

Un peu de calcul différentiel

Résumé

On souhaite généraliser la démarche adoptée pour résoudre géométriquement certains programmes linéaires au cas des problèmes d'optimisation non-linéaires. L'objectif est de trouver des hyperplans d'appui aux sous-niveaux d'une fonction objectif; ils indiquent une direction de recherche pour minimiser celle-ci. La définition de ces hyperplans d'appui s'effectue par une étude locale des fonctions objectifs, une étude qui généralise l'apport de la dérivée d'une fonction numérique à la compréhension du comportement de celle-ci en un point.

Table des matières

1	Normes sur \mathbb{R}^n	1
2	Différentiabilité et différentielle en un point	4
2.1	Interprétations géométriques	6
2.2	Optimiser, toujours	6
3	Lagrangien et conditions KKT	7
3.1	Des problèmes simples	7
3.2	Un problème débile	7
3.3	Un problème géométrique	8
4	Hessienne d'une fonction	8
4.1	Convexité	9

1 Normes sur \mathbb{R}^n

Une norme sur un espace vectoriel apporte une manière de mesurer la *longueur* d'un vecteur tout en respectant un minimum la structure vectorielle. Elle permet en particulier de définir une notion de distance entre deux points de \mathbb{R}^n par la *longueur* du vecteur qui les relie. Pouvoir changer de mesure de longueur suivant les problèmes qu'on attaque est crucial lorsque l'on s'attaque à des problèmes d'optimisation. À la fois pour pouvoir modéliser les problèmes en jeu; comment mesure la différence entre deux mots? Ou pour accélérer la convergence de certains algorithmes d'apprentissages.

Définition 1.1. Une norme sur \mathbb{R}^n est une application $\|\cdot\| : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}_+$ telle que :

1. $\|x\| = 0 \Leftrightarrow x = 0$;
2. $\forall \lambda \in \mathbb{R}, \forall x \in \mathbb{R}^n, \|\lambda x\| = |\lambda| \|x\|$ (relation d'*homogénéité*);
3. $\forall x \in \mathbb{R}^n, \forall y \in \mathbb{R}^n, \|x + y\| \leq \|x\| + \|y\|$ (*Inégalité triangulaire*).

Question 1-1 Interpréter chacune des propriétés suivantes avec vos propres mots.

L'inégalité triangulaire donne lieu à une autre inégalité, appelée *inégalité triangulaire inversée* qui peut parfois être utile¹ :

$$\forall x, y \in \mathbb{R}^n, \quad \left| \|x\| - \|y\| \right| \leq \|x - y\|.$$

1. Il est très probable qu'elle ne fasse que partie de votre culture ...

Question 1-2 Représenter cette inégalité géométriquement. Essayer de la déduire de l'inégalité triangulaire.

Les trois normes les plus fréquentes d'utilisation sont les trois suivantes, elles sont respectivement qualifiées de normes 1, 2 et infinie.

1. $\forall x \in \mathbb{R}^n, \|x\|_1 = \sum_{i=1}^n |x_i|$;
2. $\forall x \in \mathbb{R}^n, \|x\|_2 = \sqrt{\sum_{i=1}^n x_i^2} = \sqrt{x^T x}$;
3. $\forall x \in \mathbb{R}^n, \|x\|_\infty = \max\{|x_i| \mid 1 \leq i \leq n\}$.

Les définitions des normes 1 et 2 vont pouvoir se généraliser pour tout $p \geq 1$ ², par

$$\forall x \in \mathbb{R}^n, \quad \|x\|_p = \left(\sum |x_i|^p \right)^{\frac{1}{p}}.$$

La norme $\|\cdot\|_p$ est communément appelée la norme p . Montrer le fait que c'est une norme est uniquement délicat pour ce qui est de l'inégalité triangulaire, la preuve de ce fait se base sur des inégalités de convexités dites de HÖLDER, on n'abordera pas cette preuve dans ce cours. Les normes p ne seront que très localement utilisées en dehors des cas standards des normes 1, 2 et $+\infty$, il est cela dit usuel d'en connaître la définition.

