

## 1 Intégrales : calculs

En première année on a appris à calculer des intégrales :

### 1. par utilisation d'une primitive

revoir le cours et les exercices T1 du TD 5 de S1.

**exemple :**  $\int_0^3 \sqrt{2x+3} dx = \left[ \frac{(2x+3)^{3/2}}{2 \times 3/2} \right]_0^3 = \left[ \frac{(2x+3)^{3/2}}{3} \right]_0^3 = \frac{9^{3/2} - 3^{3/2}}{3} = 9 - \sqrt{3}$

### 2. par intégration par parties

revoir le cours et les exercices T2 du TD 5 de S1.

**exemple :** pour calculer  $\int_0^1 x e^{2x} dx$  : on choisit de dériver  $x$  en 1, de primitiver  $e^{2x}$  en  $e^{2x}/2$ , et on obtient donc :  $\int_0^1 x e^{2x} dx = [x e^{2x}/2]_0^1 - \int_0^1 e^{2x}/2 dx$ , cette deuxième intégrale se calcule alors par primitive :  $\int_0^1 x e^{2x} dx = [x e^{2x}/2]_0^1 - [e^{2x}/4]_0^1 = e^2/2 - e^2/4 + 1/4 = (e^2 + 1)/4$

### 3. par changement de variables

revoir le cours et les exercices T3 du TD 5 de S1.

**exemple :** pour calculer  $\int_2^{+\infty} x e^{-x^2} dx$  on peut poser  $y = x^2$ , donc  $dy = 2x dx$  et l'intégrale devient  $\int_4^{+\infty} e^{-y}/2 dy = [-e^{-y}/2]_4^{+\infty}$  soit  $e^{-4}/2$ .

### 4. par décomposition en éléments simples d'une fraction rationnelle

revoir le cours et les exercices T4 du TD 5 de S1.

**exemple :** pour  $\int_1^2 \frac{x^2+1}{x^2+x} dx$  :

- la partie entière de la fraction (le quotient de  $x^2 + 1$  par  $x^2 + x$  vaut 1
- on factorise le dénominateur en  $x(x+1)$ , on peut donc mettre la fraction sous la forme  $1 + \frac{\alpha}{x} + \frac{\beta}{x+1}$ ,

- pour trouver  $\alpha$  on peut par exemple multiplier l'expression par  $x$ , simplifier, et prendre  $x = 0$  :  $x \frac{x^2+1}{x^2+x} = x + \frac{\alpha x}{x} + \frac{\beta x}{x+1}$ , d'où  $\frac{x^2+1}{x+1} = x + \alpha + \frac{\beta x}{x+1}$ , et en prenant  $x = 0$  :  $1 = \alpha$ .

De même on trouve  $\beta = -2$ , donc une primitive de la fonction intégrée sur  $[1, 2]$  est  $x + \ln x - 2 \ln(x+1)$ , et par conséquent l'intégrale vaut  $1 + 3 \ln 2 - 2 \ln 3$ .

### 5. par linéarisation de polynômes trigonométriques

revoir le cours et les exercices T5 du TD 5 de S1.

**exemple :** pour calculer  $\int_0^{\pi/4} \sin^3 \theta d\theta$  on peut grâce aux formules d'Euler, linéariser  $\sin^3 \theta = \frac{1}{4}(-\sin 3\theta + 3 \sin \theta)$ , ce qui permet de trouver une primitive ( $\cos(3\theta)/3$  pour  $-\sin(3\theta)$ , et  $-3 \cos(\theta)$  pour  $3 \sin(\theta)$ ), et au final l'intégrale vaut  $\frac{2}{3} - \frac{5\sqrt{2}}{12}$ .

## 2 Intégrales fonction de la borne supérieure

**propriété :** si  $f$  est une fonction continue sur un intervalle  $I$ , si  $a \in I$ , si on définit sur  $I$  la fonction  $F$  par  $F(x) = \int_a^x f(t) dt$ , alors  $F$  est dérivable et  $F'(x) = f(x)$ .

Plus précisément, c'est la primitive de  $f$  qui s'annule en  $a$ .

**exemple :** une primitive de  $\ln(x)$  est donc  $F(x) = \int_1^x \ln(t) dt$ . On peut calculer cette intégrale par parties en primitivant 1 et en dérivant  $\ln(t)$ , ce qui amène à  $F(x) = [t \ln(t)]_1^x - \int_0^x t/t dt = x \ln(x) - x + 1$ .

**généralisation :** si  $f$  est une fonction continue sur un intervalle  $I$ , si  $u(x)$  et  $v(x)$  sont des fonctions dérivables et à valeurs dans  $I$ , alors (règle de dérivation des fonctions composées) la fonction  $\int_{u(x)}^{v(x)} f(t) dt$  a pour dérivée  $v'(x)f(v(x)) - u'(x)f(u(x))$ .

**exemple :** si  $f(x) = \int_1^{x^2} e^{-t^2} dt$ , alors  $f'(x) = 2xe^{-x^4}$ .

### 3 Intégrales à paramètres

**définition :** si  $f(x, t)$  est une fonction de deux variables, si  $[a, b]$  est un intervalle ( $a$  ou  $b$  pouvant être infinis), on peut définir une fonction par l'intégrale à paramètre  $g(x) = \int_a^b f(x, t) dt$ .

Dans le calcul d'intégrale,  $x$  est constant et on intègre en  $t$ . Mais si on considère ensuite toutes ces valeurs pour tous les  $x$ , on obtient une fonction  $g$ .

**remarque :** ici encore plus que dans le reste de ce cours de S4, on oublie toute rigueur mathématique, sur la régularité et autres propriétés des fonctions considérées : dans les contextes de physique où vous croiserez ces méthodes...vous considèrerez que les bonnes hypothèses seront là.

**limite d'une intégrale à paramètre :** si pour chaque valeur de  $t \in [a, b]$ , quand  $x$  tend vers  $l$  ( $l$  peut être fini ou infini),  $f(x, t)$  tend vers une valeur  $u(t)$ , alors la fonction  $g(x) = \int_a^b f(x, t) dt$  tend vers  $\int_a^b u(t) dt$  quand  $x$  tend vers  $l$ . Autrement dit, "la limite de la l'intégrale est l'intégrale de la limite".

Par exemple, si on prend la fonction  $g(x) = \int_0^1 \frac{\exp(-x^2(1+t^2))}{1+t^2} dt$  : pour n'importe que  $t$  fixé, quand  $x$  tend vers  $+\infty$ ,  $\frac{\exp(-x^2(1+t^2))}{1+t^2}$  tend vers 0. Par conséquent la limite en  $+\infty$  de  $g(x)$  est l'intégrale de la limite de  $g(x)$  en  $+\infty$ , soit  $\int_0^1 0 dt = 0$  :  $\lim_{x \rightarrow +\infty} g(x) = 0$ .

**dérivation d'une intégrale à paramètre :** si  $f(x, t)$  est une fonction de deux variables, si  $[a, b]$  est un intervalle ( $a$  ou  $b$  pouvant être infinis), la fonction  $g(x) = \int_a^b f(x, t) dt$  est dérivable et on a  $g'(x) = \int_a^b \frac{\partial f}{\partial x}(x, t) dt$ .

Autrement dit, "la dérivée de la fonction définie comme un intégrale à paramètre est l'intégrale de la dérivée".

### 4 transformée de Laplace

Un exemple d'usage fréquent de fonctions définies par des intégrales "à paramètre" est la

**transformée de Laplace :** la transformée de Laplace d'une fonction  $f$  est définie pour  $p > 0$  par  $L(f)(p) = \int_0^{+\infty} f(t) e^{-pt} dt$ .

