

Exercices associés au cours d'Analyse Numérique I Rappels d'Algèbre Linéaire

1 Matrices Blocs

EXERCICE 1

On considère les matrices blocs suivantes

$$\mathbb{A} = \left(\begin{array}{cc|cc} 1 & 2 & 1 & 0 \\ 3 & 4 & 0 & 1 \\ \hline 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \end{array} \right) = \left(\begin{array}{c|c} \mathbb{C} & \mathbb{I} \\ \hline \mathbb{I} & \mathbb{O} \end{array} \right) \quad \text{et} \quad \mathbb{B} = \left(\begin{array}{cc|cc} 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \\ \hline 1 & 2 & 1 & 2 \\ 3 & 4 & 3 & 4 \end{array} \right) = \left(\begin{array}{c|c} \mathbb{I} & \mathbb{O} \\ \hline \mathbb{C} & \mathbb{C} \end{array} \right)$$

avec par identification

$$\mathbb{I} = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}, \quad \mathbb{C} = \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 3 & 4 \end{pmatrix} \quad \text{et} \quad \mathbb{O} = \begin{pmatrix} 0 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$$

Q. 1 Calculer les matrices $\mathbb{A}\mathbb{B}$ et $\mathbb{B}\mathbb{A}$ en utilisant l'écriture bloc. □

Q. 2 Exprimer les matrices $\mathbb{A}(\mathbb{A} + \mathbb{B})$ et $(2\mathbb{B} - \mathbb{A})(\mathbb{B} + \mathbb{A})$ en fonction des matrices \mathbb{C} et \mathbb{I} . □

EXERCICE 2

Soient

$$\mathbb{A} = \left(\begin{array}{ccc|ccc} 1 & 0 & 0 & 3 & 3 & 3 \\ 1 & 0 & 0 & 3 & 3 & 3 \\ \hline 1 & 2 & 2 & 0 & 0 & 0 \end{array} \right) \quad \text{et} \quad \mathbb{B} = \begin{pmatrix} -1 & -1 \\ 0 & 0 \\ 0 & 0 \\ -1 & -2 \\ -1 & -2 \\ -1 & -2 \end{pmatrix}$$

Utiliser la multiplication par blocs pour calculer $\mathbb{A}\mathbb{B}$.

EXERCICE 3

Soient \mathbb{A} et \mathbb{B} deux matrices de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$, bloc-carrés de 2×2 blocs dont le bloc $(1, 1)$ est dans $\mathcal{M}_1(\mathbb{R})$.

Q. 1 a. Justifiez de la faisabilité du produit matriciel par blocs de $\mathbb{A}\mathbb{B}$.

b. Utiliser la multiplication par blocs pour calculer $\mathbb{A}\mathbb{B}$. □

Soient \mathbb{E} et \mathbb{F} deux matrices de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$, bloc-carrés de 2×2 blocs dont le bloc $(2, 2)$ est dans $\mathcal{M}_1(\mathbb{R})$.

Q. 2 a. Justifiez de la faisabilité du produit matriciel par blocs de $\mathbb{E}\mathbb{F}$.

b. Utiliser la multiplication par blocs pour calculer $\mathbb{E}\mathbb{F}$. □

Soient n un entier, $n \geq 2$, α_1, α_2 , deux réels, $\mathbf{u}_1, \mathbf{v}_1, \mathbf{u}_2, \mathbf{v}_2$, quatre vecteurs (colonne) de \mathbb{R}^n , et A_1, A_2 , deux matrices de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$. On note

$$\forall i \in \llbracket 1, 2 \rrbracket, \quad B_i = \left(\begin{array}{c|c} A_i & \mathbf{v}_i \\ \hline \mathbf{u}_i^t & \alpha_i \end{array} \right) \text{ et } C_i = \left(\begin{array}{c|c} \alpha_i & \mathbf{u}_i^t \\ \hline \mathbf{v}_i & A_i \end{array} \right)$$

Q. 3 a. Quel est l'ensemble des produits matriciels par blocs possible entre les matrices B_1, B_2, C_1 et C_2 .

b. En utilisant, si possible, la multiplication par blocs, calculer $B_1 B_2, B_1 C_1$ et $C_1 C_2$.

□

EXERCICE 4

Soient $E \in \mathcal{M}_m(\mathbb{K}), F \in \mathcal{M}_n(\mathbb{K})$ et I_n la matrice identité de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$.

