

Espaces euclidiens

Exercice 1

On munit $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ du produit scalaire canonique.

a. Montrer que l'ensemble \mathcal{H} des matrices de trace nulle est un sous-espace vectoriel de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$, et en donner la dimension.

b. Soit J la matrice dont tous les coefficients sont égaux à 1. Calculer $d(J, \mathcal{H})$.

a. La trace est une application linéaire donc $\mathcal{H} = \text{Ker}(\text{tr})$ est un sous-espace vectoriel de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$. Son image est égale à \mathbb{R} donc la trace est de rang 1, et d'après le théorème du rang, $\dim \mathcal{H} = n^2 - 1$.

b. Pour tout $H \in \mathcal{H}$, $\langle I_n | H \rangle = \text{tr} H = 0$ donc $\mathcal{H}^\perp = \text{Vect}(I_n)$.

La projection orthogonale de J sur $\text{Vect}(I_n)$ vaut : $\left\langle J \mid \frac{I_n}{\|I_n\|} \right\rangle \frac{I_n}{\|I_n\|} = I_n$ car $\|I_n\| = \sqrt{n}$ et $\langle J | I_n \rangle = n$.

On en déduit que $d(J, \mathcal{H}) = \|I_n\| = \sqrt{n}$.

Exercice 2

Soit $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$. Déterminer $\min_{M \in \mathcal{S}_n(\mathbb{R})} \sum_{i,j} (a_{ij} - m_{ij})^2$.

On munit $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ du produit scalaire canonique $\langle A | B \rangle = \text{tr}(A^T B) = \sum_{i,j} a_{ij} b_{ij}$. Pour ce produit scalaire, $\mathcal{S}_n(\mathbb{R})$ et $\mathcal{A}_n(\mathbb{R})$

sont supplémentaires orthogonaux puisque si S est symétrique et A antisymétrique, $\langle S | A \rangle = \text{tr}(S^T A) = \text{tr}(SA) = \text{tr}(AS) = -\text{tr}(A^T S) = -\langle A | S \rangle$ donc $\langle S | A \rangle = 0$.

Il s'agit donc de minimiser $\|A - M\|^2$ pour $M \in \mathcal{S}_n(\mathbb{R})$. Ce minimum est atteint lorsque $M = p(A)$ est la projection orthogonale de A sur $\mathcal{S}_n(\mathbb{R})$, soit $M = \frac{1}{2}(A + A^T)$. Ce minimum vaut alors $\left\| \frac{1}{2}(A - A^T) \right\|^2 = \frac{1}{4} \sum_{i,j} (a_{ij} - a_{ji})^2$.

Exercice 3

Soit $E = \mathbb{R}[X]$. Pour P et Q dans E on pose $\langle P | Q \rangle = \int_{-1}^1 \frac{P(t)Q(t)}{\sqrt{1-t^2}} dt$.

a. Justifier que $\langle P | Q \rangle$ existe pour tout P et Q dans E , et qu'on définit ainsi un produit scalaire.

b. Montrer que pour tout $n \in \mathbb{N}$, il existe un unique polynôme $T_n \in \mathbb{R}[X]$ tel que : $\forall x \in \mathbb{R}, T_n(\cos x) = \cos(nx)$.

Préciser le degré et le coefficient dominant de T_n .

c. Montrer que la famille (T_n) est orthogonale, et en déduire la valeur de $\inf_{P \in \mathcal{U}_n} \int_{-1}^1 \frac{P(t)^2}{\sqrt{1-t^2}} dt$ pour $n \geq 1$, où \mathcal{U}_n désigne l'ensemble des polynômes unitaires de degré n .

a. Au voisinage de 1, $\frac{1}{\sqrt{1-t^2}} \underset{1}{\sim} \frac{1}{\sqrt{2}\sqrt{1-t}}$ donc $\left| \frac{P(t)Q(t)}{\sqrt{1-t^2}} \right| \underset{1}{=} O\left(\frac{1}{\sqrt{1-t}}\right)$. Or $\int_0^1 \frac{dt}{\sqrt{1-t}}$ converge, donc il en est de même de $\int_0^1 \frac{P(t)Q(t)}{\sqrt{1-t^2}} dt$. On procède de même sur $] -1, 0]$, sachant que $\frac{1}{\sqrt{1-t^2}} \underset{-1}{\sim} \frac{1}{\sqrt{2}\sqrt{1+t}}$.

