

Chapitre I

Topologie

Sommaire

| | | |
|-------|---|----|
| I.1 | Motivations, vue d'ensemble | 9 |
| I.2 | Distance, espace métrique | 11 |
| I.3 | Topologie des espaces métriques | 15 |
| I.4 | Suites | 18 |
| I.5 | Complétude | 20 |
| I.6 | Compacité | 21 |
| I.7 | Applications entre espaces métriques | 23 |
| I.8 | Compléments | 25 |
| I.8.1 | Théorème de point fixe de Banach | 25 |
| I.8.2 | Compléments sur les e.v.n. de dimension finie | 26 |
| I.9 | Exercices | 29 |

I.1 Motivations, vue d'ensemble

Les sections qui suivent portent pour l'essentiel sur des questions de topologie dite métrique, c'est-à-dire sur la manière dont une *distance* structure un ensemble. Cette notion est très intuitive, du fait que la distance euclidienne de l'espace physique \mathbb{R}^3 , ou tout du moins l'ordre de grandeur de la distance entre deux objets, est directement accessible aux sens. Il est néanmoins intéressant, y compris pour appréhender le monde réel, d'aborder cette notion d'un point de vue général, abstrait. En effet, la modélisation d'un très grand nombre de phénomènes réels repose sur la définition d'une métrique adaptée. Ce rôle central joué par la métrique s'est encore accru ces dernières années avec l'explosion de la science des données. Nous décrivons ci-dessous quelques exemples de situations dans lesquelles une part essentielle de la démarche réside dans la définition d'une distance adaptée, en nous limitant aux 3 grandes classes de contextes qui nous paraissent essentielles.

1) En premier lieu une distance a vocation à structurer un espace donné, et sa définition dépend du regard que l'on souhaite porter sur cet espace, et des facteurs que l'on souhaite prendre en compte. Ainsi, pour deux points d'une zone géographique représentée sur un plan, la distance euclidienne canonique correspond à la distance "à vol d'oiseau" du langage commun. Mais si l'on s'intéresse à une notion de proximité respectueuse de la difficulté effective de se rendre d'un point à un autre, il peut être pertinent de privilégier par exemple le temps qu'il faut pour se rendre du point x au point y , selon une modalité donnée, en prenant en compte les contraintes associées à la topographie du terrain. Un exemple archétypal de cette approche est la célèbre *distance de Manhattan*, appelée aussi *distance du chauffeur de taxi*, adaptée à une zone géographique dans laquelle les axes de circulation sont structurés en réseau orthogonal. À l'échelle d'un pays comme la France, il peut être fécond de définir la distance entre deux points comme le temps minimal qu'il faut pour aller d'un point à un autre en utilisant les transports en communs (complétés par de la marche à pied au départ et à l'arrivée). L'espace métrique associé (ce terme est défini plus loin, il s'agit simplement de la carte munie de la

distance que l'on vient de définir) est difficile à représenter graphiquement, mais il est une représentation plus fidèle et féconde du territoire si l'on s'intéresse à la manière dont le réseau de transport structure l'espace. On pourra considérer par exemple le "disque" (dont la forme peut être très éloignée de l'image que l'on se fait d'un disque) centré en la position d'une entreprise et de rayon une demie-heure, qui couvrira la zone dans laquelle habiteront les salariés qui souhaitent garder leur temps de déplacement journalier en dessous de cette durée. On pourra aussi considérer la distance associée au temps de parcours sur route, et s'intéresser par exemple à la part du territoire constituée des points situés à moins d'une demie-heure d'un hôpital ou d'une maternité. Ce type d'approche conduit assez naturellement à des problèmes délicats d'optimisation, comme par exemple : comment positionner de façon optimale des centres de soin dans un territoire de façon à minimiser la distance (= temps) maximale pour se rendre dans l'un de ces centres ? Ces problèmes complexes et la forme de leurs solutions dépendent étroitement de la distance choisie.

