

3.1 Existence de solutions d'un système linéaire

3.2 Matrices à coefficients complexes

3.3 Systèmes linéaires

3.4 Calcul théorique de l'inverse de A

4 Valeurs propres

4.1 Vecteurs propres

4.2 Matrices à coefficients complexes

4.3 Sous-espace propre

4.4 Réduction d'une matrice

4.5 Complément Cayley-Hamilton

5

## 6.2 Système d'équations différentielles

**Définition 58** On appelle **système d'équations différentielles linéaires** de **premier ordre** un système de la forme  $x'(t) = A(t)x(t) + g(t)$  où  $A(t) \in M_{n,n}(\mathbb{R})$  et  $g(t) \in \mathbb{R}^n$ .

**Définition 59** Une **équation différentielle d'ordre n** se met sous la forme d'un système de n équations du premier ordre. En effet, soit l'équation :

$$z^{(n)}(t) + \alpha_{n-1}(t)z^{(n-1)}(t) + \dots + \alpha_0(t)z(t) = f(t)$$

On pose  $x_1(t) = z(t)$ ,  $x_2(t) = z'(t)$ ,  $\dots$ ,  $x_n(t) = z^{(n-1)}(t)$ , alors l'équation se réécrit  $x'(t) = A(t)x(t) + g(t)$  où

$$x'(t) = \begin{pmatrix} x_1(t) \\ x_2(t) \\ \vdots \\ x_{n-1}(t) \\ x_n(t) \end{pmatrix}, g(t) = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ \vdots \\ 0 \\ f(t) \end{pmatrix}$$

$$A(t) = \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 0 & 1 & \dots & 0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & \dots & 1 \\ -\alpha_0(t) & -\alpha_1(t) & -\alpha_2(t) & \dots & -\alpha_{n-1}(t) \end{pmatrix}$$

## 6.3 Existence et unicité des solutions des systèmes différentiels

### 6.3.1 Système homogène

**Proposition 45** Soient  $t_0 \in I$  et  $(\xi_1, \dots, \xi_n)$  un vecteur de  $\mathbb{R}^n$ , alors il existe une unique  $x$  de  $(C^1(I, \mathbb{R}))^n$  tel que  $x'(t) = A(t)x(t)$ ,  $x(t_0) = (\xi_1, \dots, \xi_n)$ .

**Proposition 46**  $S_0 = \{x \in ((C^1(I, \mathbb{R}))^n)^n \mid x'(t) = A(t)x(t)\}$  est un sous-espace vectoriel de  $((C^1(I, \mathbb{R}))^n)^n$  de dimension  $n$ .  
Toute solution  $x(t) = A(t)x(t)$  peut donc s'écrire sous la forme  $x = \sum_{i=1}^n \alpha_i X_i$  où les  $X_i$  sont n solutions linéairement indépendantes de  $x'(t) = A(t)x(t)$ .

### 6.3.2 Systèmes avec second membre

**Proposition 47** Soit  $g \in (C^0(I, \mathbb{R}))^n$ . La solution générale de l'équation  $x'(t) = A(t)x(t) + g(t)$  s'écrit  $x = x_p + x_h$  avec  $x_p$  solution particulière de l'équation inhomogène et  $x_h$  solution générale de l'équation homogène.

## 6.4 Systèmes à coefficients constants

Lorsque les coefficients de  $A$  ne dépendent pas de  $t$ , le système est dit à coefficients constants.

### 6.4.1 Matrice diagonalisable

Si la matrice  $A$  (à coefficients constants) est diagonalisable, alors toute solution de  $x'(t) = A(t)x(t)$  s'écrit sous la forme

$$x(t) = \sum_{i=1}^n \alpha_i e^{\lambda_i t} Y_i$$

**Remarque** :  $A$  et  $D$  ont les mêmes valeurs propres, ce sont les éléments de la diagonale de  $D$ . De plus, les colonnes de  $P$  sont les vecteurs propres correspondants.