La bilinéarité, la symétrie, la positivité sont évidentes. Enfin, si $\langle P | P \rangle = 0$ alors par continuité et positivité on a pour tout $t \in -1, 1[$, $P(t)^2 = 0$ donc P possède une infinité de racines et donc $P = 0$. Il s'agit bien d'un produit scalaire.

b. Raisonnons par récurrence sur n .

- Si $n = 0$ on a nécessairement $T_0 = 1$.

- Si $n = 1$ on a nécessairement $T_1 = X$.

- Si $n \geq 2$, supposons acquise l'existence de T_{n-1} et T_{n-2} .

Utilisons la formule $\cos(a+b) + \cos(a-b) = 2 \cos a \cos b$ avec $a = (n-1)x$ et $b = x$.

On obtient : $\cos(nx) + \cos((n-2)x) = 2 \cos((n-1)x) \cos x$ donc $\cos(nx) = 2 \cos x T_{n-1}(\cos x) - T_{n-2}(\cos x)$. Il suffit donc de poser $T_n(X) = 2X T_{n-1}(X) - T_{n-2}(X)$ pour prouver l'existence de T_n .

Supposons maintenant l'existence d'un autre polynôme solution \tilde{T}_n . Dans ce cas, le polynôme $T_n - \tilde{T}_n$ s'annule sur $[-1, 1]$ donc possède une infinité de racines : c'est le polynôme nul.

Ceci assure donc l'existence et l'unicité de T_n , la récurrence se propage.

Remarque. les polynômes ainsi définis s'appellent les *polynômes de Tchebychev*; ils sont défini par les relations :

$$T_0 = 1, \quad T_1 = X, \quad T_n = 2XT_{n-1} - T_{n-2} \quad \text{pour } n \geq 2.$$

Ces relations permettent de prouver sans peine par récurrence que $\deg T_n = n$ et que le coefficient de T_n est égal à 2^{n-1} pour tout $n \geq 1$.

c. Le changement de variable $t = \cos x$ donne :

$$\langle T_p | T_q \rangle = \int_0^\pi T_p(\cos x) T_q(\cos x) dx = \int_0^\pi \cos(px) \cos(qx) dx = \frac{1}{2} \int_0^\pi (\cos((p+q)x) + \cos((p-q)x)) dx$$

Sachant que $\int_0^\pi \cos(nx) dx = \begin{cases} \pi & \text{si } n = 0 \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}$, on en déduit : $\langle T_p | T_q \rangle = \begin{cases} 0 & \text{si } p \neq q \\ \pi/2 & \text{si } p = q \neq 0 \\ \pi & \text{si } p = q = 0 \end{cases}$

Soit $P \in U_n$ avec $n \geq 1$. Il se décompose dans la base (T_0, \dots, T_n) sous la forme : $P = \sum_{k=0}^n a_k T_k$, avec $a_n = \frac{1}{2^{n-1}}$ puisqu'il est unitaire. Puisque la famille (T_k) est orthogonale, $\|P\|^2 = \sum_{k=0}^n a_k^2 \|T_k\|^2$ et cette quantité est minimale lorsque $a_0 = \dots = a_{n-1} = 0$. La valeur minimale recherchée vaut donc $a_n^2 \|T_n\|^2 = \frac{\pi}{2^{2n-1}}$.

Exercice 4

Soit E un espace préhilbertien et A une partie non vide de E supposée convexe, fermée et bornée.

