VIII - Réduction des matrices carrées

Révisions

- Calcul matriciel.
- Matrices inversibles.

I - Matrices diagonalisables

I.1 - Diagonalisabilité

Définition 1 - Matrices diagonalisables

Soit $A \in \mathscr{M}_n(\mathbb{R})$ une matrice carrée. La matrice A est *diagonalisable* s'il existe une matrice $P \in \mathscr{M}_n(\mathbb{R})$ inversible et une matrice $D \in \mathscr{M}_n(\mathbb{R})$ diagonale telles que $A = PDP^{-1}$.

Exemple 1 - Matrice diagonalisable

Soit $A = \begin{pmatrix} 7 & -4 & -4 \\ 3 & -1 & -3 \\ 5 & -4 & -2 \end{pmatrix}$, $D = \begin{pmatrix} -1 & 0 & 0 \\ 0 & 2 & 0 \\ 0 & 0 & 3 \end{pmatrix}$, $P = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 1 & 1 & 0 \\ 1 & -1 & 1 \end{pmatrix}$.

- D'après la définition du produit matriciel,

$$AP = \begin{pmatrix} -1 & 0 & 3 \\ -1 & 2 & 0 \\ -1 & -2 & 3 \end{pmatrix} \text{ et } PD = \begin{pmatrix} -1 & 0 & 3 \\ -1 & 2 & 0 \\ -1 & -2 & 3 \end{pmatrix}.$$

- En utilisant la méthode de Gauss-Jordan, on montre que P est inversible :

$$\left|\begin{array}{ccc|ccc} 1 & 0 & 1 & 1 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 0 & 0 & 1 & 0 \\ 1 & -1 & 1 & 0 & 0 & 1 \end{array}\right|$$

$$\left|\begin{array}{ccc|ccc} 1 & 0 & 1 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & -1 & -1 & 1 & 0 \\ 0 & -1 & 0 & -1 & 0 & 1 \end{array}\right| \begin{array}{l} \\ L_2 \leftarrow L_2 - L_1 \\ L_3 \leftarrow L_3 - L_1 \end{array}$$

$$\left|\begin{array}{ccc|ccc} 1 & 0 & 1 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & -1 & -1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & -1 & -2 & 1 & 1 \end{array}\right| \begin{array}{l} \\ \\ L_3 \leftarrow L_3 + L_2 \end{array}$$

$$\left|\begin{array}{ccc|ccc} 1 & 0 & 1 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & -1 & -1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 2 & -1 & -1 \end{array}\right| \begin{array}{l} \\ \\ L_3 \leftarrow -L_3 \end{array}$$

$$\left|\begin{array}{ccc|ccc} 1 & 0 & 0 & -1 & 1 & 1 \\ 0 & 1 & 0 & 1 & 0 & -1 \\ 0 & 0 & 1 & 2 & -1 & -1 \end{array}\right| \begin{array}{l} L_1 \leftarrow L_1 - L_3 \\ L_2 \leftarrow L_2 + L_3 \\ \end{array}$$

En reprenant l'égalité trouvée précédente et l'inversibilité de P,

$$\begin{aligned} AP &= PD \\ APP^{-1} &= PDP^{-1}, && \text{en mult. à droite par } P^{-1} \\ AI &= PDP^{-1}, && \text{car } PP^{-1} = I \\ A &= PDP^{-1}, && \text{en mult. à gauche par } P \end{aligned}$$

La matrice A est donc diagonalisable.

I.2 - Valeurs propres, Vecteurs propres

Définition 2 - Valeurs propres, Vecteurs propres

Soit $A \in \mathscr{M}_n(\mathbb{R})$ une matrice carrée. Le réel λ est une *valeur propre* de la matrice A s'il existe une matrice colonne X telle que

- X soit non nulle,
- $AX = \lambda X$.

La matrice colonne X est un *vecteur propre* associé à la valeur propre λ.