Q. 1 Démontrer par récurrence sur n que

$$\det \left(\begin{array}{c|c} E & O_{m,n} \\ \hline O_{n,m} & I_n \end{array} \right) = \det \left(\begin{array}{c|c} I_n & O_{n,m} \\ \hline O_{m,n} & E \end{array} \right) = \det E.$$

□

Q. 2 a. Donner les dimensions des blocs pour que le produit suivant soit possible et effectuer le calcul:

$$A = \left(\begin{array}{c|c} E & O \\ \hline O & J_2 \end{array} \right) \left(\begin{array}{c|c} J_1 & O \\ \hline O & F \end{array} \right)$$

où J_1 et J_2 sont des matrices identités.

b. En déduire le déterminant de A en fonction des déterminants de E et F .

□

Soient $(A_i)_{i \in \mathbb{N}^*}$ une suite de matrices carrées (pouvant être de dimensions différentes). Soit B_n la matrice bloc-carrée diagonale décomposée en $n \times n$ blocs, $n \geq 2$, définie par

$$B_n = \left(\begin{array}{cccc} A_1 & 0 & \dots & 0 \\ & \ddots & \ddots & \vdots \\ 0 & & \ddots & 0 \\ \vdots & & & \ddots \\ 0 & \dots & 0 & A_n \end{array} \right)$$

Q. 3 Démontrer par récurrence sur n que

$$\det B_n = \prod_{i=1}^n \det A_i.$$

□

EXERCICE 5

Soient $E \in \mathcal{M}_m(\mathbb{K}), F \in \mathcal{M}_n(\mathbb{K})$ et I_n la matrice identité de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$.

Q. 1 a. Démontrer par récurrence sur n que

$$\det \left(\begin{array}{c|c} E & O \\ \hline \bullet & I_n \end{array} \right) = \det \left(\begin{array}{c|c} I_n & \bullet \\ \hline O & E \end{array} \right) = \det E.$$

où \bullet note des éléments quelconques

b. Que peut-on dire de

$$\det \left(\begin{array}{c|c} \mathbb{E} & \bullet \\ \hline \mathbb{O} & \mathbb{I}_n \end{array} \right) \text{ et } \det \left(\begin{array}{c|c} \mathbb{I}_n & \mathbb{O} \\ \hline \bullet & \mathbb{E} \end{array} \right)?$$

□

Q. 2 a. Donner les dimensions des blocs pour que le produit suivant soit possible et effectuer le calcul:

$$\mathbb{A} = \left(\begin{array}{c|c} \mathbb{E} & \mathbb{O} \\ \hline \mathbb{H} & \mathbb{J}_2 \end{array} \right) \left(\begin{array}{c|c} \mathbb{J}_1 & \mathbb{O} \\ \hline \mathbb{O} & \mathbb{F} \end{array} \right)$$

où \mathbb{J}_1 et \mathbb{J}_2 sont des matrices identités et \mathbb{H} une matrice.

b. En déduire le déterminant de \mathbb{A} en fonction des déterminants de \mathbb{E} et \mathbb{F} .

□

Soit \mathbb{B}_n la matrice bloc-carrée triangulaire inférieure décomposée en $n \times n$ blocs, $n \geq 2$, définie par

$$\mathbb{B}_n = \begin{pmatrix} \mathbb{B}_{1,1} & \mathbb{O} & \dots & \mathbb{O} \\ \vdots & \ddots & \ddots & \vdots \\ \mathbb{B}_{n,1} & \dots & \dots & \mathbb{B}_{n,n} \end{pmatrix}$$

Q. 3 Démontrer par récurrence sur n que

$$\det \mathbb{B}_n = \prod_{i=1}^n \det \mathbb{B}_{i,i}.$$

□

2 Matrices

EXERCICE 6

Soit $\mathbb{A} \in \mathcal{M}_{n,n}(\mathbb{C})$ une matrice et (λ, \mathbf{u}) un élément propre de \mathbb{A} avec $\|\mathbf{u}\|_2 = 1$.

Q. 1 En s'aidant de la base canonique $\{\mathbf{e}_1, \dots, \mathbf{e}_n\}$, construire une base orthonormée $\{\mathbf{x}_1, \dots, \mathbf{x}_n\}$ telle que $\mathbf{x}_1 = \mathbf{u}$.