**Définition 36** (n) **Polynôme caractéristique** de  $A$  :  $P_A(\lambda) = \det(\lambda I - A)$ .  
Le polynôme caractéristique de  $A$  est de degré  $n$  et plus précisement il est de la forme  $\pi_A(s) = s^n + \alpha_{n-1}s^{n-1} + \dots + \alpha_1s + \alpha_0$ .

**Proposition 22** Une condition nécessaire et suffisante pour que  $\lambda$  soit valeur propre de  $A$  est qu'il existe  $v \neq 0$  tel que  $Av = \lambda v$ .

**Définition 37** On appelle **multiplicité** de la valeur propre  $\lambda_i$  la multiplicité de la racine correspondante du polynôme caractéristique.

**Proposition 23** Si  $A \in M_{n,n}(\mathbb{C})$  est une matrice triangulaire, ses valeurs propres sont ses termes diagonaux.

**Proposition 24** Si  $A \in M_{n,n}(\mathbb{C})$ , alors  $\lambda$  et  $\lambda^T$  ont les mêmes polynômes caractéristiques et donc les mêmes valeurs propres.

**Proposition 25** Deux matrices semblables ont le même polynôme caractéristique et en particulier les mêmes valeurs propres.

**Définition 38** Soit  $\lambda$  une valeur propre de  $A$ , on appelle **sous-espace propre** associé à  $\lambda$  le sous-espace vectoriel de  $M_{n,n}$  noté  $V_\lambda$ , défini par  $V_\lambda = \{v \in M_n \mid Av = \lambda v\}$ .

**Proposition 26** Si  $A$  est une matrice appartenant à  $M_{n,n}(\mathbb{C})$  qui admet  $r$  valeurs propres distinctes  $\lambda_1, \dots, \lambda_r$ , on a  $\sum_{i=1}^r \dim(V_{\lambda_i}) = n$ .

**Proposition 27** Soit  $A \in M_{n,n}(\mathbb{C})$  et soient  $\{\mu_1, \dots, \mu_n\}$  ses valeurs propres complexes (distinctes ou confondues), alors la trace de  $A$  est égale à la somme de ses valeurs propres, le déterminant de  $A$  est égal au produit de ses valeurs propres.

**Définition 39**  $A \in M_{n,n}(\mathbb{C})$  est dite **diagonalisable** dans  $\mathbb{K}$  s'il existe  $D \in M_n(\mathbb{K})$  diagonale et une matrice  $P$  inversible telles que  $A = PDP^{-1}$ .

**Définition 39**  $A \in M_{n,n}$  est dite **diagonalisable** dans  $\mathbb{K}$  s'il existe  $D \in M_n(\mathbb{K})$  diagonale et une matrice  $P$  inversible telles que  $A = PDP^{-1}$ .

**4.1.1 Réduction d'une matrice**

**4.1.2 Diagonalisation**

**4.1.3 Valeurs propres et matrice semblable**

**4.1.4 Valeurs propres et matrices particulières**

**4.1.5 Vecteurs propres et matrice semblable**

**4.2 Matrices à coefficients complexes**

**4.3 Sous-espace propre**

**4.4 Réduction d'une matrice**

**4.5 Complément Cayley-Hamilton**

**5**

## 6.4.1 Matrice diagonalisable

**Rappel** : Toute matrice est trigonalisable dans  $\mathbb{C}$ . Si  $A$  n'est pas diagonalisable, on écrit :

$$x'(t) = Ax(t) \iff x(t) = PTP^{-1}x(t) \iff x(t) = Tz(t)$$

où  $z(t) = P^{-1}x(t)$ . On a donc

$$\begin{cases} z_1'(t) = \lambda_1 z_1(t) \\ z_2'(t) = \lambda_2 z_2(t) \\ \vdots \\ z_n'(t) = \lambda_n z_n(t) \end{cases}$$

avec sur la diagonale de  $T$  les valeurs propres de  $A$ . On peut alors résoudre ce système en commençant par la dernière équation, puis on remplace  $z_n$  par sa valeur dans l'équation précédente que l'on peut alors résoudre...