2) Une distance a également vocation à quantifier une différence, un écart, entre deux entités de même nature. Prenons l'exemple d'une collection d'images. Une image (disons carrée, et en noir et blanc) d'une résolution donnée peut être vue comme une matrice $N \times N$ de valeurs de l'intervalle $[0, 1]$ (niveaux de gris). La proximité entre deux images (par exemple parmi des images représentant des formes géométriques, ou des objets de la vie courante) peut être estimée assez efficacement par un enfant de 3 ans, mais il est extrêmement délicat de définir une métrique adaptée à cette situation, et la réponse peut dépendre du type d'images que l'on considère. On pourra se convaincre rapidement qu'identifier des images à des vecteurs de $[0, 1]^{N^2}$, et utiliser la distance euclidienne standard sur \mathbb{R}^{N^2} , est très loin d'être pertinent. Dans un contexte différent, on peut penser à une population d'individus à laquelle on associe un vecteur de caractéristiques (poids, âge, taille, taux de diverses substances dans le sang, ...). Structurer la population en catégories pertinentes passe par la définition d'une distance : peut-on associer à tout couple de personnes (représentées ici par leurs vecteurs de paramètres) un nombre qui quantifie leur éloignement ? Là encore une réponse pertinente à cette question peut être assez éloignée de la distance euclidienne. Un écart de 2 mois entre individus peut ainsi être considéré comme plus significatif s'il s'agit de nouveaux-nés que s'il s'agit d'adultes en pleine force de l'âge. Il peut être aussi pertinent de prendre en compte des couplages forts entre composantes, ce que la distance euclidienne ne permet pas. À titre d'exemple, une différence de poids de 5 kg est plus significative pour des nouveaux-nés que pour des quinquagénaires. Ces questions sont également cruciales dans le contexte de l'apprentissage statistique supervisé : l'apprentissage passe par une étape de minimisation d'une fonctionnelle de coût (appelée fonction *loss*), basée sur la définition d'une distance entre ce qui est produit par la fonction prédictive et la sortie provenant des données labellisées de la base d'apprentissage, et l'efficacité de l'approche repose en grande partie sur le choix de la distance.

3) L'expression des lois de la physique (systèmes de particules, mécanique des fluides, du solide, électromagnétisme, mécanique quantique), ou la modélisation de phénomènes réels (en biologie, dynamique des populations, économie, ...) conduit à des équations différentielles ordinaires (EDO) ou à des équations aux dérivées partielles (EDP), qui font intervenir dans le premier cas (EDO) des fonctions d'un intervalle en temps dans \mathbb{R}^d , dans le second cas (EDP) des fonctions à la fois du temps et d'une variable d'espace dans \mathbb{R}^d . L'analyse théorique de ces équations nécessite une structuration de l'espace dans lequel vivent leurs solutions. Il s'agit d'espaces de dimension infinie¹ sur lesquels il s'agit de définir une distance. On choisit en général une distance qui respecte la structure linéaire, construite à partir de ce que l'on appellera une *norme*. L'étude de tels espaces, qui constitue ce que l'on appelle l'*Analyse Fonctionnelle*, repose sur les notions qui sont introduites dans les sections qui suivent (espace vectoriel normé, ouverts et fermés, suites, complétude, compacité).

Dans un contexte plus directement lié aux sciences de l'ingénieur, la résolution numérique des problèmes de type EDO ou EDP mentionnés ci-dessus passe par des approximations : on effectue ce que l'on appelle une *discrétisation* du temps, en subdivisant l'intervalle continu en petits tronçons, qui vont permettre de transformer le problème de départ, qui est en dimension infinie, en un problème en dimension finie. Une approche analogue est faite en espace dans le cas des EDP². Étudier ces méthodes d'approximation (ce

1. On ne peut par exemple pas décrire l'ensemble des fonctions continues d'un intervalle en temps $[0, T]$ dans \mathbb{R}^d comme combinaison linéaire d'un nombre fini de fonctions particulières. C'est encore pire, si l'on ose dire, dans le cas des EDP, où l'on est amené à considérer, par exemple pour représenter un champ scalaire dynamique comme une température, des applications de $\mathbb{R} \times \mathbb{R}^d$ dans \mathbb{R} .

2. Il s'agit là d'un domaine extrêmement vaste, qui dépasse largement le cadre de ce cours. Citons simplement les trois grandes méthodes de discrétisation en espace : différences finies, éléments finis (très utilisés par exemple en mécanique du

qu'on appelle l'*Analyse Numérique*) consiste à montrer que les solutions approchées *convergent* vers la solution exacte de l'équation. Cette dernière vivant dans un espace de dimension infinie, sur lequel toutes les normes ne sont pas équivalentes, le choix de la norme conditionne encore de façon essentielle la nature du résultat de convergence.