Exemple 2 - Valeurs / Vecteurs propres

Soit $A = \begin{pmatrix} 1 & -1 & -1 \\ -1 & 1 & -1 \\ -1 & -1 & 1 \end{pmatrix}$ et $X = \begin{pmatrix} -1 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix}$. Alors,

$$AX = \begin{pmatrix} -1 - 1 \\ 1 + 1 \\ 1 - 1 \end{pmatrix} = 2X.$$

Comme X est non nul et $AX = 2X$, alors X est un vecteur propre de A associé à la valeur propre 2.

Proposition 1 - Vecteurs propres / Diagonalisation

Soit $A \in \mathscr{M}_3(\mathbb{R})$. On suppose que A possède 3 valeurs propres distinctes λ_1, λ_2, λ_3 associées aux vecteurs propres X_1, X_2, X_3. En notant P la matrice dont les colonnes sont X_1, X_2, X_3 et D la matrice diagonale dont les coefficients diagonaux sont λ_1, λ_2, λ_3, alors

$$A = PDP^{-1}.$$

Exemple 3

Soit $A = \begin{pmatrix} 7 & -4 & -4 \\ 3 & -1 & -3 \\ 5 & -4 & -2 \end{pmatrix}$, $X_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}$, $X_2 = \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ -1 \end{pmatrix}$ et $X_3 = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}$.

- D'après la définition du produit matriciel,

$$AX_1 = \begin{pmatrix} 7 & -4 & -4 \\ 3 & -1 & -3 \\ 5 & -4 & -2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 7-4-4 \\ 3-1-3 \\ 5-4-2 \end{pmatrix}$$
$$= \begin{pmatrix} -1 \\ -1 \\ -1 \end{pmatrix} = - \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix} = -X_1.$$

Comme X_1 est non nul et $AX_1 = -X_1$, alors X_1 est un vecteur propre de A associé à la valeur propre -1.

- D'après la définition du produit matriciel,

$$AX_2 = \begin{pmatrix} 7 & -4 & -4 \\ 3 & -1 & -3 \\ 5 & -4 & -2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ -1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -4+4 \\ -1+3 \\ -4+2 \end{pmatrix}$$
$$= \begin{pmatrix} 0 \\ 2 \\ -2 \end{pmatrix} = 2 \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ -1 \end{pmatrix} = 2X_2.$$

Comme X_2 est non nul et $AX_2 = 2X_2$, alors X_2 est un vecteur propre de A associé à la valeur propre 2.

- D'après la définition du produit matriciel,

$$AX_3 = \begin{pmatrix} 7 & -4 & -4 \\ 3 & -1 & -3 \\ 5 & -4 & -2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 7-4 \\ 3-3 \\ 5-2 \end{pmatrix}$$
$$= \begin{pmatrix} 3 \\ 0 \\ 3 \end{pmatrix} = 3 \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix} = 3X_3.$$

Comme X_3 est non nul et $AX_3 = 3X_3$, alors X_3 est un vecteur propre de A associé à la valeur propre 3.

Proposition 2 - Diagonalisabilité et Valeurs propres (H.P.)

Soit $A \in \mathscr{M}_3(\mathbb{R})$, P une matrice inversible dont les colonnes sont notées X_1, X_2, X_3 et $D = \begin{pmatrix} d_1 & 0 & 0 \\ 0 & d_2 & 0 \\ 0 & 0 & d_3 \end{pmatrix}$.

Si $A = PDP^{-1}$, alors $AX_1 = d_1X_1$, $AX_2 = d_2X_2$ et $AX_3 = d_3X_3$.

