

TD d'optimisation  
ENSAE  
1A

Gabriel Romon

Version du 3 mars 2017

## 1. Différentielle

### Exercice 1.1

Soit  $f : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}, (x, y) \mapsto \frac{x^3 y^3}{x^2 + y^2}$  si  $(x, y) \neq (0, 0)$  et  $f(0, 0) = 0$ .

1. Montrer que  $f$  est  $C^1$ .
2. Montrer que  $f$  est  $C^2$ .

1. Les dérivées partielles de  $f$  en  $(x, y) \neq (0, 0)$  sont clairement définies et données par  $\frac{\partial f}{\partial x}(x, y) = \frac{x^2 y^3 (x^2 + 3y^2)}{(x^2 + y^2)^2}$  et  $\frac{\partial f}{\partial y}(x, y) = \frac{x^3 y^2 (3x^2 + y^2)}{(x^2 + y^2)^2}$ . Comme pour tout  $h \in \mathbb{R}, f(0, h) = f(h, 0) = f(0, 0) = 0$ , les dérivées partielles de  $f$  existent en  $(0, 0)$  avec  $\frac{\partial f}{\partial x}(0, 0) = \frac{\partial f}{\partial y}(0, 0) = 0$ .

$(x, y) \mapsto \frac{\partial f}{\partial x}(x, y)$  et  $(x, y) \mapsto \frac{\partial f}{\partial y}(x, y)$  sont clairement continues en tout  $(x, y) \neq (0, 0)$ . Montrons que ces deux fonctions sont continues en  $(0, 0)$ .

Pour  $(x, y) \in \mathbb{R}^2$ , si  $x = 0$  ou  $y = 0$ ,  $\frac{\partial f}{\partial x}(x, y) = \frac{\partial f}{\partial y}(x, y) = 0$ . Dans la suite on supposera donc sans perte de généralité que  $x \neq 0$  et  $y \neq 0$ .

$$\left| \frac{\partial f}{\partial x}(x, y) \right| = \left| \frac{x^2 y^3 (x^2 + 3y^2)}{(x^2 + y^2)^2} \right| \leq \frac{|y|^3 x^4}{(x^2 + y^2)^2} + 3 \frac{|y|^5 x^2}{(x^2 + y^2)^2} \leq |y|^3 + 3|y|x^2 \xrightarrow{(x, y) \rightarrow (0, 0)} 0$$

$$\left| \frac{\partial f}{\partial y}(x, y) \right| \leq |x|^3 + 3|x|y^2 \xrightarrow{(x, y) \rightarrow (0, 0)} 0 \text{ par symétrie.}$$

$f$  admet donc des dérivées partielles qui sont définies et continues en tout point de  $\mathbb{R}^2$ .  $f$  est donc  $C^1$ .

2.  $(x, y) \mapsto \frac{\partial f}{\partial x}(x, y)$  et  $(x, y) \mapsto \frac{\partial f}{\partial y}(x, y)$  admettent clairement des dérivées partielles en tout  $(x, y) \neq (0, 0)$  données par

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x^2}(x, y) = -\frac{2xy^5(x^2 - 3y^2)}{(x^2 + y^2)^3}$$

$$\frac{\partial^2 f}{\partial yx}(x, y) = \frac{x^2 y^2(3x^4 + 14x^2 y^2 + 3y^4)}{(x^2 + y^2)^3}$$

et par symétrie

$$\frac{\partial^2 f}{\partial y^2}(x, y) = \frac{2x^5 y(3x^2 - y^2)}{(x^2 + y^2)^3}$$

$$\frac{\partial^2 f}{\partial xy}(x, y) = \frac{x^2 y^2(3x^4 + 14x^2 y^2 + 3y^4)}{(x^2 + y^2)^3}$$

Comme pour tout  $h \in \mathbb{R}$ ,

$$\frac{\partial f}{\partial x}(0, h) = \frac{\partial f}{\partial x}(h, 0) = \frac{\partial f}{\partial y}(0, h) = \frac{\partial f}{\partial y}(h, 0) = \frac{\partial f}{\partial x}(0, 0) = \frac{\partial f}{\partial y}(0, 0) = 0$$

## 1.. DIFFÉRENTIELLE

---

les dérivées partielles de  $\frac{\partial f}{\partial x}$  et  $\frac{\partial f}{\partial y}$  existent en  $(0, 0)$  avec

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x^2}(0, 0) = \frac{\partial^2 f}{\partial y^2}(0, 0) = \frac{\partial^2 f}{\partial xy}(0, 0) = \frac{\partial^2 f}{\partial yx}(x, y) = 0$$

Les quatre dérivées partielles sont clairement continues en tout  $(x, y) \neq (0, 0)$ . Montrons qu'elles sont continues en  $(0, 0)$ .

Soit  $(x, y) \in \mathbb{R}^2$ . Comme précédemment on peut supposer que  $x \neq 0$  et  $y \neq 0$ .

**Lemme :**  $\forall (x, y) \in \mathbb{R}^2, |xy| \leq \|(x, y)\|_2^2$

Preuve : Conséquence de l'inégalité  $ab \leq \frac{a^2+b^2}{2}$  avec  $a = |x|$  et  $b = |y|$ .

$$\begin{aligned} \left| \frac{\partial^2 f}{\partial x^2}(x, y) \right| &= \left| \frac{2xy^5(x^2 - 3y^2)}{(x^2 + y^2)^3} \right| \leq \frac{2|x|^3|y|^5}{(x^2 + y^2)^3} + \frac{6|x||y|^7}{(x^2 + y^2)^3} \\ &= \frac{2y^2(|xy|)^3}{\|(x, y)\|_2^6} + \frac{6|x||y|^7}{(x^2 + y^2)^3} \\ &\leq \underbrace{\frac{2y^2\|(x, y)\|_2^6}{\|(x, y)\|_2^6}}_{\text{Lemme}} + 6|x||y| \\ &= 2y^2 + 6|x||y| \xrightarrow{(x, y) \rightarrow (0, 0)} 0 \end{aligned}$$

La symétrie permet de conclure  $\left| \frac{\partial^2 f}{\partial x^2}(x, y) \right| \leq 2x^2 + 6|x||y| \xrightarrow{(x, y) \rightarrow (0, 0)} 0$

et une technique similaire donne

$$\left| \frac{\partial^2 f}{\partial yx}(x, y) \right| \leq 3y^2 + 14\|(x, y)\|_2^2 + 3x^2 \xrightarrow{(x, y) \rightarrow (0, 0)} 0$$

$\frac{\partial f}{\partial x}$  et  $\frac{\partial f}{\partial y}$  admettent des dérivées partielles qui sont définies et continues en tout point de  $\mathbb{R}^2$ . Donc  $f$  est  $C^2$ .

### Exercice 1.2

Soit  $f : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}, (x, y) \mapsto (x^2 + y^2)^x$  si  $(x, y) \neq (0, 0)$ .  
Montrer que  $f$  est différentiable sur  $\mathbb{R}^2 \setminus \{(0, 0)\}$ .

$f$  admet clairement des dérivées partielles en tout  $(x, y) \neq (0, 0)$  données par  $\frac{\partial f}{\partial x}(x, y) = (x^2 + y^2)^x \left( \frac{2x^2}{x^2 + y^2} + \log(x^2 + y^2) \right)$  et  $\frac{\partial f}{\partial y}(x, y) = 2xy(x^2 + y^2)^{x-1}$ . Par composition et multiplication de fonction continues, ces dérivées partielles sont continues en tout  $(x, y) \neq (0, 0)$ .

$f$  est donc différentiable en tout  $(x, y) \neq (0, 0)$  et son gradient en  $(x, y)$  est

$$\left( (x^2 + y^2)^x \left( \frac{2x^2}{x^2 + y^2} + \log(x^2 + y^2) \right), 2xy(x^2 + y^2)^{x-1} \right)$$

**Exercice 1.3**

Soit  $f : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}^2, (x, y) \mapsto (x + y, xy)$ . Calculer la différentielle de  $f$ .

Pour  $(x, y) \in \mathbb{R}^2$  fixé et  $(h_1, h_2) \in \mathbb{R}^2$ ,

$$f((x, y) + (h_1, h_2)) = f(x + h_1, y + h_2) = f(x, y) + \begin{pmatrix} h_1 + h_2 \\ yh_1 + xh_2 \end{pmatrix}^T + \begin{pmatrix} 0 \\ h_1h_2 \end{pmatrix}^T$$

Le candidat pour la différentielle de  $f$  en  $(x, y)$  est donc  $(h_1, h_2) \mapsto \left[ \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ y & x \end{pmatrix} \begin{pmatrix} h_1 \\ h_2 \end{pmatrix} \right]^T$ .

Il suffit de prouver que  $\frac{\|(0, h_1h_2)\|}{\|(h_1, h_2)\|} \xrightarrow{\|(h_1, h_2)\| \rightarrow 0} 0$

Le choix de la norme n'importe pas étant donné l'équivalence des normes en dimension finie. On choisit par exemple la norme 2.

$$\frac{\|(0, h_1h_2)\|}{\|(h_1, h_2)\|} = \frac{|h_1h_2|}{\sqrt{h_1^2 + h_2^2}} \leq |h_1| \rightarrow 0$$

en minorant trivialement le dénominateur par  $\sqrt{h_2^2}$ .

**Exercice 1.4**

Soit  $f : M_n(\mathbb{R}) \rightarrow M_n(\mathbb{R}), X \mapsto X^T X$ . Calculer la différentielle de  $f$ .

Pour  $X \in M_n(\mathbb{R})$  et  $H \in M_n(\mathbb{R})$ ,  $f(X + H) = f(X) + X^T H + H^T X + H^T H$ .

Le candidat pour la différentielle de  $f$  en  $X$  est donc  $H \mapsto X^T H + H^T X$ .

Il suffit de prouver que  $\frac{\|H^T H\|}{\|H\|} \xrightarrow{\|H\| \rightarrow 0} 0$ .

Par équivalence des normes en dimension finie, on choisit n'importe quelle norme d'opérateur sur  $M_n(\mathbb{R})$  (celle qui dérive de la norme 2 par exemple). Alors

$\frac{\|H^T H\|}{\|H\|} \leq \frac{\|H^T\| \|H\|}{\|H\|} = \|H^T\|$ . La transposée étant linéaire, elle est continue en 0, donc  $\|H^T\| \xrightarrow{\|H\| \rightarrow 0} 0$  ce qui achève la preuve.

**Exercice 1.5**

Soient  $f, g \in C^1(\mathbb{R}^2, \mathbb{R})$  et  $\varphi : \mathbb{R}^3 \rightarrow \mathbb{R}^2, (x, y, z) \mapsto (f(x^2y, z^2x), g(x^y, zx))$ . Calculer, si elle existe, la différentielle de  $f$ .