I.2 Distance, espace métrique

Notions principales : distance, espace métrique, boules ouvertes et fermées, sphères, norme, espace vectoriel normé.

Définition I.2.1. (Distance, espace métrique (•))

Soit X un ensemble non vide. On appelle distance (ou métrique) sur X une application de $X \times X$ dans \mathbb{R}_+ vérifiant les propriétés suivantes :

- (i) (*Séparation*) Pour tous x, y dans X , on a $d(x, y) = 0 \iff x = y$.
- (ii) (*Symétrie*) $d(x, y) = d(y, x)$ pour tous x, y dans X .
- (iii) (*Inégalité triangulaire*) Pour tous x, y, z dans X , on a

$$d(x, z) \leq d(x, y) + d(y, z).$$

Le couple (X, d) est appelé espace métrique.

Exercice I.2.1. (•) On considère l'ensemble fini $\llbracket 1, N \rrbracket$, pour N entier ≥ 1 . À une distance sur X on peut associer une matrice carrée $D = (d_{ij}) \in \mathcal{M}_N(\mathbb{R})$, avec $d_{ij} = d(i, j)$. Décrire l'ensemble \mathcal{D} des matrices $D \in \mathcal{M}_N(\mathbb{R})$ qui correspondent à une métrique sur X . Quelles sont les propriétés de cet ensemble ?

Vocabulaire afférent aux espaces métriques

Définition I.2.2. (Diamètre (•))

Soit (X, d) un espace métrique, et $A \subset X$ une partie non vide de X . On appelle diamètre de A le nombre (potentiellement égal à $+\infty$)

$$\text{diam}(A) = \sup_{x, y \in A} d(x, y) \in [0, +\infty].$$

Définition I.2.3. (Distance à une partie)

Soit (X, d) un espace métrique, $A \subset X$ non vide, et $x \in X$. On définit la distance de x à A par

$$d(x, A) = \inf_{y \in A} d(x, y).$$

On dit que cette distance est *atteinte* s'il existe $z \in A$ tel que $d(x, A) = d(x, z)$.

Exercice I.2.2. On se place sur $X = \mathbb{R}^2$ muni de la distance usuelle. Donner un exemple de partie $A \subset X$ pour laquelle la distance à A est atteinte pour n'importe quel point $x \in \mathbb{R}$, et un exemple de partie pour laquelle cette distance n'est atteinte que pour les points de A .

Exercice I.2.3. On se place sur un espace métrique X . Montrer que la fonction

$$x \in A \mapsto d(x, A)$$

ne caractérise pas A en général, en donnant un exemple de $A \subset X$ pour lequel il existe d'autres ensembles conduisant à la même fonction distance. Montrer en particulier que cette fonction peut être identiquement nulle sans que A ne s'identifie à X .

solide), et volumes finis (très adaptés à la discrétisation de lois de conservation dites hyperboliques, utilisés par exemple pour modéliser les écoulements compressibles). Selon des procédures diverses, chacune de ces méthodes est basée sur un espace de dimension finie dont les éléments (fonctions particulières, par exemple affines par morceaux pour certaines méthodes d'éléments finis), ont vocation à *approcher* les solutions des systèmes de départ.

Définition I.2.4. (Boules ouvertes, boules fermée, sphères (•))

Soit (X, d) un espace métrique, on appelle boule ouverte de centre x et de rayon $r \geq 0$ l'ensemble

$$B(x, r) = \{y \in X, d(x, y) < r\}.$$

La boule fermée, notée³ $B_f(x, r)$, est obtenue en remplaçant l'inégalité stricte par l'inégalité large $d(x, y) \leq r$. La sphère de centre x et de rayon r est l'ensemble des points situés à distance r de x :

$$S(x, r) = \{y \in X, d(x, y) = r\}.$$

Définition I.2.5. (Ensemble discret)

Soit (X, d) un espace métrique, et A une partie de X . On dit que l'ensemble A est *discret* si pour tout élément x de A il existe une boule de centre x qui ne contient pas d'autre élément de A :

$$\forall x \in A, \exists \varepsilon > 0, B(x, \varepsilon) \cap A = \{x\}.$$

Remarque I.2.6. On prendra garde au fait que, dans la définition ci-dessus, le ε dépend x , de telle sorte que l'ensemble $\{1/n, n \in \mathbb{N}\} \subset \mathbb{R}$ est discret, bien que deux points distincts de cet ensemble puissent être arbitrairement proches.