**exemple 1 :** la transformée de Laplace de la fonction constante égale à 1 vaut  $L(1)(p) = \int_0^{+\infty} e^{-pt} dt = [-e^{-pt}/p]_{t=0}^{t=+\infty} = 1/p$

**exemple 2 :** la transformée de Laplace de la fonction exponentielle vaut  $L(\exp)(p) = \frac{1}{p-1}$ .

**exemple 3 :** détermination de la transformée de Laplace de la fonction sinus. Comme  $\sin(t)$  est la partie imaginaire de  $e^{it}$ ,  $L(\sin)(p) = \int_0^{+\infty} \sin(t) e^{-pt} dt = \text{Im} \int_0^{+\infty} e^{-pt} e^{it} dt = \text{Im} \int_0^{+\infty} e^{(-p+i)t} dt = \text{Im} \left( \left[ \frac{e^{(-p+i)t}}{-p+i} \right]_{t=0}^{t=+\infty} \right)$ .

Comme la limite en  $+\infty$  de  $e^{-pt}$  vaut 0 ( $p > 0$ ) et que  $e^{it}$ , de module 1, est borné, on en déduit que

$$L(\sin)(p) = \text{Im} \left( 0 - \frac{1}{-p+i} \right) = \text{Im} \left( -\frac{-p-i}{(-p)^2 - i^2} \right) = \frac{1}{p^2 + 1}.$$

### 5 transformée de Fourier

On rencontre aussi la

**transformée de Fourier :** la transformée de Fourier d'une fonction  $f$  est définie par  $TF(f)(\omega) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(t) e^{-i\omega t} dt$ .

(selon le contexte d'utilisation, d'autres définitions proches existent)

**exemple :** calcul de la transformée de Fourier de  $f(t) = e^{-a|t|}$ .

C'est la fonction définie par  $TF(f)(\omega) = \int_{-\infty}^{+\infty} e^{-a|t|} e^{-i\omega t} dt$ .

On peut par relation de Chasles en 0 séparer l'intégrale en deux, sur  $\mathbb{R}_+$ ,  $|t| = t$ , et sur  $\mathbb{R}_-$ ,  $|t| = -t$ , donc  $TF(f)(\omega) = \int_0^{+\infty} e^{(-i\omega-a)t} dt + \int_{-\infty}^0 e^{(-i\omega+a)t} dx$ .

On peut alors primitiver chaque exponentielle :

$$TF(f)(\omega) = \left[ \frac{e^{(-i\omega-a)t}}{-i\omega-a} \right]_0^{+\infty} + \left[ \frac{e^{(-i\omega+a)t}}{-i\omega+a} \right]_{-\infty}^0.$$

La limite en les infinis des primitives est nulle, et il ne reste que les valeurs en 0 :

$$TF(f)(\omega) = \frac{-1}{-i\omega-a} + \frac{1}{-i\omega+a}.$$

Après simplifications on trouve  $TF(f)(\omega) = \frac{2a}{a^2 + \omega^2}$

## 1 Espaces vectoriels

### 1.1 définition

**définition :** un **espace vectoriel** réel est un ensemble constitué de vecteurs, qui reste stable par addition des vecteurs et multiplication d'un vecteur par un **scalaire** (un élément de  $\mathbb{R}$ ).

**exemples :**

1. le point  $O$ , la droite  $\mathbb{R}$ , le plan  $\mathbb{R}^2$  et l'espace  $\mathbb{R}^3$
2. dans  $\mathbb{R}^2$  toute droite passant par  $(0, 0)$ ; dans  $\mathbb{R}^3$ , toute droite ou plan passant par  $(0, 0, 0)$
3. l'ensemble des fonctions continues, l'ensemble  $\mathbb{R}[X]$  des polynômes réels, ...
4. l'ensemble des solutions d'une équation différentielle  $y'' + \alpha(x)y' + \beta(x)y = 0$
5. l'ensemble  $E_{a,b,c}$  des suites  $(u_n)_{n \geq 0}$  vérifiant, pour tout  $n$ ,  $au_{n+2} + bu_{n+1} + cu_n = 0$

**définition :** une **combinaison linéaire** des vecteurs  $\vec{u}$  et  $\vec{v}$  est un vecteur de la forme  $\lambda\vec{u} + \mu\vec{v}$ , avec  $\lambda, \mu$  réels. On considère de même des combinaisons linéaires de 3, 4, ... vecteurs.

**exemple :** le vecteur  $\vec{v} = (1, 2, -1)$  est combinaison linéaire des vecteurs  $\vec{i} = \vec{e}_1 = (1, 0, 0)$ ,  $\vec{j} = \vec{e}_2 = (0, 1, 0)$ ,  $\vec{k} = \vec{e}_3 = (0, 0, 1)$  : il s'écrit  $\vec{v} = \vec{e}_1 + 2\vec{e}_2 - \vec{e}_3$ .

Plus généralement, dans  $\mathbb{R}^3$ , tout vecteur est combinaison linéaire des vecteurs  $\vec{e}_1, \vec{e}_2, \vec{e}_3$ , et cela de façon unique.

### 1.2 bases et dimensions

**définition :** on appelle **base** d'un espace vectoriel une famille de vecteurs telle que tout autre vecteur s'écrit de façon unique comme combinaison linéaire des vecteurs de la base.

**exemples :**

1.  $(\vec{e}_1, \vec{e}_2, \vec{e}_3)$  est une base de  $\mathbb{R}^3$ , appelée **base canonique**
2. de même,  $\vec{e}_1 = (1, 0), \vec{e}_2 = (0, 1)$  forme une base de  $\mathbb{R}^2$

**exercice :** on considère l'ensemble  $P$  des vecteurs orthogonaux au vecteur  $(2, -1, 1)$ . Déterminer une équation et une base de  $P$ .

**correction :**  $\vec{v}$  de coordonnées  $(x, y, z)$  est dans  $P$  si et seulement si il est orthogonal à  $(2, -1, 1)$ , donc si et seulement si  $2x - y + z = 0$ . C'est l'équation de  $P$ .

Mais si  $(x, y, z)$  est dans  $P$ , on a  $z = -2x + y$ , donc les vecteurs  $(1, 0, -2)$  et  $(0, 1, 1)$  sont dans  $P$ , et tout élément de  $P$  s'écrit bien  $x(1, 0, -2) + y(0, 1, 1)$  de façon unique.

Ainsi,  $(1, 0, -2)$  et  $(0, 1, 1)$  forment une base de  $P$  :  $P$  est donc un plan (sous-espace de dimension 2) de l'espace.

**définition :** la **dimension** d'un espace vectoriel est le cardinal de ses bases.

**exemple 1 :**  $\mathbb{R}^2$  est de dimension 2,  $\mathbb{R}^3$  est de dimension 3; le plan  $P$  est de dimension 2.

**exemple 2 :** (admis, et relativement difficile) l'ensemble des solutions d'une équation différentielle linéaire du second ordre sans second membre est de dimension 2.

**exemple 3 :** l'ensemble des suites définies par une récurrence d'ordre 1 de la forme  $u_{n+1} = au_n$  est un espace vectoriel de dimension 1.

En effet ces suites vérifient  $u_1 = au_0, u_2 = au_1 = a^2u_0, u_3 = a^3u_0, \dots$  : ce sont les suites de la forme  $u_0a^n$ , donc les suites géométriques, multiples de la suite  $a^n$ .

**exemple 4 :** l'espace des suites définies par une relation de récurrence linéaire du type  $au_{n+2} + bu_{n+1} + cu_n = 0$  ( $a \neq 0, b$  et  $c$  étant fixés) est de dimension 2.

Méthode : on note  $ar^2 + br + c = 0$  l'équation caractéristique associée. C'est une équation du second degré, on note  $\Delta$  son discriminant.