□

Notons \mathbb{P} la matrice de changement de base canonique $\{\mathbf{e}_1, \dots, \mathbf{e}_n\}$ dans la base $\{\mathbf{x}_1, \dots, \mathbf{x}_n\}$:

$$\mathbb{P} = \begin{pmatrix} | & & | \\ \mathbf{x}_1 & \dots & \mathbf{x}_n \\ | & & | \end{pmatrix}$$

Soit \mathbb{B} la matrice définie par $\mathbb{B} = \mathbb{P}^* \mathbb{A} \mathbb{P}$.

Q. 2 a. Exprimer les coefficients de la matrice \mathbb{B} en fonction de la matrice \mathbb{A} et des vecteurs \mathbf{x}_i , $i \in \llbracket 1, n \rrbracket$.

$$\mathbb{B} = \mathbb{P}^* \mathbb{A} \mathbb{P}.$$

b. En déduire que la première colonne de \mathbb{B} est $(\lambda, 0, \dots, 0)^t$.

□

Q. 3 Par récurrence sur l'ordre de la matrice, montrer que la matrice \mathbb{A} peut s'écrire sous la forme

$$\mathbb{A} = \mathbb{U} \mathbb{T} \mathbb{U}^*$$

où \mathbb{U} est une matrice unitaire et \mathbb{T} une matrice triangulaire supérieure.

□

Q. 4 En supposant \mathbb{A} inversible et la décomposition $\mathbb{A} = \mathbb{U} \mathbb{T} \mathbb{U}^*$ connue, expliquer comment résoudre "simplement" le système linéaire $\mathbb{A} \mathbf{x} = \mathbf{b}$.

□

3 Normes

EXERCICE 7

Soient \mathbf{x} et \mathbf{y} deux vecteurs de \mathbb{C}^n .

Q. 1 Trouver $\alpha \in \mathbb{C}$ tel que $\langle \alpha \mathbf{x} - \mathbf{y}, \mathbf{x} \rangle = 0$. □

Q. 2 En calculant $\|\alpha \mathbf{x} - \mathbf{y}\|_2^2$, montrer que

$$|\langle \mathbf{x}, \mathbf{y} \rangle| \leq \|\mathbf{x}\|_2 \|\mathbf{y}\|_2. \quad (1)$$

Q. 3 Soit $\mathbf{x} \neq 0$. Montrer alors que l'inégalité (1) est une égalité si et seulement si $\mathbf{y} = \alpha \mathbf{x}$. □

EXERCICE 8

Q. 1 Soit la fonction $f(t) = (1 - \lambda) + \lambda t - t^\lambda$ avec $0 < \lambda < 1$. Montrer que pour tous $\alpha \geq 0$ et $\beta \geq 0$ on a

$$\alpha^\lambda \beta^{1-\lambda} \leq \lambda \alpha + (1 - \lambda) \beta. \quad (2)$$

Soient \mathbf{x} et \mathbf{y} deux vecteurs non nuls de \mathbb{C}^n . Soient $p > 1$ et $q > 1$ vérifiant $\frac{1}{p} + \frac{1}{q} = 1$.

Q. 2 On pose $\mathbf{u} = \frac{\mathbf{x}}{\|\mathbf{x}\|_p}$ et $\mathbf{v} = \frac{\mathbf{y}}{\|\mathbf{y}\|_q}$. En utilisant l'inégalité (2), montrer que l'on a l'inégalité

$$\sum_{i=1}^n |u_i v_i| \leq \frac{1}{p} \sum_{i=1}^n |u_i|^p + \frac{1}{q} \sum_{i=1}^n |v_i|^q = 1. \quad (3)$$

Q. 3 En déduire l'inégalité de Holder suivante

$$|\langle \mathbf{x}, \mathbf{y} \rangle| \leq \sum_{i=1}^n |x_i y_i| \leq \|\mathbf{x}\|_p \|\mathbf{y}\|_q. \quad (4)$$

Quel est le lien entre l'inégalité de Hölder et l'inégalité de Cauchy-Schwarz? □

EXERCICE 9

Etant donné une norme vectorielle $\|\bullet\|$ sur \mathbb{K}^n , on définit l'application $\|\bullet\|_s : \mathcal{M}_n(\mathbb{K}) \rightarrow \mathbb{R}^+$ par

$$\|A\|_s \stackrel{\text{def}}{=} \sup_{\substack{\mathbf{v} \in \mathbb{K}^n \\ \mathbf{v} \neq 0}} \frac{\|A\mathbf{v}\|}{\|\mathbf{v}\|} \quad (5)$$