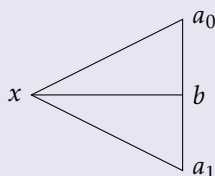
On rappelle que la *distance* de $x \in E$ à A est définie par : $d(x, A) = \inf\{\|x - a\| \mid a \in A\}$.

a. Soit $x \in E$. Montrer qu'il existe un unique $a_0 \in A$ tel que $d(x, A) = \|x - a_0\|$. On note $a_0 = p_A(x)$; c'est le *projeté* de x sur A . (Attention, ce n'est pas une application linéaire).

b. Montrer que pour tout $x \in E$ on a : $\forall a \in A, \langle x - p_A(x) \mid y - p_A(x) \rangle \leq 0$.

a. Fixons $x \in E$. L'application $\begin{pmatrix} A & \longrightarrow & \mathbb{R} \\ a & \longmapsto & \|x - a\| \end{pmatrix}$ est continue; puisque A est fermé borné cette application est bornée et atteint ses bornes, en particulier sa borne inférieure.

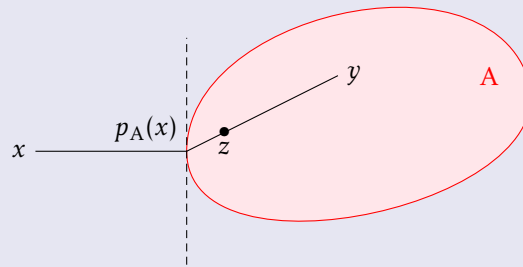
Supposons que cette borne soit atteinte en deux points a_0 et a_1 . Puisque A est convexe, $[a_0, a_1] \subset A$ et en particulier, $b = \frac{1}{2}(a_0 + a_1) \in A$. Guidons nous maintenant par un dessin :



$$\langle b - x \mid a_1 - a_0 \rangle = \left\langle \frac{a_0 + a_1}{2} - x \mid a_1 - a_0 \right\rangle = \frac{1}{2} \langle (a_1 - x) + (a_0 - x) \mid (a_1 - x) - (a_0 - x) \rangle = \frac{1}{2} (\|a_1 - x\|^2 - \|a_0 - x\|^2) = 0.$$

Les vecteurs $b - x$ et $a_0 - b$ sont orthogonaux donc d'après le théorème de Pythagore, $\|b - x\|^2 = \|x - a_0\|^2 - \|b - a_0\|^2 < \|x - a_0\|^2$ et ainsi $\|x - b\| < \|x - a_0\|$, ce qui contredit le caractère minimal de $\|x - a_0\|$. Le minimum est bien atteint en un unique point.

b. Illustrons de nouveau la situation avec un dessin :



Soit $t \in]0, 1[$ et $z = p_A(x) + t(y - p_A(x))$. $z \in [p_A(x), y]$ donc $z \in A$ puisque A est convexe.
 Par définition on a $\|x - p_A(x)\|^2 \leq \|x - z\|^2 = \|x - p_A(x)\|^2 - 2t\langle x - p_A(x) | y - p_A(x) \rangle + t^2\|y - p_A(x)\|^2$.
 On a pour tout $t \in]0, 1[$, $2\langle x - p_A(x) | y - p_A(x) \rangle \leq t\|y - p_A(x)\|^2$, et en faisant tendre t vers 0 : $\langle x - p_A(x) | y - p_A(x) \rangle \leq 0$.

Exercice 5

Soit S une matrice symétrique de $\mathcal{S}_n(\mathbb{R})$. Montrer qu'il existe $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ dans \mathbb{R} et U_1, \dots, U_n dans $\mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{R})$ tels que :

$$\forall k \in \llbracket 1, n \rrbracket, \quad U_k^T U_k = 1 \quad \text{et} \quad S = \sum_{k=1}^n \lambda_k U_k U_k^T$$

S est symétrique réelle donc diagonalisable dans une base orthonormée : il existe $P \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R})$ et $D = \text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$ tels que $S = PDP^T = \sum_{k=1}^n \lambda_k P E_{kk} P^T$ où (E_{ij}) représente la base canonique de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$.

Notons (X_1, \dots, X_n) la base canonique de \mathbb{R}^n . On a $E_{kk} = X_k X_k^T$ donc $S = \sum_{k=1}^n \lambda_k U_k U_k^T$ avec $U_k = P X_k$.

Enfin, sachant que (X_k) est une base orthonormée et que $P \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R})$, la famille (U_k) est elle aussi orthonormée, et ainsi $U_k^T U_k = \langle U_k | U_k \rangle = 1$.