Alors :

- si  $\Delta > 0$ , les suites de la formes  $Ar_1^n + Br_2^n$  où  $A$  et  $B$  sont des réels quelconques et  $r_1, r_2$  les deux racines réelles de l'équation.
- si  $\Delta = 0$ , les suites de la formes  $Ar^n + Bnr^n$  où  $A$  et  $B$  sont des réels quelconques et  $r$  l'unique racine réelle de l'équation.
- si  $\Delta < 0$ , les suites de la formes  $A\rho^n \cos(n\theta) + B\rho^n \sin(n\theta)$  où  $A$  et  $B$  sont des réels quelconques et  $\rho e^{i\theta}$  une racine non réelle de l'équation.

**complément :** les suites définies par une récurrence linéaire d'ordre 1 ou 2 avec un **second membre constant** peuvent être déterminées en ajoutant une suite solution de l'équation sans second membre et une solution particulière qui sera souvent constante, et à défaut, polynômiale.

Par exemple pour chercher les suites vérifiant pour tout  $n$  :  $u_{n+1} = 3u_n - 2$ , on ajoute à une suite  $C.3^n$  solution de  $u_{n+1} = 3u_n$  (relation sans second membre) une suite constante vérifiant  $u = 3u - 2$  dont  $2u = 2, u = 1$  : on trouve ainsi les suite  $u_n = C.3^n + 1$ .

Autre exemple pour chercher les suites vérifiant pour tout  $n$  :  $u_{n+2} = 2u_{n+1} + 2u_n - 1$  :

a) on résoud  $X^2 - 2X - 2$  équation caractéristique associée à la relation de récurrence sans second membre  $u_{n+2} = 2u_{n+1} + 2u_n$ , on trouve un discriminant 12 et racines  $1 + \sqrt{3}$  et  $1 - \sqrt{3}$ , donc des suites  $A.(1 + \sqrt{3})^n + B.(1 - \sqrt{3})^n$

b) on cherche une solution constante  $u$ , vérifiant donc  $u = 2u + 2u - 1$ , donc  $u = 1/3$

c) les solutions de l'équation sont donc les suites de la forme  $u_n = A.(1 + \sqrt{3})^n + B.(1 - \sqrt{3})^n + 1/3$ .

## 2 Matrices

### 2.1 définition

**définition :** On appelle **matrice** un tableau de nombres.

Si la matrice a  $n$  lignes et  $p$  colonnes, on dit que sa **taille** est  $(n, p)$ .

Une matrice à  $n$  lignes et 1 colonne est un **vecteur-colonne**, une matrice à 1 ligne et  $n$  colonnes est un **vecteur-ligne**. Une matrice qui a le même nombre de lignes et de colonnes est une matrice **carrée**.

### 2.2 addition

On peut additionner coefficient par coefficient des matrices de même taille.

**exemple :** si  $A = \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 2 & 3 \end{pmatrix}$ ,  $B = \begin{pmatrix} -1 & 3 \\ 0 & 4 \end{pmatrix}$ ,  $A + B = \begin{pmatrix} 0 & 5 \\ 2 & 7 \end{pmatrix}$ .

**matrice nulle :** on note 0 la matrice nulle, dont tous les coefficients sont nuls.

### 2.3 multiplication

On considère deux matrices  $A$  et  $B$ .

Si  $A$  a le même nombre de colonnes que  $B$  de lignes, on peut définir le produit de  $A$  par  $B$  en calculant chaque coefficient de  $AB$  comme un produit scalaire de la ligne de  $A$  et la colonne de  $B$  correspondants.

Le produit  $AB$  a donc le même nombre de ligne que  $A$ , et le même nombre de colonnes que  $B$ .

**remarque :** si  $A$  et  $B$  sont deux matrices carrées de même taille, les deux produits  $AB$  et  $BA$  existent, mais en général,  $AB \neq BA$ .

**exemples :**

1.  $A = \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ -3 & 1 \end{pmatrix}$ ,  $B = \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ -1 & 1 \end{pmatrix}$ . On pose le calcul de  $AB$  ainsi :

$$\begin{pmatrix} 1 & 2 \\ -3 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ -1 & 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 \times 1 + 2 \times -1 & 1 \times 1 + 2 \times 1 \\ -3 \times 1 + 1 \times -1 & -3 \times 1 + 1 \times 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -1 & 3 \\ -4 & -2 \end{pmatrix}$$

Le calcul de  $BA$  donne, lui :

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

différent de  $AB$ .

2.  $A = \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ -3 & 1 \end{pmatrix}$ ,  $B = \begin{pmatrix} -2 \\ 1 \end{pmatrix}$ . Alors  $AB$  vaut

$$\begin{pmatrix} 1 & 2 \\ -3 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} -2 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 \times -2 + 2 \times 1 \\ -3 \times -2 + 1 \times 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 7 \end{pmatrix}$$

et on ne peut calculer  $BA$ .

3.  $A = \begin{pmatrix} 1 & 2 & -1 \\ 0 & 2 & 1 \\ 1 & 0 & -1 \end{pmatrix}$ ,  $B = \begin{pmatrix} 0 & 1 & 2 \\ -1 & 1 & 3 \\ -1 & 2 & 0 \end{pmatrix}$ . Alors on calcule  $AB$  :

$$\begin{pmatrix} 1 & 2 & -1 \\ 0 & 2 & 1 \\ 1 & 0 & -1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0 & 1 & 2 \\ -1 & 1 & 3 \\ -1 & 2 & 0 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 \times 0 + 2 \times -1 + -1 \times -1 & 1 \times 1 + 2 \times 1 + -1 \times 2 & 1 \times 2 + 2 \times 3 + -1 \times 0 \\ 0 \times 0 + 2 \times -1 + 1 \times -1 & 0 \times 1 + 2 \times 1 + 1 \times 2 & 0 \times 2 + 2 \times 3 + 1 \times 0 \\ 1 \times 0 + 0 \times -1 - 1 \times -1 & 1 \times 1 + 0 \times 1 - 1 \times 2 & 1 \times 2 + 0 \times 3 - 1 \times 0 \end{pmatrix}$$

soit

$$AB = \begin{pmatrix} -1 & 1 & 8 \\ -3 & 4 & 6 \\ 1 & -1 & 2 \end{pmatrix}$$

On trouve de même  $BA = \begin{pmatrix} 2 & 2 & -1 \\ 2 & 0 & -1 \\ -1 & 2 & 3 \end{pmatrix}$ , et une fois de plus  $AB \neq BA$ .

**matrice identité :** on note  $I_n$  la matrice carrée de taille  $(n, n)$  dont les coefficients sont des 1 sur la diagonale et des 0 ailleurs (on notera simplement  $I$  s'il n'y a pas d'ambiguïté sur  $n$ ).

Ainsi,  $I_2 = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$ ,  $I_3 = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$ ...

**propriété :** pour toute matrice ayant  $n$  colonnes,  $AI_n = A$ ; pour toute matrice ayant  $n$  lignes,  $I_n A = A$ .

Et donc pour toute matrice carrée,  $AI = IA = A$ .

## 2.4 puissances

Pour calculer  $A^2, A^3, \dots$ , la première méthode calculatoire mais élémentaire consiste à calculer des produits successifs :  $A^2 = A \times A, A^3 = (A \times A) \times A, \dots$

**exemple :** si  $A = \frac{1}{3} \begin{pmatrix} 2 & -5 & 5 \\ -2 & 8 & -2 \\ 8 & 1 & 5 \end{pmatrix}$ , calculer  $A^3$ .

On trouve successivement  $A^2 = \frac{1}{9} \begin{pmatrix} 54 & -45 & 45 \\ -36 & 72 & -36 \\ 54 & -27 & 63 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 6 & -5 & 5 \\ -4 & 8 & -4 \\ 6 & -3 & 7 \end{pmatrix}$ ,

puis  $A^3 = A^2 \times A = \frac{1}{3} \begin{pmatrix} 62 & -65 & 65 \\ -56 & 80 & -56 \\ 74 & -47 & 71 \end{pmatrix}$ .