Espaces métriques particuliers : les espaces vectoriels normés

Lorsque l'ensemble considéré a une structure d'espace vectoriel, il est en général fécond de choisir des distances particulières qui respectent la structure linéaire sous-jacente. On souhaite en particulier que la distance entre deux points x et y ne dépende que du vecteur $y - x$. Ces distances particulières sont construites à partir de *normes*, selon $d(u, v) = \|v - u\|$, où $\|\cdot\|$ est une norme selon la définition qui suit.

Définition I.2.7. (Norme, espace vectoriel normé (•))

Soit E un espace vectoriel. On appelle norme une application de E dans \mathbb{R}_+ , notée $u \mapsto \|u\|$ qui vérifie les propriétés suivantes :

- (i) (*Séparation*) Pour tout x dans E , on a $\|x\| = 0 \iff x = 0$.
- (ii) (*Homogénéité*) Pour tout $x \in E$, tout $\lambda \in \mathbb{R}$, $\|\lambda x\| = |\lambda| \|x\|$.
- (iii) (*Inégalité triangulaire*) Pour tous x, y dans E , on a

$$\|x + y\| \leq \|x\| + \|y\|$$

Le couple $(E, \|\cdot\|)$ est appelé *espace vectoriel normé*. On vérifie immédiatement que c'est un espace métrique pour

$$(u, v) \mapsto d(u, v) = \|v - u\|.$$

Exercice I.2.4. (•) Soit E un e.v.n. Montrer que, pour tous x, y dans E , on a

$$|\|x\| - \|y\|| \leq \|x - y\|.$$

Proposition I.2.8. (Normes $\|\cdot\|_p$ sur \mathbb{R}^d (•))

L'ensemble des réels muni de la valeur absolue est un e.v.n. Pour tout d entier ≥ 1 , tout $p \in [1, +\infty]$, les

3. On trouvera parfois la notation $\overline{B}(x, r)$ pour désigner la boule fermée de centre x et de rayon r . Dans \mathbb{R}^d , la boule fermée $B_f(x, r)$ s'identifie en effet à l'adhérence (au sens précisé plus loin) de la boule ouverte $B(x, r)$. Il est cependant préférable d'éviter cette notation, du fait que cette correspondance peut être invalidée. Considérer par exemple l'espace métrique \mathbb{N} muni de la distance canonique. La boule fermée $B_f(0, 1)$ de centre 0 et de rayon 1 s'identifie à $\{-1, 0, 1\}$, la boule ouverte $B(0, 1)$ est réduite à $\{0\}$, dont l'adhérence est $\{0\}$.

expressions

$$\|x\|_p = \left(\sum_{k=1}^d |x_k|^p \right)^{1/p} \quad \text{si } p \in [1, +\infty[, \quad \|x\|_\infty = \max_{1 \leq i \leq d} |x_i|,$$

définissent des normes sur \mathbb{R}^d , qu'on appelle norme p , ou norme ℓ^p . Le cas $p = 2$ correspond à la norme dite *euclidienne*, associée au produit scalaire canonique

$$\langle x | y \rangle = \sum_{i=1}^d x_i y_i,$$

de telle sorte que $\|x\|_2 = \langle x | x \rangle^{1/2}$.

Démonstration. On sait déjà que $|x - y|$ définit une distance sur \mathbb{R} (proposition A.1.33), on a donc la séparation et l'inégalité triangulaire. Et on a par ailleurs $|\lambda x| = |\lambda| |x|$ pour tous x et λ réels par définition de la valeur absolue et du produit entre réels.

En dimension supérieure, les propriétés de séparation et d'homogénéité sont immédiates. L'inégalité triangulaire pour $p = +\infty$ découle de celle de la valeur absolue :

$$\|x + y\|_\infty = \max_{1 \leq i \leq d} |x_i + y_i| \leq \max_{1 \leq i \leq d} (|x_i| + |y_i|) \leq \max_{1 \leq i \leq d} |x_i| + \max_{1 \leq i \leq d} |y_i|.$$

Pour $p \in [1, +\infty[$ est une conséquence directe de l'inégalité dite de *Minkovski* (voir proposition A.1.33, page 137). \square