### 6.4.3 Systèmes non homogènes à coefficients constants

On veut résoudre  $x'(t) = A(t)x(t) + g(t)$ . On suppose que  $A$  (diagonalisable ou trigonalisable) est semblable à  $A$ , d'où  $x'(t) = P A P^{-1} x(t) + g(t) \iff P^{-1} x'(t) = A P^{-1} x(t) + P^{-1} g(t)$

### 6.5 Second ordre

Une équation différentielle du second ordre s'écrit sous la forme

$$ay''(t) + by'(t) + cy(t) = 0, a, b, c \in \mathbb{R}, a \neq 0.$$

Elle se résout en calculant les racines du trinôme caractéristique  $as^2 + bs + c$ . Deux cas peuvent se présenter :  
- Si les racines sont distinctes, on les appelle  $\lambda_1$  et  $\lambda_2$  et on a alors  $y(t) = \alpha_1 e^{\lambda_1 t} + \alpha_2 e^{\lambda_2 t}$ .  
- Si les deux racines sont confondues (donc réelles), appelons  $\lambda$  cette racine double alors on a :  $y(t) = (\alpha_1 + \alpha_2 t)e^{\lambda t}$ .

Dans le cas de racines complexes, elles sont conjuguées. Si on cherche une solution réelle, on choisira donc  $\alpha_1$  et  $\alpha_2$  conjugués.

### 6.6 Coefficients non constants

Passes à l'exo suivant. Si il te reste plus que ça, suicide toi !-)

### 6.7 Formules magiques

Variation de la constante :

$$y''(t) - ay(t) = 0 \Rightarrow y(t) = Ce^{at}$$
$$y''(t) - ay(t) = f \Rightarrow y(t) = \left( \int \int e^{-at} f(t) dt + C \right) e^{at}$$

**3.3.3** Existence de solutions d'un système linéaire

**3.3.1** Existence de la solution d'un système de m-a

**3.3.2** Matrices à coefficients complexes

**3.3.3** Systèmes linéaires

**3.3.4** Calcul théorique de l'inverse de A

**4 Valeurs propres**

**4.1 Vecteurs propres**

**4.2 Matrices à coefficients complexes**

**4.3 Sous-espace propre**

**4.4 Réduction d'une matrice**

**4.5 Complément Cayley-Hamilton**

**5**

## 1 Espaces vectoriels

### 1.1 Généralités

#### 1.1.1 Groupe

**Définition 1** On appelle **groupe** un ensemble  $G$  muni d'une loi de composition interne ( $c$  est à dire d'une application de  $G \times G$  dans  $G$ ), notée par exemple  $(x, y) \mapsto x \cdot y$ , qui possède les propriétés suivantes :

- elle est **associative** :  $\forall x, y, z \in G$  on a  $(x \cdot (y \cdot z)) = (x \cdot y) \cdot z$ ;
- elle admet un élément neutre :  $\exists e \in G$  tel que  $\forall x \in G$  on a  $e \cdot x = x \cdot e = x$ ;
- tout élément admet un **symétrique** (ou **opposé** ou **inverse** qui est nécessairement unique) :  $\forall x \in G, \exists \tilde{x} \in G$  tel que  $x \cdot \tilde{x} = \tilde{x} \cdot x = e$ .

Un groupe est **commutatif** si la loi de composition est commutative.