## 2.5 inverse d'une matrice

**définition :** une matrice carrée  $M$  est inversible s'il existe une matrice de même taille  $N$  telle que  $MN = I$ .

On note alors  $N = M^{-1}$ , et alors on a aussi  $M^{-1}M = I$ .

L'ensemble des matrices inversibles de taille  $n$  est noté  $GL_n(\mathbb{R})$ .

**proposition :** si  $A$  est inversible et si  $Y = AX$ , alors  $X = A^{-1}Y$ .

Cette propriété est utilisable de deux manières différentes :

- pour calculer  $A^{-1}$ , en résolvant un système linéaire.  
En particulier,  $A$  est inversible si et seulement si le système admet une solution unique,
- pour calculer  $X$  connaissant  $Y$  et  $A^{-1}$  (au lieu de résoudre le système) : il suffit d'effectuer une multiplication de la matrice  $A^{-1}$  par le vecteur  $Y$  pour trouver la solution  $X$  du système.

**exemple :** pour inverser  $A = \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ -1 & 3 \end{pmatrix}$ , on peut résoudre  $\begin{cases} x_1 + 2x_2 = y_1 \\ -x_1 + 3x_2 = y_2 \end{cases}$

Les coefficients dans l'expression de  $\begin{pmatrix} y_1 & y_2 \end{pmatrix}$  en fonction de  $\begin{pmatrix} x_1 & x_2 \end{pmatrix}$  seront les coefficients de  $A^{-1}$ .

On résoud, par exemple par combinaisons linéaires :  $\begin{cases} x_1 + 2x_2 = y_1 \\ 5x_2 = y_1 + y_2 \end{cases}$ , donc

$$\begin{cases} x_1 = y_1 - 2\frac{y_1 + y_2}{5} = \frac{3y_1 - 2y_2}{5} \\ x_2 = \frac{y_1 + y_2}{5} \end{cases}, \text{ ce qui montre que } A^{-1} = \frac{1}{5} \begin{pmatrix} 3 & -2 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}.$$

## 3 déterminant

On rappelle les éléments du cours de première année - S2 :

Le déterminant est une application  $M_n(\mathbb{R}) \rightarrow \mathbb{R}$  vérifiant pour toutes matrices  $A, B$   $\det(AB) = \det(A) \det(B)$  et  $\det(I) = 1$ .

**proposition :** le déterminant d'une matrice est nul si et seulement si la matrice n'est pas inversible.

On peut le calculer par récurrence en développant selon une ligne ou une colonne.

**exemple 1 :** le déterminant de  $\begin{pmatrix} a & b \\ c & d \end{pmatrix}$  est  $\begin{vmatrix} a & b \\ c & d \end{vmatrix} = ad - bc$ .

**exemple 2 :**

$$\det \left( \frac{1}{3} \begin{pmatrix} 2 & -5 & 5 \\ -2 & 8 & -2 \\ 8 & 1 & 5 \end{pmatrix} \right) = \frac{2(8 \times 5 - (-2) \times 1) + 5(-2 \times 5 - (-2) \times 8) + 5(-2 \times 1 - 8 \times 8)}{27} = \frac{-216}{27} = -8.$$

Avant ce développement il est possible d'effectuer des opérations sur les lignes ou les colonnes, de manière à faire apparaître des zéros :

- Ajouter un multiple d'une ligne ou colonne à une autre ( $L_i \leftarrow L_i + kL_j, C_i \leftarrow C_i + kC_j$ ) ne change pas la valeur du déterminant,
- Permuter deux lignes ou deux colonnes ( $L_i \leftrightarrow L_j, C_i \leftrightarrow C_j$ ) change le signe du déterminant,
- Multiplier une ligne par un scalaire  $k$  ( $L_i \leftarrow kL_i$ ) multiplie le déterminant par  $k$ .

**exemple :** reprendre l'exemple 2 pour calculer plus simplement le déterminant.

**lien entre déterminants et bases :** Un système de  $n$  vecteurs dans un espace de dimension  $n$  est une base si et seulement si la matrice carrée formée par les  $n$  vecteurs est inversible, i.e si

son déterminant est non nul. **exemple :**  $\begin{vmatrix} \frac{\sqrt{2}}{2} & -\frac{\sqrt{2}}{2} & 0 \\ \frac{\sqrt{2}}{2} & \frac{\sqrt{2}}{2} & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{vmatrix} = 1 \neq 0$ , donc les vecteurs  $\begin{pmatrix} \frac{\sqrt{2}}{2} \\ \frac{\sqrt{2}}{2} \\ 0 \end{pmatrix}$ ,

$\begin{pmatrix} -\frac{\sqrt{2}}{2} \\ \frac{\sqrt{2}}{2} \\ 0 \end{pmatrix}$  et  $\begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}$  forment une base de l'espace

(obtenue par une rotation d'angle  $\pi/4$  autour de  $\vec{e}_3$  de la base canonique)

**lien entre déterminants et solution d'un système linéaire :** si on considère le système  $AX = Y$ ,  $A$  et  $Y$  étant connus, et s'il admet une solution unique (i.e si  $\det(A) \neq 0$ ), la coordonnée  $x_i$  de  $X$  peut se calculer par  $x_i = \frac{\det(A_i)}{\det(A)}$ ,  $A_i$  étant la matrice obtenue en remplaçant la  $i$ -ème colonne de  $A$  par le vecteur  $Y$ .

**exemple :** à partir de 
$$\begin{cases} (R + R_1)I_1 + R_2I_2 + R_3I_3 = E_1 \\ R_1I_1 + (R + R_2)I_2 + R_3I_3 = E_2 \\ R_1I_1 + R_2I_2 + (R + R_3)I_3 = E_2 \end{cases}$$
 on ob-

tient par exemple 
$$I_1 = \frac{\begin{vmatrix} E_1 & R_2 & R_3 \\ E_2 & (R + R_2) & R_3 \\ E_3 & R_2 & (R + R_3) \end{vmatrix}}{\begin{vmatrix} (R + R_1) & R_2 & R_3 \\ R_1 & (R + R_2) & R_3 \\ R_1 & R_2 & (R + R_3) \end{vmatrix}}.$$

On peut calculer le dénominateur en enlevant la première ligne aux deux suivantes, puis

en additionnant les deux dernières colonnes à la première :

$$\begin{vmatrix} R + R_1 & R_2 & R_3 \\ R_1 & R + R_2 & R_3 \\ R_1 & R_2 & R + R_3 \end{vmatrix} =$$

$$\begin{vmatrix} R + R_1 & R_2 & R_3 \\ -R & R & 0 \\ -R & 0 & R \end{vmatrix} = \begin{vmatrix} R + R_1 + R_2 + R_3 & R_2 & R_3 \\ 0 & R & 0 \\ 0 & 0 & R \end{vmatrix} = R^2(R + R_1 + R_2 + R_3).$$

Pour le numérateur, on peut commencer par enlever la première ligne aux deux suivantes :

$$\begin{vmatrix} E_1 & R_2 & R_3 \\ E_2 - E_1 & R & 0 \\ E_3 - E_1 & 0 & R \end{vmatrix}, \text{ puis développer par rapport à la troisième colonne : } R_3(-R(E_3 - E_1)) + R(RE_1 - R_2(E_2 - E_1)).$$

**lien entre déterminants et inverse d'une matrice :** l'inverse de la matrice  $A$  est obtenu en calculant le coefficient de la ligne  $i$  et de la colonne  $j$  comme  $(-1)^{i+j} \frac{\det \Gamma_{j,i}}{\det A}$ ,  $\Gamma_{j,i}$  étant la matrice obtenue en enlevant la colonne  $i$  et la ligne  $j$  de la matrice  $A$ .