À partir d'une norme on va être en mesure de définir :

Une notion de *distance* entre deux points de \mathbb{R}^n par norme du vecteur qui relie les deux points en question. Plus formellement étant donné une norme $\|\cdot\|$ on note

$$\forall x, y, \quad d_{\|\cdot\|}(x, y) = \|x - y\|.$$

Dans le cas des normes p on se contente d'indiquer p en indice.

Question 1-3 Représenter graphiquement les distances 1, 2 et $+\infty$ entre deux vecteurs de \mathbb{R}^2 .

Une notion de *voisinage* d'un point de \mathbb{R}^n au sens de la norme utilisée. Cette notion éminemment liée à la première, on l'isole ici parce qu'elle apporte un point de vue auquel vous n'avez pas encore été confrontés. Étant donné un nombre réel $\varepsilon > 0$ on va qualifier ε -voisinage d'un point $x \in \mathbb{R}^n$ tous les points à distance (au sens de la norme utilisée) au plus ε de x . Dans le jargon, on appelle boule ouverte de rayon ε et centrée en x cette notion, pour une norme ambiante $\|\cdot\|$ on note

$$B_{\|\cdot\|}(x, \varepsilon) = \{y \in \mathbb{R}^n \mid d_{\|\cdot\|}(x, y) < \varepsilon\}$$

La boule fermée centrée en x et de rayon ε est la notion correspondante avec les points à distance ε incluses,

$$\overline{B}_{\|\cdot\|}(x, \varepsilon) = \{y \in \mathbb{R}^n \mid d_{\|\cdot\|}(x, y) \leq \varepsilon\}.$$

Dans le cas des normes p on se contente d'indexer les boules par p .

La notion de ε -voisinage permet d'exprimer des phénomènes de passage à la limite et d'études locales. Dire qu'une suite $(u_k)_{k \in \mathbb{N}}$ de points de \mathbb{R}^n converge vers $\ell \in \mathbb{R}^n$, au sens d'une norme $\|\cdot\|$, correspond au fait de dire que pour tout ε -voisinage $B(\ell, \varepsilon)$ de ℓ , il existe un rang N à partir duquel tous les éléments de la suite u_k sont dans $B(\ell, \varepsilon)$.

Question 1-4

- Dessiner les boules unités $\overline{B}_p(0, 1)$ pour $p \in \{1, 2, \infty\}$.
- Montrer que les ε -voisinages d'une norme $\|\cdot\|$ sur \mathbb{R}^n sont convexes.
- La définition d'un équivalent à une norme p pour $p < 1$ définit-il une norme ?

2. Il est tout à fait naturel de se poser la question de savoir pourquoi $p \geq 1$! :)

On reprend plus en détails quelques extensions des notions liées aux études locales de fonctions en suites dans \mathbb{R} .

Exemple 1.1 (Convergence d'une suite.). Une suite $(u_k)_{k \in \mathbb{N}}$ dans \mathbb{R}^n converge vers un point $\ell \in \mathbb{R}^n$, au sens d'une norme $\|\cdot\|$ si

$$\forall \varepsilon > 0, \exists N \in \mathbb{N}, \quad k \geq N \Rightarrow \|u_k - \ell\| < \varepsilon.$$

Cette définition se traduit telle quelle par :

$$\forall \varepsilon > 0, \exists N \in \mathbb{N} \quad k \geq N \Rightarrow u_k \in B(\ell, \varepsilon).$$

Ou encore : pour tout $\varepsilon > 0$ il existe un rang N à partir duquel tous les éléments de la suite u_k sont dans le ε -voisinage de ℓ pour la norme $\|\cdot\|$.

