

On démontre $\det(V_{r_0, \dots, r_n}) \neq 0$ par récurrence sur n . Pour $n = 0$, le déterminant est 1. Pour $n > 0$, on soustrait r_0 fois la colonne n de la colonne $n + 1$. Après, on soustrait r_0 fois la colonne $n - 1$ de la colonne n etc. Le résultat est la matrice

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 & \dots & 0 \\ 1 & r_1 - r_0 & r_1(r_1 - r_0) & \dots & r_1^{n-1}(r_1 - r_0) \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ 1 & r_n - r_0 & r_1(r_n - r_0) & \dots & r_n^{n-1}(r_n - r_0) \end{pmatrix} \quad (1.6)$$

Le déterminant de la matrice (1.6) est celle de V_{r_0, \dots, r_n} . Développement du déterminant le long de la première ligne donne le déterminant de la matrice

$$\begin{pmatrix} r_1 - r_0 & r_1(r_1 - r_0) \dots & r_1^{n-1}(r_1 - r_0) \\ \dots & \dots & \dots \\ r_n - r_0 & r_1(r_n - r_0) \dots & r_n^{n-1}(r_n - r_0) \end{pmatrix} \quad (1.7)$$

Alors

$$\det(V_{r_0, \dots, r_n}) = (r_n - r_0) \dots (r_1 - r_0) \det(V_{r_1, \dots, r_n})$$

Comme les r_i sont distincts, le produit $(r_n - r_0) \dots (r_1 - r_0)$ n'est pas zéro. Par l'hypothèse de récurrence, $\det(V_{r_1, \dots, r_n}) \neq 0$ et donc $\det(V_{r_0, r_1, \dots, r_n}) \neq 0$. \square

Le théorème 1.6 ne contredit pas l'exemple 1.6 car le corps \mathbb{Z}_2 n'admet que 2 éléments. Il existe bel et bien un unique polynôme $p \in \mathbb{Z}_2[x]$ de degré inférieur ou égal à 1 tel que $p(0) = p(1) = 0$. Une énumération des polynômes possibles ou la résolution du système linéaire donne $p = 0$.

Exercice 1.6. Montrer que le déterminant de V_{r_0, \dots, r_n} est

$$\det(V_{r_0, \dots, r_n}) = \prod_{0 \leq i < j \leq n} (r_j - r_i).$$

Exemple 1.7. On cherche le polynôme $f(x) \in \mathbb{Z}_5[x]$ de degré au plus 3 tel que $f(0) = 2$, $f(1) = 2$, $f(2) = 2$ et $f(3) = 3$.

En trouvant l'unique solution du système

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 1 & 1 \\ 1 & 2 & 4 & 3 \\ 1 & 3 & 4 & 2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} a_0 \\ a_1 \\ a_2 \\ a_3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 2 \\ 2 \\ 2 \\ 3 \end{pmatrix},$$

on obtient

$$\begin{pmatrix} a_0 \\ a_1 \\ a_2 \\ a_3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 2 \\ 2 \\ 2 \\ 1 \end{pmatrix}.$$

Ainsi, $f(x) = 2 + 2x + 2x^2 + x^3$ est le polynôme recherché.

1 Polynômes

Corollaire 1.7. Soit K un corps infini. Deux polynômes $p(x), q(x) \in K[x]$ sont égaux, si et seulement si les applications f_p et f_q sont les mêmes.

Démonstration. Si $p = q$, alors $p(r) = q(r)$ pour tout $r \in K$ et donc $f_p = f_q$. D'autre part, si $f_p = f_q$, on peut supposer qu'un des deux polynômes n'est pas le polynôme 0 (s'ils sont tous les deux nuls, alors $p = q$). Comme $p(r) = q(r)$ pour tout $r \in K$ et le corps K est infini, les polynômes prennent les mêmes valeurs sur $\max\{\deg(p), \deg(q)\} + 1$ éléments de K . Il en résulte que $p = q$ par le Théorème 1.6. \square

1.2 Divisibilité et racines

Soit R un anneau. La division avec reste est l'opération suivante.

Théorème 1.8. Soient $f, g \in R[x]$, $\deg(g) > 0$ et le coefficient dominant de g un élément inversible de R . Il existe $q, r \in R[x]$ unique tels que

$$f(x) = q(x)g(x) + r(x)$$

et $\deg(r) < \deg(g)$.

Démonstration. La preuve se fait par récurrence sur $\deg(f)$. Si $\deg(f) < \deg(g)$, alors on pose $q = 0$ et $r = f$.

Soit alors $\deg(f) = n \geq \deg(g) = m$ et

$$f(x) = a_0 + \dots + a_n x^n \text{ et } g(x) = b_0 + \dots + b_m x^m$$

où a_n et b_m sont les coefficients dominants de f et g respectivement. Clairement

$$\deg\left(f(x) - \frac{a_n}{b_m} x^{n-m} g(x)\right) < \deg(f(x))$$

et par hypothèse de récurrence

$$f(x) - \frac{a_n}{b_m} x^{n-m} g(x) = q(x)g(x) + r(x)$$

tel que $\deg(r(x)) < \deg(g(x))$. On obtient alors

$$f(x) = \left(q(x) + \frac{a_n}{b_m} x^{n-m}\right) g(x) + r(x).$$

Supposons maintenant qu'il existe deux autres polynômes $q'(x)$ et $r'(x)$ tels que

$$f(x) = q'(x)g(x) + r'(x)$$

et $\deg(r') < \deg(g)$. Alors

$$r(x) - r'(x) = (q(x) - q'(x)) \cdot g(x).$$

Par le théorème 1.4

$$\deg(r - r') = \deg(q - q') + \deg(g) \geq \deg(g),$$

ce qui contredit le fait que $\deg(r) < \deg(g)$ et $\deg(r') < \deg(g)$. \square

Exemple 1.8. La division avec reste du polynôme $x^5 + 2x^2 + 1$ par $2x^3 + x + 1$ de $\mathbb{Z}_3[x]$ donne

$$x^5 + 2x^2 + 1 = (2x^2 + 2)(2x^3 + x + 1) + (x + 2).$$

Définition 1.3. Un polynôme $q(x)$ *divise* un polynôme $f(x)$ s'il existe un polynôme $g(x)$ tel que $f(x) = g(x) \cdot q(x)$. On dit que $q(x)$ est un *diviseur* de $f(x)$ et on écrit $q(x) \mid f(x)$.

Exemple 1.9. Soient $q(x) = x^2 + 1 \in \mathbb{Z}_2[x]$ et $f(x) = x^3 + x^2 - x + 1 \in \mathbb{Z}_2[x]$. On a $f(x) = q(x)(x + 1)$ et donc $q(x) \mid f(x)$.

Définition 1.4. Soit $p(x) \in \mathbb{K}[x] \setminus \{0\}$. Un $\alpha \in K$ tel que $f_p(\alpha) = 0$ est une *racine* de $f(x)$.

Exemple 1.10. Soit $p(x) = x^4 + x^3 + x^2 + x + 1 \in \mathbb{Z}_5(x)$, alors $\alpha = 1$ est une racine de $p(x)$.

f

Théorème 1.9 (Théorème fondamental de l'algèbre). *Tout polynôme $p(x) \in \mathbb{C}[x] \setminus \{0\}$ non constant admet au moins une racine complexe.*

Théorème 1.10. *Soit $f(x) \in K[x] \setminus \{0\}$ un polynôme et $\alpha \in K$, alors α est une racine de f si et seulement si $(x - \alpha) \mid f(x)$.*

Démonstration. Si $f(x) = q(x) \cdot (x - \alpha)$, alors $f(\alpha) = 0$.

Dans l'autre sens, si f est une constante, $f(\alpha) = 0$ implique que $f = 0$ et $(x - \alpha)$ divise f .

Si f n'est pas une constante, il existe $q(x)$ et $r(x)$ tels que

$$f(x) = q(x) \cdot (x - \alpha) + r(x)$$

avec $\deg(r) \leq 0$. Alors $f(\alpha) = 0$ implique $r = 0$. □

Définition 1.5. La *multiplicité* d'une racine α de $p(x) \in K[x] \setminus \{0\}$ est le plus grand entier $i \geq 1$ tel que $(x - \alpha)^i \mid p(x)$. Si $p(x)$ est le polynôme caractéristique d'un endomorphisme d'un espace vectoriel, on appelle la multiplicité de α la *multiplicité algébrique*.

Exemple 1.11 (Suite de l'exemple 1.10). Le polynôme $p(x) = x^4 + x^3 + x^2 + x + 1 \in \mathbb{Z}_5$ est divisible par $x - 1$, et

$$p(x) = (x^3 + 2 * x^2 + 3 * x + 4)(x - 1).$$

De plus, 1 est aussi une racine de $x^3 + 2 * x^2 + 3 * x + 4$. En fait

$$x^4 + x^3 + x^2 + x + 1 = (x - 1)^4,$$

alors la multiplicité de la racine 1 de $p(x)$ est 4 parce que $(x - 1)^4$ divise p mais pas $(x - 1)^5$, en tant que polynôme de degré 5 (théorème 1.4).

1.3 Factorisation de polynômes sur un corps

Dans cette section, on fixe un corps K .

Définition 1.6. Un polynôme $p(x) \in K[x] \setminus \{0\}$ est *irréductible*, si

- i) $\deg(p) \geq 1$ et
- ii) si $p(x) = f(x)g(x)$ alors $\deg(f) = 0$ ou $\deg(g) = 0$.

Exemple 1.12. 1. Chaque polynôme linéaire $p(x) = ax + b \in K[x]$, $a \in K \setminus \{0\}$ est irréductible. En effet, si $p(x) = f(x)g(x)$ et $\deg(f) > 0$ et $\deg(g) > 0$, alors le théorème 1.4 implique que $\deg(p) > 1$.

- 2. $x^2 + 1 \in \mathbb{R}[x]$ est irréductible. Autrement, il existe un polynôme linéaire $f(x) = x - \alpha \in \mathbb{R}[x]$ qui divise f ce qui implique que α est une racine de $x^2 + 1$. Cependant, aucun nombre α réel ne satisfait $\alpha^2 = -1$.

Théorème 1.11. Soient $f(x)$ et $g(x)$ deux polynômes sur K non tous deux nuls et soit

$$I = \{u \cdot f + v \cdot g : u, v \in K[x]\}.$$

Il existe un polynôme $d(x) \in K[x]$ tel que

$$I = \{h \cdot d : h \in K[x]\}. \quad (1.8)$$

Démonstration. Remarquons que I contient des polynômes non nuls (notamment f ou g). Soit $d \in I \setminus \{0\}$ de degré minimal et $u', v' \in K[x]$ tels que

$$u' \cdot f + v' \cdot g = d.$$

Soit $u \cdot f + v \cdot g \in I$. La division avec reste donne $u \cdot f + v \cdot g = qd + r$, avec $\deg(r) < \deg(d)$. Alors

$$r = (u - qu') \cdot f + (v - qv') \cdot g \in I$$

et par minimalité de $d \in I \setminus \{0\}$, $r = 0$. Ainsi il existe un $h \in K[x]$ tel que $h \cdot d = u \cdot f + v \cdot g$. Il est clair que $h \cdot d \in I$ pour tous les $h \in K[x]$ et l'assertion est démontrée. \square

Définition 1.7. Un polynôme $f(x) \in K[x] \setminus \{0\}$ dont le coefficient dominant est 1 est appelé *polynôme unitaire*.

Définition 1.8. Soient $f, g \in K[x]$ non tous deux nuls. Un *diviseur commun* de f et g est un diviseur de f et g .

Théorème 1.12. Soient f, g et d comme dans le théorème 1.11.

- i) d est un diviseur commun de f et g .
- ii) Chaque diviseur commun de f et g est un diviseur de d .
- iii) Si d est unitaire, alors d est unique.

Démonstration. L'assertion i) suit du fait que $f, g \in I$ et de (1.8). Soient $u, v \in K[x]$ tels que $d = u \cdot f + v \cdot g$ et soit w un diviseur commun de f et g . Alors il existe $f', g' \in K[x]$ tels que $f = f'w$ et $g = g'w$. Par conséquent

$$d = (u \cdot f' + v \cdot g')w,$$

ce que montre que $w \mid d$ et ii). Soient d et d' deux polynômes unitaires satisfaisant (1.8). i) et ii) impliquent que $d \mid d'$ et $d' \mid d$. Alors il existe $z, z' \in K[x]$ tel que $d = d'z'$ et $d' = dz$. Par suite, $d = d \cdot z \cdot z'$. Le théorème 1.4 implique que $z, z' \in K$. Et comme d et d' sont unitaires, $z = z' = 1$, ce que démontre iii). \square

Définition 1.9. L'unique polynôme unitaire $d \in K[x]$ satisfaisant (1.8) est appelé le *plus grand commun diviseur* de f et g . Il est noté $\gcd(f, g)$ ou $\text{pgcd}(f, g)$.

1.3.1 L'algorithme d'Euclide

Pour calculer le plus grand diviseur commun de $f(x)$ et $g(x)$ on peut utiliser l'algorithme d'Euclide. Soient $f_0, f_1 \in K[x]$ pas tous les deux nuls et $\deg(f_0) \geq \deg(f_1)$. Si $f_1 = 0$, alors

$$\gcd(f_0, f_1) = f_0.$$

Autrement, on applique la division avec reste

$$f_0 = q_1 f_1 + f_2,$$

où $q_1, f_2 \in K[x]$ et $\deg(f_2) < \deg(f_1)$. Un polynôme $d \in K[x]$ est un diviseur commun de f_0 et f_1 si et seulement si d est un diviseur commun de f_1 et f_2 . L'algorithme d'Euclide est le procédé de calculer la suite $f_0, f_1, f_2, \dots, f_{k-1}, f_k \in K[x]$ où $\deg(f_{k-1}) \geq 0$, $f_k = 0$ et

$$f_{i-1} = q_i f_i + f_{i+1}$$

est le résultat de la division avec reste de f_{i-1} par f_i . Le procédé se termine toujours car la suite des degrés $\{\deg(f_i)\}$ est entière et strictement décroissante (méthode de descente infinie de Fermat). Le dernier reste non nul f_{k-1} est un multiple constant de $\gcd(f_0, f_1)$: il suffit de diviser par le coefficient dominant pour le rendre unitaire.

Exemple 1.13. On calcule le plus grand diviseur commun de $f_0 = 4x^6 + x^4 + 2x^2 + 2 \in \mathbb{Z}_5[x]$ et $f_1 = 3x^4 + x^3 + 2x^2 + 2x + 2 \in \mathbb{Z}_5[x]$.

$$q_1 = 3x^2 + 4x + 2, f_2 = 4x^3 + 4x^2 + 3x + 3,$$

$$q_2 = 2x + 2, f_3 = 3x^2 + 1,$$

$$q_3 = 3x + 3, f_4 = 0.$$

Alors tout diviseur commun de f_0 et f_1 divise $f_3 = 3x^2 + 1$ et f_3 est aussi un diviseur commun. On divise par 3 (ou multiplie par 2) et on obtient $\gcd(f_0, f_1) = x^2 + 2$.

1 Polynômes

Le calcul des suites f_i et q_i donne aussi une représentation $\gcd(f_0, f_1) = u \cdot f_0 + v \cdot f_1$, $u, v \in K[x]$. En effet

$$\begin{pmatrix} f_i \\ f_{i+1} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & -q_i \end{pmatrix} \begin{pmatrix} f_{i-1} \\ f_i \end{pmatrix}$$

et alors

$$\begin{pmatrix} f_{k-1} \\ f_k \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & -q_{k-1} \end{pmatrix} \cdots \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & -q_1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} f_0 \\ f_1 \end{pmatrix}.$$

Exemple 1.14. On continue l'exemple 1.13.

$$\begin{pmatrix} 3x+3 & x^3+4x^2+2x \\ x^2+2x+2 & 2x^4+4x^2+3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & 2x+2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & 3x+3 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & 2x^2+x+3 \end{pmatrix}$$

et

$$\begin{pmatrix} 3x^2+1 \\ 0 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 3x+3 & x^3+4x^2+2x \\ x^2+2x+2 & 2x^4+4x^2+3 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 4x^6+x^4+2x^2+2 \\ 3x^4+x^3+2x^2+2x+2 \end{pmatrix}.$$

$$\begin{pmatrix} x^2+2 \\ 0 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} x+1 & 2x^3+3x^2+4x \\ 2x^2+4x+4 & 4x^4+3x^2+1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 4x^6+x^4+2x^2+2 \\ 3x^4+x^3+2x^2+2x+2 \end{pmatrix}$$

Alors

$$x^2+2 = \gcd(f_0, f_1) = (x+1)f_0 + (2x^3+3x^2+4x)f_1.$$

1.3.2 Factorisation en irréductibles

Clairement, tout polynôme $f(x) \in K[x] \setminus \{0\}$ peut être factorisé comme

$$f(x) = a \cdot \prod_i p_i(x), \quad (1.9)$$

dont les p_i sont irréductibles et unitaires et $a \in K$. On va voir maintenant que cette factorisation est unique.

Théorème 1.13. Soit $p(x) \in K[x]$ irréductible et supposons que $p(x)$ divise un produit $f_1(x) \cdots f_k(x)$ de polynômes non nul. Alors $p(x)$ divise un polynôme $f_i(x)$.

Démonstration. Par récurrence il suffit de démontrer l'assertion pour $k = 2$. Ainsi, supposons $p \mid fg$, $f, g \in K[x] \setminus \{0\}$. Si p ne divise pas f , alors $\gcd(p, f) = 1$ car les seuls diviseurs de p sont des multiples constants de 1 et lui-même. Soient donc $u, v \in K[x]$ t.q. $up + vf = 1$. Alors $upg + vfg = g$, et donc $p \mid g$. \square

Théorème 1.14. La factorisation (1.9) est unique à l'ordre près des p_i .

1.3 Factorisation de polynômes sur un corps

Démonstration. Pour une factorisation $f(x) = a \prod_i q_i(x)$, où les q_i sont irréductibles et unitaires on utilise le théorème 1.13 pour déduire qu'il existe j tel que $p_1 \mid q_j$. Comme p_1 et q_j sont irréductibles et unitaires, $p_1 = q_j$. En divisant par p_1 , l'assertion suit par récurrence. \square

Corollaire 1.15. *Soient $f(x) \in K[x] \setminus \{0\}$ et $\alpha_1, \dots, \alpha_\ell$ des racines de f de multiplicité k_1, \dots, k_ℓ respectivement. Alors il existe $g(x) \in K[x]$ tel que*

$$f(x) = g(x) \cdot \prod_{i=1}^{\ell} (x - \alpha_i)^{k_i}.$$

Exercice 1.7. Démontrez le Corollaire 1.15.

2 Valeurs propres

2.1 Valeurs propres et vecteurs propres

Définition 2.1. Soit V un espace vectoriel sur un corps K et $f: V \rightarrow V$ un endomorphisme. Un *vecteur propre* de f associé à la *valeur propre* $\lambda \in K$ est un vecteur $v \neq 0$ de V tel que $f(v) = \lambda v$.

Exemple 2.1. Soit $f: V \rightarrow V$, l'endomorphisme $f(v) = 0$ pour tous $v \in V$. Alors tous $0 \neq v \in V$ est un vecteur propre associé à $\lambda = 0$.

Lemme 2.1. Soit $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ une base de V et $A \in K^{n \times n}$ la matrice de l'endomorphisme $f: V \rightarrow V$ relatif à B . La matrice A est une matrice diagonale, c'est à dire A est de la forme

$$A = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & \\ & \ddots & \\ & & \lambda_n \end{pmatrix},$$

si et seulement si v_i est un vecteur propre associé à la valeur propre λ_i pour tout $i = 1, \dots, n$.

Démonstration. Pour $v \in V$ soit $[v]_B \in K^n$ le vecteur des coordonnées de v relatif à B . L'application $\phi: V \rightarrow K^n$, $\phi(x) = [x]_B$ est un isomorphisme. On a $[f(v_i)]_B = A[v_i]_B$ pour $i = 1, \dots, n$. Supposons que $\{v_1, \dots, v_n\}$ est une base de vecteurs propres. Des que $[v_i]_B = e_i$, et $f(v_i) = \lambda_i v_i$ alors

$$\lambda_i \cdot e_i = A e_i, \text{ pour } i \in \{1, \dots, n\},$$

c.à.d. que A est une matrice diagonale.

La direction d'inverse est analogue. □

Définition 2.2. Un endomorphisme $f: V \rightarrow V$ pour lequel existe une base de V composée de vecteurs propres est *diagonalisable*.

Définition 2.3. Soit $A \in K^{n \times n}$ une matrice. Un *vecteur propre* de A associé à la *valeur propre* $\lambda \in K$ est un vecteur propre de l'endomorphisme $f(x) = Ax$ de K^n .

Exemple 2.2. 1. Soit $A = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{2 \times 2}$. Alors

— $v_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix}$ est un vecteur propre associé à la valeur propre $\lambda_1 = 1$,

2 Valeurs propres

- $v_2 = \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \end{pmatrix}$ est un vecteur propre associé à la valeur propre $\lambda_2 = 0$,
 - $v_3 = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$ n'est pas un vecteur propre.
2. Soit $A = \begin{pmatrix} \cos \phi & \sin \phi \\ -\sin \phi & \cos \phi \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{2 \times 2}$ pour $\phi \in \mathbb{R}$.
- Si $\phi \neq k\pi$, $k \in \mathbb{N}$, alors A n'a pas de valeur propre (réelle).
 - Si $\phi = (2k+1)\pi$, $k \in \mathbb{N}$, alors $A = \begin{pmatrix} -1 & 0 \\ 0 & -1 \end{pmatrix}$ a une valeur propre $\lambda = -1$ et tous les vecteurs non-nuls $x \in \mathbb{R}^2$ sont des vecteurs propres associés à λ .
 - Si $\phi = 2k\pi$, $k \in \mathbb{N}$, alors $A = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$ a une valeur propre $\lambda = 1$ et encore tous les vecteurs non-nuls $x \in \mathbb{R}^2$ sont des vecteurs propres associés à λ .
- On va voir que si on considère A comme une matrice complexe, alors on a toujours les valeurs propres $\cos \phi + i \sin \phi$ et $\cos \phi - i \sin \phi$.

Lemme 2.2. *Un vecteur $v \in V \setminus \{0\}$ est un vecteur propre de $f: V \rightarrow V$ associé à la valeur propre $\lambda \in K$ si et seulement si $v \in \ker(f - \lambda \cdot \text{Id})$.*

Rappel : L'endomorphisme $\text{Id}: V \rightarrow V$ défini comme $\text{Id}(v) = v$ pour tous $v \in V$ est appelé l'*identité*.

Définition 2.4. Soit λ une valeur propre de l'endomorphisme $f: V \rightarrow V$. Le sous espace E_λ de V , défini comme

$$E_\lambda = \ker(f - \lambda \cdot \text{Id})$$

est l'espace propre de f associé à λ . La dimension de E_λ est la multiplicité géométrique de λ .

Lemme 2.3. *Soient $v_1, \dots, v_r \in V$ des vecteurs propres, associés aux valeurs propres $\lambda_1, \dots, \lambda_r$ distinctes (c'est à dire $\lambda_i \neq \lambda_j$ pour $i \neq j$), alors $\{v_1, \dots, v_r\}$ est un ensemble libre.*

Démonstration. Supposons que le théorème soit faux et soit $r \geq 1$ minimal, tel qu'il existent des vecteurs propres $v_1, \dots, v_r \in V$ associés aux valeurs propres $\lambda_1, \dots, \lambda_r$ qui sont linéairement dépendants. Des que $v_i \neq 0$ alors $r > 1$. Considérons une combinaison linéaire non triviale

$$\alpha_1 v_1 + \dots + \alpha_r v_r = 0. \tag{2.1}$$

Des que (2.1) est un contre exemple minimal, on $\alpha_i \neq 0$ pour tous i . Nous pouvons supposer que $\lambda_r \neq 0$. Autrement, on réarrange (2.1).

Si on applique f à l'expression (2.1) on obtient

$$\lambda_1 \alpha_1 v_1 + \dots + \lambda_r \alpha_r v_r = 0$$

et en divisant par λ_r

$$(\lambda_1/\lambda_r) \alpha_1 v_1 + \dots + \alpha_r v_r = 0. \tag{2.2}$$

2.1 Valeurs propres et vecteurs propres

On soustrait (2.2) de (2.1) et on obtient

$$(1 - \lambda_1/\lambda_n)\alpha_1 v_1 + \cdots + (1 - \lambda_{r-1}/\lambda_r)\alpha_{r-1} v_{r-1}$$

Ceci est en contradiction avec la minimalité de r . □

Corollaire 2.4. *Soit $f: V \rightarrow V$ un endomorphisme d'un espace vectoriel V sur K de dimension $n \in \mathbb{N}$ et soient $\lambda_1, \dots, \lambda_r$ les valeurs propres différentes de f et soient n_1, \dots, n_r leurs multiplicités géométriques respectives. Soient $B_i = \{v_1^{(i)}, \dots, v_{n_i}^{(i)}\}$ des bases de E_{λ_i} respectivement, pour $i = 1, \dots, r$. Alors*

$$\{v_1^{(1)}, \dots, v_{n_1}^{(1)}, v_1^{(2)}, \dots, v_{n_2}^{(2)}, \dots, v_1^{(r)}, \dots, v_{n_r}^{(r)}\}$$

est un ensemble libre. L'application f est diagonalisable si et seulement si

$$n_1 + \cdots + n_r = n.$$

Démonstration. Soit la combinaison linéaire

$$\sum_{i=1}^r \sum_{j=1}^{n_i} \alpha_{ij} v_j^{(i)} = 0.$$

Remarquons que les vecteurs $\sum_{j=1}^{n_i} \alpha_{ij} v_j^{(i)}$ appartiennent à E_{λ_i} pour tout i . Autrement dit, ce sont des vecteurs propres associés à des valeurs propres distinctes et dont la somme est nulle. Le lemme 2.3 garantit donc que tous les vecteurs soient nuls. Par suite, $\sum_{j=1}^{n_i} \alpha_{ij} v_j^{(i)}$ et les α_{ij} sont tous égaux à zéro car les $v_1^{(i)}, \dots, v_{n_i}^{(i)}$ sont linéairement indépendants. Ça démontre que

$$\{v_1^{(1)}, \dots, v_{n_1}^{(1)}, v_1^{(2)}, \dots, v_{n_2}^{(2)}, \dots, v_1^{(r)}, \dots, v_{n_r}^{(r)}\}$$

est un ensemble libre. En plus, si $n_1 + \cdots + n_r = n$, f est diagonalisable par définition car l'ensemble forme une base de K^n .

À l'inverse, si f est diagonalisable, et si m_i dénote le nombre vecteurs propres en E_{λ_i} dans la base consistant de vecteurs propres, alors $m_i \leq n_i$, et on a

$$n = m_1 + \cdots + m_r \leq n_1 + \cdots + n_r \leq n,$$

et donc $n_1 + \cdots + n_r = n$. □

Voici une marche à suivre afin de déterminer si $f: V \rightarrow V$ est diagonalisable ou non.

1. Déterminer les différentes $\lambda_1, \dots, \lambda_r \in K$ tel que $\ker(f - \lambda \text{Id}) \neq \{0\}$
2. Pour chaque λ_i calculer une base $\{v_1^{(i)}, \dots, v_{n_i}^{(i)}\}$ de E_{λ_i} .
3. f est diagonalisable si et seulement si $n_1 + \cdots + n_r = n$.

2 Valeurs propres

Exercices

1. Une matrice $A \in K^{n \times n}$ est appelée *diagonalisable*, si endomorphisme $\phi: K^n \rightarrow K^n$ défini comme $\phi(x) = Ax$ est diagonalisable. Démontrer que A est diagonalisable, si et seulement si il existe $U \in K^{n \times n}$ inversible tel que $U^{-1}AU$ est une matrice diagonale.

2.2 Le polynôme caractéristique

Durant ce chapitre nous allons étudier les endomorphismes $f: V \rightarrow V$ d'un espace vectoriel de dimension fini $n \in \mathbb{N}$. Si $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ est une base de V , on a

$$f(x) = \phi_B^{-1}(A_B \phi_B(x)),$$

où ϕ_B est l'isomorphisme $\phi_B: V \rightarrow K^n$, $\phi_B(x) = [x]_B$ sont les coordonnées de x par rapport à la base B . On a le diagramme suivant

$$\begin{array}{ccc} V & \xrightarrow{f} & V \\ \downarrow \phi_B & & \downarrow \phi_B \\ K^n & \xrightarrow{A \cdot x} & K^n \end{array}$$

Les colonnes de la matrice A_B sont les coordonnées de $f(v_1), \dots, f(v_n)$ dans la base B . Si B' est une autre base de V on a

$$[x]_{B'} = P_{BB'}[x]_B,$$

où $P_{BB'}$ est la matrice de changement de base de B en B' . Comme on a

$$[f(v)]_{B'} = A_{B'}[v]_{B'} = A_{B'}P_{BB'}[v]_B$$

et

$$[f(v)]_{B'} = P_{BB'}[f(v)]_B,$$

on trouve

$$[f(v)]_B = P_{BB'}^{-1}A_{B'}P_{BB'}[v]_B \text{ pour tous } v \in V.$$

Et ça implique

$$A_B = P_{BB'}^{-1}A_{B'}P_{BB'} \tag{2.3}$$

En particulier,

$$\det(A_{B'}) = \det(A_B)$$

ce qui laisse nous définir le *déterminant d'un endomorphisme* f comme $\det(f) = \det(A_B)$.

Clairement, λ est une valeur propre de f si et seulement si λ est une valeur propre de A_B et c'est le cas si et seulement si

$$\det(A_B - \lambda I_n) = 0. \tag{2.4}$$

Rappelons la formule de Leibniz pour le déterminant d'une matrice $B \in K^{n \times n}$

$$\det(B) = \sum_{\pi \in \mathcal{S}_n} \operatorname{sgn}(\pi) \prod_{i=1}^n b_{i\pi(i)} \quad (2.5)$$

et si on regroupe les puissances de λ , on a

$$\det(A_B - \lambda I_n) = a_n \lambda^n + a_{n-1} \lambda^{n-1} + \cdots + a_1 \lambda + a_0 \quad (2.6)$$

où $a_n, \dots, a_0 \in K$.

Définition 2.5. Le polynôme $\det(A_B - \lambda I_n) \in K[\lambda]$ est le *polynôme caractéristique* de f .

Remarquons que $\det(A_B) = \det(A - 0 \cdot I_n)$, d'où $a_0 = \det(A_B)$. L'expression (2.6) est un polynôme avec indéterminée λ et comme polynôme formel, est défini par la formule de Leibniz

$$p_A(\lambda) = \det(A - \lambda I_n) = \sum_{\pi \in \mathcal{S}_n} \operatorname{sgn}(\pi) \prod_{i=1}^n (A - \lambda I_n)_{i,\pi(i)}.$$

En tant que somme des polynômes $\operatorname{sgn}(\pi) \prod_{i=1}^n (A - \lambda I_n)_{i,\pi(i)}$, son degré est au plus n . Considérons la permutation triviale $\pi = \operatorname{Id}$ donnant le produit de degré n

$$\operatorname{sgn}(\operatorname{Id}) \prod_{i=1}^n (A - \lambda I_n)_{i \operatorname{Id}(i)} = \prod_{i=1}^n (A_{ii} - \lambda),$$

et en remarquons que toutes les autres permutations aboutissent à un produit au degré inférieur à $n - 2$. Cela signifie en particulier que $a_n = (-1)^n$, et donc que le polynôme caractéristique est de degré n .

Lemme 2.5. Soit $p_A(\lambda) = a_0 + a_1 \lambda + \cdots + a_n \lambda^n$ le polynôme caractéristique de la matrice $A \in K^{n \times n}$. Alors, $a_0 = \det(A)$ et $a_n = (-1)^n$.