#### 1.1.2 Espaces vectoriels

**Définition 2** Soit  $\mathbb{K}$  un corps (ses éléments sont des scalaires) commutatif. On appelle **espace vectoriel** sur  $\mathbb{K}$  un ensemble  $E$  sur lequel on a défini deux lois de composition :  
- une loi interne + telle que  $(E, +)$  soit un **groupe commutatif**  
- une loi externe définie de  $\mathbb{K} \times E$  dans  $E$  qui possède les propriétés suivantes :  $\forall \lambda, \mu \in \mathbb{K}, \forall \tilde{x}, \tilde{y} \in E$  :

- $(\lambda \mu) \cdot \tilde{x} = \lambda \cdot (\mu \cdot \tilde{x})$
- $(\lambda + \mu) \cdot \tilde{x} = \lambda \cdot \tilde{x} + \mu \cdot \tilde{x}$
- $\lambda \cdot (\tilde{x} + \tilde{y}) = \lambda \cdot \tilde{x} + \lambda \cdot \tilde{y}$
- $1 \cdot \tilde{x} = \tilde{x}$  (1 élément unité de  $\mathbb{K}$ )

**Définition 3** Soit  $F$  une partie non vide de  $E$ ,  $F$  est un **sous-espace vectoriel** de  $E$  si et seulement si :  
-  $F \neq \emptyset$ ,  
-  $\tilde{x}, \tilde{y} \in F \Rightarrow \tilde{x} + \tilde{y} \in F$ ,  
-  $\lambda \in \mathbb{K}, \tilde{x} \in F \Rightarrow \lambda \tilde{x} \in F$ .

**Proposition 1** Si  $F$  et  $G$  sont deux sous-espaces vectoriels de  $E$ , alors  $F \cap G$  est un sous-espace vectoriel et  $F \cup G$  n'en est en général pas un.

#### Définition 4

- On appelle **somme** de deux sous-espaces vectoriels  $F$  et  $G$  (d'un espace vectoriel  $E$ ) le sous-espace vectoriel  $H$  de  $E$  noté  $F + G$  tel que  $H = \{x \in E \mid \exists \tilde{y} \in F, \exists \tilde{z} \in G, x = \tilde{y} + \tilde{z}\}$ .  
- On dit que  $F$  et  $G$  sont en **somme directe** si  $F \cap G = \{0\}$  et on note alors  $H = F \oplus G$ .  
- On dit que  $F$  et  $G$  sont **supplémentaires** dans  $E$  si  $E$  est la somme directe de  $F$  et  $G$ .  
Remarque :  $H$  est un sous-espace vectoriel de  $E$

**Proposition 2** Si  $H = F \oplus G$  alors  $\forall \tilde{z} \in H$ , il existe un couple unique  $(\tilde{x}, \tilde{y}) \in F \times G$  tel que  $\tilde{z} = \tilde{x} + \tilde{y}$ . En particulier si  $E = F \oplus G$  alors tout vecteur  $\tilde{z} \in E$  s'écrit de manière unique comme somme d'un élément de  $F$  et d'un élément de  $G$ .

### 1.2 Espaces vectoriels de dimension finie

#### 1.2.1 Familles

#### Proposition 3

**3.2.3** Déterminant et matrice inversible

**3.2.4** Déterminant d'un endomorphisme

**3.2.5** Rang d'une matrice

**3.3.1** Existence de la solution d'un système de m-a

**3.3.2** Matrices à coefficients complexes

**3.3.3** Systèmes linéaires

**3.3.4** Calcul théorique de l'inverse de A

**4 Valeurs propres**

**4.1 Vecteurs propres**

**4.2 Matrices à coefficients complexes**

**4.3 Sous-espace propre**

**4.4 Réduction d'une matrice**

**4.5 Complément Cayley-Hamilton**

**5**

## 1 Espaces vectoriels

### 1.1 Généralités

#### 1.1.1 Groupe

**Définition 1** On appelle **groupe** un ensemble  $G$  muni d'une loi de composition interne ( $c$  est à dire d'une application de  $G \times G$  dans  $G$ ), notée par exemple  $(x, y) \mapsto x \cdot y$ , qui possède les propriétés suivantes :

