

Épreuve : MATHÉMATIQUES II

Filière MP

Notations

- Dans tout le problème n est un entier supérieur à 2, \mathcal{M}_n est l'ensemble des matrices carrées à n lignes, à coefficients réels.
- On note $(E_{ij}, 1 \leq i \leq n, 1 \leq j \leq n)$ la base canonique de \mathcal{M}_n . Ainsi, pour tout couple (i, j) d'entiers compris entre 1 et n , tous les coefficients de la matrice E_{ij} sont nuls sauf le coefficient d'indices (i, j) qui vaut 1. On rappelle le résultat suivant :

$$\forall i, j, k, l \in \{1, \dots, n\}, E_{ij}E_{kl} = \delta_{jk}E_{il}$$

où $\delta_{jk} = 1$ si $j = k$ et 0 sinon.

- Pour tout couple (p, q) d'entiers strictement positifs, on note $\mathcal{M}_{p,q}$ l'espace vectoriel des matrices à p lignes et q colonnes, à coefficients réels.
- Pour toute matrice M de $\mathcal{M}_{p,q}$, on note tM sa matrice transposée.
- L'espace \mathbb{R}^n est identifié à l'espace $\mathcal{M}_{n,1}$. On note $\mathcal{B} = (\mathbf{e}_1, \dots, \mathbf{e}_n)$ la base canonique de \mathbb{R}^n . Ainsi, pour tout entier k compris entre 1 et n , $\mathbf{e}_k = {}^t(0, \dots, 0, 1, 0, \dots, 0)$ où 1 est en $k^{\text{ième}}$ position.

On munit \mathbb{R}^n de sa structure euclidienne canonique.

Pour tout couple (\mathbf{u}, \mathbf{v}) de vecteurs de \mathbb{R}^n , $\mathbf{u} = {}^t(u_1, \dots, u_n)$ et $\mathbf{v} = {}^t(v_1, \dots, v_n)$,

on note $\langle \mathbf{u}, \mathbf{v} \rangle = {}^t\mathbf{u} \cdot \mathbf{v} = \sum_{k=1}^n u_k v_k$ leur produit scalaire.

- Pour tout couple d'entiers p, q tels que $p \leq q$, on note :

$$[[p, q]] = \{k \in \mathbb{N}, p \leq k \leq q\}.$$

- Étant donné ${}^t(\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_n) \in \mathbb{R}^n$, on note $D = \text{diag}(\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_n) \in \mathcal{M}_n$ la matrice diagonale telle que, pour tout i de $[[1, n]]$, $d_{ii} = \alpha_i$.
On note $I_n = \text{diag}(1, 1, \dots, 1)$ la matrice de l'identité.

Soit $A = [a_{ij}]_{1 \leq i, j \leq n} \in \mathcal{M}_n$. On considère le système linéaire

$$A\mathbf{u} = \mathbf{w}, \tag{1}$$

où $\mathbf{w} = {}^t(w_1, \dots, w_n) \in \mathbb{R}^n$ est donné, et $\mathbf{u} = {}^t(u_1, \dots, u_n)$ est l'inconnue. L'objet du problème est l'étude de quelques méthodes de résolution de ce système linéaire. On rappelle que

$$\sum_{k=1}^n k = \frac{n(n+1)}{2}, \quad \sum_{k=1}^n k^2 = \frac{n(n+1)(2n+1)}{6}.$$

Partie I - Méthode de Gauss et factorisation

Le but de cette partie est de représenter matriciellement la méthode de Gauss pour la résolution du système (1).

On note $\mathcal{TS}_n \subset \mathcal{M}_n$ l'ensemble des matrices $M = [m_{ij}]_{1 \leq i, j \leq n}$ triangulaires supérieures (c'est-à-dire $m_{ij} = 0$ pour $i > j$) et $\mathcal{TI}_n \subset \mathcal{M}_n$ l'ensemble des matrices triangulaires inférieures à diagonale unité (c'est-à-dire $m_{ii} = 1$ et $m_{ij} = 0$ pour $i < j$). Dans toute cette partie, on suppose que $\det(A) \neq 0$, de sorte que le système

(1) admette une unique solution $\mathbf{u} = {}^t(u_1, \dots, u_n) \in \mathbb{R}^n$.