Corollaire 2.6. Soit $V \neq \{0\}$ un espace vectoriel de dimension fini sur $K = \mathbb{C}$, et $f : V \rightarrow V$ un endomorphisme. Alors f possède une valeur propre.

Démonstration. Soit $f(\lambda) \in \mathbb{C}[\lambda]$ le polynôme caractéristique de f et n la dimension de V . Le degré de f est égal à $n \geq 1$, et donc $p(x)$ possède une racine $\lambda^* \in \mathbb{C}$ (théorème fondamental de l'algèbre). Cette racine λ^* est une valeur propre de f . \square

Remarque 2.7. Pour deux bases B et B' , comme on a $A_B = P_{B B'}^{-1} A_{B'} P_{B B'}$, alors

$$\begin{aligned} \det(A_B - \lambda I_n) &= \det(P_{B B'}^{-1} A_{B'} P_{B B'} - \lambda P_{B B'}^{-1} I_n P_{B B'}) \\ &= \det(P_{B B'}^{-1}) \det(A_{B'} - \lambda I_n) \det(P_{B B'}) \\ &= \det(A_{B'} - \lambda I_n). \end{aligned}$$

La définition 6.6 ne dépend ainsi pas de la base choisie et a donc un sens.

2 Valeurs propres

Définition 2.6. Soit $\lambda \in K$ une valeur propre de l'endomorphisme $f : V \rightarrow V$. La *multiplicité algébrique* de λ est la multiplicité de λ comme racine de $\det(f - \lambda \text{Id})$.

Proposition 2.8. Soit $f : V \rightarrow V$ un endomorphisme et soit $\lambda \in K$ une valeur propre de f . La *multiplicité géométrique* de λ est au plus la *multiplicité algébrique* de λ .

Démonstration. Soit m la multiplicité géométrique de λ et soit $\{v_1, \dots, v_m\}$ une base de E_λ . On la complète en une base

$$B = \{v_1, \dots, v_m, w_1, \dots, w_{n-m}\}$$

de V .

La matrice A_B de l'endomorphisme f dans la base B est alors de la forme

$$A_B = \begin{pmatrix} \lambda I_m & C \\ 0 & D \end{pmatrix}$$

où $C \in K^{m \times n-m}$ et $D \in K^{(n-m) \times (n-m)}$. En effet, on a par définition $A_B[v_i]_B = [f(v_i)]_B$, et par conséquent $A_B e_i = \lambda e_i$, où e_i est le i -ème vecteur canonique de dimension n .

Lorsqu'on développe le déterminant d'une matrice en blocs comme A_B grâce à la formule de Leibniz, seules les permutations envoyant $\{1, \dots, m\}$ et $\{m+1, \dots, n\}$ sur eux-même donnent un produit non nul. On peut alors diviser la somme en deux pour obtenir que le déterminant est exactement le produit des déterminants des blocs diagonaux. Le polynôme caractéristique $p(x) \in K[x]$ de f est alors

$$\begin{aligned} p(x) &= \det \begin{pmatrix} (\lambda - x)I_m & C \\ 0 & D - xI_{n-m} \end{pmatrix} \\ &= (\lambda - x)^m \det(D - xI_{n-m}). \end{aligned}$$

La multiplicité algébrique de λ est donc au moins m . □

Théorème 2.9 (Théorème de diagonalisation). Soit V un espace vectoriel sur K de dimension n , $f : V \rightarrow V$ un endomorphisme et $\lambda_1, \dots, \lambda_r \in K$ les valeurs propres distinctes de f . Alors f est diagonalisable si et seulement si

i) le polynôme caractéristique $p_f(x)$ de f décompose en facteurs linéaires, c'est-à-dire,

$$p_f(x) = (-1)^n \prod_{i=1}^r (x - \lambda_i)^{g_i}$$

où g_i est la multiplicité algébrique de $\lambda_i \in K$ pour tous i .

ii) $\dim(E_{\lambda_i}) = g_i$, pour tous $i = 1, \dots, r$. C'est à dire, les multiplicités algébriques et géométriques sont les mêmes.

Démonstration. Supposons f diagonalisable. Soit B une base composée de vecteurs propres de f et A la matrice de f associée à la base B . Le lemme 2.1 implique que A est diagonale et alors $p_f(x) = \det(A - x \text{Id}) = (-1)^n \prod_{i=1}^r (x - \lambda_i)^{g_i}$. La dimension de

E_{λ_i} est celle du noyau $\ker(A - \lambda_i I_n)$. Clairement $\dim(\ker(A - \lambda_i I_n)) = g_i$, et on a alors montré i) et ii).

Supposons maintenant que i) et ii) tiennent. Soient m_i les multiplicités géométriques des valeurs propres λ_i , $i = 1, \dots, r$. Comme on a

$$\deg((-1)^n \prod_{i=1}^r (\lambda_i - x)^{g_i}) = n,$$

alors $m_1 + \dots + m_r = n$ et f est diagonalisable grâce au corollaire 2.4. \square

Exemple 2.3. Soit $f: \mathbb{R}^3 \rightarrow \mathbb{R}^3$ donnée par

$$f(x) = Ax, \text{ où } A = \begin{pmatrix} 0 & -1 & 1 \\ -3 & -2 & 3 \\ -2 & -2 & 3 \end{pmatrix}$$

Pour la base canonique $B = \{e_1, e_2, e_3\}$ de \mathbb{R}^3 , on a $A_B = A$. Le polynôme caractéristique de f est

$$p(x) = -x^3 + x^2 + x - 1 = -(x-1)^2(x+1).$$

Les valeurs propres de f sont $\lambda_1 = 1$ et $\lambda_2 = -1$ et

$$\left\{ \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix} \right\} \text{ et } \left\{ \begin{pmatrix} 1 \\ 3 \\ 2 \end{pmatrix} \right\}$$

sont des bases de E_{λ_1} et E_{λ_2} respectivement. Alors f est diagonalisable et pour la base

$$B' = \left\{ \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 \\ 3 \\ 2 \end{pmatrix} \right\}$$

on a

$$A_{B'} = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & -1 \end{pmatrix}$$

et

$$P_{BB'} = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 3 \\ 1 & 1 & 2 \end{pmatrix}^{-1}.$$

On peut vérifier qu'on a bien

$$A_B = P_{BB'}^{-1} A_{B'} P_{BB'}. \quad (2.7)$$

Exercices

1. Donner un exemple d'un corps fini K et deux polynômes $p(x) \neq q(x) \in K[x]$ tel que $f_p = f_q$.

2.3 Matrices semblables

Définition 2.7. Deux matrices $A, B \in K^{n \times n}$ sont *semblables*, s'il existe une matrice inversible $P \in K^{n \times n}$ tel que $A = P^{-1} \cdot B \cdot P$.

L'équation (2.3) montre que les matrices A_B et $A_{B'}$ d'un endomorphisme $f: V \rightarrow V$ sont semblables, pour B et B' deux bases de V .

Définition 2.8. L'ensemble des valeurs propres d'une matrice $A \in K^{n \times n}$ (resp. d'un endomorphisme $f: V \rightarrow V$) est appelé le *spectre* de A (resp. de f), noté $\text{spec}(A)$ (resp. $\text{spec}(f)$).

Théorème 2.10. Soit $A \in K^{n \times n}$ une matrice et $P \in K^{n \times n}$ une matrice inversible.

- i) Le spectre de A et celui de $P^{-1}AP$ sont les mêmes.
- ii) $v \in K^n$ est un vecteur propre de A si et seulement si $P^{-1}v$ est un vecteur propre de $P^{-1}AP$.
- iii) Les polynômes caractéristiques $p_A(x)$ et $p_{P^{-1}AP}(x)$ sont identiques.

2.4 Théorème de Hamilton-Cayley

Soit $A \in K^{n \times n}$ et $p(x) = a_0 + a_1x + \dots + a_nx^n \in K[x] \setminus \{0\}$ un polynôme. On peut évaluer le polynôme en la matrice A comme suit :

$$p(A) = a_0 \cdot I_n + a_1A + \dots + a_nA^n \in K^{n \times n}.$$

Maintenant, soit $p_A(x)$ le polynôme caractéristique de A et v un vecteur propre de A associé à la valeur propre λ . On voit

$$p_A(A) \cdot v = a_0v + a_1\lambda v + \dots + a_n\lambda^n v = p_A(\lambda)v = 0 \cdot v = 0.$$

Dans le cas où A est diagonalisable, il existe une base de vecteurs propres $\{v_1, \dots, v_n\}$. On a alors $p_A(A) \cdot v_i = 0$ pour tous i , et donc $p_A(A) = 0$.

Théorème 2.11 (Hamilton-Cayley). Soit $A \in K^{n \times n}$ et $p_A(\lambda)$ le polynôme caractéristique de A , alors

$$p_A(A) = 0.$$

Démonstration. On écrit

$$\det(A - \lambda I_n)I_n = \text{cof}(A - \lambda I_n)^T (A - \lambda I_n),$$

où $\text{cof}(A - \lambda I_n)$ est la comatrice de $(A - \lambda I_n)$.

En regroupant les coefficients de λ^i dans $\text{cof}(A - \lambda I_n)^T$ on obtient

$$\text{cof}(A - \lambda I_n)^T = \sum_{i=0}^{n-1} \lambda^i B_i$$

avec certaines matrices $B_i \in K^{n \times n}$. Alors

$$a_0 I_n + a_1 \lambda I_n + \dots + a_n \lambda^n I_n = B_0 A + \sum_{i=1}^{n-1} \lambda^i (B_i A - B_{i-1}) - \lambda^n B_{n-1},$$

où $p_A(\lambda) = a_0 + \dots + a_n \lambda^n$. Ceci implique

$$\begin{aligned} a_0 I_n &= B_0 A \\ a_i I_n &= B_i A - B_{i-1} \text{ pour } i \in \{1, \dots, n-1\} \\ a_n I_n &= -B_{n-1} \end{aligned} \quad (2.8)$$

ce que sont des équations de matrices en $K^{n \times n}$. Si on multiplie les matrices indicées par i à droite par A^i et qu'on somme les équations, on obtient $p_A(A)$ à gauche du signe d'égalité. À droite, on obtient une somme télescopique égale à la matrice nulle. \square

Exemple 2.4. Le polynôme caractéristique de $A = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 0 & 2 \end{pmatrix}$ est $p_A(t) = (1-t)(2-t)$.

On a

$$p_A(A) = (I_n - A)(2I_n - A) = 0$$

Pour la matrices $A = \begin{pmatrix} 2 & 0 \\ 0 & 2 \end{pmatrix}$, on a bien sûr que $p_A(A) = 0$ pour $p_A(t) = (2-t)^2$.

Cependant, il existe un polynôme unitaire de degré strictement inférieur tel que $q(A) = 0$, à savoir $q(t) = t - 2$.

Définition 2.9. Le polynôme unitaire de degré minimal parmi ceux qui annulent A est appelé *polynôme minimal* de A .

Nous examinerons de plus près le polynôme minimal du chapitre ??.

Les résultats suivants donnent des utilisations typiques du théorème 2.11

Corollaire 2.12. Soit $A \in K^{n \times n}$.

- (i) Toute puissance A^k avec $k \in \mathbb{N}$ peut s'écrire comme une combinaison linéaire des puissances $I, A, A^2, \dots, A^{n-1}$.
- (ii) Si A est inversible, alors l'inverse A^{-1} peut s'écrire comme une combinaison linéaire des puissances $I, A, A^2, \dots, A^{n-1}$.

Démonstration. (i). Trivialement, l'assertion est vraie pour $k = 0, 1, \dots, n-1$. On montre le cas $k = n$. Par le théorème 2.11 :

$$0 = p_A(A) = \alpha_0 I + \alpha_1 A \dots + \alpha_{n-1} A^{n-1} + A^n \quad \Rightarrow \quad A^n = -\alpha_0 I - \alpha_1 A \dots - \alpha_{n-1} A^{n-1}.$$

De façon similaire, on montre le cas $k > n$ par récurrence, utilisant $0 = A^{k-n} p_A(A)$.

(ii). Si A est inversible alors $\alpha_0 = \det(A)$ est inversible. De $0 = p_A(A)$ on obtient que

$$I = -\frac{\alpha_1}{\alpha_0} A \dots - \frac{\alpha_{n-1}}{\alpha_0} A^{n-1} - \frac{1}{\alpha_0} A^n = A \left(-\frac{\alpha_1}{\alpha_0} I \dots - \frac{\alpha_{n-1}}{\alpha_0} A^{n-2} - \frac{1}{\alpha_0} A^{n-1} \right)$$

et donc $A^{-1} = -\frac{\alpha_1}{\alpha_0} I \dots - \frac{\alpha_{n-1}}{\alpha_0} A^{n-2} - \frac{1}{\alpha_0} A^{n-1}$. \square

3 Formes bilinéaires

Définition 3.1. Soit V un espace vectoriel sur un corps K . Une *forme bilinéaire* sur V est une correspondance qui à tout couple (v, w) d'éléments de V associe un scalaire, noté $\langle v, w \rangle \in K$, satisfaisant aux deux propriétés suivantes :

BL 1 Si u, v et w sont des éléments de V , et $\alpha \in K$ est un scalaire,

$$\langle u, v + w \rangle = \langle u, v \rangle + \langle u, w \rangle \quad \text{et} \quad \langle u, \alpha \cdot w \rangle = \alpha \cdot \langle u, w \rangle.$$

BL 2 Si u, v et w sont des éléments de V , et $\alpha \in K$ est un scalaire,

$$\langle v + w, u \rangle = \langle v, u \rangle + \langle w, u \rangle \quad \text{et} \quad \langle \alpha \cdot u, w \rangle = \alpha \cdot \langle u, w \rangle.$$

La forme bilinéaire est dite *symétrique* si pour tout $v, w \in V$

$$\langle v, w \rangle = \langle w, v \rangle.$$

On dit que la forme bilinéaire est *non dégénérée à gauche* (respectivement à droite) si la condition suivante est vérifiée :

Si $v \in V$, et si $\langle v, w \rangle = 0$ pour tout $w \in V$, alors $v = 0$.

Si la forme bilinéaire est non dégénérée à gauche et à droite, on dit qu'elle est *non dégénérée*.

Exemple 3.1. Soit $V = K^n$, l'application

$$\begin{aligned} \langle \rangle : V \times V &\longrightarrow K \\ (u, v) &\longmapsto \sum_{i=1}^n u_i v_i \end{aligned}$$

est une forme bilinéaire. Vérifions (BL 1). Pour tous $u, v, w \in K^n$ et $\alpha \in K$:

$$\begin{aligned} \langle u, v + w \rangle &= \sum_{i=1}^n u_i (v_i + w_i) \\ &= \sum_{i=1}^n (u_i v_i + u_i w_i) \\ &= \sum_{i=1}^n u_i v_i + \sum_{i=1}^n u_i w_i \\ &= \langle u, v \rangle + \langle u, w \rangle \end{aligned}$$

et

$$\langle u, \alpha \cdot w \rangle = \sum_{i=1}^n u_i \alpha w_i = \alpha \sum_{i=1}^n u_i w_i = \alpha \langle u, w \rangle.$$

On appelle cette forme bilinéaire la *forme bilinéaire standard* de K^n . On vérifie aussi très facilement que la forme bilinéaire standard est symétrique et non dégénérée.

3 Formes bilinéaires

Exemple 3.2. Soit $V = \mathbb{R}^3$ et

$$\langle u, v \rangle = u^T \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 2 & 0 & 2 \\ 1 & 1 & 0 \end{pmatrix} v \text{ pour } u, v \in \mathbb{R}^3,$$

est une forme bilinéaire non-symétrique, dégénérée à droite et à gauche.

Exemple 3.3. Soit V l'espace des fonctions continues à valeurs réelles, définies sur l'intervalle $[0, 2 \cdot \pi]$. Si $f, g \in V$ on pose

$$\langle f, g \rangle = \int_0^{2\pi} f(x)g(x) dx.$$

Clairement, \langle, \rangle est une forme bilinéaire symétrique sur V non dégénérée.

Exercice 3.1. Montrer que les formes bilinéaires des exemples 3.1 et 3.3 sont non dégénérées.

Soit V un espace vectoriel de dimension finie et $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ une base de V . Pour une forme bilinéaire $f : V \times V \rightarrow K$ et $x = \sum_i \alpha_i v_i$ et $y = \sum_j \beta_j v_j$ on a

$$\begin{aligned} f(x, y) &= f\left(\sum_{i=1}^n \alpha_i v_i, \sum_{j=1}^n \beta_j v_j\right) \\ &= \sum_{i=1}^n \alpha_i f\left(v_i, \sum_{j=1}^n \beta_j v_j\right) \\ &= \sum_{i,j=1}^n \alpha_i \beta_j f(v_i, v_j) \end{aligned}$$

alors pour la matrice $A_B^f \in K^{n \times n}$, ayant comme composantes $f(v_i, v_j)$, on a

$$f(x, y) = [x]_B^T A_B^f [y]_B.$$

Exercice 3.2. Soit V de dimension finie et B une base de V . Deux formes bilinéaires $f, g : V \times V \rightarrow K$ sont différentes si et seulement si $A_B^f \neq A_B^g$.

Exemple 3.4. Soit $V = \{p(x) : p \in \mathbb{R}[x], \deg(p) \leq 2\}$ l'espace vectoriel des polynômes réelles de degré au plus 2 et $B = \{1, x, x^2\}$ une base de V et $f(p, q) = \int_0^1 p(x) \cdot q(x) dx$. Il est facile de vérifier que f est une forme bilinéaire sur V . La matrice A_B^f est

$$A_B^f = \begin{pmatrix} 1 & 1/2 & 1/3 \\ 1/2 & 1/3 & 1/4 \\ 1/3 & 1/4 & 1/5 \end{pmatrix}.$$

Pour $p(x) = 2 + 3x - 5x^2$ et $q(x) = 2x + 3x^2$ on obtient

$$\int_0^1 f(x)p(x)dx = \begin{pmatrix} 2 & 3 & -5 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 1/2 & 1/3 \\ 1/2 & 1/3 & 1/4 \\ 1/3 & 1/4 & 1/5 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0 \\ 2 \\ 3 \end{pmatrix}$$

Pour mémoire, pour deux bases B, B' et étant donné $[x]_{B'}$, on trouve les coordonnées de x dans la base B , $[x]_B$, à l'aide de la matrice de changement de base $P_{B'B}$ comme

$$[x]_B = P_{B'B}[x]_{B'}.$$

Cette formule nous montre que

$$A_{B'}^f = P_{B'B}^T A_B^f P_{B'B}. \quad (3.1)$$

Exercice 3.3. Soit V un K -espace vectoriel de dimension finie et B une base de V . Une forme bilinéaire $f : V \times V \rightarrow K$ est symétrique si et seulement si A_B^f est symétrique.

Proposition 3.1. Soit V un K -espace vectoriel de dimension finie, $B = \{b_1, \dots, b_n\}$ une base de V et $f : V \times V \rightarrow K$ une forme bilinéaire. Les conditions suivantes sont équivalentes.

- i) $\text{rang}(A_B^f) = n$
- ii) f est non dégénérée à gauche, i.e. si $v \in V$, et si $\langle v, w \rangle = 0$ pour tout $w \in V$, alors $v = 0$
- iii) f est non dégénérée à droite, i.e. si $v \in V$, et si $\langle w, v \rangle = 0$ pour tout $w \in V$, alors $v = 0$

Démonstration. Nous montrons i) et ii) sont équivalentes. De la même manière, on démontre aussi que i) et iii) sont équivalentes.

i) \Rightarrow ii) : Supposons que $\text{rang}(A_B^f) = n$ et soit $v \in V$, $v \neq 0$. Pour $w \in V$ on a

$$f(v, w) = [v]_B^T A_B^f [w]_B.$$

Dès que $[v]_B \neq 0$, on a $[v]_B^T A_B^f \neq 0^T$ (car $\text{noyau}(A_B^f) = \{0\} \iff \text{rang}(A_B^f) = n$). Supposons que la i -ème composante de $[v]_B^T A_B^f$ n'est pas égale à 0. Alors $[v]_B^T A_B^f e_i \neq 0$ où toutes les composantes de e_i sont 0 sauf la i -ème composante, qui est égale à 1. Alors $f(v, b_i) \neq 0$. Donc f est non dégénérée à gauche.

ii) \Rightarrow i) : Si f est non dégénérée à gauche, alors $x^T A_B^f \neq 0$ pour tout $x \in K^n$ tel que $x \neq 0$ (sinon, on aurait trouvé un x tel que $x^T A_B^f y = 0$ pour tout $y \in K^n$). Ceci implique que les lignes de A_B^f sont linéairement indépendantes. Alors $\text{rang}(A_B^f) = n$. \square

3.1 Orthogonalité

Pour ce paragraphe 3.1, s'il n'est pas spécifié autrement, V est toujours un espace vectoriel sur K muni d'une forme bilinéaire symétrique $\langle \cdot, \cdot \rangle$.

Définition 3.2. Deux éléments $u, v \in V$ sont *orthogonaux* ou *perpendiculaires* si $\langle u, v \rangle = 0$, et l'on écrit $u \perp v$.

3 Formes bilinéaires

Proposition 3.2. Soit $E \subseteq V$ une partie de V , alors $E^\perp = \{v \in V : v \perp e \text{ pour tout } e \in E\}$ est un sous-espace vectoriel de V .

Démonstration. Pour mémoire : $\emptyset \neq W \subseteq V$ est un sous-espace si les conditions suivantes sont vérifiées.

- i) Si $u, v \in W$ on a $u + v \in W$.
- ii) Si $c \in K$ et $u \in W$ on a $c \cdot u \in W$.

Des que $0 \in E^\perp$, on a que $E^\perp \neq \emptyset$. Si $u, v \in E^\perp$ alors pour tout $e \in E$

$$\langle e, u + v \rangle = \langle e, u \rangle + \langle e, v \rangle = 0 + 0 = 0,$$

et pour $c \in K$

$$\langle e, c \cdot v \rangle = c \langle e, v \rangle = c \cdot 0 = 0.$$

□

Exercice 3.4. Soit $E \subseteq V$ et E^* le sous-espace de V engendré par les éléments de E . Montrer $E^\perp = E^{*\perp}$.

Exemple 3.5. Soient K un corps et $(a_{ij}) \in K^{m \times n}$ une matrice à m lignes et n colonnes. Le système homogène linéaire

$$A X = 0, \tag{3.2}$$

peut s'écrire sous la forme

$$\langle A_1, X \rangle = 0, \dots, \langle A_m, X \rangle = 0,$$

où les A_i sont les vecteurs lignes de la matrice A et \langle, \rangle dénote la forme bilinéaire standard de K^n . Soit W le sous-espace de K^n engendré par les A_i et U le sous-espace de K^n des solutions du système (3.2). Alors on a $U = W^\perp$ et $\dim(W^\perp) = \dim(U) = n - \text{rang}(A) = \dim(\text{noyau}(A))$.

Définition 3.3. La caractéristique d'un anneau (unitaire) R , $\text{Char}(R)$ est l'ordre de 1_R comme élément du groupe abélien $(R, +)$. En d'autres mots, c'est le nombre

$$\min_{k \in \mathbb{N}_+} \underbrace{1 + \dots + 1}_{k \text{ fois}} = 0$$

Si cet ordre est infini, la caractéristique de R est 0.

Notation. Pour $n \in \mathbb{N}_+$ l'anneau des classes des restes est dénoté comme $\mathbb{Z}/n\mathbb{Z}$ ou plus brièvement \mathbb{Z}_n (parfois aussi noté \mathbb{F}_n). Ceci est un corps si et seulement si n est un nombre premier.

Exemple 3.6. Soit $n \in \mathbb{N}_+$. Alors la caractéristique de \mathbb{Z}_n est n . La caractéristique de \mathbb{Q}, \mathbb{R} et \mathbb{C} est zéro.

Lemme 3.3. Soit $\text{Char}(K) \neq 2$. Si $\langle u, u \rangle = 0$ pour tout $u \in V$ alors

$$\langle u, v \rangle = 0 \text{ pour tous } u, v \in V$$

On dit que la forme bilinéaire symétrique \langle, \rangle est nulle.

Démonstration. Soient $u, v \in V$. On peut écrire

$$2 \cdot \langle u, v \rangle = \langle u + v, u + v \rangle - \langle u, u \rangle - \langle v, v \rangle$$

et comme $2 \neq 0$ on a $\langle u, v \rangle = 0$. \square

Définition 3.4. Une base $\{v_1, \dots, v_n\}$ de l'espace vectoriel V est une *base orthogonale* si $\langle v_i, v_j \rangle = 0$ pour $i \neq j$.

Remarque 3.4. Pour une forme bilinéaire symétrique \langle, \rangle et une base $B = \{v_1, \dots, v_n\}$. On se rappelle que

$$\langle v_i, v_j \rangle = (A_B^{\langle, \rangle})_{ij}$$

Alors B est une base orthogonale, si et seulement si, $A_B^{\langle, \rangle}$ est une matrice diagonale.

Théorème 3.5. Soit $\text{Char}(K) \neq 2$ et supposons que V est de dimension finie. Alors V possède une base orthogonale.

Démonstration. On montre le théorème par induction. Si $\dim(V) = 1$ alors toute base contient seulement un élément et alors est orthogonale.

Soit $\dim(V) > 1$. Si $\langle u, u \rangle = 0$ pour tout u , le lemme 3.3 implique que la forme bilinéaire symétrique est nulle et toute base de V est orthogonale. Autrement, soit $u \in V$ tel que $\langle u, u \rangle \neq 0$ et soit $V_1 = \text{span}\{u\}$. Pour $x \in V$ le vecteur

$$x - \langle x, u \rangle / \langle u, u \rangle \cdot u \in V_1^\perp$$

et alors $V = V_1 + V_1^\perp$. Cette somme est directe parce que chaque élément de $V_1 \cap V_1^\perp$ s'écrit comme $\beta \cdot u$ pour $\beta \in K$. Et $\langle u, \beta u \rangle = \beta \langle u, u \rangle = 0$ implique $\beta = 0$.

Alors $\dim(V_1^\perp) < \dim(V)$, et par induction, V_1^\perp possède une base orthogonale $\{v_2, \dots, v_n\}$. Alors $\{v_1, \dots, v_n\}$ est une base orthogonale de V . \square

Exemple 3.7. Soit $V = \mathbb{Z}_5^3$ et $\langle, \rangle: \mathbb{Z}_5^3 \times \mathbb{Z}_5^3 \rightarrow \mathbb{Z}_5$ défini comme

$$\langle x, y \rangle = x^T A y,$$

où

$$A = \begin{pmatrix} 0 & 2 & 1 \\ 2 & 0 & 4 \\ 1 & 4 & 0 \end{pmatrix}$$

Le but est de trouver une base orthogonale de \mathbb{Z}_5^3 . On va trouver une matrice inversible $P \in \mathbb{Z}_5^{3 \times 3}$ tel que $P^T A P$ est une matrice diagonale. Si p_1, p_2, p_3 sont les colonnes de P , alors

$$\{p_1, p_2, p_3\}$$

3 Formes bilinéaires

est une base de \mathbb{Z}_5^3 et c'est une base orthogonale, des que

$$\langle p_i, p_j \rangle = 0 \text{ si } i \neq j, 1 \leq i, j \leq 3.$$

Nous allons additionner la 2-ème colonne de A sur la 1-ère colonne et la 2-ème ligne de A sur la 1-ère ligne de A . C'est à dire on calcule

$$P^T A P = \begin{pmatrix} 4 & 2 & 0 \\ 2 & 0 & 4 \\ 0 & 4 & 0 \end{pmatrix}$$

où

$$P = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

Après on va additionner 2· la 1-ère colonne sur la deuxième, et l'opération correspondante de lignes et on obtient

$$P^T A P = \begin{pmatrix} 4 & 0 & 0 \\ 0 & 4 & 4 \\ 0 & 4 & 0 \end{pmatrix}$$

où

$$P = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 0 \\ 1 & 3 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

Après on va additionner 4· la 2-ère colonne sur la 3-ème, et l'opération correspondante de lignes et on obtient

$$P^T A P = \begin{pmatrix} 4 & 0 & 0 \\ 0 & 4 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

où

$$P = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 1 & 3 & 2 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}.$$

Nous avons trouvé une base orthogonale

$$\left\{ \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 2 \\ 3 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 3 \\ 2 \\ 1 \end{pmatrix} \right\}.$$

Exercices

1. Soit K un corps. Si la caractéristique de K est différente de zéro, alors elle est un nombre premier.

2. Soit K un corps fini. Montrer que $|K| = q^\ell$ pour un nombre premier q et un nombre naturel $\ell \in \mathbb{N}$. *Indication* : K est un espace vectoriel de dimension finie sur \mathbb{Z}_q pour un q premier.
3. On considère les vecteurs

$$v_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}, v_2 = \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix}, \text{ et } v_3 = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix} \in \mathbb{Z}_2^4.$$

Est-ce que $\text{span}\{v_1, v_2, v_3\}$ possède une base orthogonale par rapport à la forme bilinéaire symétrique standard de l'exemple 3.1 ?

4. En considérant le forme bilinéaire symétrique standard de l'exemple 3.1, trouver une base orthogonale du sous-espace de \mathbb{Z}_3^4 engendré par

$$v_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix}, v_2 = \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}, \text{ et } v_3 = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix} \in \mathbb{Z}_3^4.$$

3.2 Matrices congruentes

Définition 3.5. Deux matrices $A, B \in K^{n \times n}$ sont dites *congruentes* s'il existe une matrice $P \in K^{n \times n}$ inversible telle que

$$A = P^T B P.$$

Nous écrivons dans ce cas $A \cong B$.

Exemple 3.8. Si V est de dimension finie et B, B' sont deux bases de V , la relation (3.1) montre que $A_B^{(\cdot)} \cong A_{B'}^{(\cdot)}$.

Lemme 3.6. La relation \cong est une relation d'équivalence.

Démonstration. Voir exercice. □

Le relation entre \cong et le concept de l'orthogonalité est précisée dans le lemme suivant.

Lemme 3.7. Soit V un espace vectoriel de dimension finie et $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ une base quelconque. Alors V possède une base orthogonale si et seulement s'il existe une matrice diagonale D telle que $A_B^{(\cdot)} \cong D$.

Démonstration. Si B' est une base orthogonale de V , alors $A_{B'}^{(\cdot)}$ est une matrice diagonale. Grâce à la relation (3.1), $A_B^{(\cdot)}$ est congruente à une matrice diagonale.

Si $A_B^{(\cdot)} \cong D$ où $D \in K^{n \times n}$ est une matrice diagonale, alors il existe une matrice $P \in K^{n \times n}$ inversible, telle que

$$P^T A_B^{(\cdot)} P = D.$$

Remarquons que chaque opération est faite à la fois sur les lignes et sur les colonnes. Ceci garantit que la matrice résultante reste symétrique. De plus, les opérations sont faites sur les lignes et colonnes d'indices $j \geq i$, laissant intacte la forme de la matrice (3.3).

Exemple 3.9. Soit V un espace vectoriel sur \mathbb{Q} de dimension 3 muni d'une forme bilinéaire symétrique $\langle \cdot, \cdot \rangle$. Soit $B = \{v_1, v_2, v_3\}$ une base de V et

$$A_B^{\langle \cdot, \cdot \rangle} = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 2 \\ 0 & 3 & 4 \\ 2 & 4 & 0 \end{pmatrix}$$

Le but est de trouver une base orthogonale de V .

En utilisant notre algorithme on trouve

$$P = \begin{pmatrix} 1 & 0 & -2 \\ 0 & 1 & -\frac{4}{3} \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

telle que

$$P^T \cdot A_B^{\langle \cdot, \cdot \rangle} \cdot P = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 3 & 0 \\ 0 & 0 & -\frac{28}{3} \end{pmatrix}.$$

Alors $B' = \{v_1, v_2, -2v_1 - (4/3)v_2 + v_3\}$ est une base orthogonale de V .