II - Polynômes annulateurs

II.1 - Définition

Définition 3 - Polynôme annulateur

Soit $A \in \mathscr{M}_n(\mathbb{R})$ une matrice carrée et $Q(X) = a_0 + a_1X + \cdots + a_pX^p$ un polynôme non nul. Le polynôme Q est un *polynôme annulateur* de A si

$$Q(A) = a_0I + a_1A + \cdots + a_pA^p = 0.$$

Exemple 4 - Polynôme annulateur

Soit $A = \begin{pmatrix} 7 & -4 & -4 \\ 3 & -1 & -3 \\ 5 & -4 & -2 \end{pmatrix}$ et $Q(X) = X^3 - 4X^2 + X + 6$. Alors,

$$\begin{aligned} Q(A) &= A^3 - 4A^2 + A + 6I \\ &= \begin{pmatrix} 7 & -4 & -4 \\ 3 & -1 & -3 \\ 5 & -4 & -2 \end{pmatrix}^3 - 4\begin{pmatrix} 7 & -4 & -4 \\ 3 & -1 & -3 \\ 5 & -4 & -2 \end{pmatrix}^2 + \cdots \\ &\quad \cdots + \begin{pmatrix} 7 & -4 & -4 \\ 3 & -1 & -3 \\ 5 & -4 & -2 \end{pmatrix} + 6\begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} 55 & -28 & -28 \\ 9 & -1 & -9 \\ 47 & -28 & -20 \end{pmatrix} - 4\begin{pmatrix} 17 & -8 & -8 \\ 3 & 1 & -3 \\ 13 & -8 & -4 \end{pmatrix} + \cdots \\ &\quad \cdots + \begin{pmatrix} 7 & -4 & -4 \\ 3 & -1 & -3 \\ 5 & -4 & -2 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} 6 & 0 & 0 \\ 0 & 6 & 0 \\ 0 & 0 & 6 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}. \end{aligned}$$

Ainsi, Q est un polynôme annulateur de A.

En particulier, on obtient alors

$$\begin{aligned} A^3 - 4A^2 + A + 6I &= 0 \\ A(A^2 - 4A + I) &= -6I \\ A\left[-\frac{1}{6}\left(A^2 - 4A + I\right)\right] &= I. \end{aligned}$$

Donc A est inversible et $A^{-1} = -\frac{1}{6}(A^2 - 4A + I)$.

Proposition 3 - Taille 2

Soit $A = \begin{pmatrix} a & b \\ c & d \end{pmatrix}$ et $Q(X) = X^2 - (a+d)X + (ad - cb)$. Alors, $Q(A) = 0$.

Exemple 5 - Matrice de taille 2

Soit $A = \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ -1 & 5 \end{pmatrix}$. On pose

$$\begin{aligned} Q(X) &= X^2 - (1+5)X + (1 \times 5 - (-1) \times 2) \\ &= X^2 - 6X + 7. \end{aligned}$$

Alors,

$$\begin{aligned} Q(A) &= A^2 - 6A + 7I \\ &= \begin{pmatrix} -1 & 12 \\ -6 & 23 \end{pmatrix} - \begin{pmatrix} 6 & 12 \\ -6 & 30 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} 7 & 0 \\ 0 & 7 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}. \end{aligned}$$

Ainsi, Q est un polynôme annulateur de A.

En particulier,

$$\begin{aligned} A^2 - 6A + 7I &= 0_2 \\ A(A - 6I) &= -7I \\ A\left[-\frac{1}{7}(A - 6I)\right] &= I. \end{aligned}$$

Donc A est inversible et $A^{-1} = -\frac{1}{7}(A - 6I)$.

II.2 - Polynômes annulateurs et Valeurs propres

Proposition 4 - Valeurs propres & Racines de polynômes annulateurs

Soit A une matrice et Q un polynôme annulateur de A. Si λ est une valeur propre de A, alors λ est une racine de Q (c'est-à-dire que $Q(\lambda)=0$).