Posons  $\gamma : (x, y, z) \mapsto (x^2y, z^2x)$  et  $\delta : (x, y, z) \mapsto (x^y, zx)$ .

$\gamma$  et  $f$  sont différentiables en tous points de leurs domaines, donc  $f \circ \gamma$  est différentiable en tout point de  $\mathbb{R}^3$  avec

$$d(f \circ \gamma)(x, y, z) = df(\gamma(x, y, z)) \circ d\gamma(x, y, z)$$

On calcule  $\text{Jac}(\gamma)(x, y, z) = \begin{pmatrix} 2xy & x^2 & 0 \\ z^2 & 0 & 2zx \end{pmatrix}$ . En passant des applications linéaires aux matrices,

$$\begin{aligned} \text{Jac}(f \circ \gamma)(x, y, z) &= \text{Jac}(f)(x^2y, z^2x) \cdot \text{Jac}(\gamma)(x, y, z) \\ &= \text{Jac}(f)(x^2y, z^2x) \cdot \begin{pmatrix} 2xy & x^2 & 0 \\ z^2 & 0 & 2zx \end{pmatrix} \end{aligned}$$

$\delta$  est définie et différentiable en  $(x, y, z)$  dès lors que  $x > 0$ . On calcule de même  $\text{Jac}(\delta)(x, y, z) = \begin{pmatrix} yx^{y-1} & x^y \ln x & 0 \\ z & 0 & x \end{pmatrix}$  de sorte que pour tout  $(x, y, z)$  avec  $x > 0$ ,

$$\text{Jac}(g \circ \delta)(x, y, z) = \text{Jac}(g)(x^y, zx) \cdot \begin{pmatrix} yx^{y-1} & x^y \ln x & 0 \\ z & 0 & x \end{pmatrix}$$

La différentielle de  $f \circ \gamma$  en  $(x, y, z)$  est donc

$$\begin{pmatrix} h_1 \\ h_2 \\ h_3 \end{pmatrix}^T \mapsto \left[ \text{Jac}(f)(x^2y, z^2x) \cdot \begin{pmatrix} 2xy & x^2 & 0 \\ z^2 & 0 & 2zx \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} h_1 \\ h_2 \\ h_3 \end{pmatrix} \right]^T$$

et celle de  $g \circ \delta$  en  $(x, y, z)$  avec  $x > 0$

$$\begin{pmatrix} h_1 \\ h_2 \\ h_3 \end{pmatrix}^T \mapsto \left[ \text{Jac}(g)(x^y, zx) \cdot \begin{pmatrix} yx^{y-1} & x^y \ln x & 0 \\ z & 0 & x \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} h_1 \\ h_2 \\ h_3 \end{pmatrix} \right]^T$$

Soit  $(x, y, z)$  fixé avec  $x > 0$  et  $h = (h_1, h_2, h_3)$

$$\begin{aligned} \varphi \left( \begin{pmatrix} x \\ y \\ z \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} h_1 \\ h_2 \\ h_3 \end{pmatrix} \right) &= \left( f \circ \gamma \left( \begin{pmatrix} x+h_1 \\ y+h_2 \\ z+h_3 \end{pmatrix} \right), g \circ \delta \left( \begin{pmatrix} x+h_1 \\ y+h_2 \\ z+h_3 \end{pmatrix} \right) \right) \\ &= (f \circ \gamma((x, y, z)) + d(f \circ \gamma)(x, y, z)(h_1, h_2, h_3) + \|h\| \varepsilon_1(\|h\|), \\ &\quad g \circ \delta((x, y, z)) + d(g \circ \delta)(x, y, z)(h_1, h_2, h_3) + \|h\| \varepsilon_2(\|h\|)) \end{aligned}$$

où  $\varepsilon_1$  et  $\varepsilon_2$  sont des fonctions telles que  $\varepsilon_1(\|h\|) \xrightarrow{\|h\| \rightarrow 0} 0$  et  $\varepsilon_2(\|h\|) \xrightarrow{\|h\| \rightarrow 0} 0$

$$\begin{aligned} &= \varphi((x, y, z)) + (d(f \circ \gamma)(x, y, z)(h_1, h_2, h_3), d(g \circ \delta)(x, y, z)(h_1, h_2, h_3)) \\ &\quad + \|h\| \underbrace{(\varepsilon_1(\|h\|), \varepsilon_2(\|h\|))}_{\xrightarrow{\|h\| \rightarrow 0} 0} \end{aligned}$$

La différentielle de  $\varphi$  en  $(x, y, z)$  est donc

$$\begin{pmatrix} h_1 \\ h_2 \\ h_3 \end{pmatrix}^T \mapsto \left( \left[ \text{Jac}(f)(x^2y, z^2x) \cdot \begin{pmatrix} 2xy & x^2 & 0 \\ z^2 & 0 & 2zx \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} h_1 \\ h_2 \\ h_3 \end{pmatrix} \right]^T, \left[ \text{Jac}(g)(x^y, zx) \cdot \begin{pmatrix} yx^{y-1} & x^y \ln x & 0 \\ z & 0 & x \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} h_1 \\ h_2 \\ h_3 \end{pmatrix} \right]^T \right)$$

**Exercice 1.6**

Soit  $E = C^0([a, b], \mathbb{R})$  muni de la norme infinie  $\|\cdot\|$  et  $\varphi : E \rightarrow E, f \mapsto f^3$ .  
Montrer que  $\varphi$  est différentiable.

On n'est plus dans le cadre des espaces de dimension finie et la notion de différentielle est celle de Fréchet.

Pour  $f \in E$  et  $h \in E$ ,  $\varphi(f+h) = \varphi(f) + 3f^2h + 3fh^2 + h^3$ .

Le candidat pour la différentielle de  $\varphi$  en  $f$  est donc  $h \mapsto 3f^2h$ .

Il suffit de prouver que  $h \mapsto 3f^2h$  est continue en 0 et que  $\frac{\|3fh^2+h^3\|}{\|h\|} \xrightarrow{\|h\| \rightarrow 0} 0$ .

**Lemme :** Pour  $f, g \in E$ ,  $\|fg\| \leq \|f\|\|g\|$ .

Preuve : Par continuité de  $|fg|$  sur  $[a, b]$ , il existe  $c \in [a, b]$  tel que

$$\|fg\| = |f(c)g(c)| \leq |f(c)|\|g\| \leq \|f\|\|g\|$$

D'après le lemme,  $\|3f^2h\| \leq 3\|f^2\|\|h\|$  ce qui prouve la continuité en 0.

On a  $\frac{\|3fh^2+h^3\|}{\|h\|} \leq 3\frac{\|fh^2\|}{\|h\|} + \frac{\|h^3\|}{\|h\|}$ .

Le lemme donne  $\frac{\|3fh^2+h^3\|}{\|h\|} \leq 3\|f\|\|h\| + \|h\| \xrightarrow{\|h\| \rightarrow 0} 0$ .

**Exercice 1.7**

Soit  $E = C^0([0, 1], \mathbb{R})$  muni de la norme infinie  $\|\cdot\|$  et  $g : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$  deux fois dérivable avec  $g''$  bornée par  $M \geq 0$ .

Soit  $I : E \rightarrow \mathbb{R}, f \mapsto \int_0^1 (g \circ f)(t) dt$

1. Montrer que  $I$  est différentiable et calculer sa différentielle.
2. Montrer que  $I$  est  $C^1$ .
3. Qu'en est-il si  $g$  est seulement  $C^1$  ?

1. Pour  $f \in E$  fixé et  $h \in E$ ,  $t \in [0, 1]$ , la formule de Taylor-Lagrange donne

$$g(f(t) + h(t)) = g(f(t)) + h(t)g'(f(t)) + \frac{h(t)^2}{2}g''(\xi_{h,t})$$

où  $\xi_t \in \mathbb{R}$  de sorte que  $t \mapsto \frac{h(t)^2}{2}g''(\xi_{h,t})$  est continue sur  $[0, 1]$  et

$$I(f+h) = I(f) + \int_0^1 h(t)g'(f(t))dt + \int_0^1 \frac{h(t)^2}{2}g''(\xi_{h,t})dt$$

Le candidat pour la différentielle de  $I$  en  $f$  est  $h \mapsto \int_0^1 h(t)g'(f(t))dt$ .

Il suffit de prouver que  $h \mapsto \int_0^1 h(t)g'(f(t))dt$  est continue en 0 et

$$\frac{\left| \int_0^1 \frac{h(t)^2}{2}g''(\xi_{h,t})dt \right|}{\|h\|} \xrightarrow{\|h\| \rightarrow 0} 0$$

On a  $\left| \int_0^1 h(t)g'(f(t))dt \right| \leq \|h\| \underbrace{\int_0^1 |g'(f(t))|dt}_{\text{indépendant de } h}$  ce qui prouve la continuité en 0.

Comme  $\left| \frac{h(t)^2}{2} g''(\xi_{h,t}) \right| \leq \frac{M}{2} h(t)^2$ ,

$$\frac{\left| \int_0^1 \frac{h(t)^2}{2} g''(\xi_{h,t}) dt \right|}{\|h\|} \leq \frac{M}{2} \frac{\int_0^1 h(t)^2 dt}{\|h\|} \leq \frac{M}{2} \frac{\|h\|^2}{\|h\|} = \frac{M}{2} \|h\| \xrightarrow{\|h\| \rightarrow 0} 0$$

2. Sur  $\mathcal{L}_c(E, \mathbb{R})$  on institue la norme d'opérateur  $\|\cdot\|_{op}$  dérivant de la norme infinie.

Il s'agit de montrer la continuité de  $\varphi : \begin{cases} E & \longrightarrow \mathcal{L}_c(E, \mathbb{R}) \\ f & \longmapsto \begin{cases} E & \longrightarrow \mathbb{R} \\ h & \longmapsto \int_0^1 h(t)g'(f(t))dt \end{cases} \end{cases}$

Soit  $f_0 \in E$  et  $h \in E$ . On a

$$\begin{aligned} |\varphi(f)(h) - \varphi(f_0)(h)| &= \left| \int_0^1 h(t)(g'(f(t)) - g'(f_0(t))) dt \right| \\ &\leq \int_0^1 |h(t)| M |f(t) - f_0(t)| dt \quad g'' \text{ est bornée par } M \text{ donc } g' \text{ est } M\text{-lipschitzienne} \\ &\leq M \|f - f_0\| \int_0^1 |h(t)| dt \\ &\leq M \|f - f_0\| \|h\| \end{aligned}$$

Donc  $\frac{|\varphi(f)(h) - \varphi(f_0)(h)|}{\|h\|}$  est bornée par  $M\|f - f_0\|$ , d'où

$$\|\varphi(f) - \varphi(f_0)\|_{op} = \sup_h \frac{|\varphi(f)(h) - \varphi(f_0)(h)|}{\|h\|} \leq M\|f - f_0\|$$

Soit  $\varepsilon > 0$ . Avec  $\delta := \frac{\varepsilon}{M}$ ,  $\|f - f_0\| \leq \delta \implies \|\varphi(f) - \varphi(f_0)\|_{op} \leq \varepsilon$  ce qui prouve la continuité de  $\varphi$  en  $f_0$ .