Exercices

1. Montrer que \cong est une relation d'équivalence sur l'ensemble des matrices $K^{n \times n}$.
2. Est-ce que la matrice

$$\begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 0 \end{pmatrix} \in \mathbb{Z}_2^{3 \times 3}$$

est congruente à une matrice diagonale? *Indice : voir l'exercice 3. de la section 3.1.*

3. Soit V un espace vectoriel sur un corps K de dimension finie muni d'une forme bilinéaire symétrique $\langle \cdot, \cdot \rangle$. Soit $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ une base de V . Montrer que $A_B^{\langle \cdot, \cdot \rangle} \in K^{n \times n}$ est congruente à une matrice diagonale si et seulement si V possède une base orthogonale.
4. Soit K un corps de caractéristique 2 et soit V un espace vectoriel sur K de dimension finie muni d'une forme bilinéaire symétrique non-nulle. Soit

$$C = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & 0 \end{pmatrix}.$$

où $c_i = \langle v_i, v_i \rangle$ pour tout i . Si $K = \mathbb{R}$ on peut ordonner la base afin d'avoir $c_1, \dots, c_r > 0$, $c_{r+1}, \dots, c_s < 0$ et $c_{s+1}, \dots, c_n = 0$.

Maintenant soit $K = \mathbb{R}$ et $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ symétrique. Le Corollaire 3.8 implique qu'il existe une matrice inversible $P \in \mathbb{R}^{n \times n}$ tel que $P^T A P = D$ où D est une matrice diagonale. Si on échange deux colonnes de P et note P' la nouvelle matrice obtenue, alors $P'^T A P' = D'$, où D' est obtenue de D en échangeant les éléments diagonaux correspondants. Alors on peut trouver une matrice inversible $P \in \mathbb{R}^{n \times n}$ telle que

$$P^T A P = \begin{pmatrix} c_1 & & \\ & \ddots & \\ & & c_n \end{pmatrix}. \quad (3.4)$$

où les c_i sont ordonnés de sorte que $c_1, \dots, c_r > 0$, $c_{r+1}, \dots, c_s < 0$ et $c_{s+1}, \dots, c_n = 0$. En multipliant les premières s colonnes de P par $1/\sqrt{|c_i|}$ on obtient en fait une factorisation (3.4) telle que $c_1, \dots, c_r = 1$, $c_{r+1}, \dots, c_s = -1$ et $c_{s+1}, \dots, c_n = 0$.

Alors on trouve $P \in \mathbb{R}^{n \times n}$ inversible telle que

$$P^T A P = \begin{pmatrix} 1 & & & & & & & & & \\ & \ddots & & & & & & & & \\ & & 1 & & & & & & & \\ & & & -1 & & & & & & \\ & & & & \ddots & & & & & \\ & & & & & -1 & & & & \\ & & & & & & 0 & & & \\ & & & & & & & \ddots & & \\ & & & & & & & & & 0 \end{pmatrix}. \quad (3.5)$$

Définition 3.6. Pour un espace vectoriel sur \mathbb{R} de dimension finie, on appelle une base B de V telle que $A_B^{\langle \cdot \rangle}$ a la forme décrite en (3.5) une *base de Sylvester*.

Nous allons maintenant démontrer, que les nombres r et s sont invariants par rapport au choix de la base B de V .

Définition 3.7. Le sous espace $V_0 = \{v \in V : \langle v, x \rangle = 0 \text{ pour tout } x \in V\}$ est appelé l'*espace de nullité* de la forme bilinéaire symétrique $\langle \cdot \rangle$.

Théorème 3.9. Soit V un espace vectoriel de dimension finie sur un corps K de caractéristique $\neq 2$ et soit V muni d'une forme bilinéaire symétrique. Soit $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ une base orthogonale de V . La dimension $\dim(V_0)$ est égale au nombre d'indices i tel que $\langle v_i, v_i \rangle = 0$.

Démonstration. Nous utilisons la notation d'au-dessus et écrivons

$$\langle v, x \rangle = [v]_B^T \begin{pmatrix} c_1 & & \\ & \ddots & \\ & & c_n \end{pmatrix} [x]_B.$$

3 Formes bilinéaires

Cette expression est égale à zéro pour tout $x \in V$ si et seulement si $([v]_B)_i = 0$ pour tout i tel que $c_i \neq 0$. Ceci démontre que $\{v_i : \langle v_i, v_i \rangle = 0\}$ est une base de l'espace de nullité. \square

Définition 3.8. La dimension de l'espace de nullité $\dim(V_0)$ est appelé l'*indice de nullité* de la forme bilinéaire symétrique.

Théorème 3.10 (Théorème de Sylvester). *Soit V un espace vectoriel de dimension finie sur \mathbb{R} muni d'une forme bilinéaire symétrique. Il existe un nombre entier $r \geq 0$ tel que, pour chaque base orthogonale $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ de V , exactement r des indices i satisfont $\langle v_i, v_i \rangle > 0$.*

Démonstration. Soient $\{v_1, \dots, v_n\}$ et $\{w_1, \dots, w_n\}$ des bases orthogonales de V ordonnées telles que $\langle v_i, v_i \rangle > 0$ si $1 \leq i \leq r$, $\langle v_i, v_i \rangle < 0$ si $r+1 \leq i \leq s$ et $\langle v_i, v_i \rangle = 0$ si $s+1 \leq i \leq n$. De même $\langle w_i, w_i \rangle > 0$ si $1 \leq i \leq r'$, $\langle w_i, w_i \rangle < 0$ si $r'+1 \leq i \leq s'$ et $\langle w_i, w_i \rangle = 0$ si $s'+1 \leq i \leq n$.

On démontre que $v_1, \dots, v_r, w_{r'+1}, \dots, w_n$ est linéairement indépendant. Ça implique que $r+n-r' \leq n$ et alors $r \leq r'$. Parce que l'argument est symétrique on peut conclure que $r = r'$.

Si $v_1, \dots, v_r, w_{r'+1}, \dots, w_n$ est linéairement dépendant, il existe des scalaires x_1, \dots, x_r et $y_{r'+1}, \dots, y_n$ respectivement non tous égaux à zéro tels que

$$x_1 v_1 + \dots + x_r v_r = y_{r'+1} w_{r'+1} + \dots + y_n w_n$$

et ça implique, car les v_i et respectivement les w_i sont orthogonaux entre eux,

$$x_1^2 \langle v_1, v_1 \rangle + \dots + x_r^2 \langle v_r, v_r \rangle = y_{r'+1}^2 \langle w_{r'+1}, w_{r'+1} \rangle + \dots + y_n^2 \langle w_n, w_n \rangle$$

Les $\langle v_i, v_i \rangle$ à gauche sont strictement positifs. Les $\langle w_i, w_i \rangle$ à droite sont négatifs ou nuls. Il suit que $x_1 = 0, \dots, x_r = 0$ et, comme les w_i sont linéairement indépendants, on a également $y_{r'+1} = 0, \dots, y_n = 0$. \square

Définition 3.9. L'entier r du théorème de Sylvester est appelé l'*indice de positivité* de la forme bilinéaire symétrique.

Exemple 3.10. Trouver une base de Sylvester de \mathbb{R}^4 et les indices de nullité et de positivité de la forme bilinéaire symétrique $x^T A y$ où

$$A = \begin{pmatrix} 2 & 4 & 6 \\ 4 & 4 & 3 \\ 6 & 3 & 1 \end{pmatrix}$$

On utilise des transformations élémentaires sur les colonnes et les mêmes sur les lignes tour à tour en alternant.

Les transformations élémentaires sur les colonnes sont représentées par

$$P_1 = \begin{bmatrix} 1 & -2 & -3 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix}$$

et transforment la matrice A en

$$\begin{pmatrix} 2 & 4 & 6 \\ 4 & 4 & 3 \\ 6 & 3 & 1 \end{pmatrix} \cdot \begin{bmatrix} 1 & -2 & -3 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 2 & 0 & 0 \\ 4 & -4 & -9 \\ 6 & -9 & -17 \end{bmatrix}.$$

Alors

$$P_1^T \cdot A \cdot P = \begin{bmatrix} 2 & 0 & 0 \\ 0 & -4 & -9 \\ 0 & -9 & -17 \end{bmatrix}$$

Avec

$$P_2 = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & -\frac{9}{4} \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix}$$

on obtient

$$P_2^T P_1^T A P_1 P_2 = \begin{bmatrix} 2 & 0 & 0 \\ 0 & -4 & 0 \\ 0 & 0 & \frac{13}{4} \end{bmatrix}$$

L'indice de nullité est zéro et l'indice de positivité est 2. Le produit $P_1 \cdot P_2$ est égal à

$$P_1 \cdot P_2 = \begin{bmatrix} 1 & -2 & \frac{3}{2} \\ 0 & 1 & -\frac{9}{4} \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix}$$

Les colonnes de P par $\sqrt{2}$, $\sqrt{4}$ et $\sqrt{13/4}$ respectivement, on obtient une transformation

$$P \text{ telle que } P^T A P = \begin{pmatrix} 1 & & \\ & 1 & \\ & & -1 \end{pmatrix}.$$

Les colonnes de P sont une base du Sylvester.

Exercices

1. Démontrer, à l'aide des théorèmes 3.9 et 3.10, que l'indice de négativité (l'entier s de l'équation (3.4)) ne dépend lui aussi pas de la base choisie.
2. Déterminer l'indice de nullité et l'indice de positivité des formes bilinéaire symétriques définies par les matrices suivantes

$$\begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 2 & -1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 2 & 4 & 2 \\ 4 & 3 & 1 \\ 2 & 1 & 1 \end{pmatrix}.$$

3. Soit V un espace vectoriel de dimension finie sur \mathbb{R} et soit $\langle \cdot \rangle$ une forme bilinéaire symétrique sur V . Montrer que V admet une décomposition en somme directe

$$V_0 \oplus V^+ \oplus V^-$$

3 Formes bilinéaires

où V_0 est l'espace de nullité et V^+ et V^- sont des sous-espaces tels que

$$\langle v, v \rangle > 0 \text{ pour tout } v \in V^+ \setminus \{0\}$$

et

$$\langle v, v \rangle < 0 \text{ pour tout } v \in V^- \setminus \{0\}.$$

3.4 Le cas réel, défini positif

Définition 3.10. Soit V un espace vectoriel sur \mathbb{R} muni d'une forme bilinéaire symétrique. La forme bilinéaire symétrique est définie positive si $\langle v, v \rangle \geq 0$ pour tout $v \in V$, et si $\langle v, v \rangle > 0$ lorsque $v \neq 0$. Une forme bilinéaire symétrique définie positive est un *produit scalaire*.

Exemple 3.11. Soit $V = \mathbb{R}^n$. La forme bilinéaire symétrique

$$\langle u, v \rangle = \sum_{i=1}^n u_i v_i$$

est un produit scalaire, appelé le *produit scalaire ordinaire*. Aussi, la forme bilinéaire de l'exemple 3.3 est un produit scalaire.

Définition 3.11. Soit \langle, \rangle un produit scalaire. La *longueur* ou la *norme* d'un élément $v \in V$ est le nombre

$$\|v\| = \sqrt{\langle v, v \rangle}.$$

Un élément $v \in V$ est un *vecteur unitaire* si $\|v\| = 1$.

Pour le reste de ce paragraphe 3.4, s'il n'est pas spécifié autrement, V est toujours un espace vectoriel sur \mathbb{R} muni d'un produit scalaire. On appelle un espace vectoriel sur \mathbb{R} muni d'un produit scalaire un *espace euclidien*.

Proposition 3.11. Pour $v \in V$ et $\alpha \in \mathbb{R}$ on a

$$\|\alpha v\| = |\alpha| \|v\|.$$

Démonstration.

$$\begin{aligned} \|\alpha v\| &= \sqrt{\langle \alpha v, \alpha v \rangle} \\ &= \sqrt{\alpha^2 \langle v, v \rangle} \\ &= |\alpha| \|v\|. \end{aligned}$$

□

Proposition 3.12 (Théorème de Pythagore). *Si v et w sont perpendiculaires*

$$\|v + w\|^2 = \|v\|^2 + \|w\|^2.$$

Démonstration.

$$\begin{aligned} \|v + w\|^2 &= \langle v + w, v + w \rangle \\ &= \langle v, v + w \rangle + \langle w, v + w \rangle \\ &= \langle v, v \rangle + \langle v, w \rangle + \langle w, v \rangle + \langle w, w \rangle \\ &= \|v\|^2 + \|w\|^2 \end{aligned}$$

□

Proposition 3.13 (Règle du parallélogramme). *Pour tous v et w , on a*

$$\|v + w\|^2 + \|v - w\|^2 = 2\|v\|^2 + 2\|w\|^2.$$

Soit V un espace vectoriel sur un corps K muni d'une forme bilinéaire symétrique \langle, \rangle . Si w est un élément de V tel que $\langle w, w \rangle \neq 0$, pour tout $v \in V$, il existe un élément unique $\alpha \in K$ tel que $\langle w, v - \alpha w \rangle = 0$.

En fait,

$$\langle w, v - \alpha w \rangle = \langle w, v \rangle - \alpha \langle w, w \rangle.$$

Alors $\langle w, v - \alpha w \rangle = 0$ si et seulement si $\alpha = \langle v, w \rangle / \langle w, w \rangle$.

Définition 3.12. Soit V un espace euclidien. Soit $w \in V \setminus \{0\}$. Pour $v \in V$, soit $\alpha = \langle v, w \rangle / \langle w, w \rangle$. Le nombre α est la *composante* de v sur w , ou le *coefficient de Fourier* de v relativement à w . Le vecteur αw s'appelle la *projection* de v sur w .

Exemple 3.12. Soit V l'espace vectoriel de l'exemple 3.3 et $f(x) = \sin kx$, où $k \in \mathbb{N}_{>0}$. Alors

$$\|f\| = \sqrt{\langle f, f \rangle} = \sqrt{\int_0^{2\pi} \sin^2 kx \, dx} = \sqrt{\pi}$$

Si g est une fonction quelconque, continue sur $[0, 2\pi]$, le coefficient de Fourier de g relativement à f est

$$\langle f, g \rangle / \langle f, f \rangle = \frac{1}{\pi} \int_0^{2\pi} g(x) \sin kx \, dx.$$

Théorème 3.14 (Inégalité de Cauchy-Schwarz). *Pour tous $v, w \in V$, on a*

$$|\langle v, w \rangle| \leq \|v\| \|w\|.$$

Démonstration. Si $w = 0$, les deux termes de cette inégalité sont nuls et elle devient évidente. Supposons maintenant que $w \neq 0$. Si $\alpha = \langle v, w \rangle / \langle w, w \rangle$ est la composante

3 Formes bilinéaires

de v sur w , $v - \alpha w$ est perpendiculaire à w , donc aussi à αw . D'après le théorème de Pythagore, on trouve

$$\begin{aligned}\|v\|^2 &= \|v - \alpha w\|^2 + \|\alpha w\|^2 \\ &\geq \alpha^2 \|w\|^2 \\ &= \langle v, w \rangle^2 / \|w\|^2.\end{aligned}$$

Cela implique

$$|\langle v, w \rangle| \leq \|v\| \|w\|.$$

□

Théorème 3.15 (Inégalité triangulaire). *Si $v, w \in V$.*

$$\|v + w\| \leq \|v\| + \|w\|.$$

Démonstration.

$$\begin{aligned}\|v + w\|^2 &= \|v\|^2 + 2\langle v, w \rangle + \|w\|^2 \\ &\leq \|v\|^2 + 2\|v\| \|w\| + \|w\|^2 \\ &= (\|v\| + \|w\|)^2,\end{aligned}$$

en recourant à l'inégalité de Cauchy-Schwarz.

□

Lemme 3.16. *Soit V un espace euclidien et soient v_1, \dots, v_n des éléments de V , deux à deux orthogonaux, tels que $\langle v_i, v_i \rangle \neq 0$ pour tout i , et soit $a_1, \dots, a_n \in \mathbb{R}$. Le vecteur*

$$v - a_1 v_1 - \dots - a_n v_n$$

est perpendiculaire à tous les v_1, \dots, v_n si et seulement si a_i est la composante de v sur v_i , c'est-à-dire $a_i = \langle v, v_i \rangle / \langle v_i, v_i \rangle$ pour tout i .

Démonstration. Pour le vérifier, il suffit d'en faire le produit scalaire avec v_j pour tout j . Tous les termes $\langle v_i, v_j \rangle$ donnent zéro si $i \neq j$. Le reste

$$\langle v, v_j \rangle - a_j \langle v_j, v_j \rangle$$

s'annule si et seulement si $a_j = \langle v, v_j \rangle / \langle v_j, v_j \rangle$.

□

Notation. Soient V un espace vectoriel et $v_1, \dots, v_n \in V$. Le sous-espace engendré par v_1, \dots, v_n est dénoté par $\text{span}\{v_1, \dots, v_n\}$.

Théorème 3.17 (Le procédé d'orthogonalisation de Gram-Schmidt). *Soient V un espace euclidien et $\{v_1, \dots, v_n\} \subseteq V$ un ensemble libre. Il existe un ensemble libre orthogonal $\{u_1, \dots, u_n\}$ de V tel que pour tout i , $\{v_1, \dots, v_i\}$ et $\{u_1, \dots, u_i\}$ engendrent le même sous-espace de V .*

Démonstration. On montre le théorème par induction. On met $u_1 = v_1$ et on suppose qu'on a construit $\{u_1, \dots, u_{i-1}\}$ pour $i \geq 2$. L'ensemble $\{u_1, \dots, u_{i-1}, v_i\}$ est libre et une base du sous-espace engendré par $\{v_1, \dots, v_i\}$. On met

$$u_i = v_i - \alpha_{1,i}u_1 - \dots - \alpha_{i-1,i}u_{i-1}$$

où les $\alpha_{j,i}$ sont les composantes de v_i sur u_j . Comme ça

$$\begin{aligned} \text{span}\{u_1, \dots, u_i\} &= \text{span}\{u_1, \dots, u_{i-1}, v_i\} \\ &= \text{span}\{v_1, \dots, v_i\}. \end{aligned}$$

Surtout $\{u_1, \dots, u_i\}$ est un ensemble orthogonal. \square

Exercice 3.5. Est-ce qu'il faut vraiment supposer que le produit scalaire $\langle \cdot \rangle$ soit réel et défini positif et sur \mathbb{R} pour ce procédé? Peux-tu imaginer une condition plus faible et satisfaite par le produit scalaire qui permet le procédé de Gram-Schmidt?

Définition 3.13. Une base $\{u_1, \dots, u_n\}$ d'un espace euclidien est *orthonormale* si elle est orthogonale et se compose de vecteurs tous unitaires.

Corollaire 3.18. Soit V un espace euclidien de dimension finie. Supposons $V \neq \{0\}$. V possède alors une base orthonormale.

Démonstration. Soient $\{v_1, \dots, v_n\}$ une base de V et $\{u_1, \dots, u_n\}$ le résultat du procédé Gram-Schmidt appliqué à $\{v_1, \dots, v_n\}$. Alors $\{u_1/\|u_1\|, \dots, u_n/\|u_n\|\}$ est une base orthonormale de V . \square

Exemple 3.13. Trouver une base orthonormale de l'espace vectoriel engendré par

$$\begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 \\ -2 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} \text{ et } \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ -1 \\ 2 \end{pmatrix}$$

Notons A, B et C les vecteurs. Soit $A' = A$ et

$$B' = B - \frac{A' \cdot B}{A' \cdot A'} \cdot A'$$

On trouve

$$B' = \frac{1}{3} \begin{pmatrix} 4 \\ -5 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}$$

On calcule

$$C' = C - \frac{A' \cdot C}{A' \cdot A'} \cdot A' - \frac{B' \cdot C}{B' \cdot B'} \cdot B'$$

3 Formes bilinéaires

et on trouve

$$C' = \frac{1}{7} \begin{pmatrix} -4 \\ -2 \\ -7 \\ 6 \end{pmatrix}$$

La base orthonormale est

$$A'/\|A'\| = \frac{1}{\sqrt{3}} \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}, B'/\|B'\| = \frac{1}{\sqrt{42}} \begin{pmatrix} 4 \\ -5 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix} \text{ et } C'/\|C'\| = \frac{1}{\sqrt{105}} \begin{pmatrix} -4 \\ -2 \\ -7 \\ 6 \end{pmatrix}$$

Corollaire 3.19. Soit $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$ une matrice de rang (colonne) plein. On peut factoriser A comme

$$A = A^* \cdot R$$

où les colonnes de $A^* \in \mathbb{R}^{m \times n}$ sont deux à deux orthonormales et $R \in \mathbb{R}^{n \times n}$ est une matrice triangulaire supérieure dont les valeurs diagonales sont positives.

Démonstration. Comme $\text{rang}(A) = n$, les colonnes de A sont libres; dès lors on peut appliquer le procédé de Gram-Schmidt à $\{a_1, \dots, a_n\}$ où a_j désigne la j -ième colonne de A . On obtient alors une base orthogonale $B = \{a'_1, \dots, a'_n\}$ avec la relation :

$$a_1 = a'_1, \quad a_j = \sum_{i=1}^{j-1} \alpha_{i,j} a'_i + a'_j$$

pour tout $j \in \{2, \dots, n\}$, et où $\alpha_{i,j}$ est le coefficient de Fourier de a_j relativement à a'_i . Grâce à ce procédé, on a pu écrire a_j comme une combinaison linéaire de $\{a'_1, \dots, a'_n\}$. On peut représenter cela avec un produit matrice-vecteur :

$$a_j = (a'_1 \ \dots \ a'_n) \begin{pmatrix} \alpha_{1,j} \\ \alpha_{2,j} \\ \vdots \\ \alpha_{j-1,j} \\ 1 \\ 0 \\ \vdots \\ 0 \end{pmatrix}.$$

En posant

$$S = \begin{pmatrix} 1 & \alpha_{1,2} & \alpha_{1,3} & \cdots & \alpha_{1,n-1} & \alpha_{1,n} \\ 0 & 1 & \alpha_{2,3} & \cdots & \alpha_{2,n-1} & \alpha_{2,n} \\ \vdots & & \ddots & & & \vdots \\ \vdots & & & \ddots & & \vdots \\ 0 & \cdots & \cdots & 0 & 1 & \alpha_{n-1,n} \\ 0 & 0 & \cdots & \cdots & 0 & 1 \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{n \times n},$$

on a, par les propriétés du produit matriciel,

$$A = A'S.$$

Il nous faut encore normaliser les colonnes de la matrice A' . Pour cela, on définit les deux matrices diagonales suivantes :

$$D = \begin{pmatrix} 1/\|a'_1\| & & \\ & \ddots & \\ & & 1/\|a'_n\| \end{pmatrix}, \quad D^{-1} = \begin{pmatrix} \|a'_1\| & & \\ & \ddots & \\ & & \|a'_n\| \end{pmatrix} \quad D, D^{-1} \in \mathbb{R}^{n \times n}$$

En posant $A^* = A'D$ et $R = D^{-1}S$ on obtient :

$$A = A^*R$$

où $A^* \in \mathbb{R}^{m \times n}$ et $R \in \mathbb{R}^{n \times n}$ sont des matrices qui vérifient les propriétés de l'énoncé. \square

Exemple 3.14. Trouver une factorisation Q, R du Corollaire 3.19 de la matrice

$$\begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 1 & -2 & 0 \\ 0 & 0 & -1 \\ 1 & 0 & 2 \end{pmatrix}$$

On trouve

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 1 & -2 & 0 \\ 0 & 0 & -1 \\ 1 & 0 & 2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & \frac{4}{3} & -\frac{4}{7} \\ 1 & -\frac{5}{3} & -\frac{2}{7} \\ 0 & 0 & -1 \\ 1 & \frac{1}{3} & \frac{6}{7} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & -\frac{1}{3} & \frac{1}{7} \\ 0 & 1 & \frac{3}{7} \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix}$$

et alors

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 1 & -2 & 0 \\ 0 & 0 & -1 \\ 1 & 0 & 2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \frac{1}{\sqrt{3}} & \frac{2\sqrt{42}}{21} & -\frac{4}{\sqrt{105}} \\ \frac{1}{\sqrt{3}} & -\frac{5}{\sqrt{42}} & -\frac{\sqrt{105}}{2} \\ 0 & 0 & -\frac{\sqrt{105}}{15} \\ \frac{1}{\sqrt{3}} & \frac{1}{\sqrt{42}} & \frac{2\sqrt{105}}{35} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \sqrt{3} & -\frac{\sqrt{3}}{3} & \sqrt{3} \\ 0 & \frac{\sqrt{42}}{3} & \frac{\sqrt{42}}{7} \\ 0 & 0 & \frac{\sqrt{105}}{7} \end{bmatrix}$$

Théorème 3.20 (Inégalité de Bessel). *Si v_1, \dots, v_n sont des vecteurs unitaires deux à deux orthogonaux et si $\alpha_i = \langle v, v_i \rangle$ sont les coefficients de Fourier de v relativement à v_i alors*

$$\sum_{i=1}^n \alpha_i^2 \leq \|v\|^2.$$

Démonstration.

$$\begin{aligned} 0 &\leq \left\langle v - \sum_{i=1}^n \alpha_i v_i, v - \sum_{i=1}^n \alpha_i v_i \right\rangle \\ &= \langle v, v \rangle - 2 \cdot \sum \alpha_i \langle v, v_i \rangle + \sum \alpha_i^2 \\ &= \langle v, v \rangle - \sum \alpha_i^2 \end{aligned}$$

\square

Exercices

1. Soit V un espace vectoriel sur \mathbb{R} de dimension fini, muni d'une forme bilinéaire $\langle \cdot, \cdot \rangle$. Soit $B = \{b_1, \dots, b_n\}$ une base orthogonale et $U = \text{span}\{b_i : i = 1, \dots, n, \langle b_i, b_i \rangle > 0\}$. Montrer que $\langle \cdot, \cdot \rangle$ restreint à U est un produit scalaire du sous-espace U .
2. Soient V un espace vectoriel muni d'une forme bilinéaire symétrique $\langle \cdot, \cdot \rangle$ et $\{v_1, \dots, v_n\} \subseteq V$ un ensemble de vecteurs deux à deux orthogonaux.
 - a) Montrer que $\{v_1, \dots, v_n\}$ est un ensemble libre si pour tout i , $\langle v_i, v_i \rangle \neq 0$.
 - b) Donner un contre-exemple ou une démonstration de la réciproque.
3. Considérant l'exemple 3.3, montrer que l'ensemble

$$\{1, \sin x, \cos x, \sin(2x), \cos(2x), \sin(3x), \cos(3x), \dots\}$$

est un ensemble de vecteurs deux à deux orthogonaux.

4. Trouver la factorisation $Q \cdot R$ du Corollaire 3.19 de la matrice

$$\begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

Trouver la factorisation de la matrice $n \times n$

$$\begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 1 & 1 & 0 & \dots & 0 \\ & & \vdots & & & \\ 0 & \dots & \dots & 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & \dots & \dots & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

5. Trouver une forme bilinéaire symétrique de \mathbb{R}^n telle qu'il existe des vecteurs $u, v \in \mathbb{R}^n$ avec $\langle u, u \rangle < 0$ et $\langle v, v \rangle > 0$.
6. Soit V un espace vectoriel sur \mathbb{R} muni d'une forme bilinéaire symétrique. S'il existe des vecteurs $u, v \in V$ tels que $\langle u, u \rangle < 0$ et $\langle v, v \rangle > 0$, il existe un vecteur $w \neq 0$ tel que $\langle w, w \rangle = 0$.
7. Montrer que l'inégalité de Bessel (Théorème 3.20) est une égalité si v est dans le sous-espace engendré par les v_1, \dots, v_n .
8. On considère l'espace euclidien des fonctions continues sur l'intervalle $[0, 1]$ muni de la forme bilinéaire symétrique

$$\langle f, g \rangle = \int_0^1 f(x)g(x) dx.$$

- i) Soit V le sous-espace engendré par $f(x) = x$ et $g(x) = x^2$. Trouver une base orthonormale de V .

- ii) Soit V le sous-espace engendré par $\{1, x, x^2\}$. Trouver une base orthonormale de V .
9. Soient V un espace euclidien, $\{u_1, \dots, u_n\}$ un ensemble orthonormal et $f, g \in \text{span}\{u_1, \dots, u_n\}$. Montrer l'identité de Parseval

$$\langle f, g \rangle = \sum_i \langle f, u_i \rangle \langle u_i, g \rangle.$$

3.5 La méthode des moindres carrées

Soient $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$ et $b \in \mathbb{R}^m$ et supposons que le système des équations linéaires

$$Ax = b \tag{3.6}$$

n'a pas de solution. Dans beaucoup d'applications, on cherche un $x \in \mathbb{R}^n$ tel que la distance entre Ax et b est *minimale*. On aimerait alors résoudre le problème d'optimisation suivant

$$\min_{x \in \mathbb{R}^n} \|Ax - b\|. \tag{3.7}$$

Pour le reste de ce paragraphe 3.5, s'il n'est pas spécifié autrement, V est toujours un espace euclidien.

Théorème 3.21. Soient v_1, \dots, v_n des vecteurs deux à deux orthogonaux et tels que $\|v_i\| > 0$ pour tout i . Soit v un élément de V et soit $\alpha_i = \langle v, v_i \rangle / \langle v_i, v_i \rangle$ la composante de v sur v_i . Pour $a_1, \dots, a_n \in \mathbb{R}$ alors

$$\left\| v - \sum_{i=1}^n \alpha_i v_i \right\| \leq \left\| v - \sum_{i=1}^n a_i v_i \right\|.$$

De plus, l'inégalité au-dessus est une égalité si et seulement si $a_i = \alpha_i$ pour tout i . Alors $\sum_{i=1}^n \alpha_i v_i$ est l'unique meilleure approximation de v par un vecteur du sous-espace engendré par les v_1, \dots, v_n .

Démonstration.

$$\begin{aligned} \left\| v - \sum_{i=1}^n a_i v_i \right\|^2 &= \left\| v - \sum_{i=1}^n \alpha_i v_i - \sum_{i=1}^n (a_i - \alpha_i) v_i \right\|^2 \\ &= \left\| v - \sum_{i=1}^n \alpha_i v_i \right\|^2 + \left\| \sum_{i=1}^n (a_i - \alpha_i) v_i \right\|^2 \end{aligned}$$

en utilisant le lemme 3.16 et le théorème de Pythagore. □

Maintenant nous pouvons décrire un *algorithme* pour résoudre le problème suivant.

Soient $v, v_1, \dots, v_n \in V$, trouver $u \in \text{span}\{v_1, \dots, v_n\}$ tel que la distance

$$\|v - u\|$$

est minimale.

Algorithme 3.2.

- i) Trouver une base orthonormale $\{u_1, \dots, u_k\}$ du sous-espace $\text{span}\{v_1, \dots, v_n\}$ avec le procédé de Gram-Schmidt.
- ii) Retourner $u = \sum_{i=1}^k \langle v, u_i \rangle u_i$.

Théorème 3.22. Soient $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$ et $b \in \mathbb{R}^m$. Les solutions du système

$$A^T A x = A^T b \tag{3.8}$$

sont les solutions optimales du problème (3.7) (où l'on considère la norme euclidienne sur \mathbb{R}^m)

Démonstration. Soit $\{a_1^*, \dots, a_k^*\}$ une base orthonormale du sous-espace $\text{Col}(A) = \{Ax : x \in \mathbb{R}^n\}$ engendré par les colonnes de A . Le théorème 3.21 implique que les solutions du problème (3.7) sont les solutions du système

$$Ax = \sum_i \langle b, a_i^* \rangle \cdot a_i^*.$$

Le lemme 3.16 implique que

$$b - \sum_i \langle b, a_i^* \rangle \cdot a_i^*$$

est perpendiculaire à tout a_i^* et dès que les a_i^* engendrent $\text{Col}(A)$ on a

$$A^T (Ax - b) = 0$$

pour toute solution optimale x de (3.7).