**remarque 1 :** ne pas essayer de calculer un déterminant de grande taille ainsi...

**remarque 2 :** mais on peut cependant calculer le déterminant d'une matrice carrée de taille

$$2: \begin{pmatrix} a & b \\ c & d \end{pmatrix}^{-1} = \frac{\begin{pmatrix} d & -b \\ -c & a \end{pmatrix}}{\begin{vmatrix} a & b \\ c & d \end{vmatrix}} = \frac{1}{ad - bc} \begin{pmatrix} d & -b \\ -c & a \end{pmatrix}.$$

## 4 applications linéaires

**définition :** si  $E$  et  $F$  sont des espaces vectoriels,  $f$  est linéaire si pour tous vecteurs  $\vec{u}, \vec{v}$  de  $E$  et tous réels  $\lambda, \mu$ , on a  $f(\lambda\vec{u} + \mu\vec{v}) = \lambda f(\vec{u}) + \mu f(\vec{v})$ .

On note  $L(E, F)$  l'ensemble des applications linéaires de  $E$  dans  $F$ .

**exemple 1 :** une rotation de l'espace (d'axe passant par  $O$ ).

**exemple 2 :** une symétrie orthogonale par rapport à un plan passant par  $O$ .

**exemple 3 :** l'application qui à un polynôme  $P$  associe sa dérivée est une application linéaire.

**exemple 4 :** l'application qui a une fonction continue de  $[a, b]$  dans  $\mathbb{R}$  associe son intégrale sur  $[a, b]$  est linéaire.

**définition :** si  $B_1 = (\vec{e}_i)$  est une base de  $E$  et  $B_2 = (\vec{f}_i)$  une base de  $F$ , on peut écrire pour tout  $i$  :  $f(\vec{e}_i) = a_{i1}\vec{f}_1 + \dots + a_{ip}\vec{f}_p$ .

La matrice des  $[a_{ij}]$  est appelée **matrice de  $f$  dans les bases  $B_1$  et  $B_2$** .

### Changement de bases

Une application linéaire d'un espace vectoriel  $E$  dans lui-même est appelée **endomorphisme**. L'ensemble des endomorphismes de  $E$  est noté  $L(E)$ .

Si on fixe une base  $B$  de  $E$ , on peut associer à tout endomorphisme  $u \in L(E)$  sa matrice  $M$  dans la base  $B$  (en prenant  $B_1 = B_2$  dans ce qui précède).

Par ailleurs, si  $B'$  est une autre base de  $E$ , on note  $P = \text{Mat}_B(B')$  : c'est la matrice dont les colonnes sont les coefficients dans la base  $B$  des vecteurs formant  $B'$ .

Alors la matrice dans  $B'$  de  $u$  est la matrice  $P^{-1}MP$ .

L'opération de **conjugaison** par une matrice inversible correspond donc à l'opération de changement de base sur les applications linéaires.

**Noyau et image** Soit  $E, F$  deux espaces vectoriels et  $u \in L(E, F)$ .

On appelle **noyau** de  $u$ , et on note  $\ker(u)$ , l'ensemble des  $x \in E$  tels que  $u(x) = 0$ .

On appelle **image** de  $u$ , et on note  $\text{im}(u)$ , l'ensemble des  $y \in F$  tels qu'il existe  $x$  dans  $E$  tels que  $y = u(x)$ .

Par extension, on note aussi  $\ker(A - \lambda I)$  l'ensemble des vecteurs  $X$  tels que  $AX = \lambda X$ .

## 5 polynôme caractéristique

**définition :**  $\det(A - XI)$  est un polynôme, appelé **polynôme caractéristique** de  $A$ .

**proposition :** si  $P$  est le polynôme caractéristique de  $A$ ,  $P(A) = 0$ .

**applications :**

→ déterminer  $A^{-1}$

→ déterminer les puissances de  $A$

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

Le polynôme caractéristique est 
$$\begin{vmatrix} 1 - X & 2 & -1 \\ 0 & 2 - X & 1 \\ 1 & 0 & -1 - X \end{vmatrix} = (1 -$$



$$X) \begin{vmatrix} 2-X & 1 \\ 0 & -1-X \end{vmatrix} + 1 \begin{vmatrix} 2 & -1 \\ 2-X & 1 \end{vmatrix} = (1-X)(2-X)(-1-X) + 2 + 2 - X = -X^3 + 2X^2 + 2.$$

Il est donc inutile de vérifier que  $-A^3 + 2A^2 + 2I = 0$ .

Et on obtient facilement :

$$A^3 = 2A^2 + 2I = \begin{pmatrix} 2 & 12 & 4 \\ 2 & 10 & 2 \\ 0 & 4 & 2 \end{pmatrix},$$

et en multipliant par  $A^{-1}$  :  $-A^2 + 2A + 2A^{-1} = 0$ , donc  $A^{-1} = \frac{A^2 - 2A}{2} =$

$$\frac{1}{2} \begin{pmatrix} -2 & 2 & 4 \\ 1 & 0 & -1 \\ -2 & 2 & 2 \end{pmatrix}.$$

Pour calculer  $A^p$ , on peut diviser le polynôme  $X^p$  par  $P$  :  $X^p = QP + R$ , avec  $R$  de degré strictement inférieur à celui de  $P$ . Alors  $A^p = Q(A)P(A) + R(A)$ , mais comme  $P(A) = 0$ ,  $A^p = R(A)$  et (pour une matrice  $3 \times 3$ ) on est ramené du calcul d'une puissance  $p$ -ième au calcul de  $A^2$  et à des additions de matrices.

Ainsi, par exemple,  $X^5 = (-X^3 + 2X^2 + 2)(-X^2 - 2X - 4) + 10X^2 + 4X + 8$ , donc

$$A^5 = 10A^2 + 4A + 8I = \begin{pmatrix} 12 & 68 & 16 \\ 10 & 56 & 14 \\ 4 & 20 & 4 \end{pmatrix}.$$

## 6 Réduction des matrices

### 6.1 valeurs et vecteurs propres

**définitions** : un **vecteur propre** d'une matrice  $A$  est un vecteur  $X$  tel que  $AX$  et  $X$  sont colinéaires, i.e pour lequel il existe  $\lambda$  tel que  $AX = \lambda X$ .

Une valeur  $\lambda$  qui correspond à au moins un vecteur propre non nul est appelée **valeur propre** de  $A$ .

Ainsi,  $\lambda$  est une valeur propre de  $A$  si et seulement si le noyau de  $A - \lambda I$  n'est pas réduit à  $\{0\}$ .

Les valeurs propres de  $A$  sont les  $\lambda$  pour lesquelles le système  $AX = \lambda X$  a des solutions non nulles. Ce sont donc les valeurs de  $\lambda$  pour lesquelles la matrice  $A - \lambda I$  n'est pas inversible, i.e  $\det(A - \lambda I) = 0$ .

On en déduit une méthode pour déterminer les valeurs propres et vecteurs propres de  $A$  :

- on calcule le polynôme  $\det(A - \lambda I)$ ,
- on détermine ses racines : les valeurs propres de  $A$ ,
- pour chaque racine  $\lambda$  on résout le système  $AX = \lambda X$ , les solutions sont les vecteurs propres de  $A$  associés à la valeur propre  $\lambda$

**exemple** : soit  $A = \begin{pmatrix} 0 & -2 & 0 \\ -1 & 2 & 1 \\ -1 & -2 & 1 \end{pmatrix}$ .

Alors le polynôme caractéristique est  $-X^3 + 3X^2 - 2X$ , donc les racines évidentes sont 0, 1 et 2. Ainsi, **les valeurs propres de  $A$  sont 0, 1, 2**.

On résout alors  $AX = 0$  : on trouve pour solutions les  $a \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}$ ,  $a \in \mathbb{R}$ .