Dans le cas de la norme infinie, la définition précédente s'écrit explicitement comme

$$\forall \varepsilon > 0, \exists N \in \mathbb{N}, \quad k \geq N \Rightarrow \max_{1 \leq i \leq n} \|u_{k,i} - \ell_i\| < \varepsilon.$$

où $u_{k,i}$ (resp. ℓ) est la composante le long de la coordonnée i du vecteur u_k (resp. ℓ_i). Cette définition peut encore être réécrite

$$\forall \varepsilon > 0, \exists N \in \mathbb{N}, \quad k \geq N \Rightarrow \forall i \in \{1, \dots, n\}, \|u_{k,i} - \ell_i\| < \varepsilon.$$

Un peu de réflexion permet de voir que cette dernière est équivalente

$$\forall i \in \{1, \dots, n\}, \forall \varepsilon > 0, \exists N \in \mathbb{N}, \quad k \geq N \Rightarrow \|u_{k,i} - \ell_i\| < \varepsilon.$$

Autrement dit, la suite (u_k) converge vers ℓ , au sens de la norme infinie, si et seulement si, chacune des suites **numériques** $(u_{k,i})$ converge vers ℓ_i .

Exemple 1.2 (Limite d'une fonction en un point.). On considère deux normes $\|\cdot\|_\alpha$ et $\|\cdot\|_\beta$ respectivement sur \mathbb{R}^n et \mathbb{R}^m . Une fonction $f : (\mathbb{R}^n, \|\cdot\|_\alpha) \rightarrow (\mathbb{R}^m, \|\cdot\|_\beta)$ a une limite $\ell \in \mathbb{R}^m$ en un point $a \in \mathbb{R}^n$ si

$$\forall \varepsilon > 0, \exists \eta > 0, \quad x \neq a \text{ et } \|x - a\|_\alpha \eta \Rightarrow \|f(x) - \ell\|_\beta < \varepsilon.$$

Chose qu'on peut encore exprimer par

$$\forall \varepsilon > 0, \exists \eta > 0, \quad x \in B_{\|\cdot\|_\alpha}(a, \eta) \setminus \{a\} \Rightarrow f(x) \in B_{\|\cdot\|_\beta}(\ell, \varepsilon),$$

ou encore pour tout ε -voisinage B de ℓ pour la norme $\|\cdot\|_\beta$ il existe un η -voisinage de a , a étant exclu dont tout élément a une image dans B .

Exemple 1.3 (Continuité d'une fonction en un point.). La continuité d'une fonction $f : (\mathbb{R}^n, \|\cdot\|_\alpha) \rightarrow (\mathbb{R}^m, \|\cdot\|_\beta)$ en un point $a \in \mathbb{R}^n$ s'écrit

$$\forall \varepsilon > 0, \exists \eta > 0, \quad \|x - a\|_\alpha \eta \Rightarrow \|f(x) - f(a)\|_\beta < \varepsilon.$$

Autrement dit pour tout ε -voisinage B de $f(a)$ pour la norme $\|\cdot\|_\beta$ il existe un η -voisinage de a dont tout élément a une image dans B .

Question 1-5

- Donner des exemples de fonctions continues (pour les normes de votre choix) de \mathbb{R}^2 dans \mathbb{R} .
- Comment peut-on en construire d'autres à partir de celles-ci ? Que dire de l'addition, la multiplication, le quotient ou la composition de fonctions continues ?
- Comment tester la continuité de fonctions à plusieurs variables en se ramenant au cas des fonctions numériques ?
- Est-ce que ça marche tous les temps ?

Exemple 1.4 (Comparaisons en un point.). Une fonction $f : (\mathbb{R}^n, \|\cdot\|_\alpha) \rightarrow (\mathbb{R}^m, \|\cdot\|_\beta)$ est un o en un point $a \in \mathbb{R}^n$ d'une fonction g , sur les mêmes espaces et par rapport aux mêmes normes, s'il existe une fonction $\epsilon : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ telle que $f = \epsilon g$ avec $\lim_{t \rightarrow a} \epsilon(t) = 0$. Quand g n'est pas nulle sur un voisinage de a la définition précédente est équivalente au fait que

$$\lim_{t \rightarrow a} \frac{\|f(t)\|_\alpha}{\|g(t)\|_\beta} = 0.$$

On écrit dans ce cas que f est un $o_a(g)$. On laisse tomber le point a quand celui-ci est clair du contexte. Pour obtenir les notions d'équivalence et de \mathcal{O} en un point a , il suffit de remplacer les limites de ϵ ou de quotient respectivement par 1 et une constante positive quelconque.