Maintenant, soit x une solution du système (3.8). Alors $Ax - b$ est perpendiculaire à tous les a_i^* . Le seul vecteur $v \in \text{span}\{a_1^*, \dots, a_k^*\} = \text{Col}(A)$ tel que $\langle b - v, v \rangle = 0$ est $v = \sum_i \langle a_i^*, b \rangle \cdot a_i^*$. Ceci démontre le théorème. \square

Remarque 3.23. Pour une norme $\|\cdot\|$ quelconque engendrée par un produit scalaire $\langle \cdot, \cdot \rangle$, une preuve similaire montre que les solutions du système

$$A^T F^{\langle \cdot, \cdot \rangle} A x = A^T F^{\langle \cdot, \cdot \rangle} b$$

sont les solutions optimales du problème (3.7), où $F^{\langle \cdot, \cdot \rangle}$ est la matrice du produit scalaire $\langle \cdot, \cdot \rangle$ selon la base canonique (i.e. $(F^{\langle \cdot, \cdot \rangle})_{i,j} = \langle e_i, e_j \rangle$).

Exemple 3.15. Trouver une solution de moindres carrés sur les données

$$A = \begin{pmatrix} 4 & 0 \\ 0 & 2 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \text{ et } b = \begin{pmatrix} 2 \\ 0 \\ 11 \end{pmatrix}$$

$$A^T A = \begin{pmatrix} 17 & 1 \\ 1 & 5 \end{pmatrix} \text{ et } A^T b = \begin{pmatrix} 19 \\ 11 \end{pmatrix}.$$

La solution du système

$$\begin{pmatrix} 17 & 1 \\ 1 & 5 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 19 \\ 11 \end{pmatrix}.$$

est $x^* = (1, 2)^T$.

3.6 Formes linéaires, bilinéaires et l'espace dual

Soient V un espace vectoriel sur un corps K et V^* l'ensemble des applications linéaires de V dans K , où on considère K comme espace vectoriel de dimension 1 sur lui-même. Clairement, V^* est un espace vectoriel lui-même.

Définition 3.14. L'ensemble des applications linéaires $\phi : V \rightarrow K$ est noté V^* et, muni de l'addition et de la multiplication scalaire usuelles, est appelé l'*espace dual* de V . Les éléments de V^* sont appelés *formes linéaires*.

Remarque 3.24. Soit V un espace vectoriel sur un corps K . Une application

$$f : V \times V \rightarrow K$$

est une forme bilinéaire si et seulement si pour tout $v \in V$, les applications $g, h : V \rightarrow K$ telles que $g(x) = f(v, x)$ et $h(x) = f(x, v)$ sont des formes linéaires.

Si V est de dimension finie et si $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ est une base de V , l'image d'un vecteur $x = \sum_i \alpha_i v_i$ par une forme linéaire f est

$$\begin{aligned} f(x) &= f\left(\sum_i \alpha_i v_i\right) \\ &= \sum_i \alpha_i f(v_i) \\ &= (f(v_1), \dots, f(v_n))[x]_B, \end{aligned}$$

où $[x]_B = (\alpha_1, \dots, \alpha_n)^T$ sont les coordonnées de x dans la base B .

Lemme 3.25. Supposons que V est de dimension finie et $\{v_1, \dots, v_n\}$ est une base de V . La fonction $\phi_j : V \rightarrow K$

$$\phi_j\left(\sum_i \alpha_i v_i\right) = \alpha_j$$

est une forme linéaire.

3 Formes bilinéaires

Démonstration. Immédiate. □

Théorème 3.26. *Les formes linéaires $\{\phi_j \in V^* : j = 1, \dots, n\}$ du lemme 3.25 précédent forment une base de V^* .*

Démonstration. Si, pour $\beta_i \in K$, on a $\sum_i \beta_i \phi_i = 0$, alors

$$0 = \left(\sum_i \beta_i \phi_i \right) (v_j) = \beta_j,$$

c'est-à-dire les ϕ_j sont linéairement indépendantes. Les ϕ_j engendrent V^* puisque pour $f \in V^*$, $f = \sum_i f(v_i) \phi_i$. □

Définition 3.15. La base $\{\phi_1, \dots, \phi_n\}$ est la *base duale* de la base $\{v_1, \dots, v_n\}$.

Lemme 3.27. *Soit V un espace vectoriel sur le corps K de dimension finie muni d'une forme bilinéaire non dégénérée et soit $f : V \rightarrow K$ une forme linéaire. Il existe un $v \in V$ tel que $f(x) = \langle v, x \rangle$ pour tout $x \in V$.*

Démonstration. Soient $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ une base de V et $A_B^\diamond \in K^{n \times n}$ la matrice dans la base B associée à la forme bilinéaire. Soit $a \in K^n$ tel que $f(x) = a^T [x]_B$ pour tout $x \in V$. Dès que A_B^\diamond est de rang plein (Proposition 3.1), alors il existe $v \in V$ tel que $[v]_B^T A_B^\diamond = a^T$. Ceci revient à résoudre un système d'équations linéaires (cf semestre 1) et comme la matrice A_B^\diamond est de rang plein, on a l'existence (et même l'unicité) d'une solution, i.e., $[v]_B^T A_B^\diamond = a^T$. Ainsi $f(x) = \langle v, x \rangle$ pour tout $x \in V$. □

Théorème 3.28 (Supplémentaire orthogonal). *Soient V un espace vectoriel de dimension finie sur corps K et W un sous-espace de V . Soit $\langle \cdot \rangle$ une forme bilinéaire symétrique tel que, si restreint sur $W \times W$, elle est non dégénérée. Alors $V = W \oplus W^\perp$.*

Démonstration. Pour un élément $u \in W \cap W^\perp$ on a $\langle u, w \rangle = 0$ pour tout $w \in W$. Dès que $\langle \cdot \rangle$ est non dégénéré sur W on a $u = 0$, alors $W \cap W^\perp = \{0\}$.

Il reste à démontrer que $V = W + W^\perp$. Pour $v \in V$ le lemme 3.27 implique qu'il existe un $w_0 \in W$ tel que pour tout $u \in W$, $\langle u, v \rangle = \langle u, w_0 \rangle$ et ça démontre $v - w_0 \in W^\perp$ et alors $v \in W + W^\perp$. □

Exercices

1. Soient V un espace vectoriel de dimension finie, $f : V \rightarrow K$ une forme linéaire et B, B' des bases de V . Soit

$$f(x) = a^T [x]_B$$

où $a \in K^n$. Décrire $f(x)$ en termes de $P_{B'B}$ et $[x]_{B'}$.

3.7 Formes sesquilinéaires et produits hermitiens

2. Soient V un espace vectoriel de dimension finie, $f : V \times V \rightarrow K$ une forme bilinéaire et B, B' des bases de V . Soit

$$f(x, y) = [y]_B^T A_B^f [x]_B.$$

Décrire $f(x, y)$ en termes de $P_{B'B}$, $[x]_{B'}$, et $[y]_{B'}$.

3. On considère les vecteurs

$$v_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} \text{ et } v_2 = \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix} \in \mathbb{Z}_2^4$$

et la forme bilinéaire standard. Trouver une base du $\text{span}\{v_1, v_2\}^\perp$. Est-ce que $\mathbb{Z}_2^4 = \text{span}\{v_1, v_2\} \oplus \text{span}\{v_1, v_2\}^\perp$?

4. Soit $V \subseteq \mathbb{R}[x]$ l'espace euclidien des polynômes de degré au plus n muni du produit scalaire $\langle p, q \rangle = \int_0^1 p(x)q(x) dx$. Décrire la matrice $A_B^\langle \cdot \rangle$ pour $B = \{1, x, \dots, x^n\}$.
5. Soit V un espace vectoriel sur un corps K et soient $f, g \in V^* \setminus \{0\}$ linéairement indépendants. Montrer que

$$\ker f \cap \ker g$$

est de dimension $n - 2$.

6. Soit V un espace vectoriel de dimension finie sur un corps K et soit $\langle \cdot \rangle$ une forme bilinéaire symétrique. Exprimez $(W_1 + W_2)^\perp$ et $(W_1 \cap W_2)^\perp$ en fonction de W_1^\perp et W_2^\perp .
7. Donner un exemple d'un espace vectoriel V muni d'un produit scalaire dégénéré et d'un sous-espace $W \subseteq V$ tel que V n'est pas la somme directe de W et W^\perp .

3.7 Formes sesquilinéaires et produits hermitiens

Maintenant nous considérons le cas $K = \mathbb{C}$. Il faut un peu modifier la définition d'un produit scalaire pour obtenir des résultats similaires à ceux des sections précédentes. Le carré de la longueur d'un vecteur

$$v = \begin{pmatrix} a_1 + i \cdot b_1 \\ \vdots \\ a_n + i \cdot b_n \end{pmatrix} \in \mathbb{C}^n$$

où $a_i, b_i \in \mathbb{R}$, est égal à

$$\sum_i (a_i^2 + b_i^2) = \sum_i (a_i + ib_i) \cdot (a_i - ib_i) = \sum_i v_i \cdot \bar{v}_i,$$

où $v_i = a_i + i \cdot b_i$ et \bar{v}_i est la conjugaison de v_i . Ceci suggère la définition suivante.

3 Formes bilinéaires

Définition 3.16. Soit V un espace vectoriel sur un corps \mathbb{C} et

$$\langle, \rangle : V \times V \longrightarrow \mathbb{C}$$

une correspondance qui à tout couple (v, w) d'éléments de V associe un nombre complexe, noté $\langle v, w \rangle$. En considérant les propriétés suivantes :

PH 1 On a $\langle v, w \rangle = \overline{\langle w, v \rangle}$ pour tout $v, w \in V$.

PH 2 Si u, v et w sont des éléments de V ,

$$\langle u, v + w \rangle = \langle u, v \rangle + \langle u, w \rangle \text{ et } \langle v + w, u \rangle = \langle v, u \rangle + \langle w, u \rangle$$

PH 3 Si $x \in \mathbb{C}$ et $u, v \in V$,

$$\langle x \cdot u, v \rangle = x \langle u, v \rangle \text{ et } \langle u, x \cdot v \rangle = \bar{x} \cdot \langle u, v \rangle.$$

on dit que \langle, \rangle est

- i) une *forme sesquilinéaire*, si \langle, \rangle satisfait PH 2 et PH 3.
- ii) une *forme hermitienne*, si \langle, \rangle satisfait PH 1, PH 2 et PH 3.
- iii) un *produit hermitien*, si \langle, \rangle satisfait PH 1, PH 2 et PH 3 et

$$\langle v, v \rangle > 0, \text{ pour tout } v \in V \setminus \{0\}.$$

Une forme sesquilinéaire est *non dégénérée à gauche* si la condition suivante est vérifiée.

Si $v \in V$ et si $\langle v, w \rangle = 0$ pour tout $w \in V$, alors $v = 0$.

Remarque 3.29. Si \langle, \rangle est une forme hermitienne, pour tout $v \in V$, on a $\langle v, v \rangle \in \mathbb{R}$ dès que $\langle v, v \rangle = \overline{\langle v, v \rangle}$ par PH 1. On dit que la forme hermitienne est *définie positif* si $\langle v, v \rangle > 0$ pour tout $v \in V \setminus \{0\}$. Alors un produit hermitien est une forme hermitienne définie positif.

Exemple 3.16. Le produit *hermitien standard* de \mathbb{C}^n

$$\langle u, v \rangle = \sum_i u_i \bar{v}_i$$

satisfait les condition PH 1-3 et est défini positif.

Les notions d'*orthogonalité*, de *perpendicularité*, de *base orthogonale* et de *supplémentaire orthogonal* sont définies comme avant. Par contre, les notions de *coefficients de Fourier* et la *projection de v sur w* doivent être modifiés : les coefficients de Fourier dans le cadre d'un \mathbb{C} -espace vectoriel sont les conjugués complexes des coefficients de Fourier de base.

Exemple 3.17. Soit V l'espace vectoriel des fonctions $f: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{C}$ continues sur l'intervalle $[0, 2\pi]$. Pour $f, g \in V$ on pose

$$\langle f, g \rangle = \int_0^{2\pi} f(x)\overline{g(x)} dx.$$

C'est un produit hermitien défini positif. Les fonctions $f_n(x) = e^{inx}$ pour $n \in \mathbb{Z}$ sont orthogonales dès que

$$f_n(x)\overline{f_m(x)} = e^{i(n-m)x} = \cos((n-m)x) + i \cdot \sin((n-m)x)$$

et alors

$$\langle f_n, f_n \rangle = \int_0^{2\pi} 1 dx = 2\pi$$

et pour $n \neq m$

$$\langle f_n, f_m \rangle = \int_0^{2\pi} \cos((n-m)x) dx + i \cdot \int_0^{2\pi} \sin((n-m)x) dx = 0.$$

Pour $f \in V$ la composante de f sur f_n , ou le coefficient de Fourier de f relativement à f_n , est

$$\frac{\langle f, f_n \rangle}{\langle f_n, f_n \rangle} = \frac{1}{2\pi} \cdot \int_0^{2\pi} f(x)e^{-inx} dx.$$

Soient V un espace vectoriel sur \mathbb{C} de dimension finie et $f: V \times V \rightarrow \mathbb{C}$ une forme sesquilinéaire. Pour une base $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ de V et $x = \sum_i \alpha_i v_i$ et $y = \sum_i \beta_i v_i$ on a

$$\langle x, y \rangle = \sum_{ij} \alpha_i \overline{\beta_j} f(v_i, v_j)$$

et avec la matrice $A_B^f = (f(v_i, v_j))_{1 \leq i, j \leq n}$ alors

$$\langle x, y \rangle = [x]_B^T A_B^f \overline{[y]_B} \tag{3.9}$$

où pour un vecteur $v \in \mathbb{C}^n$ le vecteur \overline{v} est tel que $(\overline{v})_i = \overline{(v)_i}$ pour tout i . Pour une matrice $A \in \mathbb{C}^{m \times n}$, $\overline{A} \in \mathbb{C}^{m \times n}$ est la matrice telle que $(\overline{A})_{ij} = \overline{(A_{ij})}$ pour out i, j .

Définition 3.17. Une matrice $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ est appelée *hermitienne* si on a

$$A = \overline{A^T}.$$

Proposition 3.30. Soit V un espace vectoriel sur \mathbb{C} de dimension finie et soit B une base de V . Une forme sesquilinéaire f est une forme hermitienne si et seulement si A_B^f est hermitienne.

Définition 3.18. Deux matrices $A, B \in \mathbb{C}^{n \times n}$ sont *congruentes complexes* s'il existe une matrice inversible $P \in \mathbb{C}^{n \times n}$ telle que $A = P^T \cdot B \cdot \overline{P}$. Nous écrivons $A \cong_{\mathbb{C}} B$.

3 Formes bilinéaires

$\cong_{\mathbb{C}}$ est aussi une relation d'équivalence. On peut aussi modifier l'algorithme 3.1 tel qu'il calcule une matrice diagonale congruente complexe par rapport à une matrice hermitienne $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, voir l'exercice 6. Alors on a le théorème suivant.

Théorème 3.31. *Soit V un espace vectoriel sur \mathbb{C} de dimension finie, muni d'une forme hermitienne. Alors V possède une base orthogonale.*

Démonstration. Soit $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ une base de V . Pour $x, y \in V$ on a

$$\langle x, y \rangle = [x]_B^T A_B \overline{[y]_B}.$$

Soit $P \in \mathbb{C}^{n \times n}$ inversible telle que

$$P^T A \overline{P} = \begin{pmatrix} c_1 & & \\ & \ddots & \\ & & c_n \end{pmatrix}.$$

La base orthogonale est w_1, \dots, w_n dont $[w_j]_B$ est la j -ème colonne de P ,

$$[w_j]_B = \begin{pmatrix} p_{1j} \\ \vdots \\ p_{nj} \end{pmatrix},$$

alors $w_j = \sum_{i=1}^n p_{ij} v_i$.

□

Exemple 3.18. On considère la matrice hermitienne

$$A = \begin{bmatrix} 0 & -i & 3+4i \\ i & -2 & 12 \\ 3-4i & 12 & 5 \end{bmatrix}$$

et le but est de trouver une matrice inversible $P \in \mathbb{C}^{3 \times 3}$ telle que

$$P^T \cdot A \cdot \overline{P}$$

est une matrice diagonale. Nous échangeons la première et la deuxième colonne ainsi que la première et la deuxième ligne et obtenons

$$\begin{bmatrix} -2 & i & 12 \\ -i & 0 & 3+4i \\ 12 & 3-4i & 5 \end{bmatrix}.$$

Après on transforme

$$\begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ -0.5i & 1 & 0 \\ 6 & 0 & 1 \end{bmatrix} \cdot \begin{bmatrix} -2 & i & 12 \\ -i & 0 & 3+4i \\ 12 & 3-4i & 5 \end{bmatrix} \cdot \begin{bmatrix} 1 & 0.5i & 6 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -2 & 0 & 0 \\ 0 & 0.5 & 3-2i \\ 0 & 3+2i & 77 \end{bmatrix}$$

La prochaine transformation est

$$\begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & -6 - 4i & 1 \end{bmatrix} \cdot \begin{bmatrix} -2 & 0 & 0 \\ 0 & 0.5 & 3 - 2i \\ 0 & 3 + 2i & 77 \end{bmatrix} \cdot \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & -6 + 4i \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -2 & 0 & 0 \\ 0 & 0.5 & 0 \\ 0 & 0 & 51 \end{bmatrix}.$$

Pour

$$P = \begin{bmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} \cdot \begin{bmatrix} 1 & -0.5i & 6 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} \cdot \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & -6 - 4i \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix}$$

on obtient

$$P^T \cdot A \cdot \bar{P} = \begin{bmatrix} -2 & 0 & 0 \\ 0 & 0.5 & 0 \\ 0 & 0 & 51 \end{bmatrix}.$$

Exercices

- Soit V un espace vectoriel sur \mathbb{C} et $f : V \times V \rightarrow \mathbb{C}$ une application satisfaisant les axiomes
 - On a $f(v, w) = \overline{f(w, v)}$ pour tout $v, w \in V$.
 - Si u, v et w sont des éléments de V ,

$$f(u, v + w) = f(u, v) + f(u, w)$$

- Si $x \in \mathbb{C}$ et $u, v \in V$,

$$f(x \cdot u, v) = x f(u, v).$$

Montrer que f est une forme hermitienne.

- Soit V un espace vectoriel sur \mathbb{C} de dimension finie et $f : V \times V \rightarrow \mathbb{C}$ une forme sesquilinéaire. Pour une base $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ de V et $x = \sum_i \alpha_i v_i$ et $y = \sum_i \beta_i v_i$ montrer en détail que

$$\langle x, y \rangle = [x]_B^T A_B^f \overline{[y]_B}$$

avec la matrice $A_B^f = (f(v_i, v_j))_{1 \leq i, j \leq n}$. Indiquez l'application des axiomes PH 2) et PH 3) dans les pas correspondants.

- Démontrer la proposition 3.30.
- Soit V un espace vectoriel sur \mathbb{C} de dimension n et soit $\langle \cdot \rangle$ une forme sesquilinéaire. Montrer que $\langle \cdot \rangle$ est non dégénéré si et seulement si $\text{rang}(A_B^{\langle \cdot \rangle}) = n$ pour chaque base B de V .
- Montrer que $\cong_{\mathbb{C}}$ est une relation d'équivalence.
- Modifier l'algorithme 3.1 afin qu'il calcule une matrice diagonale congruente complexe par rapport à une matrice hermitienne $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$.

3 Formes bilinéaires

7. Soient V un espace vectoriel sur \mathbb{C} et $\dim(V) = 3$ et $B = \{v_1, v_2, v_3\}$ une base de V . Avec les matrices $A_i \in \mathbb{C}^{3 \times 3}$ décrites en bas et les applications $f_i(x, y) = [x]_B^T A_i [y]_B$, cocher ce qui s'applique.

	A_1	A_2	A_3
forme sesquilinéaire	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
forme hermitienne	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

$$A_1 = \begin{pmatrix} 2 & 1 & 3 \\ 1 & 0 & 2 \\ 3 & 2 & 0 \end{pmatrix}, A_2 = \begin{pmatrix} 2 & 1+i & 3 \\ 1 & 0 & 2 \\ 3 & 2 & 0 \end{pmatrix}, A_3 = \begin{pmatrix} 2 & 1+2 \cdot i & 3-i \\ 1-2 \cdot i & 0 & 2-i \\ 3-i & 2+i & 0 \end{pmatrix}.$$

3.8 Espaces hermitiens

Pour le reste de ce paragraphe, s'il n'est pas spécifié autrement, V est toujours un espace vectoriel sur \mathbb{C} muni d'un produit hermitien. Alors V est un espace hermitien.

Définition 3.19. Soit $\langle \cdot, \cdot \rangle$ un produit hermitien défini positif. La *longueur* ou la *norme* d'un élément $v \in V$ est le nombre

$$\|v\| = \sqrt{\langle v, v \rangle}.$$

Un élément $v \in V$ est un *vecteur unitaire* si $\|v\| = 1$.

Aussi, l'inégalité de Cauchy-Schwarz est démontrée comme avant :

$$|\langle u, v \rangle| \leq \|u\| \|v\|. \quad (3.10)$$

Les propriétés suivantes sont facilement vérifiées :

- i) Pour tout $v \in V$, $\|v\| \geq 0$ et $\|v\| = 0$ si et seulement si $v = 0$.
- ii) Pour $\alpha \in \mathbb{C}$ et $v \in V$ on a $\|\alpha \cdot v\| = |\alpha| \cdot \|v\|$.
- iii) Pour chaque $u, v \in V$ $\|u + v\| \leq \|u\| + \|v\|$.

Aussi, nous avons le théorème de Pythagore, l'inégalité de Bessel et la règle du parallélogramme. L'équivalent du procédé de Gram-Schmidt pour les espaces hermitiens est comme suit.

Théorème 3.32 (Le procédé d'orthogonalisation de Gram-Schmidt). *Soit V un espace hermitien et $\{v_1, \dots, v_n\} \subseteq V$ un ensemble libre. Il existe un ensemble libre orthogonal $\{u_1, \dots, u_n\}$ de V tel que pour tout i , $\{v_1, \dots, v_i\}$ et $\{u_1, \dots, u_i\}$ engendrent le même sous-espace de V .*

Comme avant, une base orthonormale est une base orthogonale consistant de vecteurs unitaires et le procédé de Gram-Schmidt nous donne le corollaire suivant.

Corollaire 3.33. *Soit V un espace hermitien de dimension finie. V possède alors une base orthonormale.*

Exercices

1. (Composante de u sur v ; indépendance de la direction) Soient $u, v \in V$ tel que $\langle v, v \rangle \neq 0$. Montrer qu'il existe un seul $\alpha \in \mathbb{C}$ tel que

$$\langle u - \alpha \cdot v, v \rangle = 0.$$

Pour ce α on a

$$\langle v, u - \alpha \cdot v \rangle = 0.$$

2. Montrer l'inégalité de Cauchy-Schwarz.
3. Montrer l'inégalité triangulaire iii).
4. Montrer qu'un espace hermitien de dimension finie possède une base B telle que $\langle x, y \rangle = [x]_B^T \cdot \overline{[y]_B}$, où \cdot est le produit hermitien standard.

4 Le théorème spectral et la décomposition en valeurs singulières

Dans ce chapitre, nous allons étudier les espaces euclidiens et hermitiens d'une manière plus profonde. Lorsque l'on parle de \mathbb{C} ou de \mathbb{R} , nous allons utiliser la lettre \mathbb{K} pour dénoter \mathbb{C} ou \mathbb{R} . On va rappeler quelques notions importantes du cours du premier semestre. Un *endomorphisme* est une application linéaire $f: V \rightarrow V$. Si V est un espace vectoriel de dimension finie et si $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ est une base de V , on a

$$f(x) = \phi_B^{-1}(A_B \phi_B(x)),$$

où ϕ_B est l'isomorphisme $\phi_B: V \rightarrow K^n$, $\phi_B(x) = [x]_B$ sont les coordonnées de x par rapport à la base B . On a le diagramme suivant

$$\begin{array}{ccc} V & \xrightarrow{f} & V \\ \downarrow \phi_B & & \downarrow \phi_B \\ K^n & \xrightarrow{A_B \cdot x} & K^n \end{array}$$

Les colonnes de la matrice A_B sont les coordonnées de $f(v_1), \dots, f(v_n)$ dans la base B . Une matrice $A \in K^{n \times n}$ est *diagonalisable* s'il existe une matrice inversible $P \in K^{n \times n}$ telle que $P^{-1} \cdot A \cdot P$ est une matrice diagonale.

4.1 Les endomorphismes auto-adjoints

Dans ce paragraphe 4.1, V est toujours un espace euclidien ou un espace hermitien de dimension finie.

Définition 4.1. Un endomorphisme F est *auto-adjoint* si

$$\langle F(v), w \rangle = \langle v, F(w) \rangle \text{ pour tous } v, w \in V.$$

Théorème 4.1. Soient $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ une base orthonormale de V et F un endomorphisme. Alors F est auto-adjoint si et seulement si sa matrice A_B dans la base B est symétrique ($\mathbb{K} = \mathbb{R}$) ou hermitienne ($\mathbb{K} = \mathbb{C}$).

4 Le théorème spectral et la décomposition en valeurs singulières

Démonstration. On traite seulement le cas $\mathbb{K} = \mathbb{C}$. Le cas $\mathbb{K} = \mathbb{R}$ est démontré d'une manière analogue. Nous avons, où \cdot dénote le produit hermitien standard,

$$\langle F(v), w \rangle = (A_B[v]_B) \cdot [w]_B = [v]_B^T A_B^T \overline{[w]_B},$$

et

$$\langle v, F(w) \rangle = [v]_B^T \overline{A_B[w]_B}.$$

Alors si $\overline{A_B} = A_B^T$, il est clair que $\langle F(v), w \rangle = \langle v, F(w) \rangle$ et donc F est auto-adjoint.

Et si F est auto-adjoint, en choisissant $v = v_i$, $w = v_j$, on obtient

$$\langle F(v_i), v_j \rangle = e_i^T A_B^T e_j = (A_B^T)_{i,j} = \langle v_i, F(v_j) \rangle = e_i^T \overline{A_B} e_j = (\overline{A_B})_{i,j},$$

donc $A_B^T = \overline{A_B}$ □

Lemme 4.2. Soit $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ une matrice hermitienne. Les valeurs propres de A sont réelles.

Démonstration. Soient $\lambda \in \mathbb{C}$ une valeur propre et $v \neq 0$ son vecteur propre. Alors

$$\lambda v^T \bar{v} = v^T A^T \bar{v} = v^T \overline{A} \bar{v} = \bar{\lambda} v^T \bar{v}.$$

□

Corollaire 4.3. Soit F un endomorphisme auto-adjoint, alors toutes ses valeurs propres sont réelles.

Démonstration. Soit $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ une base orthonormale. Les valeurs propres de F sont les valeurs propres de la matrice hermitienne A_B . □

Corollaire 4.4. Une matrice symétrique $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ (hermitienne $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$) a une valeur propre réelle.

Démonstration. Le polynôme caractéristique $p(x) = \det(A - x \cdot I_n)$ a une racine complexe selon le théorème fondamental de l'algèbre. Les valeurs propres de A sont les racines de $p(x)$. Mais toutes ces racines sont réelles selon le corollaire 4.3. □

Remarque 4.5. La même preuve, par le théorème fondamental de l'algèbre, montre en fait que le polynôme caractéristique de A est scindé sur \mathbb{R} , i.e. A possède n valeurs propres réelles (en comptant les multiplicités algébriques).

Lemme 4.6. Soient F un endomorphisme auto-adjoint et $u, v \neq 0$ deux vecteurs propres dont leurs valeurs propres sont différentes, alors $\langle u, v \rangle = 0$.

Démonstration. Soient $\lambda \neq \gamma$ les valeurs propres correspondant aux vecteurs propres $u, v \neq 0$ respectivement. Puisque $\lambda, \gamma \in \mathbb{R}$ on a

$$\lambda \langle u, v \rangle = \langle F(u), v \rangle = \langle u, F(v) \rangle = \gamma \langle u, v \rangle$$

et alors $\langle u, v \rangle = [u]_B \cdot [v]_B = 0$, où \cdot dénote le produit scalaire/hermitien standard et B est une base orthonormale de V . □

4.1 Les endomorphismes auto-adjoints

Définition 4.2. Une matrice inversible $U \in \mathbb{R}^{n \times n}$ est *orthogonale* si $U^{-1} = U^T$. Une matrice inversible $U \in \mathbb{C}^{n \times n}$ est *unitaire* si $U^{-1} = \overline{U}^T$.

Si U est orthogonale (unitaire), les colonnes de U sont une base orthonormale de \mathbb{R}^n (\mathbb{C}^n), où l'orthonormalité est entendue au sens du produit scalaire (hermitien) standard.

Notation. Nous allons écrire A^* pour dénoter \overline{A}^T pour une matrice A .

Théorème 4.7 (Théorème spectral). Soit $A \in \mathbb{K}^{n \times n}$ une matrice symétrique (hermitienne), alors A est diagonalisable avec une matrice orthogonale (unitaire) $P \in \mathbb{K}^{n \times n}$ telle que

$$P^* \cdot A \cdot P = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & \\ & \ddots & \\ & & \lambda_n \end{pmatrix} \quad (4.1)$$

où $\lambda_1, \dots, \lambda_n \in \mathbb{R}$ sont les valeurs propres de A .

Démonstration. Soit $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ une matrice symétrique. Le cas où $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ est hermitienne est laissé en exercice.

Le théorème est démontré par induction. Si $n = 1$, l'assertion est triviale.

Supposons le théorème vrai jusqu'à $n - 1 \in \mathbb{N}$, $n \geq 2$. Montrons le pour n .

Soit $\lambda_1 \in \mathbb{R}$ une valeur propre de A et $v \neq 0 \in \mathbb{R}^n$ un vecteur propre correspondant à λ_1 . Avec la méthode de Gram-Schmidt, on peut trouver une base orthonormale $\{v, u_2, \dots, u_n\}$ dans \mathbb{R}^n . Soit $U \in \mathbb{R}^{n \times n-1}$ la matrice dont les colonnes sont u_2, \dots, u_n . On considère la matrice

$$U^T \cdot A \cdot U \in \mathbb{R}^{n-1 \times n-1}.$$

Cette matrice est symétrique. En effet :

$$(U^T \cdot A \cdot U)^T = U^T \cdot A^T \cdot (U^T)^T = U^T \cdot A \cdot U,$$

car A est symétrique. Par hypothèse d'induction, cette matrice peut être diagonalisée avec une matrice orthogonale $K \in \mathbb{R}^{n-1 \times n-1}$, alors

$$K^T \cdot U^T \cdot A \cdot U \cdot K = \begin{pmatrix} \lambda_2 & & \\ & \ddots & \\ & & \lambda_n \end{pmatrix}.$$

Maintenant, soit $P \in \mathbb{R}^{n \times n}$ la matrice

$$P = (v, U K) \in \mathbb{R}^{n \times n}$$

La matrice P est orthogonale puisque

$$P^T P = \begin{pmatrix} v^T v & v^T U K \\ (U K)^T v & (U K)^T (U K) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & & \\ & \ddots & \\ & & 1 \end{pmatrix}.$$

4 Le théorème spectral et la décomposition en valeurs singulières

car $v^T \cdot v = 1$, $U^T \cdot U = I_{n-1}$ et $v^T \cdot U = 0$. Et

$$P^T A P = \begin{pmatrix} v^T A \\ K^T U^T A \end{pmatrix} \begin{pmatrix} v & U K \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & \\ & \ddots & \\ & & \lambda_n \end{pmatrix}$$

□

Corollaire 4.8. Soit V un espace euclidien (hermitien) de dimension finie et F un endomorphisme auto-adjoint. Alors V possède une base $\{v_1, \dots, v_n\}$ orthonormale de vecteurs propre de F .