I.A - Résolution d'un système triangulaire

On suppose dans cette question que $A \in \mathcal{TS}_n$.

I.A.1) Calculer u_n puis pour $k \in [[1, n-1]]$ exprimer u_{n-k} en fonction de $u_n, u_{n-1}, \dots, u_{n-k+1}$. Écrire l'algorithme de résolution du système (1).

I.A.2) Exprimer en fonction de n le nombre d'additions, de multiplications et de divisions nécessaires à la résolution du système (1).

I.B - Matrices d'élimination de Gauss

La matrice A de \mathcal{M}_n est de nouveau quelconque avec $\det A \neq 0$.

Étant donné $M = [m_{ij}]_{1 \leq i, j \leq n} \in \mathcal{M}_n$, on note pour tout entier q de $[[1, n]]$, $\Delta_q(M)$ la sous-matrice de M définie par $\Delta_q(M) = [m_{ij}]_{1 \leq i, j \leq q}$ élément de \mathcal{M}_q , et on note $D_q(M) = \det \Delta_q(M)$ ($D_1(M), \dots, D_n(M)$ sont appelés les mineurs principaux de M).

Par ailleurs, on note $L_i(M)$ le $i^{\text{ième}}$ vecteur ligne de la matrice M et défini par $L_i(M) = (m_{i1}, m_{i2}, \dots, m_{in})$. On note aussi $C_j(M)$ le $j^{\text{ième}}$ vecteur colonne de M défini par $C_j(M) = {}^t(m_{1j}, m_{2j}, \dots, m_{nj})$. On dira aussi dans la suite les lignes L_i de M et les colonnes C_j de M .

I.B.1) Soient M une matrice de \mathcal{M}_n et $P = MA$. Exprimer, pour tout entier q de $[[1, n]]$, $L_q(P)$ en fonction des lignes $L_i(A)$ de la matrice A .

(On pourra, si l'on veut, utiliser la décomposition de $L_q(P)$ sous la forme $\sum_{j=1}^n p_{qj}E_{qj}$

avec $P = (p_{ij})_{1 \leq i, j \leq n}$).

I.B.2) Pour un entier k de $[[1, n-1]]$ et un vecteur $\beta = {}^t(\beta_{k+1}, \dots, \beta_n) \in \mathbb{R}^{n-k}$, on note $F(k, \beta)$ la matrice de \mathcal{M}_n qui réalise par le produit à gauche $P = F(k, \beta)A$ les combinaisons linéaires de lignes suivantes, en notant pour simplifier $L_i = L_i(A)$ et $L'_i = L_i(P)$:

$$\forall i \in [[1, k]], \quad L'_i = L_i \quad \text{et} \quad \forall i \in [[k+1, n]], \quad L'_i = L_i + \beta_i L_k. \quad (2)$$

a) Montrer que $F(k, \beta)^{-1} = F(k, -\beta)$.

b) Montrer que si $P = F(k, \beta)A$ on a :

$$\forall q \in [[1, n]], \quad D_q(P) = D_q(A).$$

c) Déterminer les coefficients ϵ_{ij} de $F(k, \beta)$ pour tout couple (i, j) d'entiers de $[[1, n]] \times [[1, n]]$. Montrer que $F(k, \beta) \in \mathcal{TI}_n$.

I.B.3)

a) Étant donnée une matrice $M = [m_{ij}]_{1 \leq i, j \leq n}$ de \mathcal{M}_n , exprimer les vecteurs colonnes C'_j du produit matriciel $MF(k, \beta)$ en fonction des colonnes C_j de M .

b) Soit q un entier de $[[1, n]]$ et pour tout entier k de $[[1, q]]$, $\beta_k = {}^t(\beta_{k+1, k}, \dots, \beta_{n, k})$ un vecteur de \mathbb{R}^{n-k} . On considère la matrice produit

$$P_q = F(1, \beta_1) \cdot F(2, \beta_2) \dots F(q, \beta_q) = \prod_{k=1}^q F(k, \beta_k). \quad (3)$$

On note C_j^q les vecteurs colonnes de la matrice P_q et pour tout entier k de $[[1, q]]$, $\mathbf{b}_k = {}^t(0, \dots, 0, 1, \beta_{k+1, k}, \dots, \beta_{n, k}) \in \mathbb{R}^n$.