Question 1-6 Justifier les affirmations suivantes :

1. $\langle h, h \rangle$ est un $o_0(h)$;
2. $\sin(\langle h, h \rangle) \sim_0 \langle h, h \rangle$.

À ce stade on est en droit de se demander si le choix des normes avec lesquels on travaille a une incidence sur les limites des suites qu'on étudie (une même suite convergerait pour une norme et pas pour une autre), les fonctions qu'on regarde (une même fonction serait continue pour une norme et pas pour une autre) etc. Le théorème suivant permet de se rassurer sur ce point (du moins en dimension finie).

Définition 1.2. Deux normes $\|\cdot\|_\alpha$ et $\|\cdot\|_\beta$ sur \mathbb{R}^n sont dites *équivalentes* s'il existe des constants $c, C \in \mathbb{R}_+^*$ telles que

$$\forall x \in \mathbb{R}^n, \quad c\|x\|_\alpha \leq \|x\|_\beta \leq C\|x\|_\alpha.$$

En reprenant les exemples précédents, il est relativement simple de se convaincre que deux normes équivalentes donnent des suites de mêmes natures, les mêmes fonctions continues et les mêmes comparaisons.

Question 1-7 Montrer que les normes 1, 2 et ∞ sont équivalentes.

Théorème 1.1. *Toutes les normes sur \mathbb{R}^n sont équivalentes.*

Remarque 1. La preuve de ce théorème est en dehors du périmètre de ce cours. Elle nécessite certaines notions de topologie qui vous manquent ; notamment la notion de compacité. On se contentera du résultat.

Le fait que les normes soient équivalentes en terme de questionnement topologique (les études des phénomènes locaux) ne signifie pas qu'utiliser l'une ou l'autre en modélisation revient au même.

Question 1-8 Quelles normes utiliseriez-vous pour modéliser les problématiques suivantes :

1. Le calcul de la distance que doit parcourir un oiseau entre deux coordonnées GPS pas trop éloignées.
2. Le calcul de la distance que parcourt un touriste à Manhattan entre deux musées.
3. Le calcul du nombre de modifications nécessaires (lettre à lettre) pour changer un mot en un autre.

2 Différentiabilité et différentielle en un point

Cette série de questions est calculatoire. Savoir calculer la différentielle, le gradient (plus généralement la jacobienne) ou la dérivée directionnelle d'une fonction à plusieurs variables en tout point (ou du moins là où cela fait sens) est nécessaire.

Question 2-9 Calculer la différentielle de l'application sur \mathbb{R} , $f(x) = \frac{\sin(x)}{x^2+1}$ en tout point x . Quelle est la différence avec la dérivée de f .

Question 2-10 Calculer la différentielle des fonctions suivantes :

1. $f : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ donnée par l'expression $X \mapsto X^T A X$; , où A est une matrice carrée de taille (n, n) ;
2. $g : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ donnée par l'expression $X \mapsto 1/(X^T X + 1)$.
3. $f : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ donnée par l'expression $X \mapsto \cos^2(X^T A X)$, où A est une matrice carrée de taille (n, n) ;
4. $g : M_n(\mathbb{R}) \rightarrow \mathbb{R}$ donnée par $A \mapsto \text{tr}(A)^2$;
5. $h : M_n(\mathbb{R}) \rightarrow M_n(\mathbb{R})$ donnée par l'expression $B \mapsto \text{tr}(AB)B$ où A est une matrice carrée de taille (n, n) .