Démonstration. Soit $B = \{u_1, \dots, u_n\}$ une base de V tel que $\langle x, y \rangle = [x]_B \cdot [y]_B$ où \cdot dénote le produit hermitien standard (voir chapitre 3.8, exercice 4) et soit $A_B^{(F)}$ la matrice symétrique (hermitienne) telle que $F(x) = \phi_B^{-1}(A_B^{(F)}[x]_B)$. Selon théorème 4.7, $A_B^{(F)}$ est diagonalisable avec une matrice orthogonale (unitaire) P

$$P^* \cdot A_B^{(F)} \cdot P = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & \\ & \ddots & \\ & & \lambda_n \end{pmatrix}$$

Soient p_1, \dots, p_n les colonnes de P . La base orthonormale de vecteurs propres de F est $\{v_1, \dots, v_n\}$ où $v_i = \phi_B^{-1}(p_i)$. □

Comment peut-on calculer la diagonalisation (4.1) ? Voici un procédé pour diagonaliser une matrice symétrique (hermitienne) $A \in \mathbb{K}^{n \times n}$.

- i) Trouver les racines $\lambda_1, \dots, \lambda_k \in \mathbb{R}$ du polynôme caractéristique

$$p(x) = \det(A - x \cdot I).$$

- ii) Pour tout $j \in \{1, \dots, k\}$:

- a) Trouver une base $b_1^{(j)}, \dots, b_{d_j}^{(j)}$ du noyau de la matrice $A - \lambda_j I$, par exemple avec l'algorithme de Gauss.
 b) Trouver une base orthonormale $p_1^{(j)}, \dots, p_{d_j}^{(j)}$ du $\text{span}\{b_1^{(j)}, \dots, b_{d_j}^{(j)}\}$, par exemple avec le procédé de Gram-Schmidt.

iii) $P = \left(p_1^{(1)}, \dots, p_{d_1}^{(1)}, \dots, p_1^{(k)}, \dots, p_{d_k}^{(k)} \right)$

Exemple 4.1. Soit V un espace euclidien de dimension 3 et soit F un endomorphisme auto-adjoint de V . Soit $B = \{v_1, v_2, v_3\}$ une base orthonormale telle que

$$A_B = \begin{pmatrix} 3 & -2 & 4 \\ -2 & 6 & 2 \\ 4 & 2 & 3 \end{pmatrix}$$

4.2 Formes quadratiques réelles et matrices symétriques réelles

Trouver une base orthonormale qui se compose des vecteurs propres.

Le polynôme caractéristique de A_B est

$$p(x) = \det(A_B - xI) = -x^3 + 12x^2 - 21x - 98 = -(x-7)^2(x+2)$$

On trouve les bases des espaces propres

$$\lambda_1 = 7: b_1^{(1)} = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}, b_2^{(1)} = \begin{pmatrix} -1/2 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix} \quad \text{et} \quad \lambda_2 = -2: b_1^{(2)} = \begin{pmatrix} -1 \\ -1/2 \\ 1 \end{pmatrix}$$

Les vecteurs $b_1^{(1)}$ et $b_2^{(1)}$ ne sont pas orthogonaux. Le procédé de Gram-Schmidt produit $b_2^{(1)*} = (-1/4, 1, 1/4)^T$. Les vecteurs $b_1^{(1)}, b_2^{(1)*}, b_1^{(2)}$ sont une base orthogonale de vecteurs propres. Maintenant il reste à les normaliser et on obtient

$$p_1^{(1)} = \begin{bmatrix} \frac{\sqrt{2}}{2} \\ 0 \\ \frac{\sqrt{2}}{2} \end{bmatrix}, p_2^{(1)} = \begin{bmatrix} -\frac{\sqrt{2}}{6} \\ \frac{2\sqrt{2}}{3} \\ \frac{\sqrt{2}}{6} \end{bmatrix}, p_1^{(2)} = \begin{bmatrix} -\frac{2}{3} \\ -\frac{1}{3} \\ \frac{2}{3} \end{bmatrix}.$$

Alors $\left\{ \frac{\sqrt{2}}{2}v_1 + \frac{\sqrt{2}}{2}v_3, -\frac{\sqrt{2}}{6}v_1 + \frac{2\sqrt{2}}{3}v_2 + \frac{\sqrt{2}}{6}v_3, -\frac{2}{3}v_1 - \frac{1}{3}v_2 + \frac{2}{3}v_3 \right\}$ est une base orthonormale de vecteurs propre de F .

Exercices

1. Soit $z = x + iy \in \mathbb{C}^n$, où $x, y \in \mathbb{R}^n$. Montrer que x et y sont linéairement indépendants sur \mathbb{R} si et seulement si z et \bar{z} sont linéairement indépendants sur \mathbb{C} .

4.2 Formes quadratiques réelles et matrices symétriques réelles

Le lemme 4.2 et le corollaire 4.4 démontrent qu'une matrice symétrique réelle possède une valeur propre réelle. Cette démonstration passe par les nombres complexes et utilise le théorème fondamental de l'algèbre. Pour le cas où $A = A^T \in \mathbb{R}^{n \times n}$, nous allons maintenant démontrer l'assertion du corollaire 4.4 d'une manière géométrique. L'ensemble

$$S^{n-1} = \{x \in \mathbb{R}^n: \|x\| = 1\}$$

est appelé la n -sphère.

Définition 4.3. Une *forme quadratique* est une fonction $f: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$, $f(x) = x^T A x$ où $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ est une matrice symétrique.

4 Le théorème spectral et la décomposition en valeurs singulières

En fait, si $B \in \mathbb{R}^{n \times n}$ n'est pas symétrique, la matrice $A = 1/2(B^T + B)$ est symétrique et $x^T Bx = 1/2(x^T B^T x + x^T Bx) = x^T Ax$. Alors la fonction $g(x) = x^T Bx$ est aussi une forme quadratique.

Une forme quadratique est un polynôme de degré 2 et une fonction continue. Puisque S^{n-1} est compact et $f(x)$ est continue, $f(x)$ possède un maximum sur S^{n-1} . Nous sommes prêts à démontrer le lemme d'une manière géométrique.

Lemme 4.9. Soient $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ une matrice symétrique et $v \in S^{n-1}$ le maximum de la fonction $f(x) = x^T Ax$ sur S^{n-1} . On a $Av = \lambda v$ pour un $\lambda \in \mathbb{R}$. En particulier, A possède une valeur propre réelle.

Démonstration. Supposons qu'il n'existe pas de $\lambda \in \mathbb{R}$ tel que $Av = \lambda v$. Alors, en particulier, $Av \neq 0$ et on peut écrire

$$Av = \alpha v + \beta w$$

où $w \in S^{n-1}$, $w \perp v$ et $\beta \neq 0$. Pour $x \in [-1, 1]$ on a

$$\sqrt{(1-x^2)}v + xw \in S^{n-1}.$$

On voit facilement que $\|\sqrt{(1-x^2)}v + xw\| = 1$ en utilisant le fait que $v \perp w$, et $v, w \in S^{n-1}$. Nous considérons la fonction $g: [-1, 1] \rightarrow \mathbb{R}$

$$g(x) = \left(\sqrt{(1-x^2)}v + xw \right)^T A \left(\sqrt{(1-x^2)}v + xw \right).$$

Notons que $g(0) = f(v)$, donc si v maximise f sur la n -sphère, en particulière $x = 0$ doit maximiser $g(x)$ dans l'intervalle $[-1, 1]$. Si on démontre que $g'(0) \neq 0$, nous avons déduit une contradiction et la démonstration est faite.

Comme $w^T Av = v^T Aw$, clairement

$$g(x) = (1-x^2)v^T Av + (2 \cdot \sqrt{(1-x^2)} \cdot x) w^T Av + x^2 w^T Aw.$$

Ceci démontre que $g'(0) = 2 \cdot w^T Av = 2 \cdot \beta \neq 0$.

□

Définition 4.4. Une matrice symétrique $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ est

- définie positive, si $x^T Ax > 0$ pour tout $x \in \mathbb{R}^n \setminus \{0\}$
- définie négative, si $x^T Ax < 0$ pour tout $x \in \mathbb{R}^n \setminus \{0\}$
- semi-définie positive, si $x^T Ax \geq 0$ pour tout $x \in \mathbb{R}^n$
- semi-définie négative, si $x^T Ax \leq 0$ pour tout $x \in \mathbb{R}^n$.

La forme quadratique $x^T Ax$ correspondante est appelée définie positive, définie négative, semi-définie positive ou semi-définie négative, en accord avec A .

Théorème 4.10. Une matrice symétrique $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ est

1. définie positive, si et seulement si toutes ses valeurs propres sont strictement positives.

4.2 Formes quadratiques réelles et matrices symétriques réelles

2. *définie négative, si et seulement si toutes ses valeurs propres sont strictement négatives.*
3. *semi-définie positive, si et seulement si toutes ses valeurs propres sont positives (ou zéro).*
4. *semi-définie négative, si et seulement si toutes ses valeurs propres sont négatives (ou zéro).*

Démonstration. D'après le théorème 4.7 il existe une matrice orthogonale $U \in \mathbb{R}^{n \times n}$ telle que

$$A = U \begin{pmatrix} \lambda_1 & & \\ & \ddots & \\ & & \lambda_n \end{pmatrix} U^T. \quad (4.2)$$

où les λ_i sont les valeurs propres de A . Les colonnes u_1, \dots, u_n de U forment une base orthonormale de \mathbb{R}^n de vecteurs propres de A . Soit $x \in \mathbb{R}^n$, alors $x = \sum_i \alpha_i u_i$ et

$$x^T A x = \sum_i (\alpha_i^2) \lambda_i.$$

D'ici l'assertion suit directement. □

Le *k-mineur principal* d'une matrice A est le déterminant de la matrice qui est construite en choisissant les premières k lignes et colonnes de A ; c'est-à-dire $\det(B_k)$ où $B_k \in \mathbb{R}^{k \times k}$ telle que $b_{ij} = a_{ij}$, $1 \leq i, j \leq k$. Soit $K = \{l_1, \dots, l_k\} \subseteq \{1, \dots, n\}$ où $l_1 < l_2 < \dots < l_k$. La matrice $B_K \in \mathbb{R}^{k \times k}$ est définie par $b_{ij} = a_{l_i l_j}$, pour $1 \leq i, j \leq k$. Un *k-mineur symétrique* de A est le déterminant d'une matrice B_K ; c'est-à-dire $\det(B_K)$.

Théorème 4.11. *Soit $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ une matrice symétrique.*

- a) *A est définie positive si et seulement si tous ses mineurs principaux sont strictement positifs.*
- b) *A est semi-définie positive si et seulement si tous ses mineurs symétriques sont non négatifs.*

Ce théorème est connu sous le nom de "critère de Sylvestre".

Démonstration. On démontre a), tandis que b) est un exercice. Soit A une matrice définie positive, montrons que les matrices B_k , $1 \leq k \leq n$, sont également définies positives : soit $z_k \in \mathbb{R}^k$ non-nul, on complète ce vecteur en un vecteur $x_k \in \mathbb{R}^n$ en lui rajoutant $n - k$ zéros. On vérifie facilement que $z_k^T B_k z_k = x_k^T A x_k > 0$. Les valeurs propres de B_k sont donc toutes strictement positives en vertu du théorème précédent. En se servant alors du théorème 4.7, on obtient facilement que $\det(B_k)$ est le produit des valeurs propres de B_k , alors $\det(B_k) > 0$.

Supposons maintenant que $\det(B_k) > 0$ pour tout $k \in \{1, \dots, n\}$. L'argument est par récurrence. Le cas $n = 1$ est trivial.

Soit $n > 1$. Les matrices B_k $k = 1, \dots, n - 1$ sont définies positives par récurrence. Si A elle-même n'est pas définie positive, $\det(A) > 0$ implique qu'il existe au moins deux

4 Le théorème spectral et la décomposition en valeurs singulières

valeurs propres négatives, disons μ et λ dans la factorisation donnée par le théorème spectral, et deux vecteurs propres orthogonaux $u, v \in \mathbb{R}^n$ correspondants. Leurs dernières composantes sont pas égales à zéro, parce que A_{n-1} est définie positive. Alors il existe $\beta \neq 0$ tel que la dernière composante de $u + \beta v$ est égale à zéro. Mais

$$(u + \beta v)^T A(u + \beta v) = \mu + \beta^2 \lambda < 0,$$

ce qui est une contradiction au fait que A_{n-1} est définie positive.

Exemple 4.2. Nous pouvons alors montrer qu'une matrice symétrique est définie positive de deux manières différentes d'après les deux théorèmes précédents : considérons la matrice suivante

$$A = \begin{pmatrix} 2 & -1 & 0 \\ -1 & 2 & -1 \\ 0 & -1 & 2 \end{pmatrix}.$$

- Son polynôme caractéristique est égal à $\det(A - XI_n) = -X^3 + 6X^2 - 10X + 4$ dont les racines sont $2, 2 + \sqrt{2}$ et $2 - \sqrt{2}$. Les valeurs propres de A sont toutes les trois strictement positives donc la matrice est définie positive.

- D'une autre façon, $\det(B_1) = 2 > 0$, $\det(B_2) = 3 > 0$ et $\det(B_3) = \det(A) = 4 > 0$ donc la matrice est définie positive.

□

Théorème 4.12. Soit $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ une matrice symétrique et $f(x) = x^T A x$ la forme quadratique correspondante à A . On a

$$\max_{x \in S^{n-1}} f(x) = \lambda_1 \quad \text{et} \quad \min_{x \in S^{n-1}} f(x) = \lambda_n \quad (4.3)$$

où λ_1 et λ_n sont les valeurs propres maximale et minimale de A respectivement.

Démonstration. Nous utilisons la factorisation

$$A = P \begin{pmatrix} \lambda_1 & & \\ & \ddots & \\ & & \lambda_n \end{pmatrix} P^T$$

où $P \in \mathbb{R}^{n \times n}$ est une matrice orthogonale dont les colonnes sont p_1, \dots, p_n . Si $x = \sum_i \alpha_i p_i$, alors

$$\|x\|^2 = \sum_i \alpha_i^2 \quad \text{et} \quad x^T A x = \sum_i (\lambda_i \alpha_i^2)$$

et si $\|x\|^2 = 1$,

$$\lambda_n = \lambda_n \sum_i \alpha_i^2 \leq \sum_i (\lambda_i \alpha_i^2) \leq \lambda_1 \sum_i \alpha_i^2 = \lambda_1.$$

Ça démontre que p_1 et p_n sont les solutions optimales des problèmes d'optimisation (4.3).

□

4.2 Formes quadratiques réelles et matrices symétriques réelles

Définition 4.5. Soit $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ une matrice symétrique. Pour $x \in \mathbb{R}^n \setminus \{0\}$ le quotient *Rayleigh–Ritz* est

$$R_A(x) = \frac{x^T A x}{x^T x}.$$

Pour $x \in \mathbb{R}^n \setminus \{0\}$ $x/\|x\| \in S^{n-1}$ et $R_A(x) = (x/\|x\|)^T \cdot A(x/\|x\|)$.

Théorème 4.13 (Théorème Min-Max). Soit $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ une matrice symétrique avec les valeurs propres $\lambda_1 \geq \dots \geq \lambda_n$. Si U dénote un sous-espace de \mathbb{R}^n alors

$$\lambda_k = \max_{\dim(U)=k} \min_{x \in U \setminus \{0\}} R_A(x) \tag{4.4}$$

et

$$\lambda_k = \min_{\dim(U)=n-k+1} \max_{x \in U \setminus \{0\}} R_A(x) \tag{4.5}$$

Démonstration. Nous démontrons (4.4). La partie (4.5) est un exercice. Soit $\{u_1, \dots, u_n\}$ une base orthonormale de vecteurs propres associés à $\lambda_1 \geq \dots \geq \lambda_n$ respectivement. On fixe un entier k , et un espace U de dimension k . Clairement $\text{span}\{u_k, \dots, u_n\} \cap U \supsetneq \{0\}$. Alors il existe un vecteur $0 \neq x = \sum_{i=k}^n \alpha_i u_i \in U$. Clairement $R_A(x) \leq \lambda_k$. Pour $U = \text{span}\{u_1, \dots, u_k\}$, $\min_{x \in U \setminus \{0\}} R_A(x) = \lambda_k$. Ensemble ça démontre (4.4). \square

Exercices

1. Une matrice réelle symétrique, différente de la matrice zéro, telle que toute composante sur la diagonale est zéro ne peut pas être semi définie positive, ni semi définie négative.
2. Une matrice réelle symétrique, différente de la matrice zéro, dont la diagonale est égale à zéro, possède un 2×2 mineur symétrique négatif.
3. Soit $L \in \mathbb{R}^{n \times n}$ une matrice de la forme

$$L = \left(\begin{array}{c|c} H & 0 \\ \hline C & I_{n-i+1} \end{array} \right)$$

où $H \in \mathbb{R}^{i \times i}$ et $i \geq 0$. Soit $Q \in \mathbb{R}^{n \times n}$ la matrice de la permutation (transposition) qui échange $\mu, \nu > i$. Montrer

$$Q \cdot L = \left(\begin{array}{c|c} H & 0 \\ \hline C' & I_{n-i+1} \end{array} \right) \cdot Q$$

où C' provient de C en échangeant les lignes $\mu - i$ et $\nu - i$.

4. En s'appuyant sur l'exercice 3) montrer l'assertion suivante. Si l'algorithme 3.1 a exécuté k -itérations et dans chacune de ces k itérations, il existe un $j \geq i$ tel que $b_{jj} \neq 0$ (avec la notation de la i -ème itération), alors il existe une matrice de permutation Q telle que le résultat de ces premières k itérations s'écrit

$$R^T Q^T A Q R,$$

4 Le théorème spectral et la décomposition en valeurs singulières

où R est une matrice triangulaire supérieure dont les éléments diagonaux sont 1. En autres mots, il existe une permutation si appliquée aux lignes et colonnes, l'algorithme 3.1 n'échange pas de lignes et colonnes pendant ces premiers k itérations.

5. Soient $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ réelle symétrique et A' la matrice obtenue de A en échangeant les lignes i et j ($A' = Q^T A Q$ pour une matrice de permutation (transposition) Q). Montrer que pour tout $K \subseteq \{1, \dots, n\}$, il existe $K' \subseteq \{1, \dots, n\}$ tel que $\det(A_K) = \det(A'_{K'})$ (mineurs symétriques) et inversement. En d'autres termes, montrer que tous les mineurs symétriques de A se retrouvent dans A' et vice versa.
6. Montrer la partie b) du théorème 4.11.
Indication pour montrer \Leftarrow : Il existe une matrice de permutation Q telle que l'algorithme 3.1 n'échange pas de colonnes et lignes si confronté avec $Q^T \cdot A \cdot Q$ comme input et toutes itérations sont telles que $b_{ii} \neq 0$ jusqu'à un point, où tout le reste de la matrice est 0. Il faut s'appuyer sur les exercices 2 et 4.
7. Une matrice symétrique $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ est définie négative, si et seulement si $\det(B_k) \neq 0$ et $\det(B_k) = (-1)^k |\det(B_k)|$ pour tout k .
8. Une matrice symétrique $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ est semi-définie négative, si et seulement si $\det(B_K) = (-1)^{|K|} |\det(B_K)|$ pour tout $K \subseteq \{1, \dots, n\}$.
9. Montrer la partie (4.5) du théorème 4.13.
10. Soit $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ une matrice symétrique avec les valeurs propres $\lambda_1 \geq \dots \geq \lambda_n$. Soit B_K une matrice comme décrite en dessus où $|K| = k$ avec les valeurs propres $\mu_1 \geq \dots \geq \mu_{n-k}$. Pour $1 \leq i \leq k$, alors

$$\lambda_i \geq \mu_i \geq \lambda_{i+k}.$$

Définition 4.6. Une matrice hermitienne $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ est

- définie positive, si $x^T A \bar{x} > 0$ pour tout $x \in \mathbb{C}^n \setminus \{0\}$,
- définie négative, si $x^T A \bar{x} < 0$ pour tout $x \in \mathbb{C}^n \setminus \{0\}$,
- semi-définie positive, si $x^T A \bar{x} \geq 0$ pour tout $x \in \mathbb{C}^n$,
- semi-définie négative, si $x^T A \bar{x} \leq 0$ pour tout $x \in \mathbb{C}^n$.

Le théorème 4.10 trouve son analogue comme suivant. La démonstration est un exercice.

Théorème 4.14. Une matrice hermitienne $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ est

1. définie positive, si et seulement si toutes ses valeurs propres sont (strictement) positives.
2. définie négative, si et seulement si toutes ses valeurs propres sont (strictement) négatives.
3. semi-définie positive, si et seulement si toutes ses valeurs propres sont non-négatives (donc positives ou zéro).
4. semi-définie négative, si et seulement si toutes ses valeurs propres sont non-positives (négatives ou zéro).

4.3 La décomposition en valeurs singulières

On commence avec un théorème qui décrit la décomposition en valeurs singulières et montre qu'elle existe.

Théorème 4.15. *Une matrice $A \in \mathbb{C}^{m \times n}$ peut être décomposée comme*

$$A = P \cdot D \cdot Q$$

où $P \in \mathbb{C}^{m \times m}$ et $Q \in \mathbb{C}^{n \times n}$ sont unitaires et $D \in \mathbb{R}_{\geq 0}^{m \times n}$ est une matrice diagonale. Si A est réelle, P et Q sont réelles.

Démonstration. La matrice $A^* \cdot A$ est hermitienne et semi-définie positive dès que

$$x^* A^* A x = (Ax)^*(Ax) \geq 0.$$

Alors les valeurs propres de $A^* A$ sont non-négatives ($\lambda_i \geq 0$). Soient $\sigma_1^2 \geq \sigma_2^2 \geq \dots \geq \sigma_n^2 \geq 0$ les valeurs propres et soit $\{u_1, \dots, u_n\}$ une base orthonormale correspondante de vecteurs propres. La matrice $Q \in \mathbb{C}^{n \times n}$ est la matrice dont les lignes sont u_1^*, \dots, u_n^* .

Soit $r \in \mathbb{N}_0$ tel que $\sigma_r > 0$ et $\sigma_{r+1} = 0$; on a $\sigma_1 \geq \dots \geq \sigma_r \geq 0 = \sigma_{r+1} = \dots = 0 = \sigma_n$. Nous construisons les vecteurs

$$v_i = A u_i / \sigma_i, \quad 1 \leq i \leq r.$$

Les v_i sont orthonormaux, parce que

$$\|v_i\|^2 = (A u_i)^* A u_i / \sigma_i^2 = 1$$

et pour $1 \leq i \neq j \leq r$,

$$v_i^* v_j = u_i^* u_j = 0.$$

Avec le procédé de Gram-Schmidt, nous complétons les v_i tels que $\{v_1, \dots, v_m\}$ est une base orthonormale de \mathbb{C}^m . Les colonnes de la matrices P sont alors v_1, \dots, v_m dans cet ordre. La matrice $D \in \mathbb{C}^{m \times n}$ est la matrice diagonale dont les r premières composantes sur la diagonale sont $\sigma_1, \dots, \sigma_r$ dans cet ordre. Avec ces matrices P, D et Q nous avons

$$A = P \cdot D \cdot Q$$

ou de manière équivalente

$$P^* \cdot A \cdot Q^* = D,$$

Nous montrons ça en détail. Nous avons

$$(P^* \cdot A \cdot Q^*)_{ij} = v_i^* A u_j \tag{4.6}$$

et c'est égal à zéro si $j > r$, parce que dans ce cas $A u_j = 0$ dès que $u_j^* A^* A u_j = 0$. Si $i > r$ (4.6) pas égale a zéro implique $A u_j \neq 0$ et alors $j \leq r$. Mais dans ce cas, par construction, v_i est orthogonal à $A u_j / \sigma_j$ et (4.6) est néanmoins zéro.

Et si $1 \leq i, j \leq r$, alors

$$v_i^* A u_j / \sigma_i = u_i^* u_j \sigma_j^2 / \sigma_i = \begin{cases} \sigma_i & \text{si } i = j \\ 0 & \text{autrement.} \end{cases}$$

□

4 Le théorème spectral et la décomposition en valeurs singulières

Définition 4.7. En suivant la notation du théorème 4.15, les nombres $\sigma_1, \dots, \sigma_r$ sont les *valeurs singulières* de A . La factorisation $A = P \cdot D \cdot Q$ est une *décomposition en valeurs singulières*.

Exemple 4.3. Trouver une décomposition en valeurs singulières de

$$A = \begin{pmatrix} 0 & -1.6 & 0.6 \\ 0 & 1.2 & 0.8 \\ 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}.$$

On commence avec

$$A^* \cdot A = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 4 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

On obtient $\sigma_1 = 2, \sigma_2 = 1$ et $\sigma_3 = 0$. Les valeurs singulières sont les $\sigma_i > 0$, i.e., $\sigma_1 = 2$ et $\sigma_2 = 1$. On calcule les vecteurs propres correspondant à $\sigma_1 = 2, \sigma_2 = 1$ et $\sigma_3 = 0$. La matrice Q est

$$Q = \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \\ 1 & 0 & 0 \end{pmatrix}$$

et

$$v_1 = \frac{1}{2} \cdot A \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -0.8 \\ 0.6 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}, v_2 = A \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0.6 \\ 0.8 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}.$$

On complète avec $v_3 = e_3$ et $v_4 = e_4$, alors

$$P = \begin{pmatrix} -0.8 & 0.6 & 0 & 0 \\ 0.6 & 0.8 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

et

$$\begin{pmatrix} -0.8 & 0.6 & 0 & 0 \\ 0.6 & 0.8 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 2 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \\ 1 & 0 & 0 \end{pmatrix} = A.$$

Définition 4.8. La *pseudo inverse* d'une matrice

$$D = \begin{pmatrix} \sigma_1 & & & & & & \\ & \sigma_2 & & & & & \\ & & \ddots & & & & \\ & & & \sigma_r & & & \\ & & & & 0 & & \\ & & & & & \ddots & \\ & & & & & & 0 \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{m \times n}$$

4.3 La décomposition en valeurs singulières

où $\sigma_i \in \mathbb{R}_{>0}$ est

$$D^+ = \begin{pmatrix} \sigma_1^{-1} & & & & & & & \\ & \sigma_2^{-1} & & & & & & \\ & & \ddots & & & & & \\ & & & \sigma_r^{-1} & & & & \\ & & & & 0 & & & \\ & & & & & \ddots & & \\ & & & & & & 0 & \\ & & & & & & & 0 \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{n \times m}$$

Toutes les composantes qui ne sont pas décrites sont zéro. La *pseudo inverse* d'une matrice $A \in \mathbb{C}^{m \times n}$ avec une décomposition en valeurs singulières $A = P \cdot D \cdot Q$ est

$$A^+ = Q^* D^+ P^*.$$

Exemple 4.4. La pseudo inverse de la matrice A d'exemple 4.3 est

$$A^+ = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 1 \\ 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 0.5 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} -0.8 & 0.6 & 0 & 0 \\ 0.6 & 0.8 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

Pourquoi est-ce que nous parlons de la pseudo inverse ? Parce qu'elle est unique.

Théorème 4.16. *Soit $A \in \mathbb{C}^{m \times n}$, alors il existe au plus une seule matrice $X \in \mathbb{C}^{n \times m}$ telle que les quatre conditions de Penrose sont satisfaites :*

- i) $AXA = A$
- ii) $(AX)^* = AX$
- iii) $XAX = X$
- iv) $(XA)^* = XA$.

Démonstration. Soient X et Y deux matrices satisfaisant i-iv. Alors

$$\begin{aligned} X &= XAX \\ &= XAYAX \\ &= XAYAYAYAX \\ &= (XA)^*(YA)^*Y(AY)^*(AX)^* \\ &= A^*X^*A^*Y^*YY^*A^*X^*A^* \\ &= (AXA)^*Y^*YY^*(AXA)^* \\ &= A^*Y^*YY^*A^* \\ &= (YA)^*Y(AY)^* \\ &= YAYAY \\ &= YAY \\ &= Y. \end{aligned}$$

□

4 Le théorème spectral et la décomposition en valeurs singulières

Théorème 4.17. *La pseudo inverse d'une matrice $A \in \mathbb{C}^{m \times n}$ satisfait les conditions i-iv.*

Démonstration. Soit $A = PDQ$ une décomposition en valeurs singulières et $A^+ = Q^*D^+P^*$. Il est facile de voir que D^+ satisfait les conditions i-iv relatives à D . Les conditions sont aussi vite montrées pour A et A^+ . Par exemple i est montrée comme suit :

$$\begin{aligned} AA^+A &= PDQQ^*D^+P^*PDQ \\ &= PDD^+DQ \\ &= PDQ \\ &= A. \end{aligned}$$

Il est un exercice de vérifier les conditions ii-iv. □

4.4 Encore les systèmes d'équations

Nous considérons encore une fois un système

$$Ax = b, \tag{4.7}$$

où $A \in \mathbb{C}^{m \times n}$ et $b \in \mathbb{C}^m$.

Définition 4.9. La *solution minimale* de (4.7) est la solution du problème des moindres carrés

$$\min_{x \in \mathbb{C}^n} \|Ax - b\|^2$$

correspondant avec norme $\|x\|$ minimale.

Théorème 4.18. *La solution minimale de (4.7) est*

$$x = A^+b,$$

où A^+ est la pseudo inverse de A .

Démonstration. Tout d'abord on remarque que pour $B \in \mathbb{C}^{n \times n}$ unitaire et $y \in \mathbb{C}^n$, $\|y\|^2 = y^T \bar{y} = y^T B^T \bar{B} y = \|By\|^2$. Ainsi on a

$$\begin{aligned} \min_{x \in \mathbb{C}^n} \|Ax - b\| &= \min_{x \in \mathbb{C}^n} \|PDQx - b\| = \min_{x \in \mathbb{C}^n} \|P^*(PDQx - b)\| \\ &= \min_{x \in \mathbb{C}^n} \|DQx - P^*b\| = \min_{y \in \mathbb{C}^n} \|Dy - P^*b\| \\ &= \min_{y \in \mathbb{C}^n} \|Dy - c\| \end{aligned}$$

où $c = P^*b$. Dès lors on peut facilement vérifier que y est une solution minimale de $Dy = c \Leftrightarrow Q^*y$ est une solution minimale de $Ax = b$. Mais comme les solutions optimales de $Dy = c$ sont les $y \in \mathbb{C}^n$ tels que $y_i = c_i/\sigma_i$ pour $1 \leq i \leq r$ et $y_{r+1} \dots y_n$ sont arbitraires

alors la solution où $y_{r+1} = \dots = y_n = 0$ est celle de norme minimale. Elle est donnée par

$$y = D^+c.$$

La solution minimale de (4.7) est alors

$$x = Q^*y = Q^*D^+P^*b = A^+b.$$

□

Exemple 4.5. Trouver la solution minimale du système

$$\begin{pmatrix} 0 & -1.6 & 0.6 \\ 0 & 1.2 & 0.8 \\ 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix} x = \begin{pmatrix} 5 \\ 7 \\ 3 \\ -2 \end{pmatrix}.$$

La pseudo-inverse de la matrice ci-dessus est

$$A^+ = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 & 0 \\ -0.4 & 0.3 & 0 & 0 \\ 0.6 & 0.8 & 0 & 0 \end{pmatrix}$$

et

$$\begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 & 0 \\ -0.4 & 0.3 & 0 & 0 \\ 0.6 & 0.8 & 0 & 0 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 5 \\ 7 \\ 3 \\ -2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0.1 \\ 8.6 \end{pmatrix}.$$

4.5 Le meilleur sous-espace approximatif

Nous nous occupons du problème suivant. Soient $a_1, \dots, a_m \in \mathbb{R}^n$ des vecteurs et $1 \leq k \leq n$, trouver un sous-espace $H \subseteq \mathbb{R}^n$ de dimension k tel que

$$\sum_i d(a_i, H)^2$$

soit minimale. Ici $d(a_i, H)$ est la *distance* de a_i à H . Si $H = \text{span}\{u_1, \dots, u_k\}$ où $\{u_1, \dots, u_k\}$ est une base orthonormale de H , alors $a_i = \sum_{j=1}^k \langle a_i, u_j \rangle u_j + d_i$ où $d_i = a_i - \sum_{j=1}^k \langle a_i, u_j \rangle u_j$ est orthogonal à u_1, \dots, u_k et alors à H . Avec le théorème de Pythagore (Proposition 3.12), on a

$$d(a_i, H)^2 + \sum_{j=1}^k \langle a_i, u_j \rangle^2 = \|a_i\|^2.$$

Le sous-espace H de dimension k qui minimise $\sum_i d(a_i, H)^2$ est alors celui qui maximise

$$\sum_i \sum_{j=1}^k \langle a_i, u_j \rangle^2 = \sum_{j=1}^k \|Au_j\|^2 = \sum_{j=1}^k u_j^T A^T A u_j.$$

4 Le théorème spectral et la décomposition en valeurs singulières

Pour $k = 1$, nous connaissons déjà une manière de résoudre ce problème. Il faut résoudre

$$\max_{u \in S^{n-1}} u^T A^T A u.$$

La matrice $A^T A$ est symétrique, alors on peut la factoriser comme

$$A^T A = U \begin{pmatrix} \lambda_1 & & \\ & \ddots & \\ & & \lambda_n \end{pmatrix} U^T \quad (4.8)$$

où $U = (u_1, \dots, u_n) \in \mathbb{R}^{n \times n}$ est orthogonale. Nous pouvons supposer que les λ_i sont ordonnés comme $\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \dots \geq \lambda_n \geq 0$. Les valeurs propres sont non négatives dès que $A^T A$ est semi-définie positive. Selon Théorème 4.12 la solution est $H = \text{span}\{u_1\}$.