3. Mon intuition me laisse penser que si  $g$  est deux fois dérivable sans être bornée (donc  $C^1$ ),  $I$  n'est pas forcément différentiable. Obtenir un contre-exemple n'est pas évident, car  $I$  est tout de même continue (par uniforme continuité de  $g$  sur un compact).

### Exercice 1.8

Soient  $E$  et  $F$  des evn avec  $F$  complet. Soit  $D \subset E$  un ouvert.

On pose  $B^2 = \{f : D \rightarrow F / f \text{ } C^2, f \text{ bornée, } df \text{ bornée, et } d^2f \text{ bornée}\}$  et

$$\|f\| = \sup_{x \in D} (\|f(x)\| + \|df(x)\| + \|d^2f(x)\|)$$

Montrer que  $B^2$  est complet.

On trouvera une présentation de l'intégrale des fonctions à valeurs dans un espace de Banach à l'adresse  
[http://www.math.ucsd.edu/~bdriver/231-02-03/Lecture\\_Notes/chap4.pdf](http://www.math.ucsd.edu/~bdriver/231-02-03/Lecture_Notes/chap4.pdf)

Etant donné  $X$  un ensemble et  $(Y, \|\cdot\|_Y)$  un evn, on note  $B(X, Y)$  l'ensemble des fonctions bornées de  $X$  dans  $Y$ . On rappelle que si  $Y$  est complet, alors  $B(X, Y)$  est complet pour la norme  $\|\cdot\|_{\infty, Y}$  définie par  $\|f\|_{\infty, Y} = \sup_{x \in X} \|f(x)\|_Y$ .

On notera  $\|\cdot\|_{op}$  la norme d'opérateur sur  $\mathcal{L}_c(E, F)$  qui dérive de  $\|\cdot\|_F$ . On rappelle que  $(\mathcal{L}_c(E, F), \|\cdot\|_{op})$  est un Banach.

On notera  $\|\cdot\|_{op'}$  la norme d'opérateur sur  $\mathcal{L}_c(E, \mathcal{L}_c(E, F))$  qui dérive de  $\|\cdot\|_{op}$ , de sorte que  $(\mathcal{L}_c(E, \mathcal{L}_c(E, F)), \|\cdot\|_{op'})$  est un Banach.

On rappelle que si  $f \in B^2$  et  $a \in D$ ,  $df(a) \in \mathcal{L}_c(E, F)$  et  $d^2f(a) \in \mathcal{L}_c(E, \mathcal{L}_c(E, F))$ . La norme définie dans l'énoncé est donc à prendre au sens suivant :

$$\|f\| = \sup_{x \in D} (\|f(x)\|_F + \|df(x)\|_{op} + \|d^2f(x)\|_{op'})$$

On prouve facilement les faits suivants : pour  $f \in B^2$ ,

$$\begin{aligned} \|f\| &\geq \|f\|_{\infty, F} \\ \|f\| &\geq \|df\|_{\infty, op} \\ \|f\| &\geq \|d^2f\|_{\infty, op'} \end{aligned}$$

Soit  $(f_n)$  de Cauchy dans  $B^2$  pour  $\|\cdot\|$ .

- D'après la remarque précédente,  $(f_n)$  est de Cauchy pour  $\|\cdot\|_{\infty, F}$  dans  $B(D, F)$  qui est complet, donc  $(f_n)$  converge pour  $\|\cdot\|_{\infty, F}$  vers un  $f \in B(D, F)$ .
  - D'après la remarque précédente,  $(df_n)$  est de Cauchy pour  $\|\cdot\|_{\infty, op}$  dans  $B(D, \mathcal{L}_c(E, F))$  qui est complet, donc  $(df_n)$  converge pour  $\|\cdot\|_{\infty, op}$  vers un  $\varphi \in B(D, \mathcal{L}_c(E, F))$ .
  - En tant que limites uniformes de fonctions continues,  $f$  et  $\varphi$  sont continues.
  - Montrons que  $f$  est différentiable de différentielle  $\varphi$ .
- Soit  $a \in D$ . Pour  $h \in D$ , et  $n$  quelconque,

$$f_n(a+h) - f_n(a) = \int_0^1 df_n(a+th)dt$$

La convergence des  $df_n$  vers  $\varphi$  étant uniforme, on a en passant à la limite

$$f(a+h) - f(a) = \int_0^1 \varphi(a+th)dt$$



donc

$$\begin{aligned} \frac{\|f(a+h) - f(a) - \varphi(a)(h)\|_F}{\|h\|_E} &= \frac{\|\int_0^1 \varphi(a+th) - \varphi(a)(h) dt\|_F}{\|h\|_E} \\ &\leq \frac{\int_0^1 \|\varphi(a+th) - \varphi(a)\|_{op} \|h\|_E dt}{\|h\|_E} \\ &\leq \int_0^1 \|\varphi(a+th) - \varphi(a)\|_{op} dt \end{aligned}$$

Soit  $\varepsilon > 0$ . Comme  $\varphi$  est continue on dispose de  $\delta > 0$  tel que  $\|x\|_F \leq \delta \implies \|\varphi(a+x) - \varphi(a)\|_{op} \leq \varepsilon$ . Pour  $\|h\| \leq \varepsilon$  et  $t \in [0, 1]$  on obtient

$$\|\varphi(a+th) - \varphi(a)\|_{op} \leq \varepsilon$$

donc  $\frac{\|f(a+h) - f(a) - \varphi(a)(h)\|_F}{\|h\|_E} \leq \varepsilon$  dès que  $\|h\| \leq \delta$ .

$f$  est donc différentiable sur  $D$  et sa différentielle est  $\varphi$ , qui est continue d'après la remarque précédente.

- Un raisonnement identique en remplaçant  $f_n$  par  $df_n$  montre que  $df$  est différentiable sur  $D$ , on note  $d^2f$  sa différentielle qui est continue.
- $f$  est donc  $C^2$ , bornée, de différentielles bornées. Il reste à prouver que  $(f_n)$  converge vers  $f$  pour la norme  $\|\cdot\|$ .

Etant donné  $\varepsilon > 0$ , on dispose de  $N, N', N''$  tels que

$$\begin{aligned} \forall x \in D, \quad n \geq N &\implies \|f(x) - f_n(x)\|_F \leq \frac{\varepsilon}{3} \\ n \geq N' &\implies \|df(x) - df_n(x)\|_{op} \leq \frac{\varepsilon}{3} \\ n \geq N'' &\implies \|d^2f(x) - d^2f_n(x)\|_{op'} \leq \frac{\varepsilon}{3} \end{aligned}$$

Pour  $n \geq \max(N, N', N'')$ ,

$$\|f(x) - f_n(x)\|_F + \|df(x) - df_n(x)\|_{op} + \|d^2f(x) - d^2f_n(x)\|_{op'} \leq \varepsilon$$

et ceci pour tout  $x \in D$ , donc  $\|f - f_n\| \leq \varepsilon$ . Ceci achève la preuve.

### Exercice 1.9

Soit  $E$  un  $\mathbb{R}$ -evn,  $D \subset E$  un ouvert et  $f : \overline{D} \rightarrow \mathbb{R}$ . On suppose  $\overline{D}$  compact,  $f$  continue, nulle à la frontière de  $D$  et  $f$  différentiable sur  $D$ .  
Montrer qu'il existe  $a \in D$  tel que  $df(a) = 0$ .

$f$  est continue sur le compact  $\overline{D}$  donc elle admet un maximum  $M$  et un maximum  $m$  atteints respectivement en  $\alpha$  et  $\beta \in \overline{D}$ .

Si  $m = M = 0$ ,  $f$  est nulle sur  $D$  donc pour tout  $x \in D$ ,  $df(x) = 0$ .

Sinon,  $m < 0$  ou  $M > 0$ . On suppose par exemple  $M > 0$ . Comme  $f$  est nulle sur  $\overline{D} \setminus \overset{\circ}{D} = \overline{D} \setminus D$ , on a  $\beta \in D$ . En  $\beta$ ,  $f$  admet un maximum global (donc local), d'où  $df(\beta) = 0$ .

### Exercice 1.10

Soient  $\varphi, \psi \in C^1(\mathbb{R}, \mathbb{R})$  et  $f(x, y, z) = (x + \varphi(yz), y + \psi(\frac{x}{z}))$ .  
Calculer la différentielle de  $f$ .

La démarche est identique à celle de l'exercice 1.5. En posant  $f_1 : (x, y, z) \mapsto x + \varphi(yz)$  et  $f_2 : (x, y, z) \mapsto y + \psi(\frac{x}{z})$ , il suffit de démontrer que  $f_1$  et  $f_2$  sont différentiables en  $(x, y, z)$  pour obtenir la différentielle de  $f$  en  $(x, y, z)$  :

$$df(x, y, z) : (h_1, h_2, h_3) \mapsto (df_1(x, y, z)(h_1, h_2, h_3), df_2(x, y, z)(h_1, h_2, h_3))$$

On calcule

$$\text{Jac}(f_1)(x, y, z) = (1, \varphi'(yz)z, \varphi'(yz)y)$$

et

$$\text{Jac}(f_2)(x, y, z) = \left( \psi\left(\frac{x}{z}\right)\frac{1}{z}, 1, -\psi\left(\frac{x}{z}\right)\frac{x}{z^2} \right)$$

### Exercice 1.11

1. Soient  $E, F, G, H$  des  $\mathbb{R}$ -evn.  $B$  est une forme bilinéaire continue de  $F \times G$  dans  $H$ ,  $f : E \rightarrow F$  et  $g : E \rightarrow G$ .  
On suppose que  $f$  et  $g$  sont différentiables en  $a \in E$ . Montrer que  $C : E \rightarrow H, x \mapsto B(f(x), g(x))$  est différentiable en  $a$ .
2. Soit  $E$  un espace vectoriel euclidien.
  - (a) Montrer que  $\varphi : x \mapsto \frac{x}{\|x\|^2}$  est différentiable sur  $E \setminus \{0\}$ .
  - (b) Déterminer la différentielle de  $\psi : x \mapsto \|x\|^2$ .
  - (c) Déterminer et interpréter la différentielle de  $\varphi$ .