Q. 1 Montrer que $\|\mathbb{1}\|_s = 1$. □

On note $\mathcal{B} = \{\mathbf{v} \in \mathbb{K}^n ; \|\mathbf{v}\| \leq 1\}$ la boule unité de \mathbb{K}^n et $\mathcal{S} = \{\mathbf{v} \in \mathbb{K}^n ; \|\mathbf{v}\| = 1\}$ la sphère unité de \mathbb{K}^n .

Q. 2 a. Montrer que \mathcal{B} et \mathcal{S} sont des compacts.

b. Montrer que

$$\|A\|_s = \sup_{\mathbf{v} \in \mathcal{S}} \|A\mathbf{v}\| \quad (6)$$

c. En déduire que

$$\|A\|_s = \sup_{\mathbf{v} \in \mathcal{B}} \|A\mathbf{v}\| \quad (7)$$

d. En déduire que l'application $\|\bullet\|_s$ est bien définie sur $\mathcal{M}_n(\mathbb{K})$ i.e. $\forall A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{K}), \|A\|_s < +\infty$. □

Q. 3 a. Montrer

$$\|A\|_s \leq \inf \{ \alpha \in \mathbb{R} : \|A\mathbf{v}\| \leq \alpha \|\mathbf{v}\|, \forall \mathbf{v} \in \mathbb{K}^n \}.$$

b. Montrer qu'il existe $\mathbf{w} \in \mathcal{S}$ tel que $\|A\|_s = \|A\mathbf{w}\|$.

c. En déduire que

$$\|A\|_s = \inf \{ \alpha \in \mathbb{R} : \|A\mathbf{v}\| \leq \alpha \|\mathbf{v}\|, \forall \mathbf{v} \in \mathbb{K}^n \}. \quad (8)$$

□

Q. 4 a. Montrer que $\forall \mathbf{v} \in \mathbb{K}^n, \|A\mathbf{v}\| \leq \|A\|_s \|\mathbf{v}\|$.

b. Soit $\lambda \in \mathbb{K}^*$. Montrer qu'il existe $\mathbf{u} \in \mathbb{K}^n$ tel que $\|\mathbf{u}\| = |\lambda|$ vérifiant

$$\|A\mathbf{u}\| = \|A\|_s \|\mathbf{u}\|.$$

□

Q. 5 Montrer que $\|\bullet\|_s$ est une norme matricielle. □

EXERCICE 10

Soit $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{C})$. On note

$$\|A\|_1 \stackrel{\text{def}}{=} \sup_{\substack{\mathbf{x} \in \mathbb{C}^n \\ \mathbf{x} \neq 0}} \frac{\|A\mathbf{x}\|_1}{\|\mathbf{x}\|_1}$$

la norme matricielle subordonnée à la norme vectorielle $\|\bullet\|_1$.

Q. 1 Montrer que

$$\sup_{\substack{\mathbf{x} \in \mathbb{C}^n \\ \|\mathbf{x}\|_1=1}} \|A\mathbf{x}\|_1 \leq \max_{j \in [1, n]} \sum_{i=1}^n |A_{i,j}|.$$

□

Q. 2 a. Déterminer un $\mathbf{y} \in \mathbb{C}^n, \|\mathbf{y}\|_1 = 1$ tel que

$$\|A\mathbf{y}\|_1 = \max_{j \in [1, n]} \sum_{i=1}^n |A_{i,j}|.$$

b. Conclure. □

Q. 3 [Algo] Ecrire une fonction algorithmique, nommée *Norm1*, calculant $\|A\|_1$. □

EXERCICE 11

Soit $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{C})$. On note

$$\|A\|_\infty \stackrel{\text{def}}{=} \sup_{\substack{\mathbf{x} \in \mathbb{C}^n \\ \mathbf{x} \neq 0}} \frac{\|A\mathbf{x}\|_\infty}{\|\mathbf{x}\|_\infty}$$

la norme matricielle subordonnée à la norme vectorielle $\|\bullet\|_\infty$.