La généralisation suivante du Théorème 4.12 est un exercice.

Théorème 4.19. Soit $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ une matrice symétrique et $f(x) = x^T A x$ la forme quadratique correspondante à A . Soit

$$A = U \cdot \begin{pmatrix} \lambda_1 & & \\ & \ddots & \\ & & \lambda_n \end{pmatrix} U^T$$

une factorisation de A telle que $U = (u_1, \dots, u_n) \in \mathbb{R}^{n \times n}$ est orthogonale et $\lambda_1 \geq \dots \geq \lambda_n$. Pour $1 \leq \ell < n$ on a

$$\max_{\substack{x \in S^{n-1} \\ x \perp u_1, \dots, x \perp u_\ell}} f(x) = \lambda_{\ell+1} = \min_{\substack{x \in S^{n-1} \\ x \perp u_{\ell+2}, \dots, x \perp u_n}} f(x) \quad (4.9)$$

et $u_{\ell+1}$ est une solution optimale.

Maintenant, nous pouvons résoudre le problème central

$$\min_{\substack{H \triangleleft \mathbb{R}^n \\ \dim(H)=k}} \sum_{i=1}^m d(a_i, H)^2. \quad (4.10)$$

Théorème 4.20. Soient $a_1, \dots, a_m \in \mathbb{R}^n$, $A = (a_1, \dots, a_m)^T$ et u_1, \dots, u_k les premières colonnes de la matrice orthogonale $U \in \mathbb{R}^{n \times n}$ de la factorisation (4.8). Le sous-espace $H = \text{span}\{u_1, \dots, u_k\}$ est une solution du problème (4.10).

Démonstration. Pour $k = 1$ nous avons déjà montré l'assertion. Soit $k \geq 2$ et $W \triangleleft \mathbb{R}^n$ une solution optimale du problème (4.10) et soit w_1, \dots, w_k une base orthonormale de W . Nous pouvons supposer $w_k \perp \text{span}\{u_1, \dots, u_{k-1}\}$, (voir Exercice 6).

Par induction, nous avons

$$\sum_{j=1}^{k-1} w_j^T A^T A w_j \leq \sum_{j=1}^{k-1} u_j^T A^T A u_j.$$

Dès que

$$\max_{\substack{x \in S^{n-1} \\ x \perp \text{span}\{u_1, \dots, u_{k-1}\}}} x^T A^T A x$$

est atteint à u_k nous avons

$$w_k^T A^T A w_k \leq u_k^T A^T A u_k$$

et alors

$$\sum_{j=1}^k w_j^T A^T A w_j \leq \sum_{j=1}^k u_j^T A^T A u_j.$$

□

Définition 4.10. Soit $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$.

1) On définit la *norme Frobenius* de A comme le nombre

$$\|A\|_F = \sqrt{\sum_{ij} a_{ij}^2}.$$

2) Pour une norme vectorielle $\|\cdot\|$ définie positive sur \mathbb{R}^n , on définit la norme $|||\cdot|||$ de A , appelée *norme matricielle subordonnée* à $\|\cdot\|$, comme le nombre

$$|||A||| = \sup_{v \neq 0} \frac{\|Av\|}{\|v\|} = \sup_{\|v\|=1} \|Av\|.$$

Remarque 4.21. La norme Frobenius n'est pas une norme matricielle subordonnée.

Exemple 4.6. Soit $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$. On considère la norme euclidienne standard (aussi appelée norme 2) sur \mathbb{R}^n :

$$\|v\|_2 = \sqrt{\sum_{i=1}^n (v_i)^2}.$$

Alors la norme matricielle subordonnée à $\|\cdot\|_2$ correspond à

$$|||A|||_2 = \sup_{v \neq 0} \frac{\|Av\|_2}{\|v\|_2} = \sup_{\|v\|_2=1} \|Av\|_2 = \sup_{\|v\|_2=1} \sqrt{v^T A^T A v} = \sqrt{\lambda_1},$$

où λ_1 est la plus grande valeur propre de $A^T A$ (ou de manière équivalente, $\sqrt{\lambda_1}$ est la plus grande valeur singulière de A).

Exercice 4.1. Soient $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$, $\|\cdot\|$ une norme définie positive sur \mathbb{R}^n , $|||\cdot|||$ la norme matricielle subordonnée à $\|\cdot\|$. Alors pour tout $v \in \mathbb{R}^n$, on a :

$$\|Av\| \leq |||A||| \cdot \|v\|.$$

Définition 4.11. Soit $A \in K^{n \times n}$. La *trace* de A est la somme de ses coefficients diagonaux, $\text{Tr}(A) = \sum_{i=1}^n a_{ii}$.

Lemme 4.22. Pour $A, B \in K^{n \times n}$ $\text{Tr}(AB) = \text{Tr}(BA)$.

4 Le théorème spectral et la décomposition en valeurs singulières

Lemme 4.23. Pour $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$, $\|A\|_F^2 = \sum_{i=1}^r \sigma_i^2$ où $\sigma_1, \dots, \sigma_r$ sont les valeurs singulières de A .

Démonstration. On a $\|A\|_F^2 = \text{Tr}(A^T A) = \text{Tr}(U \cdot \text{diag}(\sigma_1^2, \dots, \sigma_n^2) \cdot U^T)$ où $U \in \mathbb{R}^{n \times n}$ est orthogonale. Alors

$$\|A\|_F^2 = \text{Tr}(\text{diag}(\sigma_1^2, \dots, \sigma_n^2)) = \sum_{i=1}^r \sigma_i^2$$

□

Maintenant nous allons résoudre le problème suivant. Étant donné $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$ et $k \in \mathbb{N}$, trouver une matrice $B \in \mathbb{R}^{m \times n}$ de $\text{rang}(B) \leq k$ tel que

$$\|A - B\|_F$$

soit minimale.

Si $A = P \cdot \text{diag}(\sigma_1, \dots, \sigma_r, 0, \dots, 0) \cdot Q$ est une décomposition en valeurs singulières où les colonnes de P sont v_1, \dots, v_m et les lignes de Q sont u_1^T, \dots, u_n^T on peut écrire

$$A = \sum_{i=1}^r \sigma_i v_i u_i^T \quad (4.11)$$

et on dénote la somme des premiers k termes comme

$$A_k = \sum_{i=1}^k \sigma_i v_i u_i^T$$

Le rang de A_k est au plus k .

Lemme 4.24. Les lignes de A_k sont les projections des lignes de A dans le sous-espace $V_k = \text{span}\{u_1, \dots, u_k\}$.

Démonstration. Soit a^T une ligne de A . La projection de a dans le sous-espace $\text{span}\{u_1, \dots, u_k\}$ est

$$\sum_{i=1}^k a^T u_i \cdot u_i^T.$$

Alors les projections des lignes de A dans le sous-espace V_k sont données par $\sum_{i=1}^k A u_i u_i^T = \sum_{i=1}^k \sigma_i v_i u_i^T = A_k$. □

Théorème 4.25. Pour une matrice $B \in \mathbb{R}^{m \times n}$ de rang plus petit ou égal à k , on a

$$\|A - A_k\|_F \leq \|A - B\|_F.$$

4.5 Le meilleur sous-espace approximatif

Démonstration. On dénote les lignes de A par a_1^T, \dots, a_m^T et soit B une matrice de rang au plus k . Les lignes de B sont dénotées comme b_1^T, \dots, b_m^T . Soit $H = \text{span}\{b_1, \dots, b_m\}$. La dimension de H est $\text{rang}(B) \leq k$. On a

$$\|A - B\|_F^2 = \sum_{i=1}^m \|a_i - b_i\|^2 \geq \sum_{i=1}^m d(a_i, H)^2.$$

Soit $\tilde{H} = \text{span}\{u_1, \dots, u_k\}$. Nous avons démontré que

- i) \tilde{H} est le meilleur sous-espace approximatif des lignes de A alors $\sum_{i=1}^m d(a_i, H)^2 \geq \sum_{i=1}^m d(a_i, \tilde{H})^2$ et
- ii) Les lignes de A_k sont les projections des lignes de A dans \tilde{H} .

En dénotant les lignes de A_k par $\tilde{a}_1^T, \dots, \tilde{a}_m^T$, alors

$$\|A - B\|_F^2 \geq \sum_{i=1}^m d(a_i, \tilde{H})^2 = \sum_{i=1}^m \|a_i - \tilde{a}_i\|^2 = \|A - A_k\|_F^2.$$

□

Exercices

1. Est-ce que la décomposition en valeurs singulières est unique ? Est-ce que les valeurs singulières sont uniques ?
2. Dans la démonstration du théorème 4.15, montrer que $\text{rang}(A) = r$.
3. Démontrer que la pseudo-inverse satisfait les conditions ii-iv.
4. Si $Ax = b$ a plusieurs solutions, il existe une solution unique avec une norme minimale.
5. Montrer Théorème 4.19.
6. Soient $G, H \subseteq \mathbb{R}^n$ des sous-espaces de \mathbb{R}^n et $k = \dim(G) > \dim(H)$. Montrer que G possède une base orthonormale w_1, \dots, w_k telle que $w_k \perp H$.

5 Systèmes différentiels linéaires

On considère le système différentiel suivant

$$\begin{aligned} \mathbf{x}'_1(t) &= a_{11}\mathbf{x}_1(t) + \cdots + a_{1n}\mathbf{x}_n(t) \\ \mathbf{x}'_2(t) &= a_{21}\mathbf{x}_1(t) + \cdots + a_{2n}\mathbf{x}_n(t) \\ &\vdots \\ \mathbf{x}'_n(t) &= a_{n1}\mathbf{x}_1(t) + \cdots + a_{nn}\mathbf{x}_n(t) \end{aligned} \tag{5.1}$$

où les $a_{ij} \in \mathbb{R}$. En notation matricielle, on peut écrire le système comme

$$\mathbf{x}' = A \mathbf{x}$$

où

$$A = \begin{pmatrix} a_{11} & \cdots & a_{1n} \\ & \vdots & \\ a_{n1} & \cdots & a_{nn} \end{pmatrix}, \quad \mathbf{x} \in C^1(\mathbb{R}; \mathbb{R}^n).$$

On cherche des fonctions dérivables $\mathbf{x}_i : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ qui, ensemble, constituent \mathbf{x} et qui satisfont (5.1). Un tel \mathbf{x} est une *solution* du système (5.1).

Exemple 5.1. Considérons l'équation différentielle $\mathbf{x}'(t) = \mathbf{x}(t)$. Une solution est $\mathbf{x}(t) = e^t$. Une autre solution est $\mathbf{x}(t) = 2 \cdot e^t$. Si on spécifie la *condition initiale* $\mathbf{x}(0) = 1$, alors $\mathbf{x}(t) = e^t$ est l'unique solution qui satisfait cette condition initiale. Généralement, si on spécifie $\mathbf{x}(0) = \alpha$, alors $\mathbf{x}(t) = \alpha \cdot e^t$ est la solution qui satisfait la condition initiale.

Considérons $\mathbf{x}'(t) = -\mathbf{x}(t)$, une solution est $\mathbf{x}(t) = e^{-t}$. C'est aussi une solution qui respecte la condition initiale $\mathbf{x}(0) = 1$.

Essayons d'abord de résoudre le système en mettant $\mathbf{x}(t) = e^{\lambda t} \mathbf{v}$ où $\mathbf{v} \in \mathbb{R}^n$ est un vecteur constant. Dans ce cas $\mathbf{x}' = A\mathbf{x}$ se réécrit comme $\lambda e^{\lambda t} \mathbf{v} = e^{\lambda t} A\mathbf{v}$. Nous avons démontré le lemme suivant.

Lemme 5.1. *Si $\lambda \in \mathbb{R}$ est une valeur propre de A et si $\mathbf{v} \in \mathbb{R}^n \setminus \{0\}$ est un vecteur propre correspondant, alors $\mathbf{x}(t) = e^{\lambda t} \mathbf{v}$ est une solution du système (5.1) pour les conditions initiales $\mathbf{x}(0) = \mathbf{v}$.*

Le théorème suivant est démontré en cours *analyse 2*.

Théorème 5.2 (Cours d'analyse II). *Étant donné les conditions initiales $\mathbf{x}(0)$ il existe une unique solution \mathbf{x} du système (5.1).*

Nous sommes concernés par le problème de *trouver* la solution \mathbf{x} explicitement. On commence avec une observation qui est un exercice simple.

5 Systèmes différentiels linéaires

Lemme 5.3. *L'ensemble $\mathcal{X} = \{\mathbf{x} : \mathbf{x} \text{ est une solution du système (5.1)}\}$ est un espace vectoriel sur \mathbb{R} .*

Est-ce que c'est possible de donner une base de \mathcal{X} explicitement ? Dans le cas où A est diagonalisable :

$$A = P \cdot \text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_n) \cdot P^{-1}$$

où $P \in \mathbb{R}^{n \times n}$ est inversible et les λ_i sont réels, le théorème suivant décrit une base intuitive de \mathcal{X} .

Théorème 5.4. *Si \mathbb{R}^n possède une base $\{v_1, \dots, v_n\} \subseteq \mathbb{R}^n$ de vecteurs propres de A telle que $Av_i = \lambda_i v_i$, alors*

$$\mathbf{x}^{(i)}(t) = e^{\lambda_i t} \cdot v_i, \quad i = 1, \dots, m$$

est une base de \mathcal{X} .

Démonstration. Montrons d'abord que les $\mathbf{x}^{(i)}$ sont linéairement indépendants. Supposons que $\sum_i \alpha_i \mathbf{x}^{(i)} = 0$. C'est-à-dire que les n fonctions qui sont les composantes de $\sum_i \alpha_i \mathbf{x}^{(i)}$ sont toutes la fonction identiquement nulle. En évaluant en $t = 0$, on trouve

$$0 = \sum_i \alpha_i v_i e^{\lambda_i 0} = \sum_i \alpha_i v_i.$$

Or les v_i sont linéairement indépendants. On a donc $\alpha_i = 0$ pour tout i ce qui démontre que les $\mathbf{x}^{(i)}$ sont linéairement indépendants.

Maintenant soit $\mathbf{y} \in \mathcal{X}$ et soient $\alpha_i \in \mathbb{R}$ tels que

$$\mathbf{y}(0) = \sum_i \alpha_i v_i.$$

Alors $\mathbf{x} := \sum_i \alpha_i \mathbf{x}^{(i)} \in \mathcal{X}$ et comme $\mathbf{x}(0) = \mathbf{y}(0)$, le Théorème 7.10 implique que $\mathbf{x} = \mathbf{y}$. Les $\mathbf{x}^{(i)}$ engendrent donc \mathcal{X} , et $\{\mathbf{x}^{(1)}, \dots, \mathbf{x}^{(n)}\}$ est une base de \mathcal{X} . \square

Est-ce qu'on peut aussi trouver une solution dans le cas où A est diagonalisable dans les nombres complexes, donc si

$$A = P \cdot \text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_n) \cdot P^{-1}$$

où $P \in \mathbb{C}^{n \times n}$ est inversible et les $\lambda_i \in \mathbb{C}$? Pour discuter de ça, il faut d'abord définir, ce qu'est une solution complexe du système (5.1). Toute fonction $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{C}$ s'écrit comme

$$f(x) = f_{\mathbb{R}}(x) + i \cdot f_{\mathbb{C}}(x)$$

où $f_{\mathbb{R}}(x), f_{\mathbb{C}}(x)$ sont des fonctions de $\mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$. Si $f_{\mathbb{R}}$ et $f_{\mathbb{C}}$ sont dérivables, on dit que $f(x)$ est dérivable et on définit

$$f'(x) = f'_{\mathbb{R}}(x) + i \cdot f'_{\mathbb{C}}(x).$$

Si $x_1, \dots, x_n: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{C}$ sont dérivables, comme avant

$$\mathbf{x} = \begin{pmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix}$$

est une *solution complexe* du système (5.1) si $\mathbf{x}' = A\mathbf{x}$. Et comme avant, on peut noter le lemme suivant, en se rappelant que $e^{a+ib} = e^a(\cos b + i \cdot \sin b)$.

Lemme 5.5. *Si $\lambda \in \mathbb{C}$ est une valeur propre de A et si $v \in \mathbb{C}^n \setminus \{0\}$ est un vecteur propre correspondant, alors $\mathbf{x}(t) = e^{\lambda t}v$ est une solution du système (5.1) pour les conditions initiales $\mathbf{x}(0) = v$.*

Démonstration. On écrit

$$\mathbf{x}' = \lambda e^{\lambda t}v = e^{\lambda t}Av = A\mathbf{x}.$$

□

Lemme 5.6. *Étant donné une solution complexe $\mathbf{x} = \mathbf{x}_{\mathbb{R}} + i\mathbf{x}_{\mathbb{C}}$ du système (5.1), alors $\mathbf{x}_{\mathbb{R}}$ et $\mathbf{x}_{\mathbb{C}}$ sont des solutions réelles.*

Démonstration. Dès que $\mathbf{x}_{\mathbb{R}} + i\mathbf{x}_{\mathbb{C}}$ est une solution, on a

$$\mathbf{x}'_{\mathbb{R}} + i\mathbf{x}'_{\mathbb{C}} = \mathbf{x}' = A\mathbf{x} = A\mathbf{x}_{\mathbb{R}} + iA\mathbf{x}_{\mathbb{C}}.$$

Comme A est réelle on a $\mathbf{x}'_{\mathbb{R}} = A\mathbf{x}_{\mathbb{R}}$ et $\mathbf{x}'_{\mathbb{C}} = A\mathbf{x}_{\mathbb{C}}$ en prenant les parties réelles et imaginaires des deux côtés. □

Supposons alors que $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ est diagonalisable. Et soit $\{v_1, \dots, v_n\}$ une base de \mathbb{C}^n de vecteurs propres associés à $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ respectivement. Si $v_i = u_i + i \cdot w_i$ où $u_i, w_i \in \mathbb{R}^n$, les $u_1, \dots, u_n, w_1, \dots, w_n$ engendrent \mathbb{R}^n (voir exercice 3). Comme nous avons noté

$$\mathbf{x}^{(j)} = e^{\lambda_j t}v_j$$

sont des solutions complexes du système (5.1).

Aussi, on peut supposer que la base et les valeurs propres sont tels que les vecteurs/valeurs propres complexes viennent en paires conjuguées complexes. Plus précisément, si $2k$ valeurs propres sont complexes et le reste sont réelles, on pose

$$v_{2j-1} = \overline{v_{2j}} \text{ et } \lambda_{2j-1} = \overline{\lambda_{2j}} \text{ pour } 1 \leq j \leq k \leq n/2 \quad (5.2)$$

et

$$v_j \in \mathbb{R}^n, \lambda_j \in \mathbb{R} \text{ pour } j > 2k. \quad (5.3)$$

Considérons maintenant une solution donnée par $v = u + iw$ $\lambda = a + ib$.

$$\begin{aligned} \mathbf{x} &= e^{at}(\cos(bt) + i \sin(bt))(u + iw) \\ &= e^{at}(\cos(bt)u - \sin(bt)w) + ie^{at}(\sin(bt)u + \cos(bt)w). \end{aligned}$$

Ceci nous donne alors deux solutions réelles

$$\begin{aligned} \mathbf{x}^{(1)} &= e^{at}(\cos(bt)u - \sin(bt)w), \\ \mathbf{x}^{(2)} &= e^{at}(\sin(bt)u + \cos(bt)w). \end{aligned}$$

Remarque 5.7. Les solutions réelles données par v et λ engendrent le même espace que les solutions réelles données par \bar{v} et $\bar{\lambda}$.

Nous pouvons alors noter une marche à suivre pour résoudre le système (5.1) étant donné $\mathbf{x}(0)$ si A est diagonalisable.

1. Trouver une base de vecteurs propres v_1, \dots, v_n de A ordonnée comme dans (5.2) et (5.3).
2. Pour chaque paire v_{2j}, λ_{2j} , $1 \leq j \leq k$ trouver les deux solutions réelles dénotées par $\mathbf{x}^{(2j-1)}$ et $\mathbf{x}^{(2j)}$.
3. Pour chaque paire réelle v_j, λ_j $n \geq j > 2k$, trouver la solution $\mathbf{x}^{(j)}$.
4. Trouver la combinaison linéaire

$$\mathbf{x}(0) = \sum_j \alpha_j \mathbf{x}^{(j)}(0)$$

5. La solution est

$$\mathbf{x} = \sum_j \alpha_j \mathbf{x}^{(j)}$$

Exemple 5.2. Résoudre le système $\mathbf{x}' = A\mathbf{x}$ où

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ -2 & 1 \end{pmatrix} \text{ et } \mathbf{x}(0) = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}.$$

On trouve que $\lambda_1 = 1 + 2i$ et $\lambda_2 = 1 - 2i$ sont les valeurs propres de A et

$$v_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ i \end{pmatrix} \text{ et } v_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ -i \end{pmatrix}$$

sont les vecteurs propres correspondants. Les deux solutions impliquées par v_1 sont

$$\begin{aligned} \mathbf{x}^{(1)} &= e^t \left(\cos(2t) \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix} - \sin(2t) \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \end{pmatrix} \right) \\ \mathbf{x}^{(2)} &= e^t \left(\sin(2t) \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix} + \cos(2t) \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \end{pmatrix} \right). \end{aligned}$$

La solution qu'on cherche est

$$\mathbf{x} = \begin{pmatrix} e^t \sin(2t) + e^t \cos(2t) \\ -e^t \sin(2t) + e^t \cos(2t) \end{pmatrix}.$$

Exercices

1. Montrer Lemme 5.3.

2. Une fonction $f : \mathbb{C} \rightarrow \mathbb{C}$ est *holomorphe* en $z_0 \in \mathbb{C}$ si

$$f'(z_0) = \lim_{z \rightarrow z_0} \frac{f(z) - f(z_0)}{z - z_0}$$

existe. Soit f holomorphe sur \mathbb{C} et $g = f|_{\mathbb{R}}$ la fonction f réduite à \mathbb{R} . Montrer

i) $g(x) = g_{\mathbb{R}}(x) + i \cdot g_{\mathbb{S}}(x)$ est dérivable au sens de notre définition, particulièrement $g_{\mathbb{R}}(x)$ et $g_{\mathbb{S}}(x)$ sont dérivables.

ii) $f'_{|\mathbb{R}}(x) = g'_{\mathbb{R}}(x) + i \cdot g'_{\mathbb{S}}(x)$.

3. Soit $\{u_1 + i \cdot w_1, \dots, u_n + i \cdot w_n\}$ une base de \mathbb{C}^n où $u_i, w_i \in \mathbb{R}^n$ pour tout i . Montrer que $\text{span}\{u_i, w_i : 1 \leq i \leq n\} = \mathbb{R}^n$.

5.1 L'exponentielle d'une matrice

Définition 5.1. Pour $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ on définit

$$e^A = I + A + \frac{1}{2!}A^2 + \frac{1}{3!}A^3 + \dots$$

On rappelle la définition d'une série intégrable

$$\sum_{j=0}^{\infty} a_j z^j,$$

où les coefficients $a_j \in \mathbb{C}$, et qui converge sur un *disque* de rayon ρ . C'est à dire que, si $|z| < \rho$ la série converge et la fonction $f : \{x \in \mathbb{C} : |x| < \rho\} \rightarrow \mathbb{C}$ définie par $f(x) = \sum_{j=0}^{\infty} a_j x^j$ est *holomorphe* avec dérivée $f'(x) = \sum_{j=0}^{\infty} j a_j x^{j-1}$. Une série intégrable importante est la série

$$e^x = \sum_{j=0}^{\infty} \frac{1}{j!} x^j,$$

qui définit la fonction holomorphe $\exp : \mathbb{C} \rightarrow \mathbb{C}$

$$e^{a+ib} = e^a(\cos b + i \sin b).$$

On va maintenant généraliser la définition de la *norme Frobenius* pour les matrices complexes. Pour $A \in \mathbb{C}^{m \times n}$,

$$\|A\|_F = \sqrt{\sum_{ij} |a_{ij}|^2}.$$

Lemme 5.8. Pour $A \in \mathbb{C}^{n \times m}$ et $B \in \mathbb{C}^{m \times n}$ on a

$$\|A \cdot B\|_F \leq \|A\|_F \cdot \|B\|_F.$$

5 Systèmes différentiels linéaires

Démonstration. Soient $a_1^T, \dots, a_n^T \in \mathbb{C}^m$ les lignes de A et $\bar{b}_1, \dots, \bar{b}_n \in \mathbb{C}^m$ les colonnes de B . Avec Cauchy-Schwarz

$$|(AB)_{ij}|^2 = (a_i^T \bar{b}_j)(\bar{a}_i^T b_j) \leq \|a_i\|^2 \|b_j\|^2$$

et donc

$$\|AB\|_F^2 = \sum_{ij} |(AB)_{ij}|^2 \leq \sum_i \|a_i\|^2 \cdot \sum_i \|b_i\|^2 = \|A\|_F^2 \cdot \|B\|_F^2.$$

□

Lemme 5.9. *La série e^A converge.*

Démonstration. Il est facile de se convaincre que la convergence pour la norme de Frobenius revient à prouver que la suite est de Cauchy.

Evidemment $\forall c \in \mathbb{C}$ la série $\sum_{j=0}^{+\infty} \frac{c^j}{j!} = e^c$ converge. La suite des sommes partielles est donc de Cauchy.

Considérons maintenant la suite $(b_n)_{n \in \mathbb{N}} = (\sum_{j=0}^n \frac{A^j}{j!})_{n \in \mathbb{N}}$. Soient $m, n \in \mathbb{N}$ alors $\|b_m - b_n\|_F = \|\sum_{j=n+1}^m \frac{A^j}{j!}\|_F \leq \sum_{j=n+1}^m \frac{\|A\|_F^j}{j!} \leq \epsilon$ pour $n, m \geq N_\epsilon$ (qui existe car la suite des sommes partielles de la série $\sum_{j=0}^{+\infty} \frac{\|A\|_F^j}{j!} = e^{\|A\|_F}$ est de Cauchy.) □

Nous avons montré que $e^{At} = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{t^k}{k!} A^k$ converge pour tout $t \in \mathbb{R}$. Plus précisément chaque composante $\sum_{k=0}^{\infty} \frac{t^k}{k!} A^k$ est une série intégrable avec un rayon de convergence ∞ . Nous pouvons donc dériver les termes de la somme pour obtenir

$$\frac{d}{dt} e^{At} = A e^{At}. \quad (5.4)$$

Théorème 5.10. *La solution du problème initial $\mathbf{x}' = A\mathbf{x}$, $\mathbf{x}(0) = \mathbf{v}$ est*

$$\mathbf{x}(t) = e^{At} \mathbf{v}.$$

Démonstration. Soit $\mathbf{x}(t) = e^{At} \mathbf{v}$. Alors $\mathbf{x}'(t) = A e^{At} \mathbf{v} = A \mathbf{x}(t)$. Plutôt $\mathbf{x}(0) = \mathbf{v}$. □

Définition 5.2. Une matrice N est *nilpotente* s'il existe un $k \in \mathbb{N}$ tel que $N^k = 0$.

Nous allons montrer ce théorème dans le prochain cours.

Théorème 5.11. *Chaque matrice $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ peut être factorisée comme*

$$A = P(\text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_n) + N)P^{-1}$$

où $N \in \mathbb{C}^{n \times n}$ est nilpotente, $P \in \mathbb{C}^{n \times n}$ est inversible, $\lambda_1, \dots, \lambda_n \in \mathbb{C}$ sont les valeurs propres de A et $\text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$ et N commutent.

Lemme 5.12. *Pour $A, B \in \mathbb{C}^{n \times n}$, si $A \cdot B = B \cdot A$ on a $e^{A+B} = e^A e^B$.*

5.2 Décomposition selon le polynôme caractéristique

Comment peut-on maintenant résoudre le problème initial $x' = Ax$, $x(0) = v$ explicitement? Nous savons que cette solution est $x = e^{tA} \cdot v$ et nous savons que c'est une solution réelle pour $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$. Mais les premiers termes s'écrivent comme

$$\sum_{i=0}^m t^i A^i = P \left(\sum_{i=0}^m t^i \text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_n)^i + t^i N \right) P^{-1}$$

où nous avons utilisé le théorème 5.11. Dès que N et $\text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$ commutent, la solution *réelle* que l'on cherche est

$$\begin{aligned} x &= P e^{t \text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_n)} e^{tN} P^{-1} v \\ &= P \left(\text{diag}(e^{\lambda_1 t}, \dots, e^{\lambda_n t}) \cdot \sum_{j=0}^{k-1} t^j N^j / j! \right) P^{-1}, \end{aligned}$$

où $k \in \mathbb{N}$ est tel que $N^k = 0$.

5.2 Décomposition selon le polynôme caractéristique

Dans ce chapitre, on va démontrer le Théorème 5.11. Dans le chapitre suivant, on va donner une forme normale spécifique pour chaque matrice complexe, la *forme normale de Jordan*.

Définition 5.3. Soient V un espace vectoriel sur un corps K , $A : V \rightarrow V$ un endomorphisme et $f(x) = a_0 + \dots + a_n x^n \in K[x]$. L'évaluation de f sur A est l'endomorphisme $f(A) : V \rightarrow V$

$$f(A) = a_n A^n + a_{n-1} A^{n-1} + \dots + a_1 A + a_0 \text{id},$$

où $A^n = \underbrace{A \circ A \circ \dots \circ A}_{n \text{ fois}}$.

Définition 5.4. Soient $A : V \rightarrow V$ un endomorphisme et $W \subseteq V$ un sous-espace de V . On dit que W est *invariant sous A* si $A(x) \in W$ pour tout $x \in W$.

Lemme 5.13. Soient $f(x) \in K[x]$ et $A : V \rightarrow V$ un endomorphisme, alors $\ker(f(A))$ est invariant sous A .

Démonstration. Si $v \in \ker(f(A))$ on trouve que $f(A) Av = Af(A)v = 0$. Alors, $Av \in \ker(f(A))$. □

Théorème 5.14. Soit $A : V \rightarrow V$ un endomorphisme et soit $f(x) = f_1(x) \cdot f_2(x)$ tel que

i) $\deg(f_1) \cdot \deg(f_2) \neq 0$,

ii) $\text{gcd}(f_1, f_2) = 1$

alors $\ker(f(A)) = \ker(f_1(A)) \oplus \ker(f_2(A))$.

