

Devoir Sur Table N°15

Déterminants Systèmes Linéaires

Problème 1

Systèmes à diagonale strictement dominante

On note $A = (a_{ij})$ une matrice de $\mathcal{M}_n(\mathbb{K})$, et $B = (b_1, b_2, \dots, b_n)$ un élément de \mathbb{K}^n .

On identifiera les éléments de \mathbb{K}^n et les matrices colonnes correspondantes.

Pour tout $Y = (y_1, y_2, \dots, y_n)$ de \mathbb{K}^n , on note $\|Y\| = \max\{|y_j|, j = 1, \dots, n\}$.

On considère le système (1) : $AX = B$ d'inconnue $X = (x_1, x_2, \dots, x_n)$ dans \mathbb{K}^n .

On suppose que : $\forall i = 1, \dots, n, |a_{ii}| > \sum_{j \neq i} |a_{ij}|$.

On exprime cette propriété en disant que A est à *diagonale strictement dominante*.

1. Montrer que A est inversible.

Indication : raisonner par l'absurde et considérer un vecteur X de \mathbb{K}^n , non nul, tel que $AX = 0$; utiliser la coordonnée de X qui est de module maximum. [S]

2. On note $\tilde{X} = (\tilde{x}_1, \dots, \tilde{x}_n)$ l'unique solution du système (1).

En divisant la i -ième équation de (1) par a_{ii} et en la résolvant par rapport à x_i , on transforme (1) en un système équivalent (2) : $X = A^*X + B^*$.

Préciser les coefficients a_{ij}^* de A^* , et b_i^* de B^* . [S]

3. Montrer qu'il existe λ dans $[0, 1[$ tel que : $\forall i = 1, \dots, n, \sum_{j=1}^n |a_{ij}^*| \leq \lambda$. [S]

4. Soit $X^{(0)} \in \mathbb{K}^n$. On définit une suite de \mathbb{K}^n en posant : $\forall k, X^{(k+1)} = A^*X^{(k)} + B^*$.

Pour tout entier k , on pourra noter $X^{(k)} = (x_1^{(k)}, x_2^{(k)}, \dots, x_n^{(k)})$.

Montrer que : $\forall k \in \mathbb{N}^*, \|\tilde{X} - X^{(k)}\| \leq \lambda^k \|\tilde{X} - X^{(0)}\|$.

En déduire que $\lim_{k \rightarrow \infty} X^{(k)} = \tilde{X}$. [S]

5. Application numérique

$$(a) \text{ Résoudre le système (1) : } \begin{cases} 400x + 24y - 8z = 30 \\ 9x + 300y - 15z = 60 \\ 4x - 8y + 400z = 50 \end{cases}$$

On en donnera la solution exacte, et la solution approchée à 10^{-10} près. [S]

- (b) Vérifier les hypothèses des questions précédentes.

Écrire la forme $X = A^*X + B^*$ du système. Que vaut λ ? [S]

- (c) On part de $X^{(0)} = (0, 0, 0)$. Préciser $X^{(1)}$, $X^{(2)}$, $X^{(3)}$, et $X^{(4)}$.

En considérant uniquement $X^{(1)}$, montrer que $\|\tilde{X}\| \leq \frac{5}{23}$.

A partir de quel entier k est-on certain que $\|\tilde{X} - X^{(k)}\| \leq 10^{-16}$? [S]

Problème 2

Inversion d'une matrice

L'objectif de ce problème est l'obtention d'une méthode permettant d'inverser certaines matrices symétriques réelles.

Préliminaire

Soit $D \in M_n(\mathbb{R})$ une matrice diagonale à coefficients diagonaux deux à deux distincts.

Montrer que si une matrice $M \in M_n(\mathbb{R})$ commute avec D alors M est diagonale.

Partie I

Soit $A \in M_n(\mathbb{R})$ une matrice symétrique réelle inversible.

On suppose qu'il existe une matrice $P \in M_n(\mathbb{R})$ et une matrice diagonale $D \in M_n(\mathbb{R})$ à coefficients diagonaux distincts telles que $AP = PD$.

