

Soient  $\mathbb{A}$  et  $\mathbb{A} + \Delta\mathbb{A}$  deux matrices inversibles. Soient  $\mathbf{x}$  et  $\mathbf{x} + \Delta\mathbf{x}$  les solutions respectives de

$$\mathbb{A}\mathbf{x} = \mathbf{b} \text{ et } (\mathbb{A} + \Delta\mathbb{A})(\mathbf{x} + \Delta\mathbf{x}) = \mathbf{b}.$$

Supposons  $\mathbf{b} \neq \mathbf{0}$ , alors on a

$$\frac{\|\Delta\mathbf{x}\|}{\|\mathbf{x} + \Delta\mathbf{x}\|} \leq \text{cond}(\mathbb{A}) \frac{\|\Delta\mathbb{A}\|}{\|\mathbb{A}\|}.$$

*Proof.* On a

$$\mathbb{A}\mathbf{x} = \mathbf{b} = (\mathbb{A} + \Delta\mathbb{A})(\mathbf{x} + \Delta\mathbf{x}) = \mathbb{A}\mathbf{x} + \mathbb{A}\Delta\mathbf{x} + \Delta\mathbb{A}(\mathbf{x} + \Delta\mathbf{x})$$

et donc

$$\mathbb{A}\Delta\mathbf{x} + \Delta\mathbb{A}(\mathbf{x} + \Delta\mathbf{x}) = \mathbf{0} \iff \Delta\mathbf{x} = -\mathbb{A}^{-1}\Delta\mathbb{A}(\mathbf{x} + \Delta\mathbf{x})$$

On en déduit alors

$$\|\Delta\mathbf{x}\| = \|\mathbb{A}^{-1}\Delta\mathbb{A}(\mathbf{x} + \Delta\mathbf{x})\| \leq \|\mathbb{A}^{-1}\| \|\Delta\mathbb{A}(\mathbf{x} + \Delta\mathbf{x})\| \leq \|\mathbb{A}^{-1}\| \|\Delta\mathbb{A}\| \|\mathbf{x} + \Delta\mathbf{x}\|$$

De plus, on a  $\text{cond}(\mathbb{A}) \stackrel{\text{def}}{=} \|\mathbb{A}\| \|\mathbb{A}^{-1}\|$  et donc  $\|\mathbb{A}^{-1}\| = \frac{\text{cond}(\mathbb{A})}{\|\mathbb{A}\|}$  ce qui donne

$$\|\Delta\mathbf{x}\| \leq \text{cond}(\mathbb{A}) \frac{\|\Delta\mathbb{A}\|}{\|\mathbb{A}\|} \|\mathbf{x} + \Delta\mathbf{x}\|.$$

2

Comme  $\mathbf{b} \neq 0$ , on a  $\mathbf{x} + \Delta \mathbf{x} = (\mathbb{A} + \Delta \mathbb{A})^{-1} \mathbf{b} \neq 0$  et de l'inégalité précédente, on déduit alors

$$\frac{\|\Delta \mathbf{x}\|}{\|\mathbf{x} + \Delta \mathbf{x}\|} \leq \text{cond}(\mathbb{A}) \frac{\|\Delta \mathbb{A}\|}{\|\mathbb{A}\|}.$$

□