Question 2-11 On considère la fonction définie sur \mathbb{R}^2 par $f(x, y) = \frac{x^2 \cos(y)}{y + \sin^2(x) + 1}$. Pour tout $\vartheta \in \mathbb{R}$ on désigne par w_ϑ le vecteur (ϑ, ϑ^2) .

1. Calculer la dérivée directionnelle $\partial_{w_\vartheta} f(0, 0)$ en fonction de ϑ ;
2. Étudier cette fonction de ϑ .
3. Pouvez-vous interpréter vos résultats géométriquement ?

Question 2-12 Expliciter le gradient, en tout point où cela fait sens, des expressions différentiables suivantes :

1. $f(x, y) = e^{xy}(x + y)$;
2. $g(x, y, z) = (x + y \ln(z), xyz)$;
3. $h(x, y, z) = \left(\frac{x^2 \sin(xy)}{z^2 + 2}, \tan(xyz) \right)$;
4. $f(x, y, z) = \frac{x + y + z}{x + y^2 + 1}$;
5. $g(x, y) = \frac{\cos(xy)}{\sqrt{x^2 + y^2}}$;
6. $h(x, y, z) = \exp(xy - z)$.

Question 2-13 Soit $f : \mathbb{R}^3 \rightarrow \mathbb{R}$ une fonction différentiable en tout point de \mathbb{R}^3 . On considère la fonction $g : \mathbb{R}^3 \rightarrow \mathbb{R}$ donnée pour tout $(x, y, z) \in \mathbb{R}^3$ par

$$g(x, y, z) = f(x - y, y - z, z - x).$$

La fonction g est différentiable en tout point car composée de fonction différentiables. Montrer qu'on a la relation

$$\frac{\partial g}{\partial x}(a, b, c) + \frac{\partial g}{\partial y}(a, b, c) + \frac{\partial g}{\partial z}(a, b, c) = 0$$

pour tout point $(a, b, c) \in \mathbb{R}^3$.

2.1 Interprétations géométriques

Question 2-14 Trouver les points sur le paraboloidé $z = 4x^2 + y^2$ où le plan tangent est parallèle au plan $x + 2y + z = 6$. Faire de même avec le plan $3x + 5y - 2z = 5$.

Question 2-15 Un étudiant malheureux trouve pour plan tangent à la surface donnée par $z = x^4 - y^2$ au point $(2, 3, 7)$ la réponse

$$z = 4x^3(x - 2) - 2y(y - 3) + 7.$$

1. Sans calcul, pourquoi est-ce faux ?
2. Donner la réponse correcte.
3. D'où venait la confusion de l'étudiant ?

2.2 Optimiser, toujours

On revient sur les problèmes d'optimisation qu'on est désormais en mesure d'optimiser à l'aide des outils de calcul différentiel abordés.

Question 2-16 On considère la fonction différentiable $f : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}$ donnée par

$$f(x, y) = 3x^2 + y^2.$$

1. Représenter les courbes de niveaux 2 et 4 de f dans le plan euclidien.
2. À quel lieu correspond la condition $f(x, y) \leq 4$?
3. On s'intéresse au problème d'optimisation (**P4**)

$$\begin{array}{ll} \text{minimiser} & 2x + y \\ \text{sujet à} & 3x^2 + y^2 \leq 4 \end{array}$$

Représenter la courbe de niveau de la fonction objectif qui correspond à la valeur optimale de (**P4**).

4. Comment trouver le point optimale correspondant à (**P4**) ? Faire le calcul.

Question 2-17 On considère le problème d'optimisation (**P5**) suivant

$$\begin{array}{ll} \text{minimiser} & x + y \\ \text{sujet à} & x + 2y \leq 3 \\ & x \in B \end{array}$$

où B est la partie de \mathbb{R}^2 intersection de l'épigraphe de la fonction $x \mapsto -\sqrt{x}$ sur \mathbb{R}_+ et de la partie

$$\{(x, y) \mid y \leq \sqrt{x}\}.$$

1. Dessiner le lieu admissible du problème de (**P5**).
2. Représenter la courbe de niveau de la fonction objective qui réalise le minimum de (**P5**).