1. Soit  $a \in E$ . Pour  $h \in E$ ,

$$\begin{aligned} C(a+h) &= C(a) + B(f(a), dg(a)(h)) + B(df(a)(h), g(a)) \\ &\quad + \\ &\quad B(f(a), \|h\|_{\varepsilon_g}(\|h\|)) + B(df(a)(h), dg(a)(h) + \|h\|_{\varepsilon_g}(\|h\|)) + B(\|h\|_{\varepsilon_f}(\|h\|), g(a+h)) \end{aligned}$$

Le candidat pour la différentielle en  $a$  de  $f$  est  $h \mapsto B(f(a), dg(a)(h)) + B(df(a)(h), g(a))$ .  
Il suffit de prouver que

$$B(f(a), \|h\|_{\varepsilon_g}(\|h\|)) + B(df(a)(h), dg(a)(h) + \|h\|_{\varepsilon_g}(\|h\|)) + B(\|h\|_{\varepsilon_f}(\|h\|), g(a+h)) = o(\|h\|)$$

$B$  étant bilinéaire continue, il existe  $K \geq 0$  tel que

$$\forall x, y \in E, \|B(x, y)\| \leq K\|x\|\|y\|$$

On traite chaque terme de la somme séparément :

- $B(f(a), \|h\|\varepsilon_g(\|h\|)) = \|h\| \underbrace{B(f(a), \varepsilon_g(\|h\|))}_{\rightarrow 0}$
- $\|B(df(a)(h), dg(a)(h))\| \leq K \|df(a)\|_{op} \|df(b)\|_{op} \|h\|^2$
- $B(df(a)(h), \|h\|\varepsilon_g(\|h\|)) = \|h\| \underbrace{B(df(a)(h), \varepsilon_g(\|h\|))}_{\rightarrow 0}$
- $B(\|h\|\varepsilon_f(\|h\|), g(a+h)) = \|h\| \underbrace{B(\varepsilon_f(\|h\|), g(a+h))}_{\rightarrow 0}$

La somme est bien  $o(\|h\|)$ .

2. a)  $(x, y) \mapsto \langle x, y \rangle$  est bilinéaire continue (d'après Cauchy-Schwarz). La question 1. implique que  $\psi : x \mapsto \langle x, x \rangle$  est différentiable en tout  $a \in E$ . La fonction  $\delta : x \mapsto \frac{1}{x}$  est différentiable en tout  $a \in \mathbb{R} \setminus \{0\}$  donc  $\delta \circ \psi$  est différentiable en tout  $a \in E \setminus \{0\}$ .

$\pi : \mathbb{R} \times E \rightarrow E$ ,  $(\lambda, x) \mapsto \lambda x$  est bilinéaire continue, et d'après 1.,  $x \mapsto \pi(\delta \circ \psi(x), x)$  est différentiable en tout  $x \in E \setminus \{0\}$ .

Ceci s'écrit encore  $\varphi : x \mapsto \frac{x}{\|x\|^2}$  est différentiable sur  $E \setminus \{0\}$ .

b) Soit  $x \in E$ . Pour  $h \in E$ ,  $\psi(x+h) = \psi(x) + 2\langle x, h \rangle + \|h\|^2$ .  
La différentielle de  $\psi$  en  $x$  est donc  $h \mapsto 2\langle x, h \rangle$ .

c) D'après 1., la différentielle de  $\varphi$  en  $x \neq 0$  est donnée par

$$\begin{aligned} d\varphi(x)(h) &= \pi(\text{Id}(x), d(\delta \circ \psi)(x)(h)) + \pi(d\text{Id}(x)(h), \delta \circ \psi(x)) \\ &= x \cdot d\delta(\psi(x))(d\psi(x)(h)) + \frac{h}{\|x\|^2} \\ &= x \cdot -\frac{2\langle x, h \rangle}{(\|x\|^2)^2} + \frac{h}{\|x\|^2} \\ &= \frac{h}{\|x\|^2} - \frac{2\langle x, h \rangle x}{\|x\|^4} \end{aligned}$$

### Exercice 1.12

Déterminer toutes les fonctions  $f \in C^2(\mathbb{R}^2, \mathbb{R})$  telles que

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x^2} = \frac{\partial^2 f}{\partial y^2}$$

C'est un classique que l'on trouve dans n'importe quel livre de prépa.

**Exercice 1.13**

En quels points de  $\mathbb{R}^2$  la fonction  $g : (x, y) \mapsto \max(x^2, y)$  est-elle différentiable ? Calculer sa différentielle.

Soit  $(x, y) \in \mathbb{R}^2$  tel que  $x^2 > y$ . Cette relation reste vérifiée sur un voisinage de  $(x, y)$  de sorte que  $g(x, y) = x^2$  sur un voisinage de  $(x, y)$ .  $g$  est donc différentiable en  $(x, y)$  de différentielle  $(h_1, h_2) \mapsto 2xh_1$ .

Soit  $(x, y) \in \mathbb{R}^2$  tel que  $x^2 < y$ . Cette relation reste vérifiée sur un voisinage de  $(x, y)$  de sorte que  $g(x, y) = y$  sur un voisinage de  $(x, y)$   $g$  est donc différentiable en  $(x, y)$  de différentielle  $(h_1, h_2) \mapsto h_2$ .

En  $(0, 0)$  :  $\frac{g(0, \frac{1}{n}) - g(0, 0)}{\frac{1}{n}} = 1$  et  $\frac{g(0, -\frac{1}{n}) - g(0, 0)}{-\frac{1}{n}} = 0$  donc  $g$  n'admet pas de dérivée partielle selon  $y$  en  $(0, 0)$  donc  $g$  n'est pas différentiable en  $(0, 0)$ .

Soit  $(x, y) \in \mathbb{R}^2$  avec  $x^2 = y$  et  $x \neq 0$ .

$$\frac{g(x + \frac{1}{n}, y) - g(x, y)}{\frac{1}{n}} = \frac{(x + \frac{1}{n})^2 - x^2}{\frac{1}{n}} \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 2x$$
$$\frac{g(x - \frac{1}{n}, y) - g(x, y)}{-\frac{1}{n}} = \frac{y - y}{-\frac{1}{n}} = 0 \neq 2x$$

donc  $g$  n'admet pas de dérivée partielle selon  $x$  en  $(x, y)$  donc  $g$  n'est pas différentiable en  $(x, y)$ .

**Exercice 1.14**

Soient  $n \geq 1$  et  $p \geq 1$  des entiers.

On définit  $f : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}, (x, y) \mapsto \frac{x^n y^p}{x^2 + y^2}$  si  $(x, y) \neq (0, 0)$  et  $f(0, 0) = 0$ .

Pour quelles valeurs de  $(n, p)$   $f$  est-elle différentiable dans  $\mathbb{R}^2$  ?

Quelles que soient les valeurs de  $n$  et  $p$ ,  $f$  est différentiable en  $(x, y) \neq (0, 0)$  par composition.  $f$  admet donc des dérivées partielles données par

$$\frac{\partial f}{\partial x}(x, y) = \frac{nx^{n-1}y^p}{x^2 + y^2} - \frac{2x^{n+1}y^p}{(x^2 + y^2)^2}$$

et

$$\frac{\partial f}{\partial y}(x, y) = \frac{px^n y^{p-1}}{x^2 + y^2} - \frac{2x^n y^{p+1}}{(x^2 + y^2)^2}$$

En  $(0, 0)$  : comme pour tout  $h \in \mathbb{R}, f(0, h) = f(h, 0) = f(0, 0) = 0$ , les dérivées

## 1.. DIFFÉRENTIELLE

---

partielles de  $f$  existent en  $(0, 0)$  avec  $\frac{\partial f}{\partial x}(0, 0) = \frac{\partial f}{\partial y}(0, 0) = 0$ .

On étudie plusieurs cas selon  $n$  et  $p$ . Si les dérivées partielles sont continues en  $(0, 0)$ ,  $f$  est différentiable en  $(0, 0)$ . Si ce n'est le pas on ne peut a priori rien dire.

On utilise les mêmes techniques de majoration que dans l'exercice 1.

1. Si  $n \geq 4$  : OK
2. Si  $n = 3$  :
  - (a) Si  $p \geq 4$  : OK par symétrie
  - (b) Si  $p = 3$  : OK
  - (c) Si  $p = 2$  : OK
  - (d) Si  $p = 1$  : OK
3. Si  $n = 2$  :
  - (a) Si  $p \geq 4$  : OK par symétrie
  - (b) Si  $p = 3$  : OK par symétrie
  - (c) Si  $p = 2$  : OK
  - (d) Si  $p = 1$  : Pour  $t \in \mathbb{R}$  non nul,

$$\frac{f((0, 0) + t(1, 1)) - f((0, 0))}{t} = \frac{1}{2}$$

$f$  admet donc une dérivée directionnelle selon le vecteur  $(1, 1)$  qui vaut  $\frac{1}{2}$ .

Si  $f$  était différentiable en  $(0, 0)$ , son gradient donné par les dérivées partielles serait nul, donc la différentielle en  $(0, 0)$  serait aussi nulle, donc toutes les dérivées directionnelles seraient aussi nulles, ce qui n'est pas le cas.  $f$  n'est donc pas différentiable en  $(0, 0)$ .

4. Si  $n = 1$  :
  - (a) Si  $p \geq 4$  : OK par symétrie
  - (b) Si  $p = 3$  : OK par symétrie
  - (c) Si  $p = 2$  : Non par symétrie
  - (d) Si  $p = 1$  :  $f(0, \frac{1}{n}) = 0$  et  $f(\frac{1}{n}, \frac{1}{n}) = \frac{1}{2}$ , donc  $f$  n'est pas continue en 0, donc pas différentiable en  $(0, 0)$ .

**Conclusion** :  $f$  est différentiable en  $(0, 0)$  pour tout  $n \geq 1$  et  $p \geq 1$  exceptés les couples  $(n = 2, p = 1)$ ,  $(n = 1, p = 2)$ ,  $(n = 1, p = 1)$ .

### Exercice 1.15

Soit  $B$  dans  $M_n(\mathbb{R})$ .

Donner la différentielle de  $\varphi : GL_n(\mathbb{R}) \rightarrow \mathbb{R}, A \mapsto \text{Tr}(A^{-1}B)$

On choisit une norme d'opérateur  $\|\cdot\|$  sur  $M_n(\mathbb{R})$ . On rappelle que  $GL_n(\mathbb{R})$  est ouvert.