Montrer par récurrence sur q que :

$$\forall j \in [[q+1, n]], \quad C_j^q = e_j \quad \text{et} \quad \forall j \in [[1, q]], \quad C_j^q = b_j.$$

En déduire que P_q appartient à \mathcal{TI}_n et que $P_{n-1} = [\mathbf{b}_1, \dots, \mathbf{b}_{n-1}, \mathbf{e}_n]$.

I.C - Factorisation de A

Dans cette question, on suppose que pour chaque $k \in [[1, n]]$, $\Delta_k(A)$ est inversible. On note $A_1 = A = [a_{ij}^1]_{1 \leq i, j \leq n}$ la matrice initiale.

I.C.1) Montrer que $a_{11}^1 \neq 0$. Déterminer $\beta_1 = {}^t(\beta_{21}, \dots, \beta_{n1}) \in \mathbb{R}^{n-1}$ pour que la première colonne de $A_2 = F(1, -\beta_1)A_1$ soit proportionnelle à \mathbf{e}_1 . Que vaut la première ligne de A_2 ?

I.C.2) On pose $F_1 = F(1, -\beta_1)$.

a) Montrer par récurrence sur k l'existence des suites de matrices $(F_{k-1})_{2 \leq k \leq n}, (A_k)_{2 \leq k \leq n}$ avec

$$F_{k-1} = F(k-1, -\beta_{k-1}) \quad A_k = [a_{ij}^k]_{1 \leq i, j \leq n} = F_{k-1}A_{k-1}$$

et telles que :

$$\forall j \in [[1, k-1]], \forall i \in [[j+1, n]], a_{ij}^k = 0 \quad \text{et} \quad \forall m \in [[1, n]], \quad D_m(A_k) \neq 0. \quad (4)$$

Exprimer le vecteur β_k à l'aide des coefficients de A_k .

b) Montrer que les lignes 1 à k de A_k et A_{k+1} sont identiques.

c) Pour $k \in [[1, n-1]]$, soit N_k le nombre de multiplications nécessaires pour passer de A_k à A_{k+1} . Calculer le nombre N_k .

I.C.3)

a) Déduire des questions précédentes qu'il existe une matrice L de \mathcal{TI}_n et une matrice U de \mathcal{TS}_n telles que l'on ait

$$A = LU. \quad (5)$$

b) Exprimer les coefficients l_{ij} de L pour $i > j$ et les coefficients u_{ij} de U pour $i \leq j$ en fonction des coefficients a_{ij}^k des matrices A_k (Utiliser (I.B.2a) et (I.C.2a)).

I.C.4) Montrer que les matrices L et U de la factorisation (5) sont uniques.

I.C.5) Écrire dans le langage de son choix un programme réalisant la factorisation $A = LU$ qui n'utilise qu'un seul tableau carré encore nommé A pour contenir toutes les itérations A_k . On prendra soin de commenter les principales lignes du programme. Comment aura-t-on en final les facteurs L et U à partir du tableau A ?

I.C.6) Soit S_n le nombre de multiplications nécessaires à la factorisation $A = LU$. Calculer S_n (*Indication* : utiliser la question I.C.2.c.)

Partie II - Applications et cas particuliers

Dans cette partie, on applique à certains exemples la factorisation vue en Partie I. Par commodité d'écriture, lorsque l'on représente une matrice, les espaces laissés vides sont remplis de 0 qui ne sont pas systématiquement écrits.

II.A - Application à la résolution de systèmes linéaires

II.A.1) On veut résoudre le système (1) en utilisant la factorisation (5). On fait toujours l'hypothèse que pour tout entier k de $[[1, n]]$, $D_k(A) \neq 0$.

Sans compter les opérations nécessaires à la factorisation, montrer qu'il suffit de $n(n-1)$ multiplications pour résoudre le système (préciser la méthode utilisée).

Partie III - Une méthode itérative

III.A -

Soit $A = [a_{ij}]_{1 \leq i, j \leq n}$ une matrice inversible de \mathcal{M}_n . On étudie ici une méthode itérative de résolution du système (1). On utilise la norme euclidienne sur \mathbb{R}^n , définie par $\|\mathbf{x}\|^2 = \langle \mathbf{x}, \mathbf{x} \rangle = \sum_{k=1}^n x_k^2$, avec $\mathbf{x} = {}^t(x_1, \dots, x_n) \in \mathbb{R}^n$. On rappelle que la norme matricielle subordonnée de $A \in \mathcal{M}_n$ est définie par $\|A\| = \sup_{\|\mathbf{x}\|=1} \|A\mathbf{x}\|$.