1. Etablir ${}^tPA = D{}^tP$.
2. En exploitant le préliminaire, établir que tPP est une matrice diagonale que l'on notera Δ .
3. On note $p_{i,j}$ le coefficient d'indice (i,j) de P et δ_k le $k^{\text{ème}}$ coefficient diagonal de Δ .
 - 3.a Exprimer δ_k à l'aide d'un symbole sommatoire et des $p_{i,j}$.
 - 3.b On suppose désormais qu'aucune colonne de P n'est nulle. Justifier que Δ , P et D sont inversibles.
- 4.a Exprimer l'inverse de A en fonction de $P, {}^tP, \Delta^{-1}$ et D^{-1} .
- 4.b On note λ_k le $k^{\text{ème}}$ coefficient diagonal de la matrice D .
On note $a_{i,j}$ et $b_{i,j}$ les coefficients d'indice (i,j) des matrices A et A^{-1} .

$$\text{Etablir } b_{i,j} = \sum_{k=1}^n \frac{p_{i,k} p_{j,k}}{\lambda_k \delta_k}.$$

Partie II

On considère ici la matrice symétrique : $A = \begin{pmatrix} 2 & -1 & 0 & \dots & \dots & 0 \\ -1 & 2 & -1 & 0 & & \vdots \\ 0 & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \vdots \\ \vdots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & 0 \\ \vdots & & & 0 & -1 & 2 & -1 \\ 0 & \dots & \dots & 0 & -1 & 2 \end{pmatrix}$.

1. On pose $D_n = \det A$.
 - 1.a Former une relation de récurrence engageant D_n, D_{n-1} et D_{n-2} .
 - 1.b Donner l'expression de D_n pour tout $n \in \mathbb{N}^*$.
 - 1.c La matrice A est-elle inversible ?
2. Soit k un entier tel que $1 \leq k \leq n$.
 - 2.a Justifier, pour tout $1 \leq i \leq n$, la relation :

$$\sin\left(\frac{(i-1)k\pi}{n+1}\right) + \sin\left(\frac{(i+1)k\pi}{n+1}\right) = 2\cos\left(\frac{k\pi}{n+1}\right) \sin\left(\frac{ik\pi}{n+1}\right).$$

2.b On note : $X_k = \left(\sin\left(\frac{ik\pi}{n+1}\right) \right)_{1 \leq i \leq n} = \begin{pmatrix} \sin\left(\frac{k\pi}{n+1}\right) \\ \sin\left(\frac{2k\pi}{n+1}\right) \\ \vdots \\ \sin\left(\frac{nk\pi}{n+1}\right) \end{pmatrix} \in M_{n,1}(\mathbb{R}) .$

Observer qu'il existe un réel λ_k tel que $AX_k = \lambda_k X_k$ et exprimer ce dernier.

2.c On note P la matrice de $M_n(\mathbb{R})$ dont les colonnes sont X_1, X_2, \dots, X_n .

Observer qu'il existe une matrice diagonale D telle que

a) $AP = PD$

b) les coefficients diagonaux de D sont deux à deux distincts.

3. On peut désormais reprendre les notations de la partie I

3.a Expliciter $p_{i,j}$.

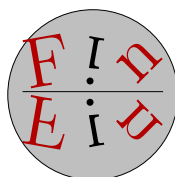
3.b Ici x désigne un réel de l'intervalle $]0, \pi[$.

Justifier la relation : $\sum_{p=1}^n \cos 2px = \frac{\sin nx}{\sin x} \cos(n+1)x .$

En déduire une expression en fonction de n et x de la somme : $S_n(x) = \sum_{p=1}^n \sin^2 px .$

3.c Observer que la valeur de δ_k ne dépend pas de k et donner celle-ci.

4. En déduire le coefficient de la ligne i et de la colonne j de l'inverse de A .



Corrigé Problème 1

1. Par l'absurde, on suppose qu'il existe $X \neq \vec{0}$ dans \mathbb{K}^n , tel que $AX = 0$.

Soit $i \in \{1, \dots, n\}$ tel que $|x_i| = \|X\| > 0$.

L'égalité $AX = \vec{0}$ implique en particulier $\sum_j a_{ij}x_j = 0$ donc $a_{ii}x_i = -\sum_{j \neq i}^n a_{ij}x_j$.

