



PRÉPASIMPLE

prepasimple.fr

HEC / ESSEC

Mathématiques

2019

Sujet de mathématiques approfondies

Mathématiques approfondies — Prépa ECG

Annales de concours · Sujet

Le problème comporte cinq parties.

Dans les trois premières parties, on étudie des propriétés usuelles des matrices tAA , où $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$. Dans la quatrième partie, on définit la racine carrée d'une matrice symétrique réelle dont les valeurs propres sont strictement positives, afin d'obtenir une décomposition d'une matrice inversible. Dans la cinquième partie, on applique ce qui précède au calcul de la distance d'une matrice inversible à l'ensemble des matrices orthogonales de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$.

Dans tout le problème :

- n désigne un entier supérieur ou égal à 2.
- $\mathcal{B}_0 = (e_1, \dots, e_n)$ désigne la base canonique de $\mathbb{R}^n$.
- Si

$$x = \sum_{i=1}^n x_i e_i$$

est un vecteur de $\mathbb{R}^n$, on lui associe la matrice colonne $X = \begin{pmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix}$ de ses coordonnées

dans la base $\mathcal{B}_0$.

- $\langle \cdot | \cdot \rangle$ est le produit scalaire canonique sur $\mathbb{R}^n$ et la norme euclidienne associée est notée $\| \cdot \|$.
- Si $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$, tA désigne sa transposée et $\text{Tr } A$ sa trace.
- I_n désigne la matrice unité de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ et Id l'endomorphisme identité de $\mathbb{R}^n$.

Endomorphisme adjoint

Si $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ et si f est l'endomorphisme canoniquement associé à A , on note f^* l'endomorphisme canoniquement associé à la matrice ${}^t A$. On notera aussi $s_f = f^* \circ f$ l'endomorphisme canoniquement associé à la matrice ${}^t A A$.

Si λ est un nombre réel, on définit $E_\lambda(f) = \text{Ker}(f - \lambda \text{Id})$ et $E_\lambda(A) = \text{Ker}(A - \lambda I_n)$.

Liste étendue des valeurs propres

Lorsqu'une matrice A de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ est diagonalisable, on appelle liste étendue des valeurs propres de A une liste de nombres réels où chaque valeur propre de A se trouve répétée

$\dim E_\lambda(A)$ fois. Par exemple, la matrice $\begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 4 & 0 \\ 0 & 0 & 4 \end{pmatrix}$ admet $(1, 4, 4)$ pour liste étendue de valeurs propres.

On adopte les notations suivantes :

- $\mathcal{S}(\mathbb{R}^n)$, respectivement $\mathcal{S}_n(\mathbb{R})$, désigne l'ensemble des endomorphismes symétriques de $\mathbb{R}^n$, respectivement des matrices symétriques de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$.
- $\mathcal{S}^+(\mathbb{R}^n)$, respectivement $\mathcal{S}_n^+(\mathbb{R})$, désigne l'ensemble des endomorphismes symétriques, respectivement des matrices symétriques, à valeurs propres positives ou nulles.
- On note $\mathcal{O}_n(\mathbb{R})$ l'ensemble des matrices orthogonales de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$. Une matrice P est orthogonale si P est inversible et si $P^{-1} = {}^t P$.
- $GL_n(\mathbb{R})$ désigne l'ensemble des matrices inversibles de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$.

Matrices définies par blocs

Considérons $r \in \{1, \dots, n-1\}$ et deux matrices $A, B \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ définies par

$$A = \begin{pmatrix} A_1 & A_2 \\ A_3 & A_4 \end{pmatrix}, \quad B = \begin{pmatrix} B_1 & B_2 \\ B_3 & B_4 \end{pmatrix},$$

avec $A_1, B_1 \in \mathcal{M}_r(\mathbb{R})$, $A_4, B_4 \in \mathcal{M}_{n-r}(\mathbb{R})$, $A_2, B_2 \in \mathcal{M}_{r, n-r}(\mathbb{R})$ et $A_3, B_3 \in \mathcal{M}_{n-r, r}(\mathbb{R})$.