Exemple 6 - Reprise de l'exemple précédent

- En posant $A=\begin{pmatrix}1 & 2\\ -1 & 5\end{pmatrix}$ et $Q(X)=X^2-6X+7$, alors $Q(A)=0$.
  Or, le discriminant du trinôme Q est $6^2-4\times 7=8$ et $\sqrt{8}=2\sqrt{2}$. Les racines de Q sont donc
  $$\frac{6-2\sqrt{2}}{2}=3-\sqrt{2} \text{ et } \frac{6+2\sqrt{2}}{2}=3+\sqrt{2}.$$
  Les valeurs propres de A sont donc incluses dans l'ensemble $\{3-\sqrt{2},3+\sqrt{2}\}$.
- Posons $A=\begin{pmatrix}1 & 2\\ -1 & 5\end{pmatrix}$ et $R(X)=X^3-7X^2+13X-7$.
  Un simple calcul montre que $R(A)=0$.
  Or, 1 est une racine évidente de R et un calcul usuel montre que
  $$R(X)=(X-1)(X^2-6X+7).$$
  D'après le calcul du point précédent,
  $$R(X)=(X-1)(X-(3-\sqrt{2}))(X-(3+\sqrt{2})).$$
  Les valeurs propres de A sont donc incluses dans l'ensemble $\{1,3-\sqrt{2},3+\sqrt{2}\}$.

Un polynôme annulateur permet d'identifier les valeurs propres **possibles** pour une matrice.

II.3 - Recherche de valeurs / vecteurs propres

Proposition 5 - Recherche de vecteurs propres

Soit $A\in\mathscr{M}_n(\mathbb{R})$ et $\lambda\in\mathbb{R}$. Pour montrer que λ est une valeur propre de A il faut déterminer les vecteurs X solutions du système linéaire $AX=\lambda X$ et montrer qu'il existe une solution non nulle.

Exemple 7 - Recherche de valeurs / vecteurs propres

Soit $A=\begin{pmatrix}3 & 4\\ 2 & 1\end{pmatrix}$ et $Q(X)=(X-5)(X+1)(X+2)$.

- **Un polynôme annulateur.** En utilisant la définition du produit matriciel,
  $$\begin{aligned} Q(A) &= (A-5I)(A+I)(A+2I)\\ &= \begin{pmatrix}-2 & 4\\ 2 & -4\end{pmatrix}\begin{pmatrix}4 & 4\\ 2 & 2\end{pmatrix}\begin{pmatrix}5 & 4\\ 2 & 3\end{pmatrix}\\ &= \begin{pmatrix}-2 & 4\\ 2 & -4\end{pmatrix}\begin{pmatrix}28 & 28\\ 14 & 14\end{pmatrix}\\ &= \begin{pmatrix}0 & 0\\ 0 & 0\end{pmatrix}.\end{aligned}$$
  Ainsi, Q est un polynôme annulateur de A.
- **Recherche des valeurs propres éventuelles.** Comme les racines de Q sont 5, -1 -2, les valeurs propres possible sont 5, -1, -2.
- **Recherche des vecteurs propres.**
  - ⋆ Résolvons le système $AX=5X$.
  $$\begin{pmatrix}3 & 4\\ 2 & 1\end{pmatrix}\begin{pmatrix}x\\ y\end{pmatrix}=5\begin{pmatrix}x\\ y\end{pmatrix} \Leftrightarrow \begin{cases}3x+4y &= 5x\\ 2x+y &= 5y\end{cases}$$
  $$\Leftrightarrow \begin{cases}-2x+4y &= 0\\ 2x-4y &= 0\end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases}-2x+4y &= 0\\ 0 &= 0 \quad {\scriptstyle L_2\leftarrow L_2+L_1}\end{cases}$$
  Ainsi, $X_1=\begin{pmatrix}2\\ 1\end{pmatrix}$ satisfait $AX_1=5X_1$. Comme X_1 est

non nul et $AX_1 = 5X_1$, alors 5 est valeur propre de A et X_1 est un vecteur propre associé.