- elle est **associative** :  $\forall x, y, z \in G$  on a  $(x \cdot (y \cdot z)) = (x \cdot y) \cdot z$ ;
- elle admet un élément neutre :  $\exists e \in G$  tel que  $\forall x \in G$  on a  $e \cdot x = x \cdot e = x$ ;
- tout élément admet un **symétrique** (ou **opposé** ou **inverse** qui est nécessairement unique) :  $\forall x \in G, \exists \tilde{x} \in G$  tel que  $x \cdot \tilde{x} = \tilde{x} \cdot x = e$ .

Un groupe est **commutatif** si la loi de composition est commutative.

#### 1.1.2 Espaces vectoriels

**Définition 2** Soit  $\mathbb{K}$  un corps (ses éléments sont des scalaires) commutatif. On appelle **espace vectoriel** sur  $\mathbb{K}$  un ensemble  $E$  sur lequel on a défini deux lois de composition :  
- une loi interne + telle que  $(E, +)$  soit un **groupe commutatif**  
- une loi externe définie de  $\mathbb{K} \times E$  dans  $E$  qui possède les propriétés suivantes :  $\forall \lambda, \mu \in \mathbb{K}, \forall \tilde{x}, \tilde{y} \in E$  :

- $(\lambda \mu) \cdot \tilde{x} = \lambda \cdot (\mu \cdot \tilde{x})$
- $(\lambda + \mu) \cdot \tilde{x} = \lambda \cdot \tilde{x} + \mu \cdot \tilde{x}$
- $\lambda \cdot (\tilde{x} + \tilde{y}) = \lambda \cdot \tilde{x} + \lambda \cdot \tilde{y}$
- $1 \cdot \tilde{x} = \tilde{x}$  (1 élément unité de  $\mathbb{K}$ )

**Définition 3** Soit  $F$  une partie non vide de  $E$ ,  $F$  est un **sous-espace vectoriel** de  $E$  si et seulement si :  
-  $F \neq \emptyset$ ,  
-  $\tilde{x}, \tilde{y} \in F \Rightarrow \tilde{x} + \tilde{y} \in F$ ,  
-  $\lambda \in \mathbb{K}, \tilde{x} \in F \Rightarrow \lambda \tilde{x} \in F$ .

**Proposition 1** Si  $F$  et  $G$  sont deux sous-espaces vectoriels de  $E$ , alors  $F \cap G$  est un sous-espace vectoriel et  $F \cup G$  n'en est en général pas un.

#### Définition 4

- On appelle **somme** de deux sous-espaces vectoriels  $F$  et  $G$  (d'un espace vectoriel  $E$ ) le sous-espace vectoriel  $H$  de  $E$  noté  $F + G$  tel que  $H = \{x \in E \mid \exists \tilde{y} \in F, \exists \tilde{z} \in G, x = \tilde{y} + \tilde{z}\}$ .  
- On dit que  $F$  et  $G$  sont en **somme directe** si  $F \cap G = \{0\}$  et on note alors  $H = F \oplus G$ .  
- On dit que  $F$  et  $G$  sont **supplémentaires** dans  $E$  si  $E$  est la somme directe de  $F$  et  $G$ .  
Remarque :  $H$  est un sous-espace vectoriel de  $E$

**Proposition 2** Si  $H = F \oplus G$  alors  $\forall \tilde{z} \in H$ , il existe un couple unique  $(\tilde{x}, \tilde{y}) \in F \times G$  tel que  $\tilde{z} = \tilde{x} + \tilde{y}$ . En particulier si  $E = F \oplus G$  alors tout vecteur  $\tilde{z} \in E$  s'écrit de manière unique comme somme d'un élément de  $F$  et d'un élément de  $G$ .

### 1.2 Espaces vectoriels de dimension finie

#### 1.2.1 Familles

#### Proposition 3