Remarque. Il résulte de ceci qu'on a aussi $U_i^T U_j = 0$ pour $i \neq j$.

Exercice 6

Soit $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$. Montrer que $A \in \mathcal{S}_n^{++}(\mathbb{R})$ si et seulement si il existe $B \in \mathcal{GL}_n(\mathbb{R})$ telle que $A = B^T B$.

Supposons $A = B^T B$ avec B inversible. Alors $A^T = B^T B = A$ donc A est symétrique, et pour tout $X \in \mathbb{R}^n$, $X \neq 0$, $X^T A X = X^T B^T B X = \|BX\|^2 > 0$ car $X \neq 0 \implies BX \neq 0$ (B est inversible).

Réciproquement, supposons $A \in \mathcal{S}_n^{++}(\mathbb{R})$. D'après le théorème spectral il existe $P \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R})$ et $D = \text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$ avec $\lambda_k > 0$ tel que $A = PDP^T$. En posant $B = \text{diag}(\sqrt{\lambda_1}, \dots, \sqrt{\lambda_n})P^T$ on a bien $B \in \mathcal{GL}_n(\mathbb{R})$ et $A = B^T B$.

Exercice 7

Soit $A \in \mathcal{S}_n^{++}(\mathbb{R})$ une matrice symétrique définie positive.

a. Montrer que l'application $(X, Y) \mapsto X^T A Y$ définit un produit scalaire sur \mathbb{R}^n .

b. En déduire l'existence d'une matrice triangulaire supérieure U telle que $A = U^T U$.

Indication. Utiliser la méthode de Gram-Schmidt.

Justifier que si on impose de plus les coefficients diagonaux de U strictement positifs, cette décomposition est unique (décomposition de Cholesky).

Dans cet exercice on note $\langle X | Y \rangle = X^T A Y$; il ne s'agit donc pas du produit scalaire usuel sur \mathbb{R}^n .

a. Cette application est à l'évidence bilinéaire.

Elle est symétrique car $\langle Y | X \rangle = Y^T A X = (Y^T A X)^T = X^T A^T Y = X^T A Y = \langle X | Y \rangle$.

Elle est définie positive car $\langle X | X \rangle = X^T A X \geq 0$ avec égalité si et seulement si $X = 0$ puisque A est supposée définie positive.

b. Notons (E_1, \dots, E_n) la base canonique de \mathbb{R}^n . Pour ce produit scalaire, cette base n'est pas orthonormée, mais on peut lui appliquer le procédé de Gram-Schmidt : il existe une famille (B_1, \dots, B_n) orthonormée pour ce produit scalaire qui vérifie : $\forall k \in \llbracket 1, n \rrbracket, \text{Vect}(B_1, \dots, B_k) = \text{Vect}(E_1, \dots, E_k)$.

Si on pose $U = \text{Mat}_{(B)}(E_1, \dots, E_n)$, cette condition impose à U d'être triangulaire supérieure.

Puisque (B) est orthonormée pour le produit scalaire, le coefficient de rang (i, j) de $U^T U$ vaut $\langle E_i | E_j \rangle = E_i^T A E_j = a_{ij}$. On a donc bien $U^T U = A$.

Pour s'assurer de l'unicité dans la méthode de Gram-Schmidt on impose les conditions $\langle B_k | E_k \rangle > 0$; ce sont les coefficients qui apparaissent sur la diagonale de la matrice U .

Exercice 8

Soit E un espace euclidien de dimension $n \geq 2$, muni d'une base orthonormée $(e) = (e_1, \dots, e_n)$. Soit (x_1, \dots, x_n) une famille de vecteurs de E . On note $G = A^T A$ avec $A = (a_{ij})$ où a_{ij} est la i^{e} coordonnée de x_j dans la base (e) .

a. Exprimer G à l'aide du produit scalaire de E .

b. Montrer que G est diagonalisable à valeurs propres positives. trouver une condition nécessaire et suffisante pour que ses valeurs propres soient strictement positives.

c. Montrer qu'il existe $(y_1, \dots, y_n) \in E^n$ tel que pour tout $i, \|y_i\| = 1$ et $i \neq j \implies \|y_i - y_j\| = 1$.