Remarque I.2.9. (•••) Comme nous le verrons plus loin (section I.8.2), toutes ces normes sont *équivalentes* (théorème I.8.4), ce qui implique en particulier que la convergence d'une suite pour l'une de ces normes implique la convergence pour toutes les autres. Cela ne signifie pas pour autant que l'on peut utiliser indifféremment l'une ou l'autre quel que soit le contexte. Les espaces correspondant, s'ils ont comme nous le verrons la même *topologie*, ont des propriétés très différentes, et leur légitimité pour formaliser tel ou tel problème dépend de la nature du problème considéré. La norme utilisée par défaut pour décrire l'espace qui nous entoure est la norme ℓ^2 , l'espace résultant de ce choix est dit euclidien, c'est à dire que l'on peut y définir un *produit scalaire* dont la norme est issue. Le chapitre III est consacré à l'étude théorique de tels espaces, appelés *espaces de Hilbert* si l'on n'impose pas à la dimension d'être finie, qui vérifient un grand nombre de propriétés qu'on ne trouve pas dans les autres espaces. Cette norme euclidienne canonique présente aussi l'avantage de ne pas dépendre des axes choisis, elle est *isotrope* (un vecteur ne change pas de norme si on lui fait subir une rotation), comme l'espace physique de la mécanique classique. Cette norme a aussi un fort intérêt dans la modélisation de phénomènes physiques, le "2" du ℓ^2 faisant écho au carré qui intervient dans l'expression de l'énergie cinétique, ce qui donnera une forte légitimité aux normes de type quadratique dans le contexte de la dynamique des fluides et des solides inertiels. On retrouve également un carré dans l'expression de l'énergie potentielle élastique d'un ressort linéaire, ce qui légitimera aussi les norme de ce type pour estimer l'énergie de déformation d'un solide élastique. On retrouve également ce "2", pour des raisons plus subtiles, en mécanique quantique⁴. Hors du contexte physique, ce cadre euclidien (ou hibernien) est aussi très naturel en statistique, pour définir notamment la notion de variance. De façon général, lorsque l'on cherche à estimer un écart entre deux collections de valeurs, il est souvent pertinent d'estimer cet écart (ou parle de *loss* dans le contexte de l'apprentissage statistique) au sens des moindre carrés, ce qui mobilise la norme ℓ^2 .

Les cas extrêmes $p = 1$ et $+\infty$ conduisent à des espaces qui ont des propriétés que l'on peut qualifier de pathologiques (voir l'exercice I.2.5 ci-après, et aussi le chapitre IV sur les espaces de dimension infinie construits sur des normes de ce type). Ils ont pourtant une forte légitimité dans certains contextes. Le cas $p = 1$ correspond en quelque sorte à un principe de conservation. On pense par exemple à une situation où un vecteur de \mathbb{R}^d contient les quantités d'une matière dans les n compartiments d'une zone de l'espace, la conservation de la masse totale s'exprime alors naturellement comme l'appartenance du vecteur à la sphère unité de ℓ^1 . Cette "manière de mesurer les choses" est de fait très adaptée aux variables *extensives*, et elle

4. La densité de probabilité de présence d'une particule quantique est égale au *carré* du module de la fonction d'onde.

jouera de fait un rôle essentiel en théorie de la mesure, dont l'un des fruits est la construction d'un espace (L^1) qui est le pendant en dimension infinie de ℓ^1 . Noter que, dans l'exemple des compartiments ci-dessus, les coefficients du vecteurs correspondent à des quantités sommables, dont les valeurs elles-mêmes n'ont pas de pertinence intrinsèque (si l'on prend, pour une même situation physique, des compartiments plus petits, on aura des valeurs plus petites). La norme ℓ^∞ valorise les valeurs elles-mêmes plus que les quantités, c'est la norme naturelle pour mesurer des variables *intensives*, comme une température⁵, dont on s'intéresse à la valeur maximale. C'est ainsi une norme très "naturelle" en ingénierie ou en sûreté, puisqu'elle se focalise sur les valeurs maximales, qui correspondent souvent à des prescriptions ou normes de fonctionnement de systèmes industriels.

Les cas extrêmes $p = 1$ et $p = +\infty$, qui sont pourtant légitimes dans certains cas (voir remarque précédente), sont d'une certaine manière dégénérés, comme l'illustre l'exercice suivant.