3. Calculer le point optimal ainsi que la valeur optimale de (**P5**).

3 Lagrangien et conditions KKT

On applique dans la suite la démarche KKT pour résoudre des problèmes d'optimisation plus délicat à résoudre géométriquement.

3.1 Des problèmes simples

Question 3-18 Résoudre le problème d'optimisation

$$\begin{aligned} &\text{minimiser} && x^2 - 14x + y^2 - 6y - 7 \\ &\text{sujet à} && \\ &&& x + y \leq 2 \\ &&& x + 2y \leq 3 \end{aligned}$$

Question 3-19 Une ressource disponible en quantité d doit être affectée à trois activités en quantités x_1 , x_2 et x_3 respectivement. L'allocation de x_k unités de ressource à l'activité k procure une recette évaluée par $f_k(x_k) = 8x_k - kx_k^2$. Calculer l'allocation qui procure la plus grande recette dans les deux éventualités suivantes :

1. la quantité d est complètement utilisée ;
2. l'excédant quand d n'est pas épuisé est revendu au prix p .

A-t-on intérêt à utiliser toutes les ressources disponibles ?

3.2 Un problème débile

Une entreprise fabrique deux modèles de clés USB, les modèles X et Y . Le modèle X se vend à 1€ pièce, le modèle Y se vend pour sa part à 3€ pièce. Le coût de fabrication en € est donné par l'expression :

$$C(x, y) = 5x^2 + 5y^2 - 2xy - 2x - 1000.$$

où x est le nombre de clés USB de type X et y celui de type Y . On suppose que toutes les clés USB ont été toutes écoulées sur le marché.

Question 3-20

6 P.

1. Soit $(x, y) \in (\mathbb{R}_+^*)^2$. Déterminer le profit $P(x, y)$ réalisé par l'entreprise lorsqu'elle a vendu x clés de modèle X et y clés de modèle Y .
2. Étudier la convexité de la fonction de profit P sur $(\mathbb{R}_+^*)^2$. Vous pouvez vous aider de la hessienne de P en tout point.
3. La capacité de production de l'entreprise est au total de 20 clés par jour ^a. Décrire le problème de maximisation du profit de l'entreprise comme un problème d'optimisation convexe.
4. En supposant que l'entreprise tourne à plein régime, trouver la répartition optimale entre les modèles de type X et Y permettant de maximiser le profit quotidien. Calculer dans ce cas le profit réalisé. *Vous êtes invités, en un premier temps, à ne pas tenir compte des contraintes de positivité de x et y .*
5. Pourquoi peut-on se dispenser des contraintes de positivité ?

^a. C'est des clés fait main !

3.3 Un problème géométrique

Question 3-21

1. Déterminer le rectangle de plus grande surface inscrit dans l'ellipse d'équation

$$\frac{x^2}{a} + \frac{y^2}{b} = 1.$$

2. Faire de même avec le parallélépipède de plus grand volume inscrit dans l'ellipsoïde d'équation

$$\frac{x^2}{a} + \frac{y^2}{b} + \frac{z^2}{c} = 1.$$

4 Hessienne d'une fonction

Dans cette section, on revient sur un point laissé de côté lors du cours : vous avez su lors de vos études secondaires étudier les types de point critiques que vous obteniez par l'annulation de la dérivée d'une fonction numérique à l'aide de la dérivée seconde. Cette démarche s'étend au cas des dimensions supérieures. Pour cela il nous faut généraliser la notion de dérivée seconde.

Définition 4.1. Soit $f : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ une fonction différentiable en tout point de son domaine de différentielle continue. On dit que f est 2-fois différentiable en un point a du domaine de f si le ∇f est différentiable. Dans ce cas on appelle **hessienne** de f en a la jacobienne de ∇f . Elle est notée $\nabla^2 f(a)$.