Soit  $A \in GL_n(\mathbb{R})$ . On considère  $V \subset GL_n(\mathbb{R})$  un voisinage de  $A$  tel que pour tout  $X \in V$ ,  $\|A^{-1}(X - A)\| < 1$ . Calculons la différentielle de la fonction  $M \rightarrow M^{-1}$  en  $A$ .

Il existe  $\delta > 0$  tel que pour tout  $H \in M_n(\mathbb{R})$ ,  $\|H\| \leq \delta \implies A + H \in V$ .

Pour  $\|H\| \leq \delta$ ,  $(A + H)^{-1} = (I_n + A^{-1}H)^{-1}A^{-1}$ .

Démontrons que  $(I_n + A^{-1}H)^{-1} = \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k (A^{-1}H)^k$ . Comme  $\|H\| \leq \delta$ ,  $\|A^{-1}H\| < 1$  donc la série en question est absolument convergente, donc convergente. On a pour  $N \geq 1$ ,

$$(I_n + A^{-1}H) \sum_{k=0}^N (-1)^k (A^{-1}H)^k = (-1)^N \underbrace{(A^{-1}H)^{N+1}}_{\xrightarrow{N \rightarrow \infty} 0} + I_n$$

En passant à la limite sur  $N$  on a l'égalité voulue.

Par conséquent

$$(A+H)^{-1} = \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k (A^{-1}H)^k A^{-1} = A^{-1} - A^{-1}HA^{-1} + \sum_{k=2}^{\infty} (-1)^k (A^{-1}H)^k A^{-1}$$

La candidat pour la différentielle de l'inverse en  $A$  est donc  $H \mapsto -A^{-1}HA^{-1}$ .

Il reste à remarquer que

$$\frac{\|\sum_{k=2}^{\infty} (-1)^k (A^{-1}H)^k A^{-1}\|}{\|H\|} \leq \frac{\|A^{-1}\|^2}{1 - \|A^{-1}H\|} \|H\| \rightarrow 0$$

La fonction  $A \mapsto \text{Tr}(AB)$  étant linéaire, la différentielle de  $\varphi$  en  $A$  est donnée par  $H \mapsto -\text{Tr}(A^{-1}HA^{-1}B)$

### Exercice 1.16

Soit  $\varphi : \mathbb{R} \rightarrow GL_n(\mathbb{R})$ ,  $x \mapsto A(x)$   
Calculer la différentielle de  $x \mapsto \ln \det A(x)$

Il est classique (cf Gourdon Analyse ou Cassini Algèbre 2) que la différentielle du déterminant en  $A$  est donnée par  $H \mapsto \text{Tr}((\text{com } A)^T H)$  qui devient  $H \mapsto \det A \text{Tr}(A^{-1}H)$  lorsque  $A$  est inversible.

Pour  $a \in \mathbb{R}$  et  $h \in \mathbb{R}$ ,

$$\begin{aligned}
 d(\ln \circ \det \circ A)(a)(h) &= d(\ln \circ \det)(A(a))(dA(a)(h)) \\
 &= h \cdot d(\ln \circ \det)(A(a))(dA(a)(1)) \\
 &= h \cdot d(\ln \circ \det)(A(a))\left(\frac{dA}{dx}(a)\right) \\
 &= h \cdot d \ln(\det A(a)) \left( d \det(A(a))\left(\frac{dA}{dx}(a)\right) \right) \\
 &= h \cdot d \ln(\det A(a)) \left( \det A(a) \operatorname{Tr} \left( A(a)^{-1} \frac{dA}{dx}(a) \right) \right) \\
 &= h \det A(a) \operatorname{Tr} \left( A(a)^{-1} \frac{dA}{dx}(a) \right) d \ln(\det A(a))(1) \\
 &= h \operatorname{Tr} \left( A(a)^{-1} \frac{dA}{dx}(a) \right)
 \end{aligned}$$

La différentielle cherchée en  $a$  est donc  $h \mapsto h \operatorname{Tr} \left( A(a)^{-1} \frac{dA}{dx}(a) \right)$

### Exercice 1.17

Soient  $f$  et  $g$  deux fonctions  $\mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$  dérivables en 1. Montrer que  $\varphi : (x, y) \mapsto f(xy) + g(\frac{x}{y})$  est différentiable en  $(1, 1)$  et calculer sa différentielle en  $(1, 1)$ .

Soient  $\alpha : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}, (x, y) \mapsto xy$  et  $\beta : \mathbb{R} \times \mathbb{R} \setminus \{0\} \rightarrow \mathbb{R}, (x, y) \mapsto \frac{x}{y}$ .

On dispose de  $U$  un voisinage de  $(1, 1)$  et  $V$  un voisinage de 1 tel que  $\alpha(U) \subset V$  et  $\beta(U) \subset V$ .  $\alpha : U \rightarrow V$  et  $\beta : U \rightarrow V$  sont différentiables en  $(1, 1)$ .

Le théorème de composition s'applique :  $f \circ \alpha$  et  $f \circ \beta$  sont différentiables en  $(1, 1)$ , donc  $\varphi$  aussi, avec

$$\begin{aligned}
 d\varphi((1, 1))(h_1, h_2) &= d(f \circ \alpha)(1, 1)(h_1, h_2) + d(f \circ \beta)(1, 1)(h_1, h_2) \\
 &= (yh_1 + xh_2)f'(1) + \left(-\frac{y}{x^2}h_1 + \frac{h_2}{x}\right)g'(1)
 \end{aligned}$$

### Exercice 1.18

Déterminer toutes les fonctions  $f$  de classe  $C^2$  sur  $\mathbb{R} \setminus \{-1, 1\}$  qui vérifient  $\frac{\partial^2 Z}{\partial x^2} - \frac{\partial^2 Z}{\partial y^2} = \frac{y}{x^3}$  où  $Z(x, y) = f(\frac{y}{x})$

?

**Exercice 1.19**

Soient  $E$  et  $F$  deux espaces de Banach. Soit  $f : E \rightarrow F$  de classe  $C^2$  telle que

$$\forall t \in \mathbb{R}, \forall x \in E, f(tx) = t^2 f(x)$$

Montrer que pour tout  $x \in E$ ,  $d^2 f(0)(x, x) = 2f(x)$ .

On rappelle que  $\mathcal{L}_c(E, \mathcal{L}_c(E, F))$  s'identifie à l'espace des applications bilinéaires  $\mathcal{L}_c(E \times E, F)$ .

L'énoncé demande en réalité de montrer que pour tout  $x \in E$ ,

$$d^2 f(0)(x)(x) = 2f(x)$$

Soit  $x \in E$  fixé.

Posons  $\alpha : \mathbb{R} \rightarrow E, t \mapsto tx$  et  $\beta : \mathbb{R} \rightarrow F, t \mapsto t^2 f(x)$ .  $\mathbb{R}$  étant de dimension finie, toute application linéaire de  $\mathbb{R}$  dans  $E$  est continue.  $\alpha$  est clairement différentiable en tout  $t \in \mathbb{R}$  de différentielle  $h \mapsto hx$ .

Pour  $t \in \mathbb{R}$  et  $h \in \mathbb{R}$ ,  $\beta(t+h) = \beta(t) + 2thf(x) + h^2 f(x)$  avec

$$\frac{\|h^2 f(x)\|_F}{|h|} = |h| \|f(x)\|_F \xrightarrow{|h| \rightarrow 0} 0$$

Donc  $\beta$  est différentiable en  $t$  de différentielle  $h \mapsto 2thf(x)$

En différentiant l'égalité  $f \circ \alpha = \beta$  en  $t \in \mathbb{R}$  on a pour tout  $h \in \mathbb{R}$ ,  $hdf(tx)(x) = 2thf(x)$  et donc

$$df(tx)(x) = 2tf(x) \quad (*)$$

ceci étant vrai pour tout  $t \in \mathbb{R}$ .

Soit  $\Pi : \mathcal{L}_c(E, F) \rightarrow F, L \mapsto L(x)$ . Pour  $L \in \mathcal{L}_c(E, F)$  et  $H \in \mathcal{L}_c(E, F)$ ,  $\Pi(L+H) = (L+H)(x) = \Pi(x) + H(x)$ .

Le candidat pour la différentielle en  $L$  est donc  $H \mapsto H(x)$ . Il suffit de montrer que cette application est continue.

Soit  $\|\cdot\|_{op}$  la norme d'opérateur sur  $\mathcal{L}_c(E, F)$  qui dérive naturellement de  $\|\cdot\|_E$  et  $\|\cdot\|_F$ .

Alors

$$\frac{\|H(x)\|_F}{\|H\|_{op}} \leq \frac{\|H\|_{op} \|x\|_E}{\|H\|_{op}} \leq \|x\|_E$$

D'où la continuité.

Soit  $\gamma : \mathbb{R} \rightarrow F, t \mapsto 2tf(x)$ . On montre facilement que  $\gamma$  est différentiable en tout  $t \in \mathbb{R}$  de différentielle  $h \mapsto 2hf(x)$ .



L'égalité (\*) se réécrit  $\Pi \circ df \circ \alpha = \gamma$ . Pour  $t \in \mathbb{R}$  et  $h \in \mathbb{R}$ ,

$$\begin{aligned} d(\Pi \circ df \circ \alpha)(t)(h) &= d\Pi(df \circ \alpha(t))(d(df \circ \alpha)(t)(h)) \\ &= d(df \circ \alpha)(t)(h)(x) \\ &= d(df)(tx)(hx)(x) \\ &= hd^2f(tx)(x)(x) \end{aligned}$$

On a donc pour tout  $h \in \mathbb{R}$ ,  $hd^2f(tx)(x)(x) = 2hf(x)$ , donc

$$d^2f(tx)(x)(x) = 2f(x)$$

ceci étant vrai pour tout  $t \in \mathbb{R}$ . En  $t = 0$  on a

$$d^2f(0)(x)(x) = 2f(x)$$

comme voulu.

## 2. Applications de la notion de différentielle

### 3. Equations différentielles

### 4. Ensembles convexes

#### Exercice 4.1

Trouver  $K$  un convexe fermé et  $f$  une application affine telle que  $f(K)$  soit un ouvert.

On considère simplement  $\text{Id} : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ .

#### Exercice 4.2

Soit  $C$  un convexe non réduit à un point.

1. Montrer l'équivalence des deux propositions suivantes :
  - (a)  $x_0 \in \text{Ri}(C)$
  - (b)  $\forall x \in C, \exists y, x_0 \in [x, y[$
2. Montrer que si  $C$  n'est pas convexe, alors la réciproque est fausse.

?