Exercice I.2.5. On se place sur \mathbb{R}^2 muni de la distance ℓ^1 . On définit la longueur d'une ligne brisée de \mathbb{R}^2 (ligne continue constituée d'un nombre fini de segments consécutif) comme la somme des longueurs des segments qui la constituent. Montrer qu'il existe une infinité de lignes brisées qui joignent l'origine 0 et le point $A = (1, 1)$, et dont la longueur est égale à la distance entre ces deux points. Décrire une situation de la vie réelle qui manifeste cette dégénérescence. Montrer que le cas $p = \infty$ est aussi dégénéré en termes d'unicité du plus court chemin.

Les espaces décrits ci-dessus jouent un rôle essentiel en analyse, en particulier l'espace euclidien (\mathbb{R}^d, ℓ^2) , mais toutes les distances ne sont pas issues d'une norme. À titre d'illustration extrême, la distance triviale définie ci-après peut être définie sur n'importe quel ensemble, y compris bien sûr l'espace vectoriel \mathbb{R}^d .

Définition I.2.10. (Distance triviale / discrète)

Soit X un ensemble. On définit $d : X \times X \rightarrow \mathbb{R}_+$ par $d(x, x) = 0$ pour tout x , et $d(x, y) = 1$ si $x \neq y$. On vérifie immédiatement qu'il s'agit d'une distance (appelée distance triviale, ou distance discrète).

L'exercice suivant définit une distance qu'il est tentant d'appeler une distance lexicographique entre mots (ou plus généralement chaîne de caractère)

Exercice I.2.6. (Distance lexicographique)

On considère A un ensemble ("A" pour Alphabet, que l'on peut voir comme la collection de lettres dont on dispose), et l'on considère un ensemble X de mots constitués de lettres de A . Un élément de X peut donc s'écrire comme une suite (x_i) finie ou infinie de lettres. Soient x et y deux mots. On note n_{xy} le plus petit indice pour lequel x_n et y_n diffèrent (avec la convention $n = +\infty$ si les mots sont les mêmes), et l'on définit $d(x, y) = 2^{-n}$. Montrer que l'on définit ainsi une distance sur X , qui une inégalité triangulaire renforcée, appelée *ultramétrique* :

$$d(x, y) \leq \max(d(x, z), d(z, y)) \quad \forall x, y, z \in X.$$

Montrer l'on peut munir \mathbb{R}^d , et même $\mathbb{R}^{\mathbb{N}}$ (ensemble des suite de réels) d'une distance de ce type.

Dans l'hypothèse (non faite jusqu'à présent) où A et X sont finis, proposer une autre distance sur X plus conforme à la distance entre les mots dans un dictionnaire.

Exercice I.2.7. Proposer une métrique sur $X =]-1, 1[$ qui en fasse un espace de diamètre infini.

Exercice I.2.8. (Des boules de toutes les formes(•))

a) Donner l'allure de la sphère unité (sphère de centre l'origine et de rayon 1) de \mathbb{R}^2 pour les différentes normes p (on distinguera les cas $p = 1$, $p \in]1, 2[$, $p = 2$, $p \in]2, +\infty[$, et $p = +\infty$).

b) On considère maintenant sur \mathbb{R}^3 la distance lexicographique qui fait l'objet de l'exercice I.2.6 : Pour x et y dans \mathbb{R}^3 , on note n_{xy} le plus petit indice (on numérote à partir de 0) pour lequel x_n et y_n diffèrent (avec la

5. Reconnaissons que la situation est parfois ambiguë. Dans l'esprit de la théorie de la mesure qui sera abordée ensuite, on peut voir une température comme une chaleur divisée par une capacité calorifique. La température est la variable intensive associée à la variable extensive de chaleur, elle jouera le rôle d'une fonction que l'on intègre contre la mesure / capacité calorifique, le résultat de l'intégration étant l'énergie thermique (ou chaleur), qui est elle une variable extensive.

convention $n = +\infty$ si $x = y$), et l'on définit $d(x, y) = 2^{-n_{xy}}$. Quel est le diamètre de \mathbb{R}^3 ? Décrire les boules pour cette distance.

c) Soit X un ensemble muni de la distance triviale (voir définition I.2.10). Quel est le diamètre de X ? Quelles sont les boules ouvertes et fermées pour cette distance?

I.3 Topologie des espaces métriques

Notions principales : ouvert, fermé, adhérence, intérieur, frontière, voisinage, partie dense.

Définition I.3.1. (Ouverts et fermés d'un espace métrique (\bullet))

Soit (X, d) un espace métrique. On dit que $U \subset X$ est ouvert s'il est vide⁶ ou si tout x dans U