

# EQUATIONS DIFFÉRENTIELLES LINÉAIRES

Dans ce chapitre,  $I$  désigne un **intervalle** de  $\mathbb{R}$  et  $E$  un  $\mathbb{K}$ -**espace vectoriel normé de dimension finie** ( $\mathbb{K} = \mathbb{R}$  ou  $\mathbb{K} = \mathbb{C}$ ).

## 1 Généralités

### Définition 1.1 Equation différentielle linéaire

On appelle **équation différentielle linéaire** une équation de la forme

$$x' = a(t)(x) + b(t)$$

où

- $a : I \rightarrow \mathcal{L}(E)$  est continue ;
- $b : I \rightarrow E$  est continue ;
- $x : I \rightarrow E$  est une fonction **inconnue** de classe  $\mathcal{C}^1$ .

### Ecriture matricielle d'une équation différentielle linéaire

Si  $\mathcal{B} = (e_1, \dots, e_n)$  est une base de  $E$ , alors en notant

- $A(t) \in \mathcal{M}_n(\mathbb{K})$  la matrice de  $a(t)$  dans la base  $\mathcal{B}$  ;
- $B(t) \in \mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{K})$  la matrice de  $b(t)$  dans la base  $\mathcal{B}$  ;
- $X(t) \in \mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{K})$  la matrice de  $x(t)$  dans la base  $\mathcal{B}$  ;

l'équation différentielle

$$x' = a(t)(x) + b(t)$$

équivalent à

$$X' = A(t)X + B(t)$$

### Définition 1.2 Equation différentielle linéaire homogène

L'équation différentielle **homogène** associée à l'équation différentielle linéaire

$$x' = a(t)(x) + b(t)$$

est

$$x' = a(t)(x)$$

### Proposition 1.1 Principe de superposition

Si  $x_1$  et  $x_2$  sont des solutions respectives des équations différentielles **linéaires**

$$x' = a(t)(x) + b_1(t) \quad \text{et} \quad x' = a(t)(x) + b_2(t)$$

alors pour tout  $(\lambda, \mu) \in \mathbb{K}^2$ ,  $\lambda x_1 + \mu x_2$  est solution de l'équation différentielle linéaire

$$x' = a(t)(x) + (\lambda b_1(t) + \mu b_2(t))$$

**Définition 1.3 Problème de Cauchy**

On appelle **problème de Cauchy** une équation différentielle linéaire assortie d'une **condition initiale** :

$$\begin{cases} x' = a(t)(x) + b(t) \\ x(t_0) = x_0 \end{cases}$$

avec  $t_0 \in I$  et  $x_0 \in E$ .

**2 Solutions d'une équation différentielle linéaire**

Dans tout ce paragraphe,

- $a : I \rightarrow \mathcal{L}(E)$  est une fonction continue ;
- $b : I \rightarrow E$  est une fonction continue ;

**2.1 Théorème de Cauchy linéaire****Théorème 2.1 Théorème de Cauchy linéaire**

Soit  $(t_0, x_0) \in I \times E$ . Le problème de Cauchy

$$\begin{cases} x' = a(t)(x) + b(t) \\ x(t_0) = x_0 \end{cases}$$

admet une unique solution.

**2.2 Equations différentielles homogènes****Proposition 2.1 Structure de l'ensemble des solutions d'une équation différentielle homogène**

L'ensemble des solutions de l'équation différentielle linéaire **homogène**

$$x' = a(t)(x)$$

est un sous-espace vectoriel du  $\mathbb{K}$ -espace vectoriel  $E^I$ .

**Proposition 2.2**

Notons  $\mathcal{S}$  l'ensemble des solutions de l'équation différentielle **homogène**

$$x' = a(t)(x)$$

Pour tout  $t_0 \in I$ , l'application

$$\begin{cases} \mathcal{S} & \longrightarrow & E \\ x & \longmapsto & x(t_0) \end{cases}$$

est un isomorphisme.

**REMARQUE.** Ceci signifie notamment que si deux solutions prennent la même valeur en un certain  $t_0$ , alors elles sont égales. De manière un peu plus savante, les graphes des solutions forment une partition de  $I \times E$ .

**Corollaire 2.1**

L'ensemble des solutions de l'équation différentielle linéaire **homogène**

$$x' = a(t)(x)$$

est un  $\mathbb{K}$ -espace vectoriel de dimension  $n = \dim E$ .

**2.3 Equations différentielles avec second membre****Proposition 2.3 Structure de l'ensemble des solutions d'une équation différentielle linéaire**

Les solutions de l'équation différentielle linéaire

$$x' = a(t)(x) + b(t)$$

sont les sommes d'une solution particulière et d'une solution de l'équation différentielle homogène associée. Autrement dit, l'ensemble des solutions est un sous-espace affine de  $E^1$  de direction l'ensemble des solutions de l'équation homogène.