#### Exercice 4.3

Soit  $K \subset \mathbb{R}^n$  convexe de cardinal  $n + 2$ . Montrer qu'il existe une partition de  $K$  en  $K_1 \cup K_2$  telles que les enveloppes convexes de  $K_1$  et  $K_2$  ne sont pas disjointes.

L'hypothèse  $K$  convexe est superflue. Ecrivons  $K = \{a_1, \dots, a_{n+2}\}$  et considérons la matrice  $A$  à  $n+1$  lignes et  $n+2$  colonnes

$$A = \begin{pmatrix} \begin{pmatrix} \vdots \\ a_1 \\ \vdots \\ 1 \end{pmatrix} & \dots & \begin{pmatrix} \vdots \\ a_{n+2} \\ \vdots \\ 1 \end{pmatrix} \end{pmatrix}$$

Elle n'est pas inversible donc il existe  $(\alpha_1, \dots, \alpha_{n+2})$  un élément non nul de  $\ker A$ , ce qu'on peut encore écrire

$$\begin{aligned} \sum_{i=1}^{n+2} \alpha_i a_i &= 0 \\ \sum_{i=1}^{n+2} \alpha_i &= 0 \end{aligned}$$

Soit  $I \subset \llbracket 1, n+2 \rrbracket$  l'ensemble des indices tels que  $\alpha_i > 0$  et  $J \subset \llbracket 1, n+2 \rrbracket$  l'ensemble des indices tels que  $\alpha_j \leq 0$ .  $I$  et  $J$  sont non vides car  $(\alpha_1, \dots, \alpha_{n+2}) \neq (0, \dots, 0)$  et  $\sum_{i=1}^{n+2} \alpha_i = 0$ .

On a  $\sum_{i \in I} \alpha_i a_i = \sum_{j \in J} (-\alpha_j) a_j$  et  $\sum_{i \in I} \alpha_i = \sum_{j \in J} (-\alpha_j)$ .

Posons  $S = \sum_{i \in I} \alpha_i$  qui est non nul. Alors

$$\sum_{i \in I} \frac{\alpha_i}{S} a_i = \sum_{j \in J} \frac{(-\alpha_j)}{S} a_j$$

avec

$$\sum_{i \in I} \frac{\alpha_i}{S} = \sum_{j \in J} \frac{(-\alpha_j)}{S} = 1$$

$K_1 = (a_i)_{i \in I}$  et  $K_2 = (a_j)_{j \in J}$  est donc une partition convenant.

#### Exercice 4.4

Soit  $K$  une partie convexe de  $E$  et  $M$  une variété affine de  $E$  telle que  $M \cap \text{Ri}(K) \neq \emptyset$ . On suppose  $M$  fermée.

1. Montrer que  $\text{Ri}(M \cap K) = M \cap \text{Ri}(K)$
2. Montrer que  $\overline{M \cap K} = M \cap \overline{K}$

?

### Exercice 4.5

Montrer que toute section plane d'un ensemble convexe est convexe.

Tout hyperplan est convexe (en tant que sous-espace vectoriel) et l'intersection de deux convexes est convexe, donc toute section plane d'un convexe est convexe.

### Exercice 4.6

Donner un exemple de fermé  $A$  d'un evn tel que  $\text{co } A$  ne soit pas fermée.

On rappelle que  $\text{co } A$  fait référence à l'enveloppe convexe de  $A$ . On se place dans  $\mathbb{R}^2$  et on pose  $A = (\{0\} \times [0, 1]) \cup ([0, \infty) \times \{0\})$  qui est fermé comme union de deux fermés.

Cependant  $\text{co } A = ([0, \infty) \times [0, 1]) \cup \{(0, 1)\}$  (évident sur un dessin) qui n'est pas fermé.

### Exercice 4.7

Soit  $X$  un fermé d'un evn  $E$ . Montrer l'équivalence des propositions suivantes

1.  $X$  convexe
2.  $\forall x, y \in X, \frac{x+y}{2} \in X$

Donner un contre-exemple si  $X$  n'est pas fermé.

$\implies$  Trivial.

$\impliedby$  Soient  $x, y \in X$  fixés. Montrons par récurrence sur  $n \geq 1$  que

$$\forall k \in [0, 2^n], \frac{k}{2^n}x + \left(1 - \frac{k}{2^n}\right)y \in X$$

- Pour  $n = 1$ , c'est une conséquence l'hypothèse  $\forall x, y \in X, \frac{x+y}{2} \in X$ .

- Supposons le résultat vrai pour  $n \geq 1$  et prouvons le pour  $n + 1$ .

On remarque que

$$\frac{k'}{2^n}x + \left(1 - \frac{k'}{2^n}\right)y = \frac{2k'}{2^{n+1}}x + \left(1 - \frac{2k'}{2^{n+1}}\right)y$$

ce qui prouve le résultat pour tout  $k$  pair dans  $\llbracket 0, 2^{n+1} \rrbracket$

Soit  $k \in \llbracket 0, 2^{n+1} - 1 \rrbracket$  impair. Ecrivons  $k = 2k' + 1$  où  $k' \in \llbracket 0, 2^n - 1 \rrbracket$ . Alors

$$\begin{aligned} \frac{k}{2^{n+1}}x + \left(1 - \frac{k}{2^{n+1}}\right)y &= \frac{2k' + 1}{2^{n+1}}x + \left(1 - \frac{2k' + 1}{2^{n+1}}\right)y \\ &= \frac{1}{2} \left[ \underbrace{\frac{k'}{2^n}x + \left(1 - \frac{k'}{2^n}\right)y}_{\in C} + \underbrace{\frac{k' + 1}{2^n}x + \left(1 - \frac{k' + 1}{2^n}\right)y}_{\in C} \right] \end{aligned}$$

Ceci achève la récurrence.

Soit  $\lambda \in [0, 1]$ . La suite  $\frac{\lfloor 2^n \lambda \rfloor}{2^n}$  converge vers  $\lambda$ , de sorte que la suite des

$$\frac{\lfloor 2^n \lambda \rfloor}{2^n}x + \left(1 - \frac{\lfloor 2^n \lambda \rfloor}{2^n}\right)y$$

est une suite d'éléments de  $C$  qui converge vers  $\lambda x + (1 - \lambda)y$ . Comme  $C$  est fermé,  $\lambda x + (1 - \lambda)y \in C$ . Ceci étant vrai pour tout  $x, y, \lambda$ ,  $C$  est convexe.

Dans le cas où  $C$  n'est pas fermé,  $\mathbb{Q}$  fournit un contre-exemple évident à la réciproque.

### Exercice 4.8

Soient  $A$  et  $B$  deux parties d'un evn  $E$ .  
Montrer que  $\text{co } A + \text{co } B = \text{co}(A + B)$ .

$\supset$  On montre facilement que si  $C$  et  $C'$  sont deux convexes de  $E$ ,  $C + C'$  est convexe.  $\text{co } A$  et  $\text{co } B$  étant convexes,  $\text{co } A + \text{co } B$  est convexe. Par ailleurs,  $A \subset \text{co } A$  et  $B \subset \text{co } B$  donc  $A + B \subset \text{co } A + \text{co } B$ .  
 $\text{co } A + \text{co } B$  est donc un convexe contenant  $A + B$ , donc  $\text{co}(A + B) \subset \text{co } A + \text{co } B$ .

$\subset$  Soit  $a + b \in \text{co } A + \text{co } B$ . Il existe  $n$  et  $p \in \mathbb{N}$ ,  $\alpha_i, \beta_j \in \mathbb{R}$ ,  $a_i \in A$ ,  $b_j \in B$  tels que  $a = \sum_{i=1}^n \alpha_i a_i$ ,  $b = \sum_{j=1}^p \beta_j b_j$ ,  $\sum_{i=1}^n \alpha_i = \sum_{j=1}^p \beta_j = 1$ .

Pour  $1 \leq j \leq p$  on pose  $c_j = b_j + \sum_{i=1}^n \alpha_i a_i = \sum_{i=1}^n \alpha_i (a_i + b_j) \in \text{co}(A + B)$ .

$$\begin{aligned} \text{Alors } \underbrace{\sum_{j=1}^p \beta_j c_j}_{\in \text{co}(\text{co}(A+B))} &= \sum_{j=1}^p \beta_j (b_j + \sum_{i=1}^n \alpha_i a_i) = \sum_{j=1}^p \beta_j b_j + \sum_{i=1}^n \alpha_i a_i = a + b \end{aligned}$$

Comme  $\text{co}(A+B)$  est convexe,  $\text{co}(\text{co}(A+B)) = \text{co}(A+B)$ , donc  $a+b \in \text{co}(A+B)$ .

### Exercice 4.9

On dit qu'un point  $x \in A$  est un point exposé de  $A$  s'il existe un hyperplan d'appui  $H$  à  $A$  tel que  $H \cap A = \{x\}$ .

On note  $\exp A$  l'ensemble des points exposés de  $A$ .

1. Montrer que si  $C$  est convexe, on a  $\exp C \subset \text{ext } C$ .
2. Donner un exemple de convexe  $C$  pour lequel  $\exp C \subsetneq \text{ext } C$ .
3. Donner un exemple dans  $\mathbb{R}^3$  qui vérifie  $\exp C \subsetneq \text{ext } C \subsetneq \overline{\exp C}$

1. Soit  $C$  un convexe. On rappelle que  $\text{ext } C$  désigne l'ensemble des points extrémaux de  $C$ .

Soit  $x^* \in \exp C$ . Soit  $H$  l'hyperplan d'appui à  $C$  tel que  $H \cap C = \{x^*\}$ . Il existe  $\ell \in \mathcal{L}_c(E, \mathbb{R})$  une forme linéaire continue non-triviale et un réel  $\alpha$  tels que  $H = \{x \in E \mid \ell(x) = \alpha\}$ . On suppose sans perte de généralité que  $C \subset H^+ = \{x \in E \mid \ell(x) \geq \alpha\}$ .

Comme  $x^* \in H$ , on a  $\ell(x^*) = \alpha$ . Si  $x \in C$  est tel que  $\ell(x) = \alpha$ , alors  $x \in C \cap H$  et donc  $x = x^*$ .

Si  $x \in C$  et  $x \neq x^*$  on a donc  $\ell(x) > \alpha$ .

Supposons par l'absurde que  $x^* \notin \text{ext } C$ . On dispose alors de  $a, b \in C$  et  $\lambda \in ]0, 1[$  tels que  $x^* = (1 - \lambda)a + \lambda b$ .

Alors  $\ell(x^*) = (1 - \lambda)\ell(a) + \lambda\ell(b)$ .

Comme  $\lambda \in ]0, 1[$ ,  $(1 - \lambda)\ell(a) + \lambda\ell(b) > \min(\ell(a), \ell(b))$ . Comme  $a \neq x^*$  et  $b \neq x^*$ ,  $\min(\ell(a), \ell(b)) > \alpha$ .