On utilisera sans démonstration les égalités suivantes :

$$AB = \begin{pmatrix} A_1B_1 + A_2B_3 & A_1B_2 + A_2B_4 \\ A_3B_1 + A_4B_3 & A_3B_2 + A_4B_4 \end{pmatrix}, \quad {}^tA = \begin{pmatrix} {}^tA_1 & {}^tA_3 \\ {}^tA_2 & {}^tA_4 \end{pmatrix}.$$

Partie I — Un premier exemple

Soit a un réel différent de 1 et

$$A = \frac{1}{1-a} \begin{pmatrix} 1 & -1 \\ a & -a \end{pmatrix} \in \mathcal{M}_2(\mathbb{R}).$$

- 1) Quel est le rang de A ? Calculer A^2 . Que peut-on dire de l'endomorphisme f canoniquement associé à A ? Est-ce un endomorphisme diagonalisable? Quelles sont les valeurs propres et les sous-espaces propres de f ?
- 2) Calculer $M = {}^tAA$. La matrice M est-elle diagonalisable? Comparer $\text{Ker } f$ et $\text{Ker}(s_f)$. Quelles sont les valeurs propres et les sous-espaces propres de s_f ?
- 3) À quelle condition nécessaire et suffisante M est-elle la matrice d'un projecteur?

Partie II — Généralités

4) Produit scalaire sur $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$

(a) Soient $A = [a_{i,j}]_{1 \leq i,j \leq n}$ et $B = [b_{i,j}]_{1 \leq i,j \leq n}$ deux matrices de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$. Donner l'expression de $\text{Tr}({}^tAB)$ en fonction des coefficients de A et de B .

(b) Montrer que l'application $(A, B) \mapsto \text{Tr}({}^tAB)$ est un produit scalaire sur $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$.

Dans la suite du problème, on notera $(A | B) = \text{Tr}({}^tAB)$ et $\|A\|_2 = \sqrt{\text{Tr}({}^tAA)}$ la norme euclidienne associée.

(c) Rappeler l'inégalité de Cauchy-Schwarz puis vérifier que, pour tout $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$,

$$\text{Tr}(A^2) \leq \text{Tr}({}^tAA).$$

Montrer également que $\text{Tr}(A^2) = \text{Tr}({}^tAA)$ si et seulement si $A \in \mathcal{S}_n(\mathbb{R})$.

Dans la suite, $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ et f est toujours l'endomorphisme canoniquement associé à A .

5) Caractérisation de la matrice de f^* en base orthonormée

Soit $\mathcal{B}' = (e'_1, \dots, e'_n)$ une base orthonormée de $\mathbb{R}^n$. On note P la matrice de passage de $\mathcal{B}_0$ vers $\mathcal{B}'$ et A' la matrice de f dans la base $\mathcal{B}'$.

(a) Rappeler la relation liant A et A' .

(b) Rappeler pourquoi P est une matrice orthogonale.

(c) En déduire que ${}^tA'$ est la matrice de f^* dans la base $\mathcal{B}'$.

6) Réduction de s_f

(a) Vérifier que, pour tout $X \in \mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{R})$, ${}^tX({}^tAA)X = \|AX\|^2$.

(b) Montrer que $\text{Ker } f = \text{Ker}(s_f)$ et $\text{rg}(s_f) = \text{rg } f$.

(c) Vérifier que s_f est un endomorphisme symétrique de $\mathbb{R}^n$.

(d) Montrer que les valeurs propres de s_f sont positives ou nulles.

On note $r = \text{rg } f$ et on suppose pour la fin de la question 6 que $1 \leq r \leq n - 1$.