**Exemple 2.1**

Soit pour  $t \in \mathbb{R}$

$$a(t) : (x, y) \in \mathbb{R}^2 \mapsto \left( \frac{tx}{1+t^2} - \frac{y}{1+t^2}, \frac{x}{1+t^2} + \frac{ty}{1+t^2} \right) \quad \text{et} \quad b(t) = \left( \frac{1+t}{1+t^2}, \frac{1-t}{1+t^2} \right)$$

On considère l'équation différentielle  $u' = a(t)(u) + b(t)$ , autrement dit le système différentiel

$$\begin{cases} x' = \frac{tx}{1+t^2} - \frac{y}{1+t^2} + \frac{1+t}{1+t^2} \\ y' = \frac{x}{1+t^2} + \frac{ty}{1+t^2} + \frac{1-t}{1+t^2} \end{cases}$$

En raisonnant dans la base canonique de  $\mathbb{R}^2$ , cette équation différentielle peut s'écrire  $X' = A(t)X + B(t)$  avec

$$A(t) = \begin{pmatrix} \frac{t}{1+t^2} & -\frac{1}{1+t^2} \\ \frac{1}{1+t^2} & \frac{t}{1+t^2} \end{pmatrix} \quad \text{et} \quad B(t) = \begin{pmatrix} \frac{1+t}{1+t^2} \\ \frac{1-t}{1+t^2} \end{pmatrix}$$

On remarque que  $u_1 : t \mapsto (1, t)$  et  $u_2 : t \mapsto (t, -1)$  sont solutions de l'équation **homogène** associée. Puisque l'ensemble des solutions de cette équation homogène est un espace vectoriel de dimension 2 et que la famille  $(u_1, u_2)$  est libre, cet ensemble de solutions est  $\text{vect}(u_1, u_2)$ .

Par ailleurs, on remarque que  $v : t \mapsto (t, t)$  est solution de l'équation **avec second membre**. Ainsi l'ensemble des solutions est

$$v + \text{vect}(u_1, u_2)$$

c'est-à-dire l'ensemble des solutions de la forme

$$t \mapsto (t + \lambda + \mu t, t + \lambda t - \mu)$$

avec  $(\lambda, \mu) \in \mathbb{R}^2$ .

### 3 Systèmes différentiels linéaires homogènes à coefficients constants

On considère dans ce paragraphe des équations différentielles linéaires du type  $x' = a(x)$  avec  $a \in \mathcal{L}(E)$ . On remarque en particulier :

- qu'il s'agit d'une équation différentielle **homogène** ;
- que  $a$  **ne dépend pas de la variable**.

En considérant les matrices  $A$  et  $X$  de  $a$  et  $x$  dans une certaine base de  $E$ , ce système équivaut alors à  $X' = AX$ .

#### 3.1 Exponentielle d'un endomorphisme ou d'une matrice carrée

##### Proposition 3.1 Continuité de l'exponentielle

Les applications  $a \in \mathcal{L}(E) \mapsto \exp(a)$  et  $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{K}) \mapsto \exp(A)$  sont continues.

##### Proposition 3.2

- Soit  $a \in \mathcal{L}(E)$ . Alors  $t \mapsto \exp(ta)$  est dérivable sur  $\mathbb{R}$  et sa dérivée est  $t \mapsto a \circ \exp(ta) = \exp(ta) \circ a$ .
- Soit  $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{K})$ . Alors  $t \mapsto \exp(tA)$  est dérivable sur  $\mathbb{R}$  et sa dérivée est  $t \mapsto A \circ \exp(tA) = \exp(tA) \circ A$ .



**ATTENTION !** Si  $A : I \rightarrow \mathcal{M}_n(\mathbb{K})$  est une application dérivable, la dérivée de  $\exp \circ A$  n'est pas forcément  $A'(\exp \circ A)$  ni  $(\exp \circ A)A'$ .

##### Exemple 3.1

Posons  $A(t) = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 0 & t \end{pmatrix}$ . On vérifie que  $A(t)^n = t^{n-1}A$  pour  $n \in \mathbb{N}^*$  et donc que  $(\exp \circ A)(t) = \begin{pmatrix} 1 & \frac{e^t - 1}{t} \\ 0 & e^t \end{pmatrix}$  prolongée par continuité en 0. Ainsi  $(\exp \circ A)'(t) = \begin{pmatrix} 0 & \frac{te^t - e^t + 1}{t^2} \\ 0 & e^t \end{pmatrix}$  prolongée par continuité en 0 tandis que  $A'(t) \exp(A(t)) = \begin{pmatrix} 0 & 0 \\ 0 & e^t \end{pmatrix}$  et  $\exp(A(t))A'(t) = \begin{pmatrix} 0 & \frac{e^t - 1}{t} \\ 0 & e^t \end{pmatrix}$  prolongée par continuité en 0.