Mais $\left| \sum_{j \neq i}^n a_{ij}x_j \right| \leq \sum_{j \neq i}^n |a_{ij}| |x_j| \leq |x_i| \sum_{j \neq i}^n |a_{ij}| < |x_i| |a_{ii}|$: c'est contradictoire.

Ainsi pour tout X de \mathbb{K}^n , on a $AX = \vec{0} \Rightarrow X = \vec{0}$. Cela signifie que l'endomorphisme de \mathbb{K}^n canoniquement associé à A est injectif donc bijectif. Ainsi A est inversible. [Q]

2. Pour tout i de $\{1, \dots, n\}$, la i -ième équation de (1) s'écrit : $a_{ii}x_i + \sum_{j \neq i} a_{ij}x_j = b_i$.

Elle s'écrit donc $x_i = \sum_{j=1}^n a_{ij}^*x_j + b_i^*$, avec $a_{ij} = \begin{cases} 0 & \text{si } j = i \\ -a_{ij}/a_{ii} & \text{si } j \neq i \end{cases}$ et $b_i^* = \frac{b_i}{a_{ii}}$.

On a ainsi obtenu $A^* = (a_{ij}^*)$ et $B^* = (b_i^*)$ tels que $AX = B \Leftrightarrow X = A^*X + B^*$. [Q]

3. Pour tout i de $\{1, \dots, n\}$, posons $\lambda_i = \sum_{j=1}^n |a_{ij}^*|$. On a $\lambda_i = \frac{1}{|a_{ii}|} \sum_{j \neq i} |a_{ij}| < 1$.

Il suffit alors de choisir $\lambda = \max_{1 \leq i \leq n} \lambda_i$ pour conclure. [Q]

4. Pour tout $k \geq 1$, on a $X^{(k)} = A^*X^{(k-1)} + B^*$. D'autre part $\tilde{X} = A^*\tilde{X} + B^*$.

Par soustraction, on obtient $\tilde{X} - X^{(k)} = A^*(\tilde{X} - X^{(k-1)})$ pour tout k de \mathbb{N}^* .

Pour $1 \leq i \leq n$, la i -ième ligne de cette égalité s'écrit $\tilde{x}_i - x_i^{(k)} = \sum_{j=1}^n a_{ij}^*(\tilde{x}_j - x_j^{(k-1)})$.

Ainsi $|\tilde{x}_i - x_i^{(k)}| \leq \sum_{j=1}^n |a_{ij}^*| |\tilde{x}_j - x_j^{(k-1)}| \leq \sum_{j=1}^n |a_{ij}^*| \|\tilde{X} - X^{(k-1)}\| \leq \lambda \|\tilde{X} - X^{(k-1)}\|$.

Il en découle $\|\tilde{X} - X^{(k)}\| = \max_{1 \leq i \leq n} |\tilde{x}_i - x_i^{(k)}| \leq \lambda \|\tilde{X} - X^{(k-1)}\|$.

Une récurrence évidente donne alors : $\forall k \in \mathbb{N}^*$, $\|\tilde{X} - X^{(k)}\| \leq \lambda^k \|\tilde{X} - X^{(0)}\|$.

Ainsi, pour tout i de $\{1, \dots, n\}$ et tout k de \mathbb{N}^* , on a $|\tilde{x}_i - x_i^{(k)}| \leq \lambda^k \|\tilde{X} - X^{(0)}\|$.

On sait que $0 \leq \lambda < 1$. Il en résulte $\lim_{k \rightarrow \infty} x_i^{(k)} = \tilde{x}_i$, pour tout i de $\{1, \dots, n\}$.

Autrement dit, la suite des vecteurs $X^{(k)}$ converge vers \tilde{X} quand k tend vers $+\infty$.