5 Systèmes différentiels linéaires

Démonstration. Dès que $\gcd(f_1, f_2) = 1$ il existe $g_1(x), g_2(x)$ tels que

$$1 = g_1(x)f_1(x) + g_2(x)f_2(x)$$

et alors

$$g_1(A) \cdot f_1(A) + g_2(A)f_2(A) = I. \quad (5.5)$$

Pour $v \in \ker(f(A))$, alors

$$g_1(A) \cdot f_1(A) \cdot v + g_2(A)f_2(A) \cdot v = v.$$

Mais $g_1(A) \cdot f_1(A) \cdot v \in \ker(f_2(A))$ dès que

$$f_2(A) \cdot g_1(A) \cdot f_1(A) \cdot v = g_1(A) \cdot f_1(A) \cdot f_2(A) \cdot v = g_1(A)f(A)v = 0$$

et d'une manière similaire on voit que $g_2(A)f_2(A) \cdot v \in \ker(f_1(A))$. Il reste à démontrer que la somme est directe.

Soit alors $v \in \ker(f_1(A)) \cap \ker(f_2(A))$. L'équation (5.5) montre

$$v = g_1(A) \cdot f_1(A)v + g_2(A)f_2(A)v = 0,$$

qui démontre que la somme est directe. □

Lemme 5.15. *Soit V un espace vectoriel de dimension finie sur \mathbb{C} et soit $T: V \rightarrow V$ une application linéaire. Alors V est la somme directe de sous-espaces $V = V_1 \oplus \dots \oplus V_K$ tels que*

- i) $T(V_i) \subseteq V_i$ pour tout i et
- ii) $T|_{V_i}: V_i \rightarrow V_i$ est de la forme $N_i + \lambda I$ où N_i est nilpotente.

Démonstration. Soit $p(x)$ = le polynôme caractéristique de T , alors $p(T) = 0$. Le coefficient dominant de $p(x)$ est 1. Le théorème fondamental de l'algèbre implique que

$$p(x) = (x - \lambda_1)^{m_1} \dots (x - \lambda_k)^{m_k}$$

avec des λ_i différents. Le diviseur le plus grand de $(x - \lambda_i)^{m_i}$ et $p(x)/(x - \lambda_i)^{m_i}$ est 1 pour $i \neq j$. En utilisant théorème 5.14 en $k - 1$ étapes, alors

$$V = \ker p(T) = \ker(T - \lambda_1 I)^{m_1} \oplus \dots \oplus \ker(T - \lambda_k I)^{m_k}$$

et avec $V_i = \ker(T - \lambda_i I)^{m_i}$ on a $V = V_1 \oplus \dots \oplus V_K$ et i) avec lemme 5.13.

De plus,

$$T|_{V_i} = (T - \lambda_i I)|_{V_i} + \lambda_i I|_{V_i} =: N_i + \lambda_i I$$

et $N_i = (T - \lambda_i I)|_{V_i}$ est bien nilpotente, car $V_i = \ker(T - \lambda_i I)^{m_i}$ et donc $N_i^{m_i} = (T - \lambda_i I)^{m_i}|_{V_i} = 0$. □

5.2 Décomposition selon le polynôme caractéristique

Remarque 5.16. Lemme 5.15 démontre qu'il existe une base

$$\mathcal{B} = b_1^1, \dots, b_{\ell_1}^1, b_1^2, \dots, b_{\ell_2}^2, \dots, b_1^k, \dots, b_{\ell_k}^k$$

où $b_1^i, \dots, b_{\ell_i}^i$ est une base de V_i telle que la matrice $A_{\mathcal{B}}^T$ de T par rapport à la base \mathcal{B} est une matrice bloc diagonale

$$A_{\mathcal{B}}^T = \begin{pmatrix} B_1 & & & \\ & B_2 & & \\ & & \ddots & \\ & & & B_k \end{pmatrix}$$

et les matrices $B_i \in \mathbb{C}^{\ell_i \times \ell_i}$ sont de la forme $B_i = N_i + \lambda_i I$ où les N_i sont nilpotentes.

Des que les N_i et $\lambda_i I$ commutent, ça démontre le Théorème 5.11.

Exemple 5.3. Soit

$$A = \begin{pmatrix} 25 & 34 & 18 \\ -14 & -19 & -10 \\ -4 & -6 & -1 \end{pmatrix}$$

Le polynôme caractéristique de A est $p_A(x) = (x - 1)^2(x - 3)$. Alors

$$\ker(p_A(A)) = \mathbb{R}^3 = \ker((A - I)^2) \oplus \ker(A - 3I).$$

On a

$$(A - I)^2 = \begin{pmatrix} 28 & 28 & 56 \\ -16 & -16 & -32 \\ -4 & -4 & -8 \end{pmatrix}$$

et une base du $\ker((A - I)^2)$ est

$$\left\{ \begin{pmatrix} 2 \\ 0 \\ -2 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 \\ 21 \\ 0 \end{pmatrix} \right\}$$

Et

$$A - 3I = \begin{pmatrix} 22 & 34 & 18 \\ -14 & -22 & -10 \\ -4 & -6 & -4 \end{pmatrix}$$

avec base de noyaux

$$\left\{ \begin{pmatrix} -7 \\ 4 \\ 1 \end{pmatrix} \right\}$$

Avec matrice

$$P = \begin{pmatrix} 2 & 0 & -7 \\ 0 & 2 & 4 \\ -1 & -1 & 1 \end{pmatrix}$$

5 Systèmes différentiels linéaires

on a

$$P^{-1}AP = \begin{pmatrix} 16 & 25 & 0 \\ -9 & -14 & 0 \\ 0 & 0 & 3 \end{pmatrix}$$

et

$$\begin{pmatrix} 15 & 25 \\ -9 & -15 \end{pmatrix}^2 = 0$$

Alors

$$P^{-1}AP = \begin{pmatrix} N_1 + 1 \cdot I_2 & 00 & N_2 + 3 \cdot I_1 \end{pmatrix}$$

est en forme blocque diagonale, où N_1 et N_2 sont nilpotentes. En fait, $N_2 = 0$.

Exercices

1. Montrer que $K[x]$ est un anneau avec $1_{K[x]} = 1_K$.
2. Montrer que $a(x) \in K[x]$ et $b(x) \in K[x]$ $\deg(a) + \deg(b) > 0$ possèdent exactement un diviseur commun le plus grand avec coefficient principal égal à 1_K .
3. Soit V un espace vectoriel de dimension fini sur \mathbb{C} , $T : V \rightarrow V$ un endomorphisme et $f(x) = (x - \lambda)^m \in \mathbb{C}[x]$. Montrer que $\ker(f(T)) \neq \{0\}$ si et seulement si λ est une valeur propre de T .

5.3 La forme normale de Jordan

Définition 5.5. Un *bloc Jordan* est une matrice de la forme

$$\begin{pmatrix} \lambda & 1 & & & \\ & \lambda & 1 & & \\ & & \ddots & \ddots & \\ & & & \lambda & 1 \\ & & & & \lambda \end{pmatrix}$$

où les éléments non décrits sont zéro.

Une matrice $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ est en *forme normale de Jordan* si A est en forme bloc diagonale, où tous les blocs sur la diagonale sont des blocs Jordan, i.e. A est de la forme

$$A = \begin{pmatrix} B_1 & & & \\ & B_2 & & \\ & & \ddots & \\ & & & B_k \end{pmatrix}$$

où les matrices $B_j \in \mathbb{C}^{n_j \times n_j}$ sont des blocs de Jordan.

Notre but est de montrer le théorème suivant.

Théorème 5.17. Soit $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, alors il existe des matrices $P, J \in \mathbb{C}^{n \times n}$ telles que J est en forme normale de Jordan, P est inversible et

$$A = P^{-1} J P.$$

Définition 5.6. Soit $V = \mathbb{C}^n$. Le *décalage* est l'application linéaire

$$U \begin{pmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} x_2 \\ x_3 \\ \vdots \\ 0 \end{pmatrix}.$$

Le décalage plus une constante est aussi une application linéaire

$$U + \lambda \cdot I.$$

Il est facile de voir que la matrice représentant le décalage plus λ est un seul bloc de Jordan

$$\begin{pmatrix} \lambda & 1 & & & \\ & \lambda & 1 & & \\ & & \ddots & \ddots & \\ & & & \lambda & 1 \\ & & & & \lambda \end{pmatrix}.$$

Rappel : Si $\phi_{\mathcal{B}}$ est l'isomorphisme $\phi_{\mathcal{B}}: V \rightarrow \mathbb{C}^n$, où $\phi_{\mathcal{B}}(x) = [x]_{\mathcal{B}}$ sont les coordonnées de x par rapport à la base \mathcal{B} , on a le diagramme suivant

$$\begin{array}{ccc} V & \xrightarrow{T} & V \\ \downarrow \phi_{\mathcal{B}} & & \downarrow \phi_{\mathcal{B}} \\ \mathbb{C}^n & \xrightarrow{A_{\mathcal{B}}^T \cdot x} & \mathbb{C}^n \end{array}$$

Il est clair, qu'il faut s'occuper maintenant des applications linéaires

$$T|_{V_i}: V_i \rightarrow V_i$$

qui sont de la forme $N + \lambda I$ pour une application nilpotente N . Le théorème suivant s'occupe des applications linéaires nilpotentes. La matrice de λI est toujours λI pour chaque base. Il est alors clair que le théorème suivant démontre le théorème 5.17.

Théorème 5.18. Soit V un espace vectoriel sur \mathbb{C} de dimension finie et $N: V \rightarrow V$ une application linéaire nilpotente. Alors V possède une base \mathcal{B} de la forme

$$x_1, Nx_1, \dots, N^{m_1-1}x_1, x_2, Nx_2, \dots, N^{m_2-1}x_2, \dots, x_k, Nx_k, \dots, N^{m_k-1}x_k$$

telle que $N^{m_i}x_i = 0$ pour tout i .

Remarque 5.19. Si on inverse l'ordre de chaque orbite $x_i, Nx_i, \dots, N^{m_i-1}x_i$, on obtient une base \mathcal{B}' et la matrice $A_{\mathcal{B}'}^N$ de l'application N a la forme

$$A_{\mathcal{B}'}^N = \begin{pmatrix} J_1 & & & \\ & J_2 & & \\ & & \ddots & \\ & & & J_k \end{pmatrix}$$

en forme normale de Jordan, où

$$J_i = \begin{pmatrix} 0 & 1 & & & \\ & 0 & 1 & & \\ & & \ddots & \ddots & \\ & & & 0 & 1 \\ & & & & 0 \end{pmatrix} \in \mathbb{C}^{m_i \times m_i}.$$

Par conséquent, $N + \lambda I$ est représentée par

$$A_{\mathcal{B}'}^{N+\lambda I} = A_{\mathcal{B}'}^N + \lambda I_n$$

en forme normale de Jordan.

Démonstration du Théorème 5.18. Pour $x \in V \setminus \{0\}$ on appelle

$$m_x = \min\{i : N^i x = 0\}$$

la *durée de vie* de x . La séquence

$$x, Nx, \dots, N^{m_x-1}x$$

est l'*orbite* de x sous N .

En concaténant les orbites des éléments d'une base et en travaillant sur cet ensemble, nous obtiendrons un ensemble de vecteurs qui engendrent V . Supposons alors qu'au début de l'étape q , nous avons un ensemble x_1, \dots, x_ℓ avec $x_1, \dots, x_\ell \neq 0$ dont les orbites

$$x_1, Nx_1, \dots, N^{m_1-1}x_1, \dots, x_\ell, Nx_\ell, \dots, N^{m_\ell-1}x_\ell \quad (5.6)$$

engendrent V (pour la première étape, on prend $\ell = n$ avec des x_i formant une base de V). Ici m_i est la durée de vie de x_i . Si (5.6) est linéairement dépendant, nous allons soit supprimer un x_i et son orbite (car superflus), soit remplacer un x_i par un vecteur y tel que

- i) Les orbites de $x_1, \dots, x_{i-1}, y, x_{i+1}, \dots, x_\ell$ engendrent aussi l'ensemble V ,
- ii) la somme des durées de vie de $x_1, \dots, x_{i-1}, y, x_{i+1}, \dots, x_\ell$ est strictement plus petite que la somme des durées de vie de x_1, \dots, x_ℓ .

Cela prouvera le théorème parce qu'un tel procédé doit se terminer.

Dès que l'ensemble (5.6) est linéairement dépendant, il existe une combinaison linéaire non triviale de (5.6) qui est égale à 0 :

$$0 = \beta_0^1 x_1 + \beta_1^1 N x_1 + \cdots + \beta_{m_1-1}^1 N^{m_1-1} x_1 + \cdots + \beta_0^\ell x_\ell + \beta_1^\ell N x_\ell + \cdots + \beta_{m_\ell-1}^\ell N^{m_\ell-1} x_\ell$$

Cas 1 :

Supposons que dans notre ensemble $x_1, N x_1, \dots, N^{m_1-1} x_1, \dots, x_\ell, N x_\ell, \dots, N^{m_\ell-1} x_\ell$, il existe i tel que la durée de vie de x_i est 1 (i.e. $N x_i = 0$ et l'orbite associée est seulement constituée de x_i) et supposons que ce x_i apparaisse (avec un coefficient non nul) dans la combinaison linéaire ci-dessus.

En passant tous les termes sauf x_i à gauche, on obtient que x_i est une combinaison linéaire non triviale des éléments de $\{x_1, N x_1, \dots, N^{m_1-1} x_1, \dots, x_\ell, N x_\ell, \dots, N^{m_\ell-1} x_\ell\} \setminus \{x_i\}$. Donc on peut supprimer x_i de cet ensemble et on obtient un nouvel ensemble de la même forme qu'en (5.6), engendrant le même espace, mais avec une orbite en moins.

Cas 2 :

Supposons que nous avons la combinaison linéaire ci-dessus, mais que nous ne sommes pas dans le cas 1.

Maintenant, nous allons appliquer l'application N k -fois, où $k \geq 0$ est le plus grand entier tel que les termes

$$\beta_i^j N^{k+i} x_j$$

ne sont pas tous égaux à zéro. Ainsi, nous avons trouvé un sous-ensemble $J \subseteq \{1, \dots, \ell\}$ et des $\gamma_j \neq 0$ tels que

$$\sum_{j \in J} \gamma_j N^{m_j-1} x_j = 0.$$

Soit $m = \min_{j \in J} m_j - 1 \geq 1$ et soit $i \in J$ un index où le minimum est atteint. Alors

$$0 = N^m \sum_{j \in J} \gamma_j N^{m_j-1-m} x_j = N^m \left(\gamma_i x_i + \sum_{j \in J, j \neq i} \gamma_j N^{m_j-1-m} x_j \right)$$

Maintenant, en posant

$$y = \sum_{j \in J} \gamma_j N^{m_j-1-m} x_j = \gamma_i x_i + \sum_{j \in J, j \neq i} \gamma_j N^{m_j-1-m} x_j$$

Si $y \neq 0$, on remplace x_i par y . Il est alors facile de voir que les orbites de

$$x_1, \dots, x_{i-1}, y, x_{i+1}, \dots, x_\ell$$

engendrent encore V . Et la durée de vie de y est au plus $m < m_i$.

Sinon, les orbites de

$$x_1, \dots, x_{i-1}, x_{i+1}, \dots, x_\ell$$

suffisent alors à engendrer V .

On a alors démontré le théorème. □

Exercices

1. Montrer que les orbites de $x_1, \dots, x_{i-1}, y, x_{i+1}, \dots, x_\ell$ engendrent encore V . (Voir démonstration du théorème 5.18).
2. Le but de cet exercice est de faire la preuve du Théorème 5.17 "à l'envers".
Soit $T: V \rightarrow V$ un endomorphisme. Soit $\phi: V \rightarrow \mathbb{C}^n$ l'isomorphisme associé à une base B de V et à la base canonique E de \mathbb{C}^n . Supposons que $A_B = ([T(b_1)]_E, \dots, [T(b_n)]_E)$, la matrice de T relativement à la base B , admette une forme normale de Jordan J avec matrice de passage $P = (p_1, \dots, p_n)$.
Montrer qu'il existe des sous-espaces V_1, \dots, V_k de V tels que pour tout i :
 - a) $V = V_1 \oplus \dots \oplus V_k$;
 - b) $V_i = \phi(\text{span}(p_{k_i}, \dots, p_{k_i+l_i}))$;
 - c) $T(V_i) \subset V_i$;
 - d) $T|_{V_i} = N_i + \lambda_i I$, où $N_i: V_i \rightarrow V_i$ est nilpotente ;
 - e) $\{\lambda_1, \dots, \lambda_k\} = \{J_{11}, \dots, J_{nn}\}$.
3. Le but de cet exercice est de montrer les propriétés des décompositions comme dans le Lemme 5.15.
Soit $T: V \rightarrow V$ un endomorphisme et soit V_1, \dots, V_k une décomposition de V tel que $V = V_1 \oplus \dots \oplus V_k$, $T(V_i) \subset V_i$ et $T|_{V_i} = N_i + \lambda_i I$, où $N_i: V_i \rightarrow V_i$ est nilpotente.
Montrer que :
 - a) $V_i \subset \ker(T - \lambda_i I)^{a_i}$ pour un entier a_i tel que $N_i^{a_i} = 0$.
 - b) Les $\lambda_1, \dots, \lambda_k$ sont des valeurs propres (pas forcément distinctes) de T . (*Indice* : Utiliser par exemple le premier point).
 - c) Le polynôme $f(x) = \prod_{i=1}^k (x - \lambda_i)^{a_i}$ annule T . (*Indice* : Montrer que $f(T)v = 0$ pour tout $v \in V$ en utilisant la décomposition de V et le premier point).
 - d) En déduire que l'ensemble $\{\lambda_1, \dots, \lambda_k\}$ contient toutes les valeurs propres de T (*Indice* : Si $v \neq 0$ est un vecteur propre de T de valeur propre λ , exprimer $f(T)v$ en fonction de f , λ , et v).
 - e) En déduire que les valeurs sur la diagonale de n'importe quelle forme normale de Jordan de T constituent l'ensemble des valeurs propres de T . (*Indice* : Utiliser l'exercice 2.)
4. Comparer les polynômes caractéristiques de J et A . En déduire que les éléments diagonaux de J contiennent exactement l'ensemble des valeurs propres de A et le nombre d'apparitions de chaque valeur propre sur la diagonale de J est égale à la multiplicité algébrique de ladite valeur propre.
5. Soit $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ et soient J une forme normale de Jordan de A , P la matrice de passage associée ($A = PJP^{-1}$).
Le but de cet exercice est de montrer que le nombre de blocs de Jordan sur J associé à une valeur propre λ est exactement $\dim \ker(A - \lambda I)$.

- a) Soit $S = \begin{pmatrix} S_1 & 0 \\ 0 & S_2 \end{pmatrix}$ une matrice blocs diagonale. Montrer que

$$\text{rang}(S) = \text{rang}(S_1) + \text{rang}(S_2)$$

Généraliser pour p blocs sur la diagonale. (*Indice* : Considérer les lignes linéairement indépendantes de S_1, S_2).

- b) Soit $B = U + \lambda I \in \mathbb{C}^{q \times q}$ un bloc de Jordan, où U est l'application de décalage. Montrez que la seule valeur propre de B est λ et que l'espace propre associé est engendré par e_1 . Déduisez $\dim \ker(B - \lambda I) = 1$ et $\dim \text{Im}(B - \lambda I) = q - 1$.
- c) Soient B_1, \dots, B_k l'ensemble des blocs de Jordan sur J associé à une valeur propre λ . Déduire de a) et b) que $\dim \text{Im}(J - \lambda I) = n - k$.
- d) En déduire que $\dim \ker(A - \lambda I) = k$ et que $\ker(A - \lambda I) = \text{span}(Pe_{i_1}, \dots, Pe_{i_k})$, où les i_j sont les indices des premières lignes/colonnes des B_1, \dots, B_k dans J .
6. Déduire des exercices 4 et 5 que si A est diagonalisable, la forme normale de Jordan J de A est diagonale.
7. Soit $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ une matrice diagonalisable. Montrer que $\ker(A - \lambda I) = \ker(A - \lambda I)^k$ pour toute valeur propre λ de A et pour tout $k > 0$. (*Indice* : Diagonaliser d'abord $(A - \lambda I)$ et $(A - \lambda I)^k$ de manière simultanée).
8. Trouver deux matrices $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ et $B \in \mathbb{C}^{n \times n}$ qui ont le même polynôme caractéristique, mais qui ne sont pas similaires (*Rappel* : A et B sont dites similaires s'il existe une matrice P inversible telle que $B = P^{-1}AP$).
9. Soit $J \in \mathbb{C}^{n \times n}$ une matrice en forme normale de Jordan. Montrer que J et J^T sont similaires. En déduire que pour tout $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$, les matrices A et A^T sont similaires.

6 Algèbre linéaire sur les entiers

Quand est-ce qu'un système d'équations linéaires possède une solution en nombre entiers ? Étant donné $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$ et $b \in \mathbb{Z}^m$, on aimerait décider si

$$Ax = b, x \in \mathbb{Z}^n \quad (6.1)$$

est résoluble et trouver toutes les solutions.

Une condition nécessaire pour que le système (6.1) soit soluble est qu'il existe une solution $x \in \mathbb{Q}^n$, et donc que $\text{rang}(A) = \text{rang}(A|b)$. Aussi, on peut supprimer une ligne de $(A|b)$ qui est dans le span des autres lignes. On peut alors supposer que A est de rang ligne plein, c'est-à-dire que $\text{rang}(A) = m$.

Définition 6.1. Un nombre entier $d \in \mathbb{Z}$ *divise* un nombre entier $a \in \mathbb{Z}$ s'il existe un nombre entier $x \in \mathbb{Z}$ tel que $d \cdot x = a$. On note alors $d \mid a$, et si d ne divise pas a on écrit $d \nmid a$.

Définition 6.2. Un nombre $d \in \mathbb{Z}$ est un diviseur commun de $a \in \mathbb{Z}$ et $b \in \mathbb{Z}$, si $d \mid a$ et $d \mid b$. Si $\max\{|a|, |b|\} \geq 1$, l'ensemble des diviseurs commun de a et b est un ensemble fini. Dans ce cas, on dénote le *plus grand diviseur commun* de a et b par $\text{gcd}(a, b)$.

Théorème 6.1. Soient $a, b \in \mathbb{Z}$ et $\max\{|a|, |b|\} \geq 1$. On a

$$\text{gcd}(a, b) = \min\{x \cdot a + y \cdot b : x, y \in \mathbb{Z}, x \cdot a + y \cdot b \geq 1\}.$$

Démonstration. Soit d un diviseur commun de a et b . Alors il existe $x^*, y^* \in \mathbb{Z}$ tel que $a = d \cdot x^*$ et $b = d \cdot y^*$. Si $x \cdot a + y \cdot b \geq 1$, où $x, y \in \mathbb{Z}$, alors

$$x \cdot a + y \cdot b = (x \cdot x^* + y \cdot y^*)d \geq |d|.$$

Par conséquent, on a $d \leq \min\{x \cdot a + y \cdot b : x, y \in \mathbb{Z}, x \cdot a + y \cdot b \geq 1\}$. Montrons que $\min\{x \cdot a + y \cdot b : x, y \in \mathbb{Z}, x \cdot a + y \cdot b \geq 1\}$ est un diviseur commun de a et b . Supposons que $\min \nmid a$. Alors la division avec reste implique l'existence de $q, r \in \mathbb{Z}$ tels que

$$a = q \cdot \min + r \quad \text{et} \quad 1 \leq r < \min.$$

Soient x, y les entiers qui vérifient $\min = x \cdot a + y \cdot b$, alors

$$1 \leq r = a - q \cdot (x \cdot a + y \cdot b) = (1 - q \cdot x)a - qy \cdot b.$$

Or r est strictement plus petit que \min , ce qui est absurde. Il suit donc que $\min \mid a$ et, de façon analogue, $\min \mid b$. Aussi, on a montré que pour tout diviseur commun d de a et b , $\min\{x \cdot a + y \cdot b : x, y \in \mathbb{Z}, x \cdot a + y \cdot b \geq 1\} \geq d$ et donc que $\min\{x \cdot a + y \cdot b : x, y \in \mathbb{Z}, x \cdot a + y \cdot b \geq 1\} = \text{gcd}(a, b)$ □

Corollaire 6.2. Soient $a, b \in \mathbb{Z}$ et $\max\{|a|, |b|\} \geq 1$. Le $\gcd(a, b)$ est le diviseur commun positif qui est divisé par chaque diviseur commun de a et b .

Pour calculer le plus grand diviseur commun de a et b on peut utiliser l'algorithme d'Euclide. Soient $a_0 \geq a_1 \in \mathbb{Z}$ pas tous les deux nuls. Si $a_1 = 0$, alors

$$\gcd(a_0, a_1) = a_0.$$

Autrement, on applique la division avec reste

$$a_0 = q_1 a_1 + a_2,$$

où $q_1, a_2 \in \mathbb{Z}$ et $0 \leq a_2 < a_1$. Un nombre entier $d \in \mathbb{Z}$ est un diviseur commun de a_0 et a_1 si et seulement si d est un diviseur commun de a_1 et a_2 . L'algorithme d'Euclide est le procédé de calculer la suite $a_0, a_1, a_2, \dots, a_{k-1}, a_k \in \mathbb{Z}$ où $a_{k-1} > 0$, $a_k = 0$ et

$$a_{i-1} = q_i a_i + a_{i+1}$$

est le résultat de la division avec reste de a_{i-1} par a_i .

Exemple 6.1. On calcule le plus grand diviseur commun de $a_0 = 52$ et $a_1 = 22$:

$$52 = 2 \cdot 22 + 8, \quad 22 = 2 \cdot 8 + 6, \quad 8 = 1 \cdot 6 + 2, \quad 6 = 3 \cdot 2 + 0.$$

La suite est alors $a_0 = 52, a_1 = 22, a_3 = 8, a_4 = 6, a_5 = 2, a_6 = 0$. Ainsi $\gcd(52, 22) = 2$.

Le calcul des suites a_i et q_i donne aussi une représentation $\gcd(a_0, a_1) = x \cdot a_0 + y \cdot a_1$, $x, y \in \mathbb{Z}$. En effet

$$\begin{pmatrix} a_i \\ a_{i+1} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & -q_i \end{pmatrix} \begin{pmatrix} a_{i-1} \\ a_i \end{pmatrix}$$

et alors

$$\begin{pmatrix} a_{k-1} \\ a_k \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & -q_{k-1} \end{pmatrix} \cdots \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & -q_1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} a_0 \\ a_1 \end{pmatrix}.$$

Exemple 6.2. On continue l'exemple 6.1.

$$\begin{aligned} \begin{pmatrix} 2 \\ 0 \end{pmatrix} &= \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & -3 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & -1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 5 \\ 22 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} 3 & -7 \\ -11 & 26 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 52 \\ 22 \end{pmatrix} \end{aligned}$$

Alors $2 = \gcd(52, 22) = 3 \cdot 52 - 7 \cdot 22$.

Nous pouvons donc résoudre le problème (6.1) dans le cas où $m = 1$ et $n = 2$.

Théorème 6.3. Soient $a, b \in \mathbb{Z}$ pas tous les deux nuls et $c \in \mathbb{Z}$. L'équation

$$x \cdot a + y \cdot b = c, \quad x, y \in \mathbb{Z} \tag{6.2}$$

possède une solution si et seulement si $\gcd(a, b) \mid c$.

Démonstration. Soient $x', y' \in \mathbb{Z}$ tel que $x'a + y'b = \gcd(a, b)$. Si $\gcd(a, b) \mid c$ alors il existe un $z \in \mathbb{Z}$ tel que $z \cdot \gcd(a, b) = c$ et $zx'a + zy'b = c$ est une solution en nombre entiers de (6.2).

S'il existe une solution de (6.2), alors chaque diviseur commun de a et b est aussi un diviseur de c . \square

Exercices

1. Démontrer le Corollaire 6.2.
2. Soient $n \geq 2$ et $a_1, \dots, a_n \in \mathbb{Z}$ pas tous égaux à zéro. On définit $\gcd(a_1, \dots, a_n)$ comme étant le plus grand diviseur commun de a_1, \dots, a_n . Montrer :
 - i) $\gcd(a_1, \dots, a_n) = \min\{x_1a_1 + \dots + x_na_n : x_1a_1 + \dots + x_na_n \geq 1, x_i \in \mathbb{Z}, i = 1, \dots, n\}$.
 - ii) $\gcd(a_1, \dots, a_n) = \gcd(\gcd(a_1, a_2), a_3, \dots, a_n)$ pour $n \geq 3$.
3. Soit $a_0 \geq a_1 \geq \dots \geq a_k = 0$ la suite calculée par l'algorithme d'Euclide. Montrer $a_{i-1} \geq 2 \cdot a_{i+1}$ et conclure que $k \leq 2 \cdot \log_2(a_0) + 1$.

6.1 La forme normale d'Hermite

Maintenant on s'occupe du problème (6.1) où $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$ et $b \in \mathbb{Z}^m$ et $\text{rang}(A) = m$.

Lemme 6.4. Soit $A \in \mathbb{Z}^{n \times n}$ une matrice inversible (sur \mathbb{Q}), alors $A^{-1} \in \mathbb{Z}^{n \times n}$ si et seulement si $\det(A) = \pm 1$.

Démonstration. Supposons que $A^{-1} \in \mathbb{Z}^{n \times n}$. Alors $1 = \det(I_n) = \det(A^{-1})\det(A)$. Les deux facteurs $\det(A^{-1})$ et $\det(A)$ sont des nombres entiers. Les seuls diviseurs de 1 en nombre entiers sont 1 et -1 .

Réciproquement, si $\det(A) = \pm 1$, on a

$$A^{-1} = \text{ad}(A) / \det(A) \in \mathbb{Z}^{n \times n}.$$

où $\text{ad}(A) \in \mathbb{Z}^{n \times n}$ est la matrice complémentaire de A . On se rappelle que $(\text{ad}(A))_{ij} = (-1)^{i+j} \det(A_{ji})$ où $A_{ji} \in \mathbb{Z}^{(n-1) \times (n-1)}$ est la matrice qu'on obtient de A en supprimant la j -ème ligne et i -ème colonne. \square

Définition 6.3. Une matrice $U \in \mathbb{Z}^{n \times n}$ telle que $\det(U) = \pm 1$ est appelée *unimodulaire*.

Remarque 6.5. Soit $U \in \mathbb{Z}^{n \times n}$ une matrice unimodulaire. Un $x^* \in \mathbb{Z}^n$ est une solution du problème (6.1) si et seulement si $U^{-1}x^* \in \mathbb{Z}^n$ est une solution du problème

$$AUx = b, x \in \mathbb{Z}^n. \quad (6.3)$$

L'idée est maintenant de trouver une matrice unimodulaire $U \in \mathbb{Z}^{n \times n}$ telle que

$$A \cdot U = [H|0] \quad (6.4)$$

où

$$H = \begin{pmatrix} h_{11} & & & \\ h_{21} & h_{22} & & \\ & & \ddots & \\ h_{m1} & \dots & \dots & h_{mm} \end{pmatrix}$$

est une matrice triangulaire. Le problème (6.1) est alors soluble si et seulement si $H^{-1}b \in \mathbb{Z}^n$.

Définition 6.4. Soit $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$ une matrice. Une *opération élémentaire unimodulaire* est l'une des trois opérations suivantes

- i) Multiplier une colonne par -1 .
- ii) Échanger deux colonnes de A .
- iii) Additionner un multiple entier d'une colonne de A à une autre colonne de A .