##### Exercice 3.1

Soit  $A : I \rightarrow \mathcal{M}_n(\mathbb{K})$  une application dérivable. Montrer que si  $A(t)$  et  $A'(t)$  commutent pour tout  $t \in I$ , alors

$$\forall t \in I, (\exp \circ A)'(t) = A'(t)(\exp \circ A)(t) = (\exp \circ A)(t)A'(t)$$

#### 3.2 Résolution d'un système différentiel linéaire homogène à coefficients constants

**Proposition 3.3**

Soit  $a \in \mathcal{L}(E)$ . L'ensemble des solutions sur  $\mathbb{R}$  de  $x' = a(x)$  d'inconnue  $x : \mathbb{R} \rightarrow E$  est

$$\{t \mapsto \exp(ta)(u), u \in E\}$$

De plus, l'unique solution du problème de Cauchy  $\begin{cases} x' = a(x) \\ x(t_0) = x_0 \end{cases}$  où  $(t_0, x_0) \in \mathbb{R} \times E$  est la fonction  $t \mapsto \exp((t-t_0)a)(x_0)$ .

**Proposition 3.4**

Soit  $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{K})$ . L'ensemble des solutions sur  $\mathbb{R}$  de  $X' = AX$  d'inconnue  $X : \mathbb{R} \rightarrow \mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{K})$  est

$$\{t \mapsto \exp(tA)U, U \in \mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{K})\}$$

De plus, l'unique solution du problème de Cauchy  $\begin{cases} X' = AX \\ X(t_0) = X_0 \end{cases}$  où  $(t_0, X_0) \in \mathbb{R} \times \mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{K})$  est la fonction

$$t \mapsto \exp((t-t_0)A)X_0$$

**Exemple 3.2 Cas diagonalisable**

On considère le système différentiel

$$\begin{cases} x' = 2y + 2z \\ y' = -x + 3y - z \\ z' = 3x - 3y + z \end{cases}$$

En posant  $X = \begin{pmatrix} x \\ y \\ z \end{pmatrix}$  et  $A = \begin{pmatrix} 0 & 2 & 2 \\ -1 & 3 & -1 \\ 3 & -3 & 1 \end{pmatrix}$ , ce système équivaut à  $X' = AX$ . Le polynôme caractéristique de A est

$$\begin{aligned} \chi_A &= \begin{vmatrix} X & -2 & -2 \\ 1 & X-3 & 1 \\ -3 & 3 & X-1 \end{vmatrix} = \begin{vmatrix} X-2 & X-2 & X-2 \\ 1 & X-3 & 1 \\ -3 & 3 & X-1 \end{vmatrix} & L_1 \leftarrow L_1 + L_2 + L_3 \\ &= (X-2) \begin{vmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 1 & X-3 & 1 \\ -3 & 3 & X-1 \end{vmatrix} = (X-2) \begin{vmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 1 & X-4 & 0 \\ -3 & 6 & X+2 \end{vmatrix} & \begin{matrix} C_2 \leftarrow C_2 - C_1 \\ C_3 \leftarrow C_3 - C_1 \end{matrix} \\ &= (X-2)(X-4)(X+2) \end{aligned}$$

La matrice A est donc diagonalisable et, en étudiant les sous espaces propres, on trouve que  $A = PDP^{-1}$  avec

$$D = \begin{pmatrix} -2 & 0 & 0 \\ 0 & 2 & 0 \\ 0 & 0 & 4 \end{pmatrix} \quad P = \begin{pmatrix} -1 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & -1 \\ 1 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

En posant  $Y = P^{-1}X$ , le système  $X' = AX$  équivaut à  $Y' = DY$ . Les solutions de ce système sont les fonctions

$$t \mapsto \exp(tD) \begin{pmatrix} a \\ b \\ c \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} e^{-2t} & 0 & 0 \\ 0 & e^{2t} & 0 \\ 0 & 0 & e^{4t} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} a \\ b \\ c \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} ae^{-2t} \\ be^{2t} \\ ce^{4t} \end{pmatrix}$$

avec  $(a, b, c) \in \mathbb{R}^3$ . On en déduit que les solutions du système  $X' = AX$  sont les fonctions

$$t \mapsto P \begin{pmatrix} ae^{-2t} \\ be^{2t} \\ ce^{4t} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -1 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & -1 \\ 1 & 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} ae^{-2t} \\ be^{2t} \\ ce^{4t} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -ae^{-2t} + be^{2t} \\ be^{2t} - ce^{4t} \\ ae^{-2t} + ce^{4t} \end{pmatrix}$$

**Exemple 3.3 Cas trigonalisable**

On considère le système différentiel

$$\begin{cases} x' = x - 3y + 4z \\ y' = 4x - 7y + 8z \\ z' = 6x - 7y + 7z \end{cases}$$