(e) Justifier qu'il existe une base orthonormée $\mathcal{C} = (\varepsilon_1, \dots, \varepsilon_r, \dots, \varepsilon_n)$ de $\mathbb{R}^n$ dans laquelle la matrice de s_f est de la forme

$$\begin{pmatrix} D & 0_{r,n-r} \\ 0_{n-r,r} & 0_{n-r,n-r} \end{pmatrix},$$

où D est une matrice diagonale d'ordre r dont les éléments diagonaux $\lambda_1, \dots, \lambda_r$ sont strictement positifs et où les autres blocs sont des matrices dont tous les coefficients sont nuls.

(f) Montrer que la matrice de f dans la base $\mathcal{C}$ est de la forme

$$\text{Mat}_{\mathcal{C}}(f) = \begin{pmatrix} A_1 & 0_{r,n-r} \\ A_3 & 0_{n-r,n-r} \end{pmatrix},$$

où $A_1 \in \mathcal{M}_r(\mathbb{R})$ et $A_3 \in \mathcal{M}_{n-r,r}(\mathbb{R})$. Vérifier que ${}^t A_1 A_1 + {}^t A_3 A_3 = D$.

7) Étude des valeurs propres de $A^t A$

On note $\tau_f = f \circ f^*$ l'endomorphisme canoniquement associé à $A^t A$.

(a) Montrer que $\text{rg}(s_f) = \text{rg}(\tau_f)$ et $\dim \text{Ker}(s_f) = \dim \text{Ker}(\tau_f)$.

(b) Soit λ une valeur propre strictement positive de s_f et x un vecteur propre associé. Vérifier que λ est une valeur propre de τ_f et que $f(x)$ en est un vecteur propre associé. Montrer alors que

$$\dim E_\lambda(s_f) \leq \dim E_\lambda(\tau_f).$$

- (c) Montrer que τ_f est diagonalisable dans une base orthonormée de vecteurs propres, qu'il possède exactement les mêmes valeurs propres que s_f et que, pour chacune de ces valeurs propres λ ,

$$\dim E_\lambda(s_f) = \dim E_\lambda(\tau_f).$$

- (d) En déduire enfin qu'il existe $\Omega \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R})$ telle que $A^t A = \Omega(^t A A)^t \Omega$.

8) Une inégalité

Dans cette question, on note $V = [0, +\infty[^n$ et $U =]0, +\infty[^n$, et φ l'application de $\mathbb{R}^n$ dans $\mathbb{R}$ définie par

$$\varphi(x_1, \dots, x_n) = \prod_{i=1}^n x_i.$$

On admet que V est une partie fermée de $\mathbb{R}^n$ et que U est une partie ouverte de $\mathbb{R}^n$. On rappelle qu'un ensemble défini par une égalité $g(x) = 0$ avec g continue est fermé, et qu'une intersection finie de fermés est fermée.

- (a) Montrer que $W = \{(x_1, \dots, x_n) \in V \mid x_1 + \dots + x_n = 1\}$ est une partie fermée bornée de $\mathbb{R}^n$.

- (b) En déduire que φ admet un maximum global noté M sur W .

- (c) Calculer $\varphi(x_1, \dots, x_n)$ lorsque $(x_1, \dots, x_n) \in V \setminus U$.

- (d) En déduire que M est le maximum de φ sur U sous la contrainte $x_1 + \dots + x_n = 1$.

(e) Déterminer alors la valeur du maximum M et préciser en quel vecteur de U il est atteint.

(f) Soit $S \in \mathcal{S}_n(\mathbb{R})$. On suppose que les valeurs propres de S sont positives ou nulles et on note $(\mu_1, \dots, \mu_n)$ une liste étendue des valeurs propres de S . Dédurre de ce qui précède que

$$\prod_{i=1}^n \mu_i \leq \left(\frac{\text{Tr } S}{n} \right)^n.$$

Dans quel cas a-t-on égalité dans cette inégalité ?