a. $a_{ij} = \langle e_i | x_j \rangle$. Le coefficient d'indice (i, j) de G est égal à : $\sum_{k=1}^n a_{ki} a_{kj} = \sum_{k=1}^n \langle e_k | x_i \rangle \langle e_k | x_j \rangle = \langle x_i | x_j \rangle$. G est la matrice de Gram des vecteurs (x_1, \dots, x_n) .

b. G est symétrique réelle donc diagonalisable. Soit $\lambda \in \text{Sp}(G)$ et $X \neq 0$ tel que $GX = \lambda X$. On a $A^T A X = \lambda X$ donc $X^T A^T A X = \lambda X^T X$, soit $\|AX\|^2 = \lambda \|X\|^2$. Puisque $X \neq 0$ on a $\lambda \geq 0$.

Si A est inversible (autrement dit si (x_1, \dots, x_n) est libre) on peut même en déduire que $\lambda > 0$.

Réciproquement, supposons toutes les valeurs propres de G strictement positives. Alors G est inversible. Mais $\det G = (\det A)^2$ donc A est inversible.

c. $\|y_i - y_j\|^2 = \|y_i\|^2 - 2\langle y_i | y_j \rangle + \|y_j\|^2$ donc la condition $\|y_i - y_j\| = 1$ est équivalente à $\langle y_i | y_j \rangle = 1/2$.

On note $A = \text{Mat}_{(e)}(y_1, \dots, y_n)$ et $G = A^T A$. On cherche A tel que

$$G = \begin{pmatrix} 1 & 1/2 & \dots & 1/2 \\ 1/2 & \ddots & \ddots & \vdots \\ \vdots & \ddots & \ddots & 1/2 \\ 1/2 & \dots & 1/2 & 1 \end{pmatrix} = \frac{1}{2}(I + U) \quad \text{avec } U = \begin{pmatrix} 1 & \dots & 1 \\ \vdots & & \vdots \\ 1 & \dots & 1 \end{pmatrix}.$$

U est symétrique réelle donc diagonalisable; elle est de rang 1 et sa trace vaut n donc il existe P orthogonale telle que

$$U = P \begin{pmatrix} n & & & \\ & 0 & & \\ & & \ddots & \\ & & & 0 \end{pmatrix} P^T \quad \text{et } G = P \begin{pmatrix} (n+1)/2 & & & \\ & 1/2 & & \\ & & \ddots & \\ & & & 1/2 \end{pmatrix} P^T.$$

par exemple choisir $A = P \begin{pmatrix} \sqrt{(n+1)/2} & & & \\ & 1/\sqrt{2} & & \\ & & \ddots & \\ & & & 1/\sqrt{2} \end{pmatrix} P^T.$

Exercice 9

Soit u un endomorphisme d'un espace euclidien tel que pour tout $x \in E$, $\langle u(x) | x \rangle = 0$.

- Montrer que pour tout $(x, y) \in E^2$, $\langle u(x) | y \rangle = -\langle x | u(y) \rangle$. On dit que u est un endomorphisme *antisymétrique*.
- Montrer qu'un endomorphisme u de E est antisymétrique si et seulement si sa matrice dans une base orthonormée est antisymétrique.
- Soit $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ une matrice antisymétrique. Montrer que ses valeurs propres sont des imaginaires purs.
- Montrer que si u est antisymétrique et H un sous-espace vectoriel stable par u , alors H^\perp est aussi stable par u .
- En déduire que si u est un endomorphisme antisymétrique, il existe une base orthonormée (e) telle que $\text{Mat}_{(e)}(u)$ est diagonale par blocs, avec sur la diagonale des zéros ou des blocs de la forme $\begin{pmatrix} 0 & a \\ -a & 0 \end{pmatrix}$.

a. On applique l'hypothèse à $x + y$ puis on développe :

$$\langle u(x+y) | x+y \rangle = 0 \iff \langle u(x) | x \rangle + \langle u(x) | y \rangle + \langle u(y) | x \rangle + \langle u(y) | y \rangle = 0 \iff \langle u(x) | y \rangle = -\langle x | u(y) \rangle$$