En posant  $X = \begin{pmatrix} x \\ y \\ z \end{pmatrix}$  et  $A = \begin{pmatrix} 1 & -3 & 4 \\ 4 & -7 & 8 \\ 6 & -7 & 7 \end{pmatrix}$ , ce système équivaut à  $X' = AX$ . Le polynôme caractéristique de  $A$  est

$$\chi_A = (X + 1)^2(X - 3)$$

En posant  $v_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 2 \end{pmatrix}$  et  $v_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 1 \end{pmatrix}$ , on a

$$\text{Ker}(A - 3I_3) = \text{vect}(v_1)$$

$$\text{Ker}(A + I_3) = \text{vect}(v_2)$$

On cherche ensuite un vecteur  $v_3$  tel que  $(A + I_3)v_3 = v_2$  et on trouve  $v_3 = \begin{pmatrix} -1 \\ -1 \\ 0 \end{pmatrix}$ . Ainsi  $A = PTP^{-1}$  avec

$$T = \begin{pmatrix} 3 & 0 & 0 \\ 0 & -1 & 1 \\ 0 & 0 & -1 \end{pmatrix}$$

$$P = \begin{pmatrix} 1 & 1 & -1 \\ 2 & 2 & -1 \\ 2 & 1 & 0 \end{pmatrix}$$

En posant  $Y = P^{-1}X$ , le système  $X' = AX$  équivaut à  $Y' = TY$ . En posant  $D = \begin{pmatrix} 3 & 0 & 0 \\ 0 & -1 & 0 \\ 0 & 0 & -1 \end{pmatrix}$  et  $N = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}$ ,

$T = D + N$ , les matrices  $D$  et  $N$  commutent et  $N^2 = 0$ . Ainsi

$$\exp(tT) = \exp(tD)\exp(tN) = \exp(tD)(I_3 + tN) = \begin{pmatrix} e^{3t} & 0 & 0 \\ 0 & e^{-t} & te^{-t} \\ 0 & 0 & e^{-t} \end{pmatrix}$$

Les solutions du système  $Y' = TY$  sont donc les fonctions

$$t \mapsto \exp(tT) \begin{pmatrix} a \\ b \\ c \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} e^{3t} & 0 & 0 \\ 0 & e^{-t} & te^{-t} \\ 0 & 0 & e^{-t} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} a \\ b \\ c \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} ae^{3t} \\ be^{-t} + cte^{-t} \\ ce^{-t} \end{pmatrix}$$

avec  $(a, b, c) \in \mathbb{R}^3$ . On en déduit que les solutions du système  $X' = AX$  sont les fonctions

$$t \mapsto P \begin{pmatrix} ae^{3t} \\ be^{-t} + cte^{-t} \\ ce^{-t} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & 1 & -1 \\ 2 & 2 & -1 \\ 2 & 1 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} ae^{3t} \\ be^{-t} + cte^{-t} \\ ce^{-t} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} ae^{3t} + be^{-t} + c(t-1)e^{-t} \\ 2ae^{3t} + 2be^{-t} + c(2t-1)e^{-t} \\ 2ae^{3t} + be^{-t} + cte^{-t} \end{pmatrix}$$

**Exercice 3.2**

Soit  $(A, B) \in \mathcal{M}_n(\mathbb{K})^2$  tel que  $A$  et  $B$  commutent. En considérant l'équation différentielle  $X' = (A + B)X$  d'inconnue  $X : \mathbb{R} \mapsto \mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{K})$ , montrer que  $\exp(A + B) = \exp(A)\exp(B)$ .

**4 Variation des constantes**

On revient dans ce paragraphe au cas général, c'est-à-dire qu'on considère

- des équations différentielles du type  $x' = a(t)(x) + b(t)$  où  $a : I \rightarrow \mathcal{L}(E)$  et  $b : I \rightarrow E$  sont des fonctions continues ;
- ou leurs versions matricielles  $X' = A(t)X + B$  où  $A : I \rightarrow \mathcal{M}_n(\mathbb{K})$  et  $B : I \rightarrow \mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{K})$  sont également des fonctions continues.

**Proposition 4.1 Variation des constantes**

Soit  $(x_1, \dots, x_n)$  une **base** de l'espace vectoriel des solutions de l'équation homogène  $x' = a(t)(x)$ . Les solutions de  $x' = a(t)(x) + b(t)$  sont les fonctions  $\sum_{k=1}^n c_k x_k$  où  $c_1, \dots, c_n$  sont des fonctions dérivables sur  $I$  à valeurs dans  $\mathbb{K}$  vérifiant

$$\sum_{k=1}^n c'_k x_k = b$$

On a bien évidemment une version matricielle.

**Proposition 4.2 Variation des constantes**

Soit  $(X_1, \dots, X_n)$  une **base** de l'espace vectoriel des solutions de l'équation homogène  $X' = A(t)X$ . Les solutions de  $X' = A(t)X + B(t)$  sont les fonctions  $X = \sum_{k=1}^n c_k X_k$  où  $c_1, \dots, c_n$  sont des fonctions dérivables sur  $I$  à valeurs dans  $\mathbb{K}$  vérifiant

$$\sum_{k=1}^n c'_k X_k = B$$

**Corollaire 4.1 Cas particulier des systèmes différentiels à coefficients constants**

- Soit  $a \in \mathcal{L}(E)$ . Alors  $x$  est solution de  $x' = a(x) + b(t)$  si et seulement si il existe  $u : \mathbb{R} \rightarrow E$  dérivable telle que

$$x = \exp(ta)(u) \quad \text{et} \quad u' = \exp(-ta)(b)$$

- Soit  $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{K})$ . Alors  $X$  est solution de  $X' = AX + B(t)$  si et seulement si il existe  $U : \mathbb{R} \rightarrow \mathcal{M}_{n,1}(\mathbb{K})$  dérivable telle que