⋆ Résolvons le système $AX = -X$.

$$\begin{pmatrix} 3 & 4 \\ 2 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} = - \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} \Leftrightarrow \begin{cases} 3x+4y &= -x \\ 2x+y &= -y \end{cases}$$

$$\Leftrightarrow \begin{cases} 4x+4y &= 0 \\ 2x+2y &= 0 \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} 4x+4y &= 0 \\ 0 &= 0 \quad {\scriptstyle L_2 \leftarrow 2L_2 - L_1} \end{cases}$$

Ainsi, $X_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ -1 \end{pmatrix}$ satisfait $AX_2 = -X_2$. Comme X_2 est non nul et $AX_2 = -X_2$, alors -1 est valeur propre de A et X_2 est un vecteur propre associé.

⋆ Résolvons le système $AX = -2X$.

$$\begin{pmatrix} 3 & 4 \\ 2 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} = -2 \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix} \Leftrightarrow \begin{cases} 3x+4y &= -2x \\ 2x+y &= -2y \end{cases}$$

$$\Leftrightarrow \begin{cases} 5x+4y &= 0 \\ 2x+3y &= 0 \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} 5x+4y &= 0 \\ 7y &= 0 \quad {\scriptstyle L_2 \leftarrow 5L_2 - 2L_1} \end{cases}$$

$$\Leftrightarrow \begin{cases} x &= 0 \\ y &= 0 \end{cases}$$

Ainsi, l'unique solution du système $AX = -2X$ est le vecteur nul. Le réel -2 n'est donc pas une valeur propre de A.

Finalement, les valeurs propres de A sont -1 et 5.

- **Diagonalisation.** On pose $P = \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 1 & -1 \end{pmatrix}$. Comme $2 \times (-1) - 1 \times 1 = -3 \neq 0$, alors P est inversible et $P^{-1} = -\frac{1}{3} \begin{pmatrix} -1 & -1 \\ -1 & 2 \end{pmatrix}$. Ainsi,

$$\begin{aligned} P^{-1}AP &= -\frac{1}{3} \begin{pmatrix} -1 & -1 \\ -1 & 2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 3 & 4 \\ 2 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 1 & -1 \end{pmatrix} \\ &= -\frac{1}{3} \begin{pmatrix} -5 & -5 \\ 1 & -2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 1 & -1 \end{pmatrix} = -\frac{1}{3} \begin{pmatrix} -15 & 0 \\ 0 & 3 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} 5 & 0 \\ 0 & -1 \end{pmatrix}. \end{aligned}$$

En posant $D = \begin{pmatrix} 5 & 0 \\ 0 & -1 \end{pmatrix}$, alors

$$\begin{aligned} P^{-1}AP &= D \\ PP^{-1}AP &= PD \\ IAPP^{-1} &= PDP^{-1} \\ A &= PDP^{-1}. \end{aligned}$$

- **Application.** Une récurrence classique permet alors de montrer que pour tout n entier naturel,

$$A^n = PD^nP^{-1} = -\frac{1}{3} \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 1 & -1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 5^n & 0 \\ 0 & (-1)^n \end{pmatrix} \begin{pmatrix} -1 & -1 \\ -1 & 2 \end{pmatrix}.$$

Ainsi, si (u_n) et (v_n) sont les suites définies par $u_0 = 1$, $v_0 = 1$ et

$$\forall\, n \geqslant 0, \begin{cases} u_{n+1} &= 3u_n + 4v_n \\ v_{n+1} &= 2u_n + v_n \end{cases}$$

On peut définir le vecteur $X_n = \begin{pmatrix} u_n \\ v_n \end{pmatrix}$, puis

(i). Montrer que $X_{n+1} = AX_n$.

(ii). À l'aide d'une récurrence, montrer que pour tout n entier naturel, $X_n = A^n X_0$.

(iii). En déduire une expression de u_n et de v_n en fonction de n.