Donc  $\ell(x^*) = (1 - \lambda)\ell(a) + \lambda\ell(b) > \alpha$  ce qui contredit  $\ell(x^*) = \alpha$ .

2. Dans  $\mathbb{R}^2$  on considère l'ensemble  $A$  formé d'un demi arc de cercle au dessous duquel on colle une sorte de carré, comme sur la figure ci dessous.

Formellement  $A = \{(x, y) \mid x^2 + y^2 = 1 \text{ et } y \geq 0\} \cup \{(-1, y) \mid y \in [0, -2]\} \cup \{(1, y) \mid y \in [0, -2]\} \cup \{(x, -2) \mid x \in [-1, 1]\}$ . Le seul hyperplan d'appui contenant  $B$  est la droite  $x = 1$  qui contient aussi  $\{(1, y) \mid y \in [0, -2]\}$ . Donc  $B$  n'est pas exposé.

Pourtant  $B$  est extrémal.

3. ?



### Exercice 4.10

Soit  $C$  un convexe compact de  $\mathbb{R}^n$ .

1. Pour  $a \in \mathbb{R}^n \setminus \{0\}$  on considère  $\varphi : C \rightarrow \mathbb{R}, x \mapsto 2\langle a, x \rangle$ . Montrer que  $\varphi$  admet un maximum sur  $C$  atteint en un point  $x_0$ .
2. Soit  $H_a = \{x \in \mathbb{R}^n \mid \langle a, x \rangle = \langle a, x_0 \rangle\}$ . Montrer que  $H_a \cap C$  est un convexe non vide.

1.  $\varphi$  est continue sur  $\mathbb{R}^n$  (car linéaire à partir d'un espace de dimension finie), donc elle admet un maximum sur le compact  $C$ .

2.  $H_a$  contient  $x_0$ . Montrons que  $H_a$  est convexe. Soit  $x, y \in H_a$  et  $\lambda \in [0, 1]$ . Alors  $\langle a, \lambda x + (1-\lambda)y \rangle = \lambda \langle a, x \rangle + (1-\lambda) \langle a, y \rangle = \lambda \langle a, x_0 \rangle + (1-\lambda) \langle a, x_0 \rangle = \langle a, x_0 \rangle$  donc  $\lambda x + (1-\lambda)y \in H_a$  et  $H_a$  est convexe.

$H_a \cap C$  est donc convexe comme intersection de deux convexes et non vide car il contient  $x_0$ .

### Exercice 4.11

Soient  $H$  un espace de Hilbert et  $C$  une partie convexe fermée non vide de  $H$ .

1. On considère  $f : H \rightarrow \mathbb{R}$  définie par  $f(x) = (d(x, C))^2$ . Montrer que  $f$  est différentiable en tout point et calculer la différentielle de  $f$  en un point  $x$  de  $H$ . (On considérera le projecteur  $P$  de meilleure approximation sur  $C$ ).
2. Soit  $\varphi : H \rightarrow \mathbb{R}$  définie par  $\varphi(x) = \langle Ax, x \rangle + \langle f, x \rangle$  où  $f \in H$  et  $A \in \mathcal{L}_c(H, H)$  auto-adjointe. Déterminer le gradient de  $\varphi$  en  $x$ .

1. On rappelle que la projection sur un convexe fermé d'un Hilbert est unique

et on notera  $p_C(x)$  le projeté de  $x$  sur  $C$ . On rappelle que  $p_C$  est 1-lipschitzienne.

Soit  $x \in H$  fixé et  $h \in H$ . On a le développement

$$\begin{aligned} d(x+h, C)^2 &= \|x+h - p_C(x+h)\|^2 \\ &= \|x - p_C(x) + h + p_C(x) - p_C(x+h)\|^2 \\ &= d(x, C)^2 + 2\langle x - p_C(x), h \rangle + 2\langle x - p_C(x), p_C(x) - p_C(x+h) \rangle + \|p_C(x) - p_C(x+h) + h\|^2 \\ &= d(x, C)^2 + 2\langle x - p_C(x), h \rangle + 2\langle p_C(x) - p_C(x+h), h + x - p_C(x) \rangle + \|p_C(x) - p_C(x+h)\|^2 + \|h\|^2 \end{aligned}$$

Le candidat naturel pour la différentielle de  $f$  en  $x$  est donc  $h \mapsto 2\langle x - p_C(x), h \rangle$ . Sachant que  $p_C$  est 1-lipschitzienne il est facile de montrer que  $\|p_C(x) - p_C(x+h)\|^2 + \|h\|^2 = o(\|h\|)$ .

Cependant il est **remarquablement difficile** de prouver par des moyens élémentaires que  $\langle p_C(x) - p_C(x+h), h + x - p_C(x) \rangle = o(\|h\|)$ . (On peut montrer facilement que c'est un  $O(\|h\|)$  mais c'est insuffisant).

On adopte une approche différente :

**Lemme** : Soit  $f, g_1, g_2 : H \rightarrow \mathbb{R}$  trois fonctions différentiables en  $x \in H$  avec  $U$  un voisinage de  $x$  et

$$\forall y \in U, g_1(y) \leq f(y) \leq g_2(y)$$

et  $g_1(x) = g_2(x)$ .

Alors  $dg_1(x) = dg_2(x)$ ,  $f$  est différentiable en  $x$  et  $df(x) = dg_1(x)$ .

Preuve : Pour  $h \in U - x$  on a  $g_1(x+h) \leq g_2(x+h)$ . On dispose de deux fonctions  $\varepsilon_1$  et  $\varepsilon_2 : H \rightarrow \mathbb{R}$  nulles et continues en 0 telles que

$$g_1(x) + dg_1(x)(h) + \|h\|\varepsilon_1(h) \leq g_2(x) + dg_2(x)(h) + \|h\|\varepsilon_2(h)$$

ie

$$dg_2(x)(h) - dg_1(x)(h) + \|h\|(\varepsilon_2(h) - \varepsilon_1(h)) \geq 0$$

Pour  $t > 0$  on remplace  $h$  par  $th$  et on obtient

$$t(dg_2(x)(h) - dg_1(x)(h)) + t\|h\|(\varepsilon_2(th) - \varepsilon_1(th)) \geq 0$$

En simplifiant par  $t$  puis en faisant  $t \rightarrow 0$ ,

$$dg_2(x)(h) - dg_1(x)(h) \geq 0$$

En remplaçant  $h$  par  $-h$  dans la dernière inégalité,

$$dg_2(x)(h) - dg_1(x)(h) \leq 0$$

donc  $dg_2(x)(h) = dg_1(x)(h)$ , ceci étant vrai pour tout  $h \in H$ , donc  $dg_2(x) = dg_1(x)$ .

Posons  $dg(x) := dg_1(x)$  et réécrivons l'inégalité  $g_1(x+h) \leq f(x+h) \leq g_2(x+h)$  :

$$f(x) + dg(x)(h) + \|h\|\varepsilon_1(h) \leq f(x+h) \leq f(x) + dg(x)(h) + \|h\|\varepsilon_2(h)$$

donc

$$\varepsilon_1(h) \leq \frac{f(x+h) - f(x) - dg(x)(h)}{\|h\|} \leq \varepsilon_2(h)$$

Par encadrement, on a pour  $\|h\| \rightarrow 0$ ,  $\frac{f(x+h) - f(x) - dg(x)(h)}{\|h\|} \rightarrow 0$ .

□

Revenons au problème. Soit  $x \in H \setminus C$  fixé. Posons  $x^* = p_C(x)$ ,  $e = \frac{x-x^*}{\|x-x^*\|}$  et  $\mathcal{H}$  l'hyperplan d'appui en  $x^*$  de normale  $e$ , de sorte que

$$\mathcal{H} = \{y \in H, \langle y, e \rangle = \langle x^*, e \rangle\}$$

**Lemme :** On note  $p_{\mathcal{H}}$  la projection orthogonale sur  $\mathcal{H}$  (qui est un sev fermé). Soit  $y \in \mathcal{H}^+$  et  $z \in \mathcal{H}^-$ . Alors  $\|y - p_{\mathcal{H}}(y)\| \leq \|y - z\|$ .

Preuve : C'est géométriquement évident (faire un dessin). Formellement, comme  $\|y - z\|^2 = \|y - p_{\mathcal{H}}(y) + p_{\mathcal{H}}(y) - z\|^2$

$$= \|y - p_{\mathcal{H}}(y)\|^2 + \|p_{\mathcal{H}}(y) - z\|^2 - 2\langle y - p_{\mathcal{H}}(y), z - p_{\mathcal{H}}(y) \rangle$$

il suffit de prouver que  $\langle y - p_{\mathcal{H}}(y), z - p_{\mathcal{H}}(y) \rangle \leq 0$  (ce qui est encore une évidence géométrique).

Comme  $y - p_{\mathcal{H}}(y) \in \mathcal{H}^\perp$  (cf théorème de la projection orthogonale sur un sev fermé), et que  $\mathcal{H}^\perp = \text{Vect}(e)$  on peut écrire

$$y - p_{\mathcal{H}}(y) = \lambda e \text{ d'où } \langle y - p_{\mathcal{H}}(y), e \rangle = \lambda \|e\|^2 = \lambda$$

$$= \langle y, e \rangle - \langle p_{\mathcal{H}}(y), e \rangle$$

$$\geq \langle x^*, e \rangle - \langle p_{\mathcal{H}}(y), e \rangle \quad \text{car } y \in \mathcal{H}^+$$

$$= \langle x^*, e \rangle - \langle x^*, e \rangle \quad \text{car } p_{\mathcal{H}}(y) \in \mathcal{H}$$

$$= 0$$

donc  $\lambda \geq 0$ .

Finalement,  $\langle y - p_{\mathcal{H}}(y), z - p_{\mathcal{H}}(y) \rangle = \lambda \langle e, z - p_{\mathcal{H}}(y) \rangle$

$$= \lambda (\langle e, z \rangle - \langle e, p_{\mathcal{H}}(y) \rangle)$$

$$\leq \lambda (\langle e, x^* \rangle - \langle e, x^* \rangle) \quad \text{car } \lambda \geq 0, z \in \mathcal{H}^-, p_{\mathcal{H}}(y) \in \mathcal{H}$$

$$= 0$$

comme souhaité.