De même,  $AX = X$  admet pour solutions les  $b \begin{pmatrix} 2 \\ -1 \\ 3 \end{pmatrix}$ ,  $b \in \mathbb{R}$  et  $AX = 2X$  les  $c \begin{pmatrix} 1 \\ -1 \\ 1 \end{pmatrix}$ ,  $c \in \mathbb{R}$ .

En particulier,  $\begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}$  est un vecteur propre associé à la valeur propre 0,  $\begin{pmatrix} 2 \\ -1 \\ 3 \end{pmatrix}$  est un vecteur propre associé à la valeur propre 1 et  $\begin{pmatrix} 1 \\ -1 \\ 1 \end{pmatrix}$  un vecteur propre associé à la valeur propre 2.

### 6.2 diagonalisation

**proposition** : si une matrice  $A$  carrée de taille  $n$  admet une base formée de vecteurs propres, si  $P$  est la matrice formée par ces vecteurs, alors  $P^{-1}AP$  est une matrice diagonale, dont les coefficients sur la diagonale sont les valeurs propres de  $A$ .

**exemple 1** : si l'on reprend l'exemple précédent, on a  $P = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 1 \\ 0 & -1 & -1 \\ 1 & 3 & 1 \end{pmatrix}$ .

On peut calculer  $P^{-1} = \begin{pmatrix} 2 & 1 & -1 \\ -1 & 0 & 1 \\ 1 & -1 & -1 \end{pmatrix}$ , et on n'a pas besoin de faire le calcul pour affirmer que  $P^{-1}AP = D = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 2 \end{pmatrix}$ .

**exemple 2** : soit  $B = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$ .

0 est la seule valeur propre de  $B$ , et les vecteurs propres sont les multiples de  $\begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix}$ . On ne peut trouver une base de vecteurs propres, et  $B$  n'est pas diagonalisable.

(autre manière de voir : si  $B$  était diagonalisable, la matrice diagonale, n'ayant que des 0 sur la diagonale, serait nulle, et donc  $B$  aussi)

**application aux calculs de puissances :** si on sait diagonaliser  $A$ , on peut alors facilement calculer  $A^n$ .

En effet,  $D = P^{-1}AP$ , donc  $PDP^{-1} = A$ , donc  $A^n = PD^nP^{-1}$ .

Mais  $D^n$  est immédiat à calculer, et on en déduit facilement la valeur de  $A^n$ .

**exemple :** en reprenant l'exemple ci-dessus, on voit que

$$A^n = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 1 \\ 0 & -1 & -1 \\ 1 & 3 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 2^n \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 2 & 1 & -1 \\ -1 & 0 & 1 \\ 1 & -1 & -1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -2 + 2^n & -2^n & 2 - 2^n \\ 1 - 2^n & 2^n & -1 + 2^n \\ -3 + 2^n & -2^n & 3 - 2^n \end{pmatrix}.$$

**critères de diagonalisabilité :** en général, la méthode évoquée ci-dessus est la plus simple pour savoir si une matrice est diagonalisable. On peut cependant donner deux cas, assez fréquents, qui assurent qu'une matrice est diagonalisable :

- une matrice carrée de taille  $n$  qui a  $n$  valeurs propres distinctes est diagonalisable,
- une matrice symétrique est diagonalisable.

**recherche des valeurs propres :** on peut citer deux astuces pour déterminer les valeurs propres :

- leur somme est égale à la **trace** de la matrice, c'est-à-dire la somme des termes de la diagonale,
- leur produit est égal au déterminant de la matrice.

## 6.3 quelques exemples concrets

### 6.3.1 matrice d'inertie

Si  $S$  est un solide, on peut définir ses moments d'inertie  $I_x$ ,  $I_y$  et  $I_z$  par rapport aux axes  $(Ox)$ ,  $(Oy)$ ,  $(Oz)$  et de même les produits d'inertie :  $P_{xy}$ , par rapport aux axes  $(Ox)$  et  $(Oy)$ ,  $P_{yz}$  par rapport aux axes  $(Oy)$  et  $(Oz)$ ,  $P_{xz}$  par rapport aux axes  $(Ox)$  et  $(Oz)$ .

On rappelle que, par exemple,  $I_x = \int \int \int_S d(M, (Ox))^2 \rho(M) dV = \int \int \int_S (y^2 + z^2) \rho(M) dx dy dz$ , et  $P_{xy} = \int \int \int_S xy \rho(M) dx dy dz$ .

La matrice  $I = \begin{pmatrix} I_x & -P_{xy} & -P_{xz} \\ -P_{xy} & I_y & -P_{yz} \\ -P_{xz} & -P_{yz} & I_z \end{pmatrix}$  est appelée **matrice d'inertie** du système.

La matrice d'inertie est symétrique, donc elle est diagonalisable. Ses vecteurs propres indiquent les directions par rapport auxquelles la rotation est équilibrée. Et les valeurs propres correspondantes sont les moments d'inertie par rapport à ces axes.

### 6.3.2 matrice de covariance

Si  $X$  et  $Y$  sont deux variables aléatoires, on définit leur **matrice de covariance**  $\begin{pmatrix} \text{Var}(X) & \text{cov}(X, Y) \\ \text{cov}(X, Y) & \text{Var}(Y) \end{pmatrix}$ .

La matrice, symétrique, est diagonalisable, et les vecteurs propres correspondent aux **composantes principales** ; ils indiquent des axes représentant l'étirement des valeurs.

Si on tire au hasard des points du plan selon la loi de  $(X, Y)$ , le nuage de points obtenus aura deux axes privilégiés qui correspondent aux vecteurs propres, et les valeurs propres correspondront à l'étirement des valeurs selon ces axes.

### 6.3.3 système oscillant

On considère sur une droite un ressort de raideur  $k$  et longueur au repos  $2L$  au bouts duquel sont fixées deux masses  $m_1$  et  $m_2$ , d'abscisses  $x_1$  et  $x_2$ .

Alors la force sur la première masse est  $k(x_2 - x_1 - 2L)$ , celle sur la seconde est  $-k(x_2 - x_1 - 2L)$ .

On a donc, si on note  $u_1 = x_1 + L$  et  $u_2 = x_2 - L$ , les équations

$$\begin{cases} m_1 \ddot{u}_1 = -ku_1 + ku_2 \\ m_2 \ddot{u}_2 = ku_1 - ku_2 \end{cases}, \text{ d'où sous forme matricielle :}$$

$$\begin{pmatrix} \ddot{u}_1 \\ \ddot{u}_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -\frac{k}{m_1} & \frac{k}{m_1} \\ \frac{k}{m_2} & -\frac{k}{m_2} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} u_1 \\ u_2 \end{pmatrix}.$$

La matrice a pour valeurs propres  $0$  et  $-k(\frac{1}{m_1} + \frac{1}{m_2})$ . Elle a deux valeurs propres distinctes, elle est donc diagonalisable. Et ses valeurs propres correspondent aux pulsations propres du système  $0$  et  $\sqrt{k(\frac{1}{m_1} + \frac{1}{m_2})}$  (voir TD).

Ces pulsations propres correspondent à deux solutions particulières : des oscillations conjointes des masses, qui laissent le ressort à sa longueur au repos, et d'autre part des oscillations des masses de part et d'autres du centre d'inertie qui reste fixe.

L'avantage de cette méthode est qu'elle est généralisable à un nombre quelconque de masses et de ressorts : le problème de la détermination des valeurs propres de la matrice ne se complique guère quand la taille de la matrice augmente, alors qu'une résolution directe du système devient vite très laborieuse.

## 6.4 application aux systèmes différentiels du premier ordre

### 6.4.1 système différentiels diagonal

Soit le système différentiel vérifié par des fonctions  $X(t), Y(t), Z(t)$   $\begin{cases} X' = 0 \\ Y' = Y \\ Z' = 2Z \end{cases}$ .