Remarque : ce résultat est indépendant du choix du vecteur initial $X^{(0)}$. [Q]

5. Application numérique

(a) On applique la méthode du pivot :

$$\left(\begin{array}{ccc|c} 400 & 24 & -8 & 30 \\ 9 & 300 & -15 & 60 \\ 4 & -8 & 400 & 50 \end{array} \right) \begin{array}{l} L_1 \leftarrow L_1/8 \\ L_2 \leftarrow L_2/3 \\ L_3 \leftarrow L_3/4 \end{array} \left(\begin{array}{ccc|c} 50 & 3 & -1 & 15/4 \\ 3 & 100 & -5 & 20 \\ 1 & -2 & 100 & 25/2 \end{array} \right) L_1 \leftrightarrow L_3$$

$$\left(\begin{array}{ccc|c} 1 & -2 & 100 & 25/2 \\ 3 & 100 & -5 & 20 \\ 50 & 3 & -1 & 15/4 \end{array} \right) \begin{array}{l} L_2 \leftarrow L_2 - 3L_1 \\ L_3 \leftarrow L_3 - 50L_1 \end{array} \left(\begin{array}{ccc|c} 1 & -2 & 100 & 25/2 \\ 0 & 106 & -305 & -35/2 \\ 0 & 103 & -5001 & -2485/4 \end{array} \right)$$

$$\begin{array}{l} L_2 \leftarrow \\ L_2 - L_3 \end{array} \begin{pmatrix} 1 & -2 & 100 & | & 25/2 \\ 0 & 3 & 4696 & | & 2415/4 \\ 0 & 103 & -5001 & | & -2485/4 \end{pmatrix} \quad \begin{array}{l} L_3 \leftarrow \\ 3L_3 - 103L_2 \end{array} \begin{pmatrix} 1 & -2 & 100 & | & 25/2 \\ 0 & 3 & 4696 & | & 2415/4 \\ 0 & 0 & -498691 & | & -64050 \end{pmatrix}$$

Le système initial est donc équivalent à
$$\begin{cases} x - 2y + 100z = 25/2 \\ 3y + 4696z = 2415/4 \\ -498691z = -64050 \end{cases}$$

On trouve d'abord $z = \frac{64050}{498691} \approx 0.1284362461$;

Ensuite $y = \frac{1}{3} \left(\frac{2415}{4} - 4696 \frac{64050}{498691} \right) = \frac{1223565}{5984292} \approx 0.2044627836$;

Enfin $x = \frac{25}{2} + \frac{1223565}{2992146} - \frac{6405000}{498691} = \frac{32565}{498691} \approx 0.0653009579$;

La solution est $(0.0653009579 ; 0.2044627836 ; 0.1284362461)$ à 10^{-10} près. [Q]

(b) Le système à résoudre est de façon évidente à diagonale strictement dominante.

On a l'équivalence
$$\begin{cases} 400x + 24y - 8z = 30 \\ 9x + 300y - 15z = 60 \\ 4x - 8y + 400z = 50 \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} x = \frac{3}{40} - \frac{3}{50}y + \frac{1}{50}z \\ y = \frac{1}{5} - \frac{3}{100}x + \frac{1}{20}z \\ z = \frac{1}{8} - \frac{1}{100}x + \frac{1}{50}y \end{cases}$$

On a ainsi obtenu la forme $X = A^*X + B^*$ du système.

Avec les notations de (I.3) on a :

$$\lambda_1 = \frac{3}{50} + \frac{1}{50} = \frac{2}{25}, \quad \lambda_2 = \frac{3}{100} + \frac{1}{20} = \frac{2}{25} \quad \text{et} \quad \lambda_3 = \frac{1}{100} + \frac{1}{50} = \frac{3}{100}.$$

On en déduit $\lambda = \max\{\lambda_1, \lambda_2, \lambda_3\} = \frac{2}{25}$. [Q]

(c) Pour tout $k \geq 1$, on a
$$X^{(k)} = \begin{pmatrix} x^{(k)} \\ y^{(k)} \\ z^{(k)} \end{pmatrix} = \frac{1}{100} \begin{pmatrix} 0 & -6 & 2 \\ -3 & 0 & 5 \\ -1 & 2 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x^{(k-1)} \\ y^{(k-1)} \\ z^{(k-1)} \end{pmatrix} + \frac{1}{40} \begin{pmatrix} 3 \\ 8 \\ 5 \end{pmatrix}$$

On trouve tout d'abord $X^{(1)} = \left(\frac{3}{40} \quad \frac{1}{5} \quad \frac{1}{8} \right) = (0.075 \quad 0.2 \quad 0.125)$.