Notons que réciproquement, tout endomorphisme vérifiant cette dernière égalité vérifie *a fortiori* $\langle u(x) | x \rangle = 0$; il suffit en effet de poser $y = x$ pour obtenir cette égalité.

b. Dans une base orthonormée (e) on pose $A = \text{Mat}_{(e)}(u)$. Alors u est antisymétrique si et seulement si pour tout $X, Y \in \mathbb{R}^n$, $X^T A^T Y = -X^T A Y$, soit $X^T (A^T + A) Y = 0$.

Pour tout $Y \in \mathbb{R}^n$, le vecteur $(A + A^T)Y$ est orthogonal à tout vecteur de \mathbb{R}^n donc est nul. Ceci étant vrai pour tout $Y \in \mathbb{R}^n$ on en déduit $A + A^T = 0$: A est antisymétrique. La réciproque est immédiate.

c. Soit $\lambda \in \mathbb{C}$ une valeur propre de A , et $Z \in \mathbb{C}^n$, $Z \neq 0$ tel que $AZ = \lambda Z$. Alors $A\bar{Z} = \bar{\lambda}\bar{Z}$, et $\bar{Z}^T A^T = \bar{\lambda}\bar{Z}^T$, soit $\bar{Z}^T A = -\bar{\lambda}\bar{Z}^T$. On en déduit que $\bar{Z}^T AZ = \lambda\bar{Z}^T Z$ et $Z^T AZ = -\bar{\lambda}\bar{Z}^T Z$ donc $(\lambda + \bar{\lambda})\bar{Z}^T Z = 0$.

Mais $\bar{Z}^T Z = \sum_{i=1}^n |z_i|^2 > 0$, donc $\lambda + \bar{\lambda} = 0$, soit $\lambda \in i\mathbb{R}$.

d. Soit $x \in H^\perp$. Pour tout $y \in H$, $\langle u(x) | y \rangle = -\langle x | u(y) \rangle = 0$ car $x \in H^\perp$ et $u(y) \in H$, donc $u(x) \in H^\perp$, et H^\perp est bien stable par u .

e. Considérons un endomorphisme antisymétrique $u \in \mathcal{L}(E)$, et A sa matrice dans une base orthonormée (e) ; A est donc antisymétrique. Raisonnons maintenant par récurrence sur n .

– si $n = 1$, la seule matrice antisymétrique est la matrice nulle.

– Si $n > 1$, on suppose le résultat acquis jusqu'au rang $n - 1$.

Si u est l'endomorphisme nul, le résultat est évident.

Dans le cas contraire A possède au moins une valeur propre complexe non nulle $\lambda = ia$ avec $a \in \mathbb{R}^*$. Soit $Z \in \mathbb{C}^n$, $Z \neq 0$, tel que $AZ = iaZ$. On pose $Z = X + iY$ avec $X, Y \in \mathbb{R}^n$. En identifiant parties réelle et imaginaire dans l'égalité $A(X + iY) = ia(X + iY)$ on obtient $AX = -aY$ et $AY = aX$.

Notons x et y les vecteurs de E définis par $\text{Mat}_{(e)}(x) = X$ et $\text{Mat}_{(e)}(y) = Y$; on a $u(x) = -ay$ et $u(y) = ax$. Montrons maintenant que x et y sont orthogonaux : $a\langle x | y \rangle = \langle ax | y \rangle = \langle u(y) | y \rangle = 0$ et puisque $a \neq 0$, $\langle x | y \rangle = 0$.

Notons par ailleurs que ces deux vecteurs sont non nuls (si l'un est nul, l'autre aussi et alors $Z = 0$) donc $e'_1 = \frac{x}{\|x\|}$

et $e'_2 = \frac{y}{\|y\|}$ constituent une famille orthonormée qui engendre un plan H stable par u et pour laquelle la matrice

associée à l'induit de u sur H est $\begin{pmatrix} 0 & a \\ -a & 0 \end{pmatrix}$.

On applique alors l'hypothèse de récurrence à H^\perp pour conclure.