On peut bien entendu résoudre séparément chacune des équations :  $X(t) = a, Y(t) = be^t, Z(t) = ce^{2t}$ .



### 6.4.2 système différentiel à matrice diagonalisable

Soit le système différentiel vérifié par des fonctions  $x(t), y(t), z(t)$  :

$$\begin{cases} x' = -2y \\ y' = -x + 2y + z \\ z' = -x - 2y + z \end{cases}$$

Il s'écrit  $\begin{pmatrix} x' \\ y' \\ z' \end{pmatrix} = A \begin{pmatrix} x \\ y \\ z \end{pmatrix}$ , et l'on retrouve la matrice  $A$  précédemment diagonalisée.

Si on pose  $\begin{pmatrix} X \\ Y \\ Z \end{pmatrix} = P^{-1} \begin{pmatrix} x \\ y \\ z \end{pmatrix}$ , on a  $\begin{pmatrix} x \\ y \\ z \end{pmatrix} = P \begin{pmatrix} X \\ Y \\ Z \end{pmatrix}$  et aussi  $\begin{pmatrix} X' \\ Y' \\ Z' \end{pmatrix} = P^{-1} \begin{pmatrix} x' \\ y' \\ z' \end{pmatrix}$ .

Par conséquent, en le multipliant par  $P^{-1}$  le système devient  $\begin{pmatrix} X' \\ Y' \\ Z' \end{pmatrix} = P^{-1}AP \begin{pmatrix} X \\ Y \\ Z \end{pmatrix}$ , et on est ramené au cas précédent.

On a  $X(t) = a$ ,  $Y(t) = be^t$ ,  $Z(t) = ce^{2t}$ , et par conséquent  $\begin{pmatrix} x(t) \\ y(t) \\ z(t) \end{pmatrix} = P \begin{pmatrix} a \\ be^t \\ ce^{2t} \end{pmatrix}$ ,

donc les solutions sont de la forme  $\begin{cases} x(t) = a + 2be^t + ce^{2t} \\ y(t) = -be^t - ce^{2t} \\ z(t) = a + 3be^t + ce^{2t} \end{cases}$ ,  $a, b, c$  étant des constantes réelles quelconques.

### 6.4.3 système différentiel à matrice diagonalisable sur $\mathbb{C}$

La vitesse  $\vec{v} \begin{pmatrix} v_x \\ v_y \\ v_z \end{pmatrix}$  d'une particule dans un champ magnétique vertical uniforme  $\vec{B} = B\vec{k}$  vérifie les équations :

$$\begin{cases} m \frac{dv_x}{dt} = qBv_y \\ m \frac{dv_y}{dt} = -qBv_x \\ m \frac{dv_z}{dt} = 0 \end{cases}$$

ce qui peut s'écrire  $\frac{d\vec{v}}{dt} = \frac{qB}{m} \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ -1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix} \vec{v}$ .

La matrice  $\frac{qB}{m} \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ -1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}$  a pour valeurs propres  $0, \frac{qB}{m}i$  et  $-\frac{qB}{m}i$  : deux sont complexes, et elle n'est pas diagonalisable sur  $\mathbb{R}$ , mais sur  $\mathbb{C}$ .

On retrouve un résultat du même type : les solutions complexes sont des combinaisons linéaires d'exponentielles  $t \mapsto e^{Ot}$ ,  $t \mapsto e^{i\frac{qB}{m}t}$  et  $t \mapsto e^{-i\frac{qB}{m}t}$ .

Si l'on repasse en réel, il ne sera donc pas surprenant de trouver des solutions en  $t \mapsto \cos \frac{qB}{m}t$  et  $t \mapsto \sin \frac{qB}{m}t$ , ce qui permet de prouver que les trajectoires sont des hélices.

### 6.4.4 système différentiel à matrice non diagonalisable

Si on cherche à résoudre un système différentiel dont la matrice n'est pas diagonalisable (même sur  $\mathbb{C}$ ) on verra apparaître pour certaines valeurs propres  $\lambda$ , en plus des exponentielles  $t \mapsto e^{\lambda t}$ , d'autres solutions du type  $t \mapsto te^{\lambda t}$ ,  $t \mapsto t^2e^{\lambda t}, \dots$

**exemple :** soit le système  $\begin{cases} x' = y \\ y' = 0 \end{cases}$ .

Alors on voit directement que  $y(t) = a$  et  $x(t) = at + b$ ,  $a$  et  $b$  étant des constantes réelles : l'unique valeur propre de la matrice  $\begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$  est  $0$ , et les solutions sont des combinaisons linéaires de  $t \mapsto e^{0t}$  et  $t \mapsto te^{0t}$ .

## 1 Séries : définitions et premières propriétés

On appelle série de terme général  $(u_n)$ , et on note  $\sum u_n$ , la suite des sommes partielles des  $u_n$ , soit la suite  $S_0 = u_0$ ,  $S_1 = u_0 + u_1$ , ...,  $S_n = \sum_{k=0}^n u_k$ .

$u_n$  est le **terme général** de la série  $\sum u_n$ .

On dit que la série  $\sum u_n$  **converge** si la suite  $S_n$  admet une limite finie, et on note alors  $\sum_{n=0}^{+\infty} u_n$  cette limite.

Dans le cas contraire on dit que la série **diverge**.

**exemple :** la série de terme général constant égal à 1 diverge.

En effet, pour tout  $n$  la somme partielle vaut  $S_n = n + 1$ , de limite infinie.

**exemple :** la série de terme général  $(-1)^n$  diverge.

En effet, les sommes partielles  $1 - 1 + 1 - 1 + \dots$  valent alternativement 1 et 0 et n'ont pas de limite.

**exemple - série géométrique :** soit  $r$  un nombre complexe différent de 1.

Alors la série  $\sum r^n$  converge si et seulement si  $|r| < 1$ .

En effet, on sait (somme des termes d'une suite géométrique de raison  $r$ ) que  $S_n = \frac{1 - r^{n+1}}{1 - r}$ .

Si  $|r| = 1$  (et  $r \neq 1$  pour que la formule ait un sens),  $S_n$  n'a pas de limite. Si  $|r| > 1$ ,  $|S_n|$  tend vers l'infini. En revanche, si  $|r| < 1$ ,  $S_n$  tend vers  $\frac{1}{1 - r}$ , et on a donc

$$\text{si } |r| < 1, \quad \sum_{n=0}^{+\infty} r^n = \frac{1}{1 - r}.$$

**exemple :** la série  $\sum \frac{1}{n(n+1)}$  converge et a pour somme 1.

En effet,  $\frac{1}{n(n+1)} = \frac{1}{n} - \frac{1}{n+1}$  donc  $\sum_{n=1}^N = (1 - 1/2) + (1/2 - 1/3) + \dots + (1/N - 1/(N+1)) = 1 - 1/(N+1)$  a pour limite 1 :  $\sum_{n=1}^{+\infty} \frac{1}{n(n+1)} = 1$ .

**proposition :** si  $\sum u_n$  converge,  $(u_n)$  tend vers 0.

En effet,  $u_n = S_n - S_{n-1}$ , donc si  $S_n$  converge,  $S_{n-1}$  aussi et vers la même limite, et par conséquent  $u_n$  tend vers 0.

**attention** la réciproque est fautive : la série  $\sum 1/n$  diverge.

En effet,  $S_{2n} - S_n = \frac{1}{n+1} + \frac{1}{n+2} + \dots + \frac{1}{2n}$  est une somme de  $n$  termes tous au moins égaux à  $\frac{1}{2n}$ , donc la somme dépasse  $n \frac{1}{2n} = \frac{1}{2}$ . Mais si  $S_n$  convergeait,  $S_{2n}$  aurait la même limite et donc  $S_{2n} - S_n$  tendrait vers 0...