Ensuite $X^{(2)} = \left(\frac{131}{2000} \quad \frac{5}{250} \quad \frac{513}{4000} \right) = (0.0655 \quad 0.204 \quad 0.12825)$.

Ensuite $X^{(3)} = \left(\frac{2613}{40000} \quad \frac{81779}{400000} \quad \frac{5137}{40000} \right) = (0.065325 \quad 0.2044475 \quad 0.128425)$.

Enfin $X^{(4)} = \left(\frac{1306033}{20000000} \quad \frac{408923}{2000000} \quad \frac{1284357}{10000000} \right) = (0.06530165 \quad 0.2044615 \quad 0.1284357)$.

Pour $k \geq 1$, on a $\|\tilde{X} - X^{(k)}\| \leq \left(\frac{2}{25}\right)^k \|\tilde{X}\|$ et notamment $\|\tilde{X} - X^{(1)}\| \leq \frac{2}{25} \|\tilde{X}\|$.

On en déduit $\|\tilde{X}\| - \|X^{(1)}\| \leq \frac{2}{25} \|\tilde{X}\|$, donc $\|\tilde{X}\| \leq \frac{25}{23} \|X^{(1)}\| = \frac{5}{23}$.

Ainsi, pour tout $k \geq 1$, on peut écrire : $\|\tilde{X} - X^{(k)}\| \leq \varepsilon_k$, avec $\varepsilon_k = \frac{5}{23} \left(\frac{2}{25}\right)^k$.

On constate que $\varepsilon_{13} \approx 1.2 \text{ E-15}$ et que $\varepsilon_{14} \approx 0.96 \text{ E-16}$.

Ainsi on est sûr que $\|\tilde{X} - X^{(k)}\| < 10^{-16}$ à partir de $k = 14$. [Q]

Correction

d'après INA 1998

Préliminaire :

$D = \text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$ avec $\forall 1 \leq i, j \leq n, \lambda_i = \lambda_j \Rightarrow i = j$. $M = (m_{i,j})$.

On a $MD = (\lambda_j m_{i,j})$ et $DM = (\lambda_i m_{i,j})$.

Si $MD = DM$ alors $\forall 1 \leq i, j \leq n, \lambda_j m_{i,j} = \lambda_i m_{i,j}$ d'où $\forall 1 \leq i \neq j \leq n, m_{i,j} = 0$ et ainsi M apparaît comme étant diagonale.

Partie I

1. ${}^t(AP) = {}^t(DP)$ donne ${}^tP^tA = {}^tD^tP$ puis ${}^tPA = D^tP$ car A et D sont des matrices symétriques.

2. ${}^tPPD = {}^tPAP = D^tPP$ donc tPP commute avec D et par suite tPP est diagonale.

3.a $P = (p_{i,j}), {}^tP = (p'_{j,i})$ avec $p'_{j,i} = p_{i,j}$.

Par produit matriciel : $\delta_k = \sum_{i=1}^n p'_{k,i} p_{i,k} = \sum_{i=1}^n p_{i,k}^2$.

3.b Si aucune colonne de P n'est nulle alors $\forall 1 \leq k \leq n, \delta_k \neq 0$.

Par suite Δ est inversible.

Comme ${}^tPP = \Delta$ on a $(\det P)^2 = \det \Delta \neq 0$ et donc P inversible.

Comme $D = P^{-1}AP$ avec A inversible, on a aussi D inversible.

4.a Comme ${}^tPP = \Delta$ on a $P^{-1} = \Delta^{-t}P$. De plus $A = PDP^{-1}$ donc $A^{-1} = PD^{-1}P^{-1} = PD^{-1}\Delta^{-t}P$.

4.b $D^{-1} = \text{diag}(1/\lambda_1, \dots, 1/\lambda_n)$, $\Delta^{-1} = \text{diag}(1/\delta_1, \dots, 1/\delta_n)$ donc $D^{-1}\Delta^{-1} = \text{diag}(1/\lambda_1\delta_1, \dots, 1/\lambda_n\delta_n)$.