$$X = \exp(tA)U \quad \text{et} \quad U' = \exp(-tA)B$$

**REMARQUE.** On peut alors préciser que l'unique solution du problème de Cauchy  $\begin{cases} x' = a(x) + b(t) \\ x(t_0) = x_0 \end{cases}$  est

$$t \mapsto \exp(ta) \left( \int_{t_0}^t \exp(-sa)(b(s)) \, ds \right) + \exp((t - t_0)a)(x_0) = \int_{t_0}^t \exp((t - s)a)(b(s)) \, ds + \exp((t - t_0)a)(x_0)$$



et que l'unique solution du problème de Cauchy  $\begin{cases} X' = AX + B(t) \\ X(t_0) = X_0 \end{cases}$  est

$$t \mapsto \exp(tA) \left( \int_{t_0}^t \exp(-sA) B(s) \, ds \right) + \exp((t - t_0)A) X_0 = \int_{t_0}^t \exp((t - s)A) B(s) \, ds + \exp((t - t_0)A) X_0$$

## 5 Equations différentielles linéaires scalaires

### 5.1 Equations différentielles linéaires scalaires résolues

#### Définition 5.1 Equation différentielle linéaire scalaire d'ordre $n$

On appelle équation différentielle linéaire **scalaire** d'ordre  $n$  une équation de la forme

$$x^{(n)} = \sum_{k=0}^{n-1} a_k(t) x^{(k)} + b(t)$$

où

- $a_0, \dots, a_{n-1}$  sont des fonctions continues sur  $I$  à valeurs dans  $\mathbb{K}$ ;
- $b$  est une fonction continue sur  $I$  à valeurs dans  $\mathbb{K}$ ;
- $x$  est une fonction inconnue de classe  $\mathcal{C}^n$  sur  $I$  à valeurs dans  $\mathbb{K}$ .

#### Proposition 5.1 Lien entre équation différentielle linéaire scalaire et système différentiel linéaire

On considère l'équation différentielle linéaire **scalaire**

$$x^{(n)} = \sum_{k=0}^{n-1} a_k(t) x^{(k)} + b(t)$$

Alors en posant

$$A(t) = \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 & \cdots & 0 \\ \vdots & \ddots & 1 & \ddots & \vdots \\ \vdots & & \ddots & \ddots & 0 \\ 0 & \cdots & \cdots & 0 & 1 \\ a_0(t) & \cdots & \cdots & \cdots & a_{n-1}(t) \end{pmatrix} \quad B(t) = \begin{pmatrix} 0 \\ \vdots \\ 0 \\ b(t) \end{pmatrix} \quad X(t) = \begin{pmatrix} x(t) \\ x'(t) \\ \vdots \\ x^{(n-1)}(t) \end{pmatrix}$$

l'équation initiale équivaut à

$$X' = A(t)X + B(t)$$

**Exemple 5.1**

L'équation différentielle linéaire scalaire

$$x^{(3)} - e^t x'' + t^2 x' + x = \sin(t)$$

équivalent à

$$X' = \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \\ -1 & -t^2 & e^t \end{pmatrix} X + \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ \sin(t) \end{pmatrix}$$

avec  $X = \begin{pmatrix} x \\ x' \\ x'' \end{pmatrix}$ .

**Corollaire 5.1 Problème de Cauchy pour une équation différentielle linéaire scalaire**

Un problème de Cauchy pour une équation différentielle linéaire scalaire d'ordre  $n$  est de la forme

$$\begin{cases} x^{(n)} = \sum_{k=0}^{n-1} a_k(t) x^{(k)} + b(t) \\ \forall k \in \llbracket 0, n-1 \rrbracket, x^{(k)}(t_0) = x_k \end{cases}$$

avec  $t_0 \in I$  et  $(x_0, \dots, x_{n-1}) \in \mathbb{K}^n$ .

**Exemple 5.2**

Voici un exemple de problème de Cauchy pour une équation différentielle scalaire linéaire d'ordre 2.

$$\begin{cases} y'' + e^t y' - \ln(t)y = \operatorname{th} t \\ y(1) = 2 \\ y'(1) = -1 \\ y''(1) = 0 \end{cases}$$

**Corollaire 5.2 Théorème de Cauchy linéaire**

Soient

- $a_0, \dots, a_{n-1}$  des fonctions continues sur  $I$  à valeurs dans  $\mathbb{K}$ ;
- $b$  une fonction continue sur  $I$  à valeurs dans  $\mathbb{K}$ ;
- $t_0 \in I$ ;
- $(x_0, \dots, x_{n-1}) \in \mathbb{K}^n$ ;

Le problème de Cauchy

$$\begin{cases} x^{(n)} = \sum_{k=0}^{n-1} a_k(t)x^{(k)} + b(t) \\ \forall k \in \llbracket 0, n-1 \rrbracket, x^{(k)}(t_0) = x_k \end{cases}$$

admet une unique solution.