(g) Dans cette question, on note $(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$ une liste étendue des valeurs propres de tAA . On définit l'application Δ sur $\mathbb{R}$ par

$$\Delta(x) = \prod_{i=1}^n (x + \lambda_i).$$

Montrer alors que, pour tout réel $x \geq 0$,

$$\Delta(x) \leq \left(\frac{\text{Tr}(xI_n + {}^tAA)}{n} \right)^n = \left(\frac{nx + \lambda_1 + \dots + \lambda_n}{n} \right)^n.$$

Partie III — Étude de deux cas particuliers

Dans cette partie encore, $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ et f est toujours l'endomorphisme canoniquement associé à A .

9) On suppose dans cette question que f est un projecteur de rang $r \in \{1, \dots, n-1\}$.

(a) Montrer que la trace de toute matrice représentant l'endomorphisme f est r .

(b) On reprend les notations de la question 6 selon lesquelles

$$\text{Mat}_{\mathcal{C}}(f) = \begin{pmatrix} A_1 & 0_{r,n-r} \\ A_3 & 0_{n-r,n-r} \end{pmatrix}.$$

Vérifier que $A_1^2 = A_1$ et que $\text{Tr}(A_1) = r$, et en déduire la matrice A_1 .

(c) Montrer que les valeurs propres non nulles de tAA sont supérieures ou égales à 1 et que $\text{Tr}({}^tAA) \geq r$.

(d) Quels sont les projecteurs orthogonaux pour lesquels $\text{Tr}({}^tAA) = r$?

10) On suppose dans cette question que f est une symétrie, c'est-à-dire $f^2 = \text{Id}$.

(a) Justifier que tAA est inversible et exprimer son inverse en fonction de A et de tA .

(b) Montrer que si λ est une valeur propre de tAA , alors $1/\lambda$ est aussi une valeur propre de tAA et que

$$\dim E_{\lambda}({}^tAA) = \dim E_{1/\lambda}({}^tAA).$$

(c) Vérifier que, pour tout réel $x > 0$, $x + 1/x \geq 2$, puis établir l'équivalence $x + 1/x = 2 \Leftrightarrow x = 1$.

(d) On note $(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$ une liste étendue des valeurs propres de tAA . Montrer que

$$\prod_{i=1}^n (1 + \lambda_i) \geq 2^n.$$

(e) Quelles sont les matrices pour lesquelles

$$\prod_{i=1}^n (1 + \lambda_i) = 2^n$$

? Montrer que cette égalité correspond au cas où f est une symétrie orthogonale, ce qui signifie que les sous-espaces $E_1(f)$ et $E_{-1}(f)$ sont orthogonaux.

Partie IV — Décomposition polaire

Dans cette partie encore, $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ et f est toujours l'endomorphisme canoniquement associé à A ; on suppose de plus que A est inversible.

11) Montrer qu'il existe une base orthonormée $\mathcal{C} = (\varepsilon_1, \dots, \varepsilon_n)$ et n réels strictement positifs $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ tels que $s_f(\varepsilon_i) = \lambda_i \varepsilon_i$ pour tout $i \in \{1, \dots, n\}$.

On pose alors $v(\varepsilon_i) = \sqrt{\lambda_i} \varepsilon_i$ pour tout $i \in \{1, \dots, n\}$.

Montrer que l'on définit ainsi un endomorphisme v de $\mathbb{R}^n$ tel que $v \in \mathcal{S}^+(\mathbb{R}^n)$ et $v^2 = s_f$.

12) Soit w un endomorphisme de $\mathbb{R}^n$ tel que $w \in \mathcal{S}^+(\mathbb{R}^n)$ et $w^2 = s_f$.