On regroupe les notations des coefficients de la matrice hessienne ; on écrira

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x^2} = \frac{\partial}{\partial x} \left(\frac{\partial f}{\partial x} \right)$$

et

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y} = \frac{\partial}{\partial x} \left(\frac{\partial f}{\partial y} \right).$$

Quand elle existe et *quand ses composantes sont continues*, la hessienne d'une fonction f en un point (a, b) définit une forme quadratique³ qu'on appelle **différentielle seconde** de f en (a, b) . Elle donne une approximation du second ordre de f au voisinage de (a, b) . La hessienne permet une étude plus fine des points critiques de la fonction f ainsi qu'une caractérisation pratique des conditions de convexité de celle-ci.

Proposition 4.1. Soit $f : U \rightarrow \mathbb{R}^m$ une application 2 fois différentiable en un point a de l'ouvert U . Alors pour h assez petit

$$f(a + h) = f(a) + \nabla f(a)h + \frac{1}{2}h^T \nabla^2 f(a)h + o_0(\|h\|^2). \quad (1)$$

.

Question 4-22 Soient $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ une fonction 2-fois dérivable et P une matrice symétrique. Quelle est la différentielle seconde, en tout point, de l'application f_P définie sur \mathbb{R}^n par $x \mapsto f(x^T P x)$?

3. Théorème de Schwarz

Question 4-23 Calculer les hessiennes en tout point des fonctions à valeurs réelles suivantes :

1. $f(x, y) = x^2 + xy + y^2 + \frac{x^3}{4}$;
2. $f(x, y) = x^3 + y^3$;
3. $f(x, y) = x^2y - \frac{x^2}{2} - y^2$;
4. $f(x, y, z) = x^2 + 3y^2 - z^2 + 2xy - 5yz$;
5. $f(x, y, z) = \ln(e^x + e^y + e^z)$.

4.1 Convexité

Soit $f : U \rightarrow \mathbb{R}$ une fonction définie et différentiable sur un ouvert convexe $U \subset \mathbb{R}^n$. Alors f est convexe si et seulement si

$$\forall x, y \in U, \quad f(x) - f(y) \geq \nabla f(x)(x - y). \quad (2)$$

On rappelle que ce critère (2) a une interprétation géométrique simple : l'hyperplan tangent au graphe de f en un point $(x, f(x))$ est un hyperplan d'appui. En effet, cette dernière condition se traduit en un point $x \in U$ par

$$(\nabla f(x), -1) \begin{pmatrix} y - x \\ f(y) - f(x) \end{pmatrix} \leq 0$$

qui donne, une fois la multiplication matricielle explicitée, la relation (2). On rappelle que le vecteur $(\nabla f(x), -1)$ est un vecteur normal définissant l'hyperplan tangent au graphe de f au point $(x, f(x))$. Notez au passage le fait que $\nabla f(x)$, x et y sont des vecteurs dans \mathbb{R}^n ; l'écriture ci-dessus est donc une écriture par blocs.

Ce critère d'ordre 1 est pratique mais pas toujours facile à manier. Quand f est une fonction 2 fois différentiable, tout comme dans le cas d'une fonction de \mathbb{R} dans \mathbb{R} , la positivité de la différentielle seconde nous apporte une information sur la convexité de f . Plus précisément :

Proposition 4.2. Soit $f : U \rightarrow \mathbb{R}$ une fonction 2 fois différentiable définie sur un ouvert convexe $U \subset \mathbb{R}^n$. Alors f est convexe si et seulement si

$$\forall x \in U, \quad \nabla^2 f(x) \geq 0. \quad (3)$$

Ainsi, un point critique d'une fonction convexe ne peut être qu'un minimum local, donc global. Les autres cas de figures sont ceux d'un maximum local (si la hessienne est négative) ou d'un **point selle** quand la hessienne n'est négative ni positive.

Question 4-24 Les fonction de la question (4-23) sont-elles convexes ? Justifier.