Q. 1 Montrer que

$$\sup_{\substack{\mathbf{x} \in \mathbb{C}^n \\ \|\mathbf{x}\|_\infty=1}} \|A\mathbf{x}\|_\infty \leq \max_{i \in \llbracket 1, n \rrbracket} \sum_{j=1}^n |A_{i,j}|.$$

□

Q. 2 a. Déterminer un $\mathbf{y} \in \mathbb{C}^n$, $\|\mathbf{y}\|_\infty = 1$ tel que

$$\|A\mathbf{y}\|_\infty = \max_{i \in \llbracket 1, n \rrbracket} \sum_{j=1}^n |A_{i,j}|.$$

b. Conclure.

□

Q. 3 [Algo] Ecrire une fonction algorithmique, nommée *NormInf*, calculant $\|A\|_\infty$.

□

EXERCICE 12

Soit $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{C})$. On note $B = A^*A$.

Q. 1 Soit $(\lambda, \mathbf{u}) \in \mathbb{C} \times \mathbb{C}^n \setminus \{0\}$ un élément propre de B .

a. Montrer que la matrice B est hermitienne.

b. Montrer que les valeurs propres de B sont réelles.

c. En déduire que

$$\lambda = \frac{\|A\mathbf{u}\|_2^2}{\|\mathbf{u}\|_2^2}.$$

□

La matrice B étant hermitienne (elle est donc normale), d'après le Théorème de réduction 3.2 page 63, il existe alors une matrice U unitaire et une matrice D diagonale telle que

$$B = UDU^*.$$

On note $(\lambda_i, \mathbf{e}_i)_{i \in \llbracket 1, n \rrbracket}$ les éléments propres de D . Les vecteurs \mathbf{e}_i sont les vecteurs de la base canonique de \mathbb{C}^n et $\lambda_i = D_{ii}$.

Q. 2 a. Démontrer que les $(\lambda_i, \mathbf{v}_i)_{i \in \llbracket 1, n \rrbracket}$ sont les éléments propres de B où \mathbf{v}_i est le i -ème vecteur colonne de U .

b. En déduire que $\{\mathbf{v}_1, \dots, \mathbf{v}_n\}$ est une base orthonormée de \mathbb{C}^n .

□

Soit $\mathbf{x} \in \mathbb{C}^n$ tel que $\|\mathbf{x}\|_2 = 1$ décomposée dans la base $\{\mathbf{v}_1, \dots, \mathbf{v}_n\}$:

$$\exists (\alpha_1, \dots, \alpha_n) \in \mathbb{C}^n, \text{ tels que } \mathbf{x} = \sum_{i=1}^n \alpha_i \mathbf{v}_i.$$

Q. 3 a. Montrer que

$$\langle \mathbf{x}, \mathbf{x} \rangle = \sum_{i=1}^n |\alpha_i|^2 = 1.$$

b. Montrer que

$$\sup_{\substack{\mathbf{v} \in \mathbb{C}^n \\ \|\mathbf{v}\|_2=1}} \|\mathbb{A}\mathbf{v}\|_2^2 \leq \rho(\mathbb{A}^*\mathbb{A}).$$

c. Déterminer un vecteur $\mathbf{w} \in \mathbb{C}^n$, tel que

$$\|\mathbb{A}\mathbf{w}\|_2^2 = \rho(\mathbb{A}^*\mathbb{A}).$$

d. En déduire que

$$\|\mathbb{A}\|_2 \stackrel{\text{def}}{=} \sup_{\substack{\mathbf{x} \in \mathbb{C}^n \\ \mathbf{x} \neq 0}} \frac{\|\mathbb{A}\mathbf{x}\|_2}{\|\mathbf{x}\|_2} = \sqrt{\rho(\mathbb{A}^*\mathbb{A})}.$$

□

Q. 4 a. Montrer que la norme $\|\bullet\|_2$ est invariante par transformation unitaire :

$$\mathbb{U}\mathbb{U}^* = \mathbb{I} \implies \|\mathbb{A}\|_2 = \|\mathbb{U}\mathbb{A}\|_2 = \|\mathbb{A}\mathbb{U}\|_2 = \|\mathbb{U}^*\mathbb{A}\mathbb{U}\|_2.$$

b. Montrer que si \mathbb{A} est hermitienne alors

$$\|\mathbb{A}\|_2 = \rho(\mathbb{A}).$$

□