III.A.1)

- a) Exprimer $\|A\mathbf{x}\|^2$ en fonction de $B = {}^tA.A$ et de \mathbf{x} . En déduire que B est une matrice symétrique positive. On note $\text{sp}(B) = \{\lambda_1(B), \dots, \lambda_n(B)\}$ le spectre de B , c'est-à-dire l'ensemble des valeurs propres de B énoncées de sorte que $\lambda_1(B) \leq \dots \leq \lambda_n(B)$.
- b) Montrer que $\|A\| = \sqrt{\lambda_n(B)}$.
- c) On suppose que A est symétrique et on note $\rho(A) = \max_{\lambda \in \text{sp}(A)} |\lambda|$, où $\text{sp}(A)$ est l'ensemble des valeurs propres de A . Montrer que l'on a $\|A\| = \rho(A)$.

III.A.2) On note H une matrice de \mathcal{M}_n et \mathbf{c} un vecteur de \mathbb{R}^n tels que le système (1) peut se réécrire sous la forme

$$\mathbf{u} = H\mathbf{u} + \mathbf{c} \tag{7}$$

Soit $\mathbf{U}_0 \in \mathbb{R}^n$. On considère la suite vectorielle itérée $(\mathbf{U}_k)_{k \in \mathbb{N}}$ définie par la relation de récurrence $\mathbf{U}_{k+1} = H\mathbf{U}_k + \mathbf{c}$. Montrer que, si $\|H\| < 1$, la suite $(\mathbf{U}_k)_{k \in \mathbb{N}}$ est convergente dans \mathbb{R}^n de limite \mathbf{u} , solution de l'équation (7).

III.A.3) Dans les questions qui suivent, on applique la méthode itérative ci-dessus au système $A_n \mathbf{u} = \mathbf{w}$ où A_n est définie en II.C par (6). On décompose A_n en

$$A_n = 2I_n - M_n. \tag{8}$$

- a) Calculer les valeurs propres de M_n (*Indication* : interpréter le système $M_n \mathbf{x} = \lambda \mathbf{x}$ comme une équation récurrente sur la suite $(x_k)_{0 \leq k \leq n+1}$ avec $x_0 = x_{n+1} = 0$. (On constatera qu'il n'y a de solution non nulle que si $|\lambda| < 2$).
- b) En déduire qu'il existe une suite de réels $(\mu_n)_{n \in \mathbb{N}}$ telle que

$$\forall n \in \mathbb{N}^*, \mu_n > 0, \quad \lim_{n \rightarrow \infty} \mu_n = 0, \quad \|M_n\| = 2 - \mu_n.$$

- c) Donner un équivalent de μ_n quand n tend vers l'infini.

III.A.4) On considère la décomposition (8). On choisit la donnée initiale \mathbf{U}_0 de sorte que $\|\mathbf{U}_0\| = 1$. On suppose en outre que $\|\mathbf{w}\| = 1$.

- a) On choisit $H = \frac{M_n}{2}$. Expliciter le vecteur \mathbf{c} de manière à appliquer la méthode itérative puis donner l'expression complète de \mathbf{U}_k en fonction de \mathbf{U}_0 , de \mathbf{c} et des matrices H^m pour $m \in [[1, k]]$.
- b) Majorer l'erreur $\epsilon_k = \|\mathbf{U}_k - \mathbf{u}\|$ en fonction de k , μ_n et $\|A_n^{-1}\|$.
- c) Montrer que $\lim_{n \rightarrow \infty} \|A_n^{-1}\| = +\infty$ et donner un équivalent de $\|A_n^{-1}\|$ pour n tendant vers l'infini.
- d) Déterminer un nombre d'itérations k suffisant pour avoir $\epsilon_k < 10^{-4}$. Donner un équivalent du nombre de multiplications pour obtenir cette approximation et comparer à la méthode de factorisation LU . Pour n grand, quelle méthode est préférable?

••• FIN •••