## 2 Série à termes positifs

Si les  $u_n$  sont positifs, la suite des sommes partielles  $S_n$  est croissante, donc elle converge si et seulement si elle est majorée. On obtient alors facilement trois propositions qui permettent d'étudier la convergence des séries à termes positifs :

**comparaison :** on considère deux suites telles que pour tout  $n$ ,  $0 \leq u_n \leq v_n$ . Alors :

si  $\sum v_n$  converge, alors  $\sum u_n$  converge,

si  $\sum u_n$  diverge, alors  $\sum v_n$  diverge.

**exemple :**  $\sum \frac{x^n}{n}$  converge si  $0 < x < 1$ .

En effet, si  $n \geq 1$ ,  $\frac{x^n}{n} \leq x^n$ , et  $\sum x^n$  converge.

**exemple :**  $\sum nx^n$  converge si  $0 < x < 1$ .

En effet, si on fixe  $a$  tel que  $x < a < 1$ , alors  $nx^n = na^n(x/a)^n$ .

$n(x/a)^n$  tend vers 0 en l'infini, donc pour  $n$  assez grand cette quantité est plus petite que 1, et donc  $0 \leq nx^n \leq a^n$ . Comme  $\sum a^n$  converge,  $\sum nx^n$  converge aussi.

**équivalence :** on considère deux suites telles que  $u_n \sim v_n$ . Alors  $\sum u_n$  et  $\sum v_n$  sont de même nature.

**exemple :** la série  $\sum \frac{1}{n^2}$  converge ; en effet,  $\frac{1}{n^2}$  est positif et  $\frac{1}{n^2} \sim \frac{1}{n(n+1)}$ , terme général d'une série convergente.

**intégrales :** on considère  $f : [0, +\infty[$  continue décroissante et de limite nulle en  $+\infty$ .

Alors  $\sum f(n)$  et  $\int^{+\infty} f$  sont de même nature.

En effet, on peut écrire pour  $x$  dans  $[n, n+1]$  :  $f(n+1) \leq f(x) \leq f(n)$ , donc en intégrant entre  $n$  et  $n+1$ ,  $f(n+1) \leq \int_n^{n+1} f(x)dx \leq f(n)$ . En sommant entre 0 et  $N$  on obtient donc  $\sum_{n=1}^{N+1} f(n) \leq \int_0^N f(x)dx \leq \sum_{n=0}^N f(n)$ , donc  $S_N + f(N+1) - f(0) \leq \int_0^N f(x)dx \leq S_N$ .

Ainsi : si la suite  $S_N$  converge, elle est bornée, et donc  $\int_0^N f(x)dx$  aussi : l'intégrale converge.

Si l'intégrale converge,  $S_N + f(N+1) - f(0)$  est bornée donc (comme  $f(N+1)$  tend vers 0),  $S_N$  aussi, donc la série converge.

**séries de Riemann :** on considère  $\alpha \in \mathbb{R}$  et la série  $\sum \frac{1}{n^\alpha}$ .

Si  $\alpha \leq 0$ ,  $\frac{1}{n^\alpha}$  ne tend pas vers 0 en l'infini et la série diverge.

Si  $\alpha > 0$ , la fonction  $1/x^\alpha$  est décroissante de limite nulle en l'infini. Donc  $\sum \frac{1}{n^\alpha}$  et  $\int^{+\infty} \frac{dx}{x^\alpha}$  sont de même nature.

Mais la fonction  $f$  admet pour primitive  $\frac{x^{-\alpha+1}}{-\alpha+1}$  si  $\alpha \neq 1$ ,  $\ln(x)$  si  $\alpha = 1$ , et on voit ainsi que l'intégrale converge en l'infini si et seulement si  $\alpha > 1$ , c'est-à-dire si l'exposant de  $x$  dans l'expression de la primitive est strictement négatif.

Donc

la série  $\sum \frac{1}{n^\alpha}$   
converge si et seulement si  $\alpha > 1$

### 3 séries à termes de signe quelconques ou complexes

Quand la série n'est pas à terme positifs, il peut être plus difficile d'étudier sa convergence. Néanmoins dans beaucoup de cas il suffit d'étudier la convergence de la série des valeurs absolues du terme général :

**convergence absolue :** si  $\sum |u_n|$  converge,  $\sum u_n$  converge.

On dit que la série  $\sum u_n$  est **absolument convergente**.

**exemple**  $\sum \frac{\sin n}{n^2}$  converge absolument, car  $\left| \frac{\sin n}{n^2} \right| \leq \frac{1}{n^2}$ , donc elle converge.

Il existe des cas où une série n'est pas absolument convergente mais est convergente :

**séries alternées** on considère une suite  $(a_n)$  décroissante de limite nulle.

Alors la série  $\sum (-1)^n a_n$  converge.

**exemple** la série  $\sum \frac{(-1)^n}{n}$  converge (bien qu'elle ne soit pas absolument convergente).

### 4 séries entières

On appelle **série entière** une fonction définie par une série convergente du type  $f(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} a_n x^n$ .

**rayon de convergence :** toute série entière admet un rayon de convergence  $R \in [0; +\infty]$  tel que : si  $|x| < R$ , la série converge, et si  $|x| > R$ , la série ne converge pas.

**exemple :**  $\sum \frac{x^n}{n}$  a pour rayon de convergence 1.

En effet, si  $|x| > 1$ ,  $x^n/n$  ne tend pas vers 0, la série diverge.

Si  $|x| < 1$ , on a vu que  $\sum |x|^n/n$  converge, donc  $\sum x^n/n$  aussi.

Pour  $|x| = 1$ , on constate en particulier que la série converge pour  $x = -1$  et diverge pour  $x = 1$ .

**proposition :** si la limite de la suite  $|a_{n+1}|/|a_n|$  existe dans  $[0, +\infty]$ , le rayon de convergence est l'inverse de cette limite.

**exemple :**  $\sum \frac{x^n}{n!}$  a pour rayon de convergence  $+\infty$ . En effet, la limite de  $\frac{1/(n+1)!}{1/n!} = \frac{1}{n+1}$  est 0, donc le rayon de convergence est  $1/0 = +\infty$ .

**proposition :** sur  $] -R, R[$  on peut intégrer ou dériver terme à terme une série entière.

**exemple :** soit pour  $x$  réel,  $x \in ] -1, 1[$ ,  $g(x) = -\sum_{n=1}^{+\infty} \frac{(-x)^n}{n}$ .

Sur  $] -1, 1[$   $g'(x) = \sum_{n=1}^{+\infty} (-x)^{n-1} = \sum_{n=0}^{+\infty} (-x)^n = \frac{1}{1 - (-x)} = \frac{1}{1+x}$ , donc en primitivant,  $g(x)$  est de la forme  $\ln(1+x) + c$ . Comme  $g(0) = 0$ ,  $c = 0$ , et donc  $\sum_{n=1}^{+\infty} \frac{(-x)^n}{n} = \ln(1+x)$ .

De plus, on peut justifier le passage à la limite  $x \rightarrow 1$  qui permet de prolonger la relation en  $\ln(2) = \sum_{n=1}^{+\infty} \frac{(-1)^n}{n}$ .

**exemple :** soit  $h(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{x^n}{n!}$ .

On a vu que le rayon de convergence de cette série est infini, l'expression est donc bien définie pour tout  $x$  réel.

Alors en dérivant on obtient  $h'(x) = h(x)$  et  $h(0) = 1$ , donc  $h(x) = e^x$ .

**exemple :** en appliquant ce qui précède à  $ix$  (on remplace  $x$  par  $ix$  dans l'expression ci-dessus), puis on prend les parties réelles et imaginaires de l'expression, on obtient les développements en série entière  $\cos(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{(-1)^n x^{2n}}{(2n)!}$  et  $\sin(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{(-1)^n x^{2n+1}}{(2n+1)!}$ .