Exemple 6.3. Une suite d'opérations élémentaire unimodulaire sur A correspond à la multiplication $A \cdot U$ où $U \in \mathbb{Z}^{n \times n}$ est une matrice unimodulaire. Soit

$$A = \begin{pmatrix} 3 & 6 & 2 \\ 11 & 5 & 7 \end{pmatrix}.$$

Échanger les colonnes 1 et 2 correspond à la multiplication à droite de A avec la matrice unimodulaire

$$\begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}.$$

$$\begin{pmatrix} 6 & 3 & 2 \\ 5 & 11 & 7 \end{pmatrix} = A \cdot \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

Additionner -3 fois la colonne 3 sur la colonne 1 est la multiplication à droite de A avec la matrice unimodulaire

$$\begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \\ -3 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

$$\begin{pmatrix} 0 & 3 & 2 \\ -16 & 11 & 7 \end{pmatrix} = A \cdot \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \\ -3 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

Exemple 6.4. Est-ce que le système

$$\begin{pmatrix} 3 & 6 & 2 \\ 11 & 5 & 10 \end{pmatrix} x = \begin{pmatrix} 2 \\ 2 \end{pmatrix}, x \in \mathbb{Z}^3 \quad (6.5)$$

possède une solution ? Soustrayons la colonne 3 à la colonne 1 :

$$\begin{pmatrix} 1 & 6 & 2 \\ 1 & 5 & 10 \end{pmatrix}$$

Ensuite, on soustrait six fois la colonne 1 à la colonne 2 et deux fois la colonne 1 à la colonne 3 :

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 1 & -1 & 8 \end{pmatrix}$$

Puis, on additionne huit fois la colonne 2 à la colonne 3 :

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 1 & -1 & 0 \end{pmatrix}.$$

Le système (6.5) se réduit finalement à résoudre

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 1 & -1 & 0 \end{pmatrix} y = b, y \in \mathbb{Z}^3$$

où $y = U^{-1}x$ pour une matrice unimodulaire U adéquate. On conclut donc qu'il possède une solution entière. En fait

$$\begin{pmatrix} 3 & 6 & 2 \\ 11 & 5 & 10 \end{pmatrix} x = b, x \in \mathbb{Z}^3$$

est soluble pour tout $b \in \mathbb{Z}^2$.

Lemme 6.6. Soit $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$ une matrice à coefficients entiers, alors il existe une matrice unimodulaire $U \in \mathbb{Z}^{n \times n}$ telle que la première ligne de AU est de la forme $(d, 0, \dots, 0)$, où $d \in \mathbb{Z}$.

Démonstration. Si la première ligne n'est pas de cette forme, et si elle possède seulement une composante qui n'est pas égale à zéro, on échange les colonnes de sorte que la matrice résultante soit de la forme souhaitée.

Autrement, il existe deux indices de colonne $j_1 \neq j_2$, tels que $a_{1j_1} \neq 0$ et $a_{1j_2} \neq 0$. On peut supposer, quitte à permuter les colonnes j_1 et j_2 , que $|a_{1j_1}| \geq |a_{1j_2}|$. La division avec reste nous donne des entiers $q \in \mathbb{Z}$ et $0 \leq r < |a_{1j_2}|$ tels que

$$a_{1j_1} = q \cdot a_{1j_2} + r.$$

6 Algèbre linéaire sur les entiers

On applique l'opération unimodulaire : *Soustraire q fois la colonne j_2 à la colonne j_1* , ce qui a pour effet de remplacer a_{1j_1} par r et de laisser les autres composantes de la première ligne intactes. Comme

$$0 < |r| + |a_{1j_2}| < |a_{1j_1}| + |a_{1j_2}|$$

ce procédé ne peut être répété infiniment. Il existe alors une matrice unimodulaire qui transforme A en une matrice dont la première ligne possède une seule composante non nulle. Un échange de colonnes adéquat donne la forme désirée. \square

Corollaire 6.7. *Soit $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$ une matrice en nombre entiers. Alors il existe une matrice unimodulaire $U \in \mathbb{Z}^{n \times n}$ telle que $A \cdot U$ est de la forme (6.4).*

Démonstration. On raisonne par récurrence sur m . Le cas $m = 1$ suit directement du Lemme 6.6. Soit $m > 1$. Le Lemme 6.6 implique qu'il existe une matrice unimodulaire $U_1 \in \mathbb{Z}^{n \times n}$ telle que

$$A \cdot U_1 = \begin{pmatrix} d & 0 \cdots 0 \\ a & A' \end{pmatrix}$$

où $d \in \mathbb{Z}$, $a \in \mathbb{Z}^{m-1}$ et $A' \in \mathbb{Z}^{(m-1) \times (n-1)}$. Par l'hypothèse de récurrence, il existe une matrice unimodulaire $U_2 \in \mathbb{Z}^{(n-1) \times (n-1)}$ telle que $A'U_2$ est de la forme désirée. Clairement

$$\begin{pmatrix} 1 & 0^T \\ 0 & U_2 \end{pmatrix} \in \mathbb{Z}^{n \times n}$$

est une matrice unimodulaire et

$$AU_1 \begin{pmatrix} 1 & 0^T \\ 0 & U_2 \end{pmatrix}$$

est de la forme (6.4). \square

Définition 6.5. Une matrice $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$ est en *forme normale d'Hermite*, si elle est de la forme (6.4), où $h_{ii} > 0$ pour tout $1 \leq i \leq m$ et $0 \leq h_{ij} < h_{ii}$ pour tout $1 \leq j < i \leq m$.

Théorème 6.8. *Soit $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$ une matrice en nombre entiers. Alors il existe une matrice unimodulaire $U \in \mathbb{Z}^{n \times n}$ telle que $A \cdot U$ est en forme normale d'Hermite.*

Définition 6.6. Soit $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$ et $\text{rang}(A) = m$. L'ensemble $\Lambda(A) := \{Ax, x \in \mathbb{Z}^n\}$ est un *réseau entier généré* de A . Une matrice $B \in \mathbb{Z}^{m \times m}$ telle que $\Lambda(A) = \Lambda(B)$ est appelée *base* de $\Lambda(A)$.

Remarque 6.9. Une base $B \in \mathbb{Z}^{m \times m}$ de $\Lambda(A)$ est inversible.

Corollaire 6.10. *Chaque réseau entier possède une base.*

Théorème 6.11. *Soient $A, B \in \mathbb{Z}^{m \times m}$ en forme normale d'Hermite. Alors $\Lambda(A) = \Lambda(B)$ si et seulement si $A = B$.*

Démonstration.

⊆ Trivial.

⊇ On montre que si $A \neq B$ alors $\Lambda(A) \neq \Lambda(B)$.

Supposons alors que $\Lambda(A) = \Lambda(B)$.

On note $A = \begin{pmatrix} a_{11} & & \\ & \ddots & \\ a_{m1} & & a_{mm} \end{pmatrix}$ et $B = \begin{pmatrix} b_{11} & & \\ & \ddots & \\ b_{m1} & & b_{mm} \end{pmatrix}$.

Soit i l'indice minimal tel que la i -ème ligne de A et celle de B soient différentes. Alors $\exists j \in \{1, \dots, i\}$ tel que $a_{ij} \neq b_{ij}$ et sans perte de généralité on a $a_{ij} > b_{ij}$. Clairement en

notant A_j (resp. B_j) la j -ème colonne de A (resp. B), on a $A_j - B_j = \begin{pmatrix} 0 \\ \vdots \\ 0 \\ a_{ij} - b_{ij} \\ \vdots \end{pmatrix} \in \Lambda(A)$

avec $a_{ii} > a_{ij} - b_{ij} > 0$.

Il existe donc forcément un vecteur entier z tel que $A_j - B_j = Az$. On montre aisément que les $i - 1$ premières coordonnées de z doivent être nulles car aucun élément diagonal de A ne l'est (ou, de manière équivalente, car A est de rang plein). Or, en comparant la i -ème coordonnée, on trouve que $a_{ij} - b_{ij} = a_{ii}z_i$. Dès lors, $a_{ii} \mid a_{ij} - b_{ij}$ ce qui est une contradiction. \square

Remarque 6.12. Le Théorème 7.10 nous permet de vérifier, pour $A \in \mathbb{Z}^{m \times n_1}$ et $B \in \mathbb{Z}^{m \times n_2}$ de rang ligne pleins, si $\Lambda(A) = \Lambda(B)$. On calcule $(H_A|0)$ et $(H_B|0)$ les formes normales d'Hermité de A et B . Comme $\Lambda(A) = \Lambda(H_A)$ et $\Lambda(B) = \Lambda(H_B)$, on a que $\Lambda(A) = \Lambda(B)$ si et seulement si $H_A = H_B$.

Exemple 6.5. On va transformer $A = \begin{pmatrix} 4 & 6 & 10 \\ 6 & 12 & 9 \end{pmatrix}$ en forme normale d'Hermité afin de trouver toutes les solutions entières de

$$\begin{pmatrix} 4 & 6 & 10 \\ 6 & 12 & 9 \end{pmatrix} x = \begin{pmatrix} 6 \\ 3 \end{pmatrix}, x \in \mathbb{Z}^3. \quad (6.6)$$

$$\begin{array}{cc}
 \begin{pmatrix} 4 & 6 & 10 \\ 6 & 12 & 9 \end{pmatrix} & \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \\
 \begin{pmatrix} 4 & 2 & 2 \\ 6 & 6 & -3 \end{pmatrix} & \begin{pmatrix} 1 & -1 & -2 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \\
 \begin{pmatrix} 2 & 4 & 2 \\ 6 & 6 & -3 \end{pmatrix} & \begin{pmatrix} -1 & 1 & -2 \\ 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \\
 \begin{pmatrix} 2 & 0 & 0 \\ 6 & -6 & -9 \end{pmatrix} & \begin{pmatrix} -1 & 3 & -1 \\ 1 & -2 & -1 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \\
 \begin{pmatrix} 2 & 0 & 0 \\ 6 & 3 & -9 \end{pmatrix} & \begin{pmatrix} -1 & 4 & -1 \\ 1 & -1 & -1 \\ 0 & -1 & 1 \end{pmatrix} \\
 \begin{pmatrix} 2 & 0 & 0 \\ 6 & 3 & 0 \end{pmatrix} & \begin{pmatrix} -1 & 4 & 11 \\ 1 & -1 & -4 \\ 0 & -1 & -2 \end{pmatrix} \\
 \begin{pmatrix} 2 & 0 & 0 \\ 0 & 3 & 0 \end{pmatrix} & \begin{pmatrix} -9 & 4 & 11 \\ 3 & -1 & -4 \\ 2 & -1 & -2 \end{pmatrix}
 \end{array} \tag{6.7}$$

L'ensemble des solutions entières de (6.6) est

$$\left\{ \begin{pmatrix} -23 \\ 8 \\ 5 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} 11 \\ -4 \\ -2 \end{pmatrix} \cdot z : z \in \mathbb{Z} \right\}$$

Définition 6.7. Soit $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$. Le noyau de A sur \mathbb{Z} est défini par $\ker_{\mathbb{Z}}(A) := \{y \in \mathbb{Z}^n, Ay = 0\}$.

Théorème 6.13. Soient $A, B \in \mathbb{Z}^{m \times m}$ en forme normale de Hermite avec $\text{rang}(A) = \text{rang}(B) = m$. Alors $\Lambda(A) = \Lambda(B) \Leftrightarrow \exists U \in \mathbb{Z}^{m \times m}$ unimodulaire telle que $B = AU$.

Démonstration.

\Rightarrow Si $\Lambda(A) = \Lambda(B)$ alors

$$A = BP, P \in \mathbb{Z}^{m \times m}$$

$$B = AQ, Q \in \mathbb{Z}^{m \times m}$$

alors on obtient $A = AQP$ ce qui implique $QP = I_m$ et donc on a bien P, Q unimodulaires.

\Leftarrow Si $B = AU, U \in \mathbb{Z}^{m \times m}$ unimodulaire alors comme $U\mathbb{Z}^m = \mathbb{Z}^m$ on obtient immédiatement $\Lambda(A) = \Lambda(B)$. \square

Définition 6.8. Soient $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$ avec $\text{rang}(A) = m$ et $\Lambda(A)$ le réseau entier de A . Le déterminant du réseau $\Lambda(A)$ est donné par $\det(\Lambda(A)) := |\det(B)|$ où $B \in \mathbb{Z}^{m \times m}$ est une base de $\Lambda(A)$

Remarque 6.14. Le théorème 6.13 assure que $|\det(B)|$ ne dépend pas du choix de B et donc que $\det(\Lambda(A))$ a du sens.

Exercices

1. Soit $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$ avec rang ligne plein. Le noyau entier de A est l'ensemble

$$\ker_{\mathbb{Z}}(A) = \{x \in \mathbb{Z}^n : Ax = 0\}.$$

Soit $U \in \mathbb{Z}^{n \times n}$ une matrice unimodulaire telle que

$$A \cdot U = (H|0)$$

est la forme normale d'Hermite. Montrer que $\ker_{\mathbb{Z}}(A) = \{y_1 u_1 + \dots + y_{n-m} u_{n-m} : y_i \in \mathbb{Z}\}$ où u_1, \dots, u_{n-m} sont les dernières $n - m$ colonnes de U .

6.2 La forme normale de Smith

À partir de maintenant, on se donne une matrice $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$ avec $\text{rang}(A) = k$ et k n'est pas forcément m .

Définition 6.9. Soit $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$ alors $\Lambda(A) = \{Ax, x \in \mathbb{R}^n\}$ est le *réseau entier général* de A .

Théorème 6.15. Soit $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$ avec $\text{rang}(A) = k$ alors $\exists B \in \mathbb{Z}^{m \times k}$ tq. $\Lambda(A) = \Lambda(B)$. B est alors appelée une *base générale* de $\Lambda(A)$.

Remarque 6.16. $\text{rang}(A) = \text{rang}(B) = k$.

Démonstration. Supposons que les k premières lignes de A sont linéairement indépendantes.

Dès lors on a $A = \begin{pmatrix} A' \\ A'' \end{pmatrix}$ avec $A' \in \mathbb{Z}^{k \times n}$ et $\text{rang}(A') = k$ soit alors $U \in \mathbb{Z}^{n \times n}$ unimodulaire tq. $A'U = [H|0]$ ou $H \in \mathbb{Z}^{k \times k}$ est en forme normale de Hermite. Alors on peut se convaincre en raisonnant sur les rangs que $AU = \begin{pmatrix} H & 0 \\ B & 0 \end{pmatrix}$. Dès lors on a

$$\Lambda(A) = A\mathbb{Z}^n = AU\mathbb{Z}^n = \begin{pmatrix} H \\ B \end{pmatrix} \mathbb{Z}^k = \Lambda\left(\begin{pmatrix} H \\ B \end{pmatrix}\right).$$

□

Théorème 6.17. Soit G un sous groupe de \mathbb{Z}^n alors $\exists B \in \mathbb{Z}^{n \times k}$ avec $\text{rang}(B) = k$ et tq. $\Lambda(B) = G$

Démonstration. Soit $(v_1, \dots, v_k) \in G^k$ tq. (v_1, \dots, v_k) est une base de $\text{span}(G)$ (qui existe car on peut toujours extraire une base d'un espace de dimension fini d'une partie génératrice même infinie). Alors posons $B = (v_1 \dots v_k)$

6 Algèbre linéaire sur les entiers

cas 1 : $\Lambda(B) = G$ et c'est terminé.

cas 2 : $\Lambda(B) \subsetneq G$ alors $\exists v^* \in G - \Lambda(B)$. Soit alors $B^* \in \mathbb{Z}^{n \times k}$ une base générale du réseau général $G \supseteq \Lambda(v_1 \dots v_k v^*) \supsetneq \Lambda(B)$. Alors $\exists U \in \mathbb{Z}^{k \times k}$ tq. $B = B^*U$ et on a nécessairement $|\det(U)| \in \mathbb{N}_{\geq 2}$. Dés lors on peut remarquer que $|\det(B^T B)| = \det(U)^2 \times |\det(B^{*T} B^*)|$ et donc $|\det(B^T B)| \leq \frac{1}{4} |\det(B^T B)|$ mais comme $|\det(B^{*T} B^*)| \geq 1$ et on peut répéter ces opérations sur B^* mais ce procédé ne peut pas continuer indéfiniment. \square

Théorème 6.18. Soit $A \in \mathbb{Z}^{m \times n} - \{0\}$ alors $\exists U \in \mathbb{Z}^{m \times m}$ et $V \in \mathbb{Z}^{n \times n}$ unimodulaires

tq. $UAV = \begin{pmatrix} \delta_1 & & & \\ & \ddots & & \\ & & \delta_k & \\ & & & \dots \end{pmatrix}$ avec $\delta_i \in \mathbb{N}_{\geq 1}$ et $\delta_1 | \dots | \delta_k$ et les coefficients non spécifiés sont 0.

Démonstration. On raisonne par récurrence sur m .

$m=1$: alors $A = (a_1 \dots a_n)$ mais alors on sait que $\exists V \in \mathbb{Z}^{n \times n}$ tq. $A \rightsquigarrow (d \ 0 \dots 0)$. On prenant $U = I_m$ on termine l'initialisation.

$m > 1$: Si nécessaire on échange les lignes de A de sorte à ce que la première ligne soit

non nulle. Alors $A = \begin{pmatrix} a_1 & \dots & a_n \\ & & A' \end{pmatrix}$ et on sait que $\exists V \in \mathbb{Z}^{n \times n}$ tq. $A \rightsquigarrow \begin{pmatrix} d & 0 & \dots & 0 \\ \alpha_1 & & & \\ \vdots & & & A'' \\ \alpha_m & & & \end{pmatrix}$

Si $d | \alpha_i \ \forall i \in \{2, \dots, m\}$ alors on effectue $C_i \leftarrow C_i - \frac{\alpha_i}{d} C_1$ et on obtient $A \rightsquigarrow$

$$\begin{pmatrix} d & 0 & \dots & 0 \\ 0 & & & \\ \vdots & & & A'' \\ 0 & & & \end{pmatrix}$$

Si non $d \nmid \alpha_j$ pour $j \in \{2, \dots, m\}$ et donc on a $\text{pgcd}(d, \alpha_2, \dots, \alpha_n) < d$. Ainsi $\exists U \in \mathbb{Z}^{m \times m}$

tq. $A \rightsquigarrow \begin{pmatrix} \tilde{d} & \beta_2 & \dots & \beta_n \\ 0 & & & \\ \vdots & & & A''' \\ 0 & & & \end{pmatrix}$ avec $\tilde{d} < d$. On construit alors une suite strictement

décroissante de \tilde{d} mais ce dernier doit rester strictement positif et donc ce procédé

se termine forcément. On obtient donc finalement $A \rightsquigarrow \begin{pmatrix} f & 0 & \dots & 0 \\ 0 & & & \\ \vdots & & & A^* \\ 0 & & & \end{pmatrix}$. Mais

par hypothèse de récurrence on sait que $\exists U^* \in \mathbb{Z}^{m-1 \times m-1}, V^* \in \mathbb{Z}^{n-1 \times n-1}$ unimo-

dulaires tq. $U^* A^* V^* = \begin{pmatrix} d_2 & & \\ & \ddots & \\ & & d_k \end{pmatrix}$ avec $d_2 | \dots | d_k$ dès lors on remarque que

$\begin{pmatrix} 1 & \\ & U^* \end{pmatrix} A \begin{pmatrix} 1 & \\ & V^* \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} f & & \\ & \ddots & \\ & & d_k \end{pmatrix}$. Dès lors si $f | d_2$ c'est terminé sinon on

peut effectuer l'opération $L_1 \leftarrow L_1 + L_2$ et transformer $A \dashrightarrow \begin{pmatrix} f & d_2 & \\ & \ddots & \\ & & d_k \end{pmatrix}$ puis

on répète l'argument déjà utilisé pour transformer cette nouvelle matrice en $A \dashrightarrow \begin{pmatrix} \tilde{f} & & \\ & \ddots & \\ & & d'_k \end{pmatrix}$ avec $\tilde{f} < f$. Une fois de plus ce procédé crée une suite strictement

décroissante de \tilde{f} , ce dernier restant strictement positif le processus doit se terminer et

on finit par obtenir $A \dashrightarrow \begin{pmatrix} d_1 & & \\ & \ddots & \\ & & d_k \end{pmatrix}$ avec $d_1 | \dots | d_k$. □

7 Groupes

Dans ce chapitre on s'intéresse à l'étude des groupes.

7.1 Groupes abéliens engendrés finis

Définition 7.1. Soit $(G, +)$ un groupe alors $H \subset G$ est un sous groupe si $(H, +|_H)$ est un groupe.

Lemme 7.1. $(H, \times|_H)$ est un sous groupe de $(G, \times) \Leftrightarrow \forall a, b \in H \quad a \times b^{-1} \in H$

Définition 7.2. $H \leq G$ est un sous groupe normal de G ssi $\forall g \in G \quad Hg = gH$ On note $H \trianglelefteq G$.

Définition 7.3. Soient $g, g' \in G$ alors on pose $Hg \circ Hg' := H(gg')$.

Théorème 7.2. \circ munit $G/H := \{gH, \quad g \in G\}$ d'une structure de groupe ssi $H \trianglelefteq G$.

Définition 7.4. Soient $(G, +), (G', \times)$ deux groupes et $\phi : G \rightarrow G'$ une application alors ϕ est un homomorphisme ssi $\forall a, b \in G, \phi(a + b) = \phi(a) \times \phi(b)$.

Remarque 7.3. $\ker(\phi) \trianglelefteq G$.

Théorème 7.4. Si ϕ est un morphisme alors $G/\ker(\phi) \cong \text{Im}(\phi)$.

Définition 7.5. Soit $(G, +)$ un groupe abélien. On dit que $(G, +)$ est engendré fini si $\exists g_1, \dots, g_n \in G$ tq. $G = \{x_1g_1 + \dots + x_n g_n, x_i \in \mathbb{Z}\}$.

Définition 7.6. Soient $(G_1, +), (G_2, \times)$ deux groupes alors $G_1 \otimes G_2 := (G_1 \times G_2, \bullet)$ avec $\forall (g_1, g_2), (g'_1, g'_2) \in G_1 \times G_2, (g_1, g_2) \bullet (g'_1, g'_2) = (g_1 + g_2, g'_1 \times g'_2)$.

Remarque 7.5. $G_1 \otimes G_2$ est un groupe.

Lemme 7.6. Soit $\phi : G \rightarrow G$ un automorphisme et $H \trianglelefteq G$ alors $G/H \cong G/\phi(H)$.

Théorème 7.7. Soit G un groupe abélien engendré fini alors $\exists d_1, \dots, d_k \in \mathbb{N}_{\geq 1}$ et $l \in \mathbb{N}$ tq $G \cong \mathbb{Z}_{d_1} \otimes \dots \otimes \mathbb{Z}_{d_k} \otimes \mathbb{Z}^l$ avec $\mathbb{Z}^l := \mathbb{Z} \otimes \dots \otimes \mathbb{Z}$ l fois. De plus on a $d_1 | \dots | d_k$.

Démonstration. Soient $g_1, \dots, g_n \in G$ tq. $G = \{x_1g_1 + \dots + x_n g_n, x_i \in \mathbb{Z}\}$ alors on peut vérifier que $\phi : \mathbb{Z}^n \rightarrow G, (x_1, \dots, x_n) \mapsto x_1g_1 + \dots + x_n g_n$ est un homomorphisme surjectif. Mais alors $\ker(\phi) \leq \mathbb{Z}^n$ et donc $\exists B \in \mathbb{Z}^{n \times k}$ avec $\text{rang}(B) = k$ et $\Lambda(B) = \ker(\phi)$. En calculant la forme normale de Smith de B on obtient que $\exists U \in \mathbb{Z}^{n \times n}, V \in$

$\mathbb{Z}^{k \times k}$ unimodulaires tqs. $B = U \begin{pmatrix} d_1 & & \\ & \ddots & \\ & & d_k \\ & & & 0 \end{pmatrix} V$ avec $1 \leq d_1 | \dots | d_k$ et donc on a

$\ker(\phi) = \left\{ U \begin{pmatrix} d_1 & & \\ & \ddots & \\ & & d_k \\ & & & 0 \end{pmatrix} y, y \in \mathbb{Z}^k \right\}$. Alors par les théorèmes explicités plus haut

on obtient $G \cong \mathbb{Z}^n / \left\{ U \begin{pmatrix} d_1 & & \\ & \ddots & \\ & & d_k \\ & & & 0 \end{pmatrix} y, y \in \mathbb{Z}^k \right\}$. Puis comme $U : \mathbb{Z}^n \rightarrow \mathbb{Z}^n$ est un

automorphisme on arrive finalement à

$G \cong \mathbb{Z}^n / \{(d_1 y_1, \dots, d_k y_k, 0, \dots, 0), y_i \in \mathbb{Z}\}$. Il suffit maintenant de constater que

$$\mathbb{Z}^n / \{(d_1 y_1, \dots, d_k y_k, 0, \dots, 0), y_i \in \mathbb{Z}\} \cong \mathbb{Z}_{d_1} \otimes \dots \otimes \mathbb{Z}_{d_k} \otimes \mathbb{Z}^{n-k}. \quad \square$$

Lemme 7.8. Soient L, K deux groupes abéliens, M un sous groupe normal de K $f : K \rightarrow L$ un isomorphisme. Alors $K/M \cong L/\phi(M)$.

Lemme 7.9. Soient G, H_1, H_2 trois groupes abéliens avec $|H_i| < \infty$ pour $i = 1, 2$ alors si $G \cong H_1 \otimes \mathbb{Z}^{n_1}$ et $G \cong H_2 \otimes \mathbb{Z}^{n_2}$ alors $H_1 \cong H_2$ et $n_1 = n_2$.

Démonstration. Soit $\phi : H_1 \otimes \mathbb{Z}^{n_1} \rightarrow H_2 \otimes \mathbb{Z}^{n_2}$ un isomorphisme. Soit $h \in H_1$ alors $\phi(h, 0) = (h', x) \in H_2 \times \mathbb{Z}^{n_2}$ mais comme ϕ préserve l'ordre on a nécessairement $x = 0$ on a ainsi $\phi(H_1, 0) \subset (H_2, 0)$ et de même $\phi^{-1}(H_2, 0) \subset (H_1, 0)$ et donc finalement $\phi(H_1, 0) = (H_2, 0)$ ce qui permet de conclure que $H_1 \cong H_2$.

Maintenant on a d'après le lemme ci dessus : $\mathbb{Z}^{n_2} \cong$

$H_2 \otimes \mathbb{Z}^{n_2} / H_2 \otimes \{0_{\mathbb{Z}^{n_2}}\} \cong H_1 \otimes \mathbb{Z}^{n_1} / H_1 \otimes \{0_{\mathbb{Z}^{n_1}}\} \cong \mathbb{Z}^{n_1}$. Mais alors on a nécessairement $n_1 = n_2$. En effet et sans perte de généralité supposons $n_1 > n_2$ alors soient $x_1, \dots, x_{n_1} \in \mathbb{Z}^{n_1}$ des vecteurs \mathbb{Q} linéairement indépendants alors on a forcément $\phi(x_1), \dots, \phi(x_{n_1}) \in \mathbb{Z}^{n_2} \otimes \mathbb{Q}$ linéairement dépendants. Ainsi $\exists \alpha_1, \dots, \alpha_{n_1} \in \mathbb{Z}$ non tous nuls avec $\alpha_1 \phi(x_1) + \dots + \alpha_{n_1} \phi(x_{n_1}) = 0$ mais comme ϕ est un isomorphisme on a $\phi(\alpha_1 x_1 + \dots + \alpha_{n_1} x_{n_1}) = 0$. Cela implique par injectivité que $\alpha_1 x_1 + \dots + \alpha_{n_1} x_{n_1} = 0$. Ceci est absurde. \square

Théorème 7.10. Soient $m_1, m_2 \in \mathbb{N}_{\geq}$ alors $\mathbb{Z}_m \cong \mathbb{Z}_{m_1} \otimes \mathbb{Z}_{m_2}$ ssi $m = m_1 \times m_2$ et $\text{pgcd}(m_1, m_2) = 1$.

Démonstration. \Leftarrow Tout d'abord il s'agit de remarquer que $\phi : \mathbb{Z}_m \rightarrow \mathbb{Z}_{m_1} \otimes \mathbb{Z}_{m_2}, a \mapsto (a, a)$ est bien définie et est un morphisme de groupe. Ensuite on a $|\mathbb{Z}_m| = |\mathbb{Z}_{m_1} \times \mathbb{Z}_{m_2}|$ donc il suffit de montrer que ϕ est surjective. En effet soit $(a, b) \in \mathbb{Z}_{m_1} \otimes \mathbb{Z}_{m_2}$ alors on a $1 = \text{pgcd}(m_1, m_2) = r m_1 + s m_2, r, s \in \mathbb{Z}$. Dès lors on vérifie que $\phi(r m_1 b + s m_2 a) = (a, b)$.

\Rightarrow En égalisant les cardinaux on a $m = m_1 m_2$ de plus en posant $d = \text{pgcd}(m_1, m_2)$ on a $\frac{m}{d} = \text{ordre}(d) = \text{ordre}(\phi(d)) \leq \frac{m}{d^2}$ et donc $1 \leq d \leq 1$ et donc $d = 1$. \square

7.1 Groupes abéliens engendrés finis

Remarque 7.11. Soit $n = p_1^{a_1} \dots p_k^{a_k}$, $p_i \in \mathbb{P}$, $a_i \in \mathbb{N}_{\geq 1}$ alors $Z_n \cong \mathbb{Z}_{p_1^{a_1}} \otimes \dots \otimes \mathbb{Z}_{p_k^{a_k}}$.

Lemme 7.12. Soient $p \in \mathbb{P}$ et $\alpha_1 \leq \dots \leq \alpha_k$, $\beta_1 \leq \dots \leq \beta_l \in \mathbb{N}_{\geq 1}$ alors $\mathbb{Z}_{p^{\alpha_1}} \otimes \dots \otimes \mathbb{Z}_{p^{\alpha_k}} \cong \mathbb{Z}_{p^{\beta_1}} \otimes \dots \otimes \mathbb{Z}_{p^{\beta_l}}$ ssi $k = l$ et $\alpha_i = \beta_i \forall i \in \{1, \dots, k\}$.

Démonstration. $\boxed{\Leftarrow}$ Trivial.

$\boxed{\Rightarrow}$ Soit ϕ l'isomorphisme entre ces deux groupes. On a $p^{\alpha_k} = \text{ordre}((0, \dots, 1)) = \text{ordre}(\phi((0, \dots, 1))) \leq p^{\beta_l}$. De même on obtient l'inégalité inverse puis finalement on trouve donc $\alpha_k = \beta_l$. Ainsi on a $\mathbb{Z}_{p^{\alpha_1}} \otimes \dots \otimes \mathbb{Z}_{p^{\alpha_{k-1}}} \cong \mathbb{Z}_{p^{\beta_1}} \otimes \dots \otimes \mathbb{Z}_{p^{\beta_{l-1}}}$ puis on prouve le théorème par induction. \square

Remarque 7.13. Soit G abélien engendré fini. Alors $G \cong \mathbb{Z}_{d_1} \otimes \dots \otimes \mathbb{Z}_{d_k} \otimes \mathbb{Z}^l$ avec $d_1, \dots, d_k \in \mathbb{N}_{\geq 1}$ tq $d_1 | \dots | d_k$ et $l \in \mathbb{N}$. Alors $d_k = p_1^{a_1} \dots p_n^{a_n}$, $p_i \in \mathbb{P}$, $a_i \in \mathbb{N}_{\geq 1}$. On obtient ainsi $d_i = p_1^{e_1^i} \dots p_n^{e_n^i}$ avec $0 \leq e_j^i \leq a_j$. Dès lors on a que $G \cong \mathbb{Z}_{p_1^{e_1^1}} \otimes \dots \otimes \mathbb{Z}_{p_n^{e_n^1}} \otimes \dots \otimes \mathbb{Z}_{p_1^{a_1}} \otimes \dots \otimes \mathbb{Z}_{p_n^{a_n}} \otimes \mathbb{Z}^l$.