□

Dans notre problème on dispose d'un voisinage de  $x$  noté  $U$  tel que  $U \subset \mathcal{H}^+$ . Pour  $y \in U$ , comme  $p_C(y) \in C \subset \mathcal{H}^-$ , le lemme donne  $(d(y, \mathcal{H}))^2 \leq (d(y, C))^2$ . On a aussi la majoration triviale  $(d(y, C))^2 \leq \|y - x^*\|^2$ . En bref

$$(d(y, \mathcal{H}))^2 \leq (d(y, C))^2 \leq \|y - x^*\|^2$$



Par ailleurs  $(d(y, \mathcal{H}))^2$  se réécrit simplement

$$\langle y - p_{\mathcal{H}}(y), e \rangle^2 = \langle y - x^*, e \rangle^2 = \langle y - x^*, \frac{x - x^*}{\|x - x^*\|} \rangle^2$$

D'où l'encadrement

$$\underbrace{\langle y - x^*, \frac{x - x^*}{\|x - x^*\|} \rangle^2}_{:=g_1(y)} \leq (d(y, C))^2 \leq \underbrace{\|y - x^*\|^2}_{:=g_2(y)}$$

On a bien  $g_1(x) = g_2(x)$ ,  $g_1$  différentiable en  $x$  et  $g_2$  différentiable en  $x$  de différentielle  $h \mapsto 2\langle h, x - x^* \rangle$  (application linéaire continue par Cauchy-Schwarz). D'après le lemme,  $f$  est différentiable en  $x$  de différentielle  $h \mapsto 2\langle h, x - x^* \rangle$ .

Il reste à traiter le cas où  $x \in C$ . Il suffit de noter qu'alors

$$(d(x + h, C))^2 \leq \|(x + h) - x\|^2 = \|h\|^2$$

Donc  $f$  est différentiable de différentielle nulle.

2. Pour  $x \in H$  on a le développement

$$\begin{aligned} \varphi(x + h) &= \varphi(x) + \langle Ax, h \rangle + \langle Ah, x \rangle + \langle f, h \rangle + \langle Ah, h \rangle \\ &= \varphi(x) + \langle Ax, h \rangle + \langle h, Ax \rangle + \langle f, h \rangle + \langle Ah, h \rangle \quad \text{car } A \text{ auto-adjointe} \\ &= \varphi(x) + \langle h, 2Ax + f \rangle + \langle Ah, h \rangle \end{aligned}$$

$h \mapsto \langle h, 2Ax + f \rangle$  est linéaire et continue (par Cauchy-Schwarz). Par ailleurs,

$$\frac{|\langle Ah, h \rangle|}{\|h\|} \leq \|Ah\| \leq \|A\|_{op} \|h\| \xrightarrow{\|h\| \rightarrow 0} 0$$

$\varphi$  est donc différentiable en  $x$ , de gradient  $2Ax + f$ .

### Exercice 4.12

Soit  $C$  un convexe de  $\mathbb{R}^n$ . Pour  $0 \geq b \geq a$ , montrer que

$$aC - bC = (a - b)C + b(C - C)$$

⊂ Soit  $ac - bc' \in aC - bC$ . Alors

$$ac - bc' = (a - b)c + b(c - c') \in (a - b)C + b(C - C)$$

⊃ Soit  $(a - b)c + b(c' - c'') \in (a - b)C + b(C - C)$ . On a

$$\begin{aligned} (a - b)c + b(c' - c'') &= -((b - a)c + (-b)(c' - c'')) \\ &= - \left( (-a) \underbrace{\left[ \left(1 - \frac{b}{a}\right)c + \frac{b}{a}c' \right]}_{\in C} + bc'' \right) \\ &= a \left[ \left(1 - \frac{b}{a}\right)c + \frac{b}{a}c' \right] - bc'' \\ &\in aC - bC \end{aligned}$$

### Exercice 4.13

Soit  $C$  un fermé de  $\mathbb{R}^n$  tel que  $\forall x, y \in C, ]x, y[ \cap C \neq \emptyset$ .  
Montrer que  $C$  est convexe.

Supposons par l'absurde que  $C$  n'est pas convexe : on dispose alors de  $x, y \in C$  et  $\alpha \in ]0, 1[$  tel que  $(1 - \alpha)x + \alpha y \notin C$ .

Considérons  $\mu = \inf\{\lambda \geq \alpha \mid (1 - \lambda)x + \lambda y \in C\}$ . On dispose de  $\lambda_n$  une suite qui décroît vers  $\mu$  avec pour tout  $n$ ,  $(1 - \lambda_n)x + \lambda_n y \in C$  et  $\lambda_n \geq \alpha$ . En passant à la limite, comme  $C$  est fermé, on a  $(1 - \mu)x + \mu y \in C$  et  $\mu \geq \alpha$ . Comme  $(1 - \alpha)x + \alpha y \notin C$ , l'inégalité est stricte :  $\mu > \alpha$ .

De même, on pose  $\nu = \sup\{\lambda \leq \alpha \mid (1 - \lambda)x + \lambda y \in C\}$ . On a encore  $(1 - \nu)x + \nu y \in C$  et  $\nu < \alpha$ .

Posons  $a = (1 - \mu)x + \mu y$  et  $b = (1 - \nu)x + \nu y$ . Alors  $]a, b[ \cap C \neq \emptyset$  : on dispose de  $\gamma \in ]0, 1[$  tel que  $(1 - \gamma)b + \gamma a \in C$ .

Or  $(1 - \gamma)b + \gamma a = (1 - [(1 - \gamma)\nu + \gamma\mu])x + [(1 - \gamma)\nu + \gamma\mu]y$  avec

$$(1 - \gamma)\nu + \gamma\mu \in ]\nu, \mu[$$

Ceci contredit la définition de  $\nu$ , absurde.

### Exercice 4.14

Soit  $X$  un fermé de  $\mathbb{R}^n$  et  $x \in X$ . On dit que  $v \in \mathbb{R}^n$  est une direction asymptotique de  $X$  en  $x$  si

$$\forall a \geq 0, x + av \in X$$

On note  $K(X, x)$  l'ensemble des directions asymptotiques de  $X$  en  $x$ .

1. Montrer que  $\forall x \in X, K(X, x)$  est un cône.
2. Si  $X$  est convexe, montrer que  $K(X, x)$  est convexe et que si  $x, x' \in X$ , alors  $K(X, x) = K(X, x')$ .

1. Soit  $x \in X, v \in K(X, x)$  et  $\lambda \geq 0$ . Montrons que  $\lambda v \in K(X, x)$ . Pour  $a \geq 0, a\lambda \geq 0$  donc  $x + a\lambda v \in X$ , donc  $\lambda v \in K(X, x)$ .

2. On suppose  $X$  convexe. Montrons que  $K(X, x)$  est convexe. Pour  $v, v' \in K(X, x), \lambda \in [0, 1]$  et  $a \geq 0$

$$x + a[(1 - \lambda)v + \lambda v'] = (1 - \lambda)\underbrace{(x + av)}_{\in X} + \lambda\underbrace{(x + av')}_{\in X} \in X$$

Donc  $(1 - \lambda)v + \lambda v' \in K(X, x)$  et  $K(X, x)$  est convexe.

Soient  $x, x' \in X$ . Montrons que  $K(X, x) \subset K(X, x')$ . Soit  $v \in K(X, x)$  et  $a \geq 0$ . On remarque que

$$x' + av = \lim_n \left( \underbrace{\left( \left(1 - \frac{1}{n}\right)x' + \frac{1}{n}\underbrace{(x + nav)}_{\in X} \right)}_{\in X} \right)$$

Comme  $X$  est fermé,  $x' + av \in X$  donc  $x' \in K(X, x)$  et  $K(X, x) \subset K(X, x')$ . On a l'inclusion inverse par symétrie.

### Exercice 4.15

Soit  $X$  un convexe de  $\mathbb{R}^n$  et  $A$  un convexe de  $\mathbb{R}^+$  qui contient 0.

Montrer que  $\bigcup_{a \in A} aX$  est convexe.

Que se passe-t-il lorsque  $A = [-1, 1]$  ?

Soient  $x, y \in \bigcup_{a \in A} aX$ . On dispose de  $a, b \in A$  et  $x_1, x_2 \in X$  tels que  $x = ax_1$  et  $y = bx_2$ . Soit  $\lambda \in [0, 1]$ .

Il s'agit de montrer que  $(1 - \lambda)ax_1 + \lambda bx_2 \in \bigcup_{a \in A} aX$ .

Si  $a = 0$  ou  $b = 0$ , en supposant par exemple que  $a = 0$ , il suffit de prouver que  $\lambda b x_2 \in \bigcup_{a \in A} aX$ . Comme  $\lambda b = (1 - \lambda)0 + \lambda b$ , on a  $\lambda b x_2 \in (\lambda b)X$ .

Si  $a \neq 0$  et  $b \neq 0$ , on remarque qu'on a l'égalité

$$\underbrace{(\lambda a + (1 - \lambda)b)}_{\in A} \underbrace{\left[ \left( 1 - \frac{(1 - \lambda)b}{\lambda a + (1 - \lambda)b} \right) x_1 + \frac{(1 - \lambda)b}{\lambda a + (1 - \lambda)b} x_2 \right]}_{\in C} = (1 - \lambda)ax_1 + \lambda b x_2$$

ce qui prouve le résultat.

### Exercice 4.16

□

### Exercice 4.17

□

### Exercice 4.18

Montrer que l'ensemble suivant est convexe :

$$C = \{(a, b, c) \in \mathbb{R}^3 \mid a > 0, b^2 - 4ac < 0\}$$

Soient  $(a, b, c), (a', b', c') \in C$  et  $\lambda \in [0, 1]$ .

Il s'agit de montrer que  $(1 - \lambda)(a, b, c) + \lambda(a', b', c') \in C$ .

Considérons les polynômes  $P(X) = aX^2 + bX + c$  et  $Q(X) = a'X^2 + b'X + c'$ .

Comme  $(a, b, c) \in C$ ,  $P$  est un polynôme strictement positif, au sens où

$$\forall x \in \mathbb{R}, P(x) > 0$$

De même,  $Q$  est strictement positif.

Or, pour deux réels strictement positifs  $x > 0$  et  $y > 0$ , on a pour tout  $\lambda \in [0, 1]$ ,  $(1 - \lambda)x + \lambda y > 0$ .

On en déduit que  $(1 - \lambda)P + \lambda Q$  est un polynôme strictement positif dont

#### 4.. ENSEMBLES CONVEXES

---

les coefficients sont  $((1 - \lambda)a + \lambda a', (1 - \lambda)b + \lambda b', (1 - \lambda)c + \lambda c')$ .

Ceci implique  $((1 - \lambda)a + \lambda a', (1 - \lambda)b + \lambda b', (1 - \lambda)c + \lambda c') \in C$ , soit encore

$$(1 - \lambda)(a, b, c) + \lambda(a', b', c') \in C$$