**Proposition 5.2 Equation différentielles scalaires homogènes**

Soient  $a_0, \dots, a_{n-1}$  sont des fonctions continues sur  $I$  à valeurs dans  $\mathbb{K}$ .

L'ensemble des solutions l'équation différentielle **scalaire homogène**

$$x^{(n)} = \sum_{k=0}^{n-1} a_k(t)x^{(k)}$$

est un sous-espace vectoriel de  $\mathbb{K}^I$  de dimension  $n$ .

**Proposition 5.3 Equation différentielles scalaires avec second membre**

Soient  $a_0, \dots, a_{n-1}, b$  sont des fonctions continues sur  $I$  à valeurs dans  $\mathbb{K}$ .

L'ensemble des solutions l'équation différentielle **scalaire**

$$x^{(n)} = \sum_{k=0}^{n-1} a_k(t)x^{(k)} + b(t)$$

est un sous-espace affine de  $\mathbb{K}^I$  de direction le sous-espace vectoriel des solutions de l'équation différentielle homogène associée.

**5.2 Equations différentielles linéaires scalaires non résolues**

On dit qu'une équation différentielle linéaire scalaire d'ordre  $n$  est **non résolue** si le coefficient de la dérivée  $n^{\text{ème}}$  de l'inconnue peut s'annuler sur l'intervalle considéré.

**Exemple 5.3**

L'équation différentielle  $x(x-1)y'' + 3xy' + y = 0$  est non résolue sur  $\mathbb{R}$  mais elle l'est sur les intervalles  $] -\infty, 0[$ ,  $]0, 1[$  et  $]1, +\infty[$ .



**ATTENTION!** Tous les résultats précédents (existence de solution, dimension de l'ensemble des solutions) ne s'appliquent plus dans le cas d'équations différentielles non résolues.

**Exemple 5.4**

L'ensemble des solutions sur  $\mathbb{R}_+^*$  de l'équation différentielle  $xy' = 1$  est bien un sous-espace affine de  $\mathbb{R}^{\mathbb{R}_+^*}$  de dimension 1, à savoir  $\ln + \text{vect}(x \mapsto 1)$  mais cette équation différentielle n'admet évidemment **aucune solution** sur  $\mathbb{R}$  (considérer  $x = 0$ ).

**Exemple 5.5**

Considérons l'équation  $xy'' + 2y' = 0$ . Cette équation équivaut à  $(xy)'' = 0$ . On trouve ainsi aisément que l'ensemble des solutions sur  $\mathbb{R}_+^*$  est un sous-espace vectoriel de  $\mathbb{R}^{\mathbb{R}_+^*}$  de dimension 2, à savoir  $\text{vect}(x \mapsto 1/x, x \mapsto 1)$ .

Une solution sur  $\mathbb{R}$  doit être solution sur  $\mathbb{R}_+^*$  donc de la forme  $x \mapsto \frac{\lambda}{x} + \mu$  mais la continuité de cette solution en 0 impose  $\lambda = 0$ . On en déduit que l'ensemble des solutions sur  $\mathbb{R}$  est  $\text{vect}(x \mapsto 1)$  qui est de dimension 1.

**Méthode Recherche de solutions développables en séries entières**

On peut rechercher des solutions d'une équation différentielle linéaire scalaire à coefficients **polynomiaux** sous forme de fonctions développables en séries entières. On rappelle que si

$$f(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} a_n x^n$$

alors  $f$  est de classe  $\mathcal{C}^\infty$  sur  $] -R, R[$  où  $R$  désigne le rayon de convergence. De plus,

$$\begin{aligned} f'(x) &= \sum_{n=1}^{+\infty} n a_n x^{n-1} = \sum_{n=0}^{+\infty} (n+1) a_{n+1} x^n \\ f''(x) &= \sum_{n=2}^{+\infty} n(n-1) a_n x^{n-2} = \sum_{n=1}^{+\infty} (n+1) n a_{n+1} x^{n-1} = \sum_{n=0}^{+\infty} (n+2)(n+1) a_{n+2} x^n \end{aligned}$$

Enfin, on peut tirer parti de l'**unicité** du développement en série entière pour déterminer des relations de récurrences entre les  $a_n$ .

**REMARQUE.** On peut en fait indexer toutes les sommes à partir de 0 car les premiers termes sont nuls. Le seul «problème» consiste alors en les éventuelles puissances négatives mais ce n'est pas un réel problème comme le montre l'exemple suivant.

**Exemple 5.6**

On considère l'équation différentielle

$$(E) : x(x-1)y'' + 3xy' + y = 0$$

On cherche une solution développable en série entière au voisinage de l'origine.

Soit  $\sum_{n \in \mathbb{N}} a_n x^n$  de rayon de convergence  $R > 0$  de somme  $f(x)$ .