Montrer que, pour toute valeur propre μ de w , $E_\mu(w) \subset E_{\mu^2}(s_f)$, et montrer ensuite que

$$E_\mu(w) = E_{\mu^2}(s_f), \quad \text{Sp}(w) = \{\sqrt{\lambda} \mid \lambda \in \text{Sp}(s_f)\}.$$

13) En déduire qu'il existe un unique endomorphisme v de $\mathbb{R}^n$ tel que $v \in \mathcal{S}^+(\mathbb{R}^n)$ et $v^2 = s_f$, et que, dans toute base orthonormée de vecteurs propres de s_f , la matrice de v est diagonale.

14) En déduire qu'il existe une unique matrice notée $\sqrt{{}^t A A}$ appartenant à $\mathcal{S}_n^+(\mathbb{R})$ telle que $(\sqrt{{}^t A A})^2 = {}^t A A$.

- 15) Vérifier que la matrice $A(\sqrt{AA^t})^{-1}$ est orthogonale. Montrer alors qu'il existe un unique couple $(\Omega, S) \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R}) \times \mathcal{S}_n^+(\mathbb{R})$ tel que $A = \Omega S$.

C'est ce que l'on appelle la décomposition polaire de A .

Partie V — Application à la distance d'une matrice inversible à l'ensemble $\mathcal{O}_n(\mathbb{R})$

Dans cette partie, A est une matrice inversible de $\mathcal{M}_n(\mathbb{R})$. Soit $M \in GL_n(\mathbb{R})$. On note $d(M)$ la distance de M à $\mathcal{O}_n(\mathbb{R})$, c'est-à-dire

$$d(M) = \inf_{V \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R})} \|M - V\|_2.$$

- 16) Justifier que $d(M)$ est bien définie.

- 17) Soit $R \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R})$. Montrer que, pour toute matrice $N \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$,
 $\|RN\|_2 = \|NR\|_2 = \|N\|_2$.

Montrer que les applications $V \mapsto VR^{-1}$ et $V \mapsto R^{-1}V$ sont des bijections de $\mathcal{O}_n(\mathbb{R})$ sur lui-même. En déduire que $d(M) = d(RM) = d(MR)$.

- 18) On note $A = \Omega S$ la décomposition polaire de A . On considère une matrice diagonale D à éléments diagonaux strictement positifs et une matrice $P \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R})$ telles que $S = PD^tP$.

Vérifier que $d(A) = d(D)$.

- 19) Soit $V \in \mathcal{O}_n(\mathbb{R})$. On note $W = \frac{1}{2}(V + {}^tV)$, et v l'endomorphisme canoniquement associé à V .

(a) Justifier que W est diagonalisable. On note w l'endomorphisme canoniquement associé à W .

(b) Soit $x \in \mathbb{R}^n$. Vérifier que $\langle w(x) | x \rangle = \langle v(x) | x \rangle$ et que $\|v(x)\| = \|x\|$. En déduire que

$$|\langle w(x) | x \rangle| \leq \|x\|^2, \quad \langle x - w(x) | x \rangle \geq 0.$$

(c) Montrer alors que les valeurs propres de $I_n - W$ sont positives ou nulles.

(d) On note $W = [w_{i,j}]_{1 \leq i,j \leq n}$. Montrer aussi que, pour tout $i \in \{1, \dots, n\}$, $1 - w_{i,i} \geq 0$.

(e) Montrer que $w_{i,i} = 1$ pour tous les indices $i \in \{1, \dots, n\}$ si et seulement si $W = I_n$.

20) On conserve les notations des questions 18 et 19.

(a) Montrer que

$$\|D - V\|_2^2 - \|D - I_n\|_2^2 = 2(I_n - V | D) = 2(I_n - W | D).$$

(b) En déduire que $\|D - V\|_2^2 - \|D - I_n\|_2^2 \geq 0$.

(c) Montrer alors que

$$d(A) = \|D - I_n\|_2 = \|\sqrt{A}A - I_n\|_2,$$

et montrer aussi que I_n est l'unique élément V de $\mathcal{O}_n(\mathbb{R})$ tel que $d(A) = \|D - V\|_2$.