$PD^{-1}\Delta^{-1} = (q_{i,j})$ avec $q_{i,j} = \frac{p_{i,j}}{\lambda_j\delta_j}$ et

$A^{-1} = PD^{-1}\Delta^{-t}P = (b_{i,j})$ avec $b_{i,j} = \sum_{k=1}^n q_{i,k} p'_{k,j} = \sum_{k=1}^n \frac{p_{i,k} p'_{j,k}}{\lambda_k \delta_k}$.

Partie II

1.a En développant selon la première colonne :

$$D_n = 2D_{n-1} + \begin{vmatrix} -1 & 0 & \cdots & \cdots & 0 \\ -1 & 2 & -1 & & 0 \\ & \ddots & \ddots & \ddots & \\ & & \ddots & \ddots & -1 \\ 0 & & & -1 & 2 \end{vmatrix}_{[n-1]}$$

puis en développant selon la première ligne :

$$D_n = 2D_{n-1} - D_{n-2}.$$

1.b (D_n) est une suite récurrente linéaire d'ordre 2

Sachant $D_1 = 2$ et $D_2 = 3$ on obtient $D_n = n + 1$.

1.c oui

2.a développer les sinus.

2.b Posons $Y_k = AX_k = \begin{pmatrix} y_1 \\ \vdots \\ y_n \end{pmatrix}$.

Pour tout $2 \leq i \leq n-1$: $y_i = -\sin \frac{(i-1)k\pi}{n+1} + 2\sin \frac{ik\pi}{n+1} - \sin \frac{(i+1)k\pi}{n+1}$

et de plus cette formule vaut aussi pour $i=1$ et $i=n$.

Pour tout $1 \leq i \leq n$: $y_i = (2 - 2\cos \frac{k\pi}{n+1})\sin \frac{ik\pi}{n+1}$

donc $Y_k = AX_k = \lambda_k X_k$ avec $\lambda_k = 2 - 2\cos \frac{k\pi}{n+1}$.

2.c AP est la matrice de colonnes $\lambda_1 X_1, \dots, \lambda_n X_n$.

Pour $D = \text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$, PD a pour colonnes $\lambda_1 X_1, \dots, \lambda_n X_n$.

Donc $AP = DP$.

De plus les coefficients diagonaux de D sont deux à deux distincts puisque la fonction cosinus est injective sur $[0, \pi]$.

3.a $p_{i,j} = \sin \frac{ij\pi}{n+1}$.

3.b $\sum_{p=1}^n \cos 2px = \text{Re} \left(\sum_{p=1}^n e^{2ipx} \right) = \text{Re} \left(e^{2ix} \frac{1 - e^{2inx}}{1 - e^{2ix}} \right) = \text{Re} \left(e^{i(n+1)x} \frac{\sin nx}{\sin x} \right) = \frac{\sin nx}{\sin x} \cos(n+1)x$.

$S_n(x) = \sum_{p=1}^n \sin^2 px = \frac{1}{2} \sum_{p=1}^n (1 - \cos 2px) = \frac{n}{2} - \frac{\sin nx}{2\sin x} \cos(n+1)x$.

3.c $\delta_k = \sum_{i=1}^n p_{i,k}^2 = \sum_{i=1}^n \sin^2 \frac{ik\pi}{n+1} = \frac{n}{2} - (-1)^k \frac{\sin \frac{nk\pi}{n+1}}{2 \sin \frac{k\pi}{n+1}} = \frac{n+1}{2}$

car $\sin \frac{nk\pi}{n+1} = \sin \left(k\pi - \frac{k\pi}{n+1} \right) = (-1)^{k-1} \sin \frac{k\pi}{n+1}$.

4. Le coefficient voulu est $\sum_{k=1}^n \frac{\sin \frac{ik\pi}{n+1} \sin \frac{jk\pi}{n+1}}{(2 - 2\cos \frac{k\pi}{n+1}) \frac{n+1}{2}} = \sum_{k=1}^n \frac{\sin \frac{ik\pi}{n+1} \sin \frac{jk\pi}{n+1}}{2(n+1) \sin^2 \frac{k\pi}{n+1}}$.