On sait que

$$\forall x \in ]-R, R[, f'(x) = \sum_{n=1}^{+\infty} n a_n x^{n-1}$$

donc

$$\forall x \in ]-R, R[, x f'(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} n a_n x^n$$

De même

$$\forall x \in ]-R, R[, f''(x) = \sum_{n=2}^{+\infty} n(n-1) a_n x^{n-2} = \sum_{n=1}^{+\infty} (n+1) n a_{n+1} x^{n-1}$$

donc

$$\forall x \in ]-R, R[, x(x-1)f''(x) = x^2 f''(x) - x f''(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} n(n-1) a_n x^n - \sum_{n=0}^{+\infty} (n+1) n a_{n+1} x^n$$

D'un point de vue technique, l'idée essentielle est de ne faire apparaître **que des termes en  $x^n$**  (pas de «mélange» de puissances). Finalement,

$$\forall x \in ]-R, R[, x(x-1)f''(x) + 3x f'(x) + f(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} [n(n-1)a_n - (n+1)na_{n+1} + 3na_n + a_n] x^n$$

ou encore

$$\forall x \in ]-R, R[, x(x-1)f''(x) + 3x f'(x) + f(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} [(n+1)^2 a_n - (n+1)na_{n+1}] x^n$$

L'**unicité du développement en série entière** permet alors d'affirmer que  $f$  est solution de (E) si et seulement si

$$\forall n \in \mathbb{N}, (n+1)^2 a_n = n(n+1)a_{n+1}$$

ou encore

$$\forall n \in \mathbb{N}, (n+1)a_n = na_{n+1}$$

On vérifie aisément que cela équivaut à  $\forall n \in \mathbb{N}, a_n = na_1$ . Ainsi les solutions de (E) développables en série entière sont les fonctions

$$x \mapsto \lambda \sum_{n=0}^{+\infty} n x^n = \frac{\lambda x}{(1-x)^2}$$

avec  $\lambda \in \mathbb{R}$ .

### 5.3 Cas des équations différentielles linéaires scalaires d'ordre 2

#### Proposition 5.4 Méthode de variation des constantes

Soient  $a$ ,  $b$  et  $c$  des fonctions continues sur  $I$  à valeurs dans  $\mathbb{K}$ . Si  $(x_1, x_2)$  est une base de l'espace vectoriel des solutions de l'équation différentielle homogène  $x'' + a(t)x' + b(t)x = 0$ , alors les solutions de l'équation différentielle  $x'' + a(t)x' + b(t)x = c(t)$  sont les fonctions  $\lambda_1 x_1 + \lambda_2 x_2$  où  $\lambda_1$  et  $\lambda_2$  sont des fonctions dérivables sur  $I$  à valeurs dans  $\mathbb{K}$  vérifiant

$$\begin{cases} \lambda_1' x_1 + \lambda_2' x_2 = 0 \\ \lambda_1' x_1' + \lambda_2' x_2' = c \end{cases}$$

**REMARQUE.** On peut calculer  $\lambda'_1$  et  $\lambda'_2$  à l'aide des règles de Cramer :

$$\begin{cases} \lambda'_1 = -\frac{cx_2}{x_1x'_2 - x'_1x_2} \\ \lambda'_2 = \frac{cx_1}{x_1x'_2 - x'_1x_2} \end{cases}$$

### Exemple 5.7

On considère l'équation différentielle

$$y'' - 3y' + 2y = \frac{1}{1 + e^{-2t}}$$

Le polynôme caractéristique associé à cette équation différentielle linéaire à coefficients constantes est  $X^2 - 3X + 2 = (X - 1)(X - 2)$  donc une base de l'espace vectoriel des solutions de l'équation homogène est  $(f_1, f_2) = (t \mapsto e^t, t \mapsto e^{2t})$ . On cherche donc une solution de la forme  $\lambda_1 f_1 + \lambda_2 f_2$  avec  $\lambda_1$  et  $\lambda_2$  dérivables sur  $\mathbb{R}_+^*$  vérifiant

$$\begin{cases} \lambda'_1 f_1 + \lambda'_2 f_2 = 0 \\ \lambda'_1 f'_1 + \lambda'_2 f'_2 = \frac{1}{1 + e^{-2t}} \end{cases}$$

ou encore

$$\begin{cases} \lambda'_1 e^t + \lambda'_2 e^{2t} = 0 \\ \lambda'_1 e^t + 2\lambda'_2 e^{2t} = \frac{1}{1 + e^{-2t}} \end{cases}$$

ce qui équivaut à

$$\begin{cases} \lambda'_1 = -\frac{e^{-t}}{1 + e^{-2t}} \\ \lambda'_2 = \frac{e^{-2t}}{1 + e^{-2t}} \end{cases}$$

On peut choisir

$$\begin{cases} \lambda_1 = \arctan(e^{-t}) \\ \lambda_2 = -\frac{1}{2} \ln(1 + e^{-2t}) \end{cases}$$

Une solution particulière est donc

$$\varphi : t \mapsto \arctan(e^{-t})e^t - \frac{1}{2} \ln(1 + e^{-2t})e^{2t}$$

et l'ensemble des solutions est  $\varphi + \text{vect}(f_1, f_2)$ .

**Exemple 5.8**

On considère l'équation différentielle

$$(1+t^2)y'' + 4ty' + 2y = 1+t^2$$

On résout d'abord l'équation homogène

$$(1+t^2)y'' + 4ty' + 2y = 0$$

On recherche des solutions développables en séries entières. Une fonction  $y : t \mapsto \sum_{n=0}^{+\infty} a_n t^n$  est solution si et seulement si  $a_{n+2} = -a_n$ . On en déduit que  $a_{2n} = (-1)^n a_0$  et que  $a_{2n+1} = (-1)^n a_1$ . Les solutions développables en séries entières sont donc les fonctions  $t \mapsto \frac{a_0 + a_1 t}{1+t^2}$ . En posant  $y_1 : t \mapsto \frac{1}{1+t^2}$  et  $y_2 : t \mapsto \frac{t}{1+t^2}$ ,  $(y_1, y_2)$  est une base de l'espace vectoriel des solutions de l'équation homogène. On trouve alors une solution particulière en appliquant la méthode de variation des constantes. On recherche une solution de la forme  $\lambda_1 y_1 + \lambda_2 y_2$  avec  $\lambda_1$  et  $\lambda_2$  dérivables vérifiant

$$\begin{cases} \lambda_1' y_1 + \lambda_2' y_2 = 0 \\ \lambda_1' y_1' + \lambda_2' y_2' = 1 \end{cases}$$

ou encore

$$\begin{cases} \frac{\lambda_1'}{1+t^2} + \frac{t\lambda_2'}{1+t^2} = 0 \\ \frac{-2t\lambda_1'}{(1+t^2)^2} + \frac{(1-t^2)\lambda_2'}{(1+t^2)^2} = 1 \end{cases}$$

ou enfin

$$\begin{cases} \lambda_1' + t\lambda_2' = 0 \\ -2t\lambda_1' + (1-t^2)\lambda_2' = (1+t^2)^2 \end{cases}$$

On trouve

$$\begin{cases} \lambda_1' = -t - t^3 \\ \lambda_2' = 1 + t^2 \end{cases}$$

On peut choisir

$$\begin{cases} \lambda_1 = -\frac{t^2}{2} - \frac{t^4}{4} \\ \lambda_2 = t + \frac{t^3}{3} \end{cases}$$

On en déduit qu'une solution particulière est

$$t \mapsto \frac{t^2}{2(1+t^2)} + \frac{t^4}{12(1+t^2)}$$

Les solutions sont donc les fonctions

$$t \mapsto \frac{t^2}{2(1+t^2)} + \frac{t^4}{12(1+t^2)} + \frac{at+b}{1+t^2}$$

**REMARQUE.** On peut faire beaucoup plus simple en reconnaissant une formule de Leibniz : l'équation équivaut à

$$((1+t^2)y)'' = 1+t^2$$

Ceci équivaut donc à l'existence de  $(a, b) \in \mathbb{R}^2$  tel que

$$(1+t^2)y = \frac{t^2}{2} + \frac{t^4}{12} + at + b$$

Les solutions sont donc les fonctions

$$t \mapsto \frac{t^2}{2(1+t^2)} + \frac{t^4}{12(1+t^2)} + \frac{at+b}{1+t^2}$$

**Définition 5.2 Wronskien de deux solutions d'une équation scalaire homogène d'ordre 2**

Soient  $a$  et  $b$  des fonctions continues sur  $I$  à valeurs dans  $\mathbb{K}$ . Si  $x_1$  et  $x_2$  sont deux solutions de l'équation différentielle  $x'' + a(t)x' + b(t)x = 0$ , on appelle **wronskien** du couple de solutions  $(x_1, x_2)$  la fonction

$$W = \begin{vmatrix} x_1 & x_2 \\ x_1' & x_2' \end{vmatrix} = x_1 x_2' - x_1' x_2$$

**REMARQUE.** Le wronskien est en particulier dérivable sur  $I$  et

$$W' = x_1 x_2'' - x_1'' x_2 = x_1(-ax_2' - bx_2) - x_2(-ax_1' - bx_1) = -aW$$

$W$  vérifie donc une équation différentielle linéaire et, en vertu du théorème de Cauchy linéaire, on a deux alternatives :

- soit le wronskien est constamment nul sur  $I$ ;
- soit il ne s'annule pas sur  $I$ .

Dans le premier cas, la famille  $(x_1, x_2)$  est liée tandis que dans le second cas,  $(x_1, x_2)$  est une base de l'espace vectoriel des solutions.

On peut également préciser une expression du wronskien : en fixant  $t_0 \in I$ ,

$$\forall t \in I, W(t) = W(t_0) \exp\left(-\int_{t_0}^t a(s) \, ds\right)$$

**Exemple 5.9**

Soit  $q : I \rightarrow \mathbb{K}$  continue Soient  $x_1$  et  $x_2$  deux solutions de l'équation différentielle  $x'' + q(t)x = 0$ . Le wronskien du couple  $(x_1, x_2)$  est

$$W = x_1 x_2' - x_1' x_2$$

De plus,  $W$  est dérivable sur  $I$  et

$$W' = x_1 x_2'' - x_1'' x_2 = -q x_1 x_2 + q x_1 x_2 = 0$$

Le wronskien est donc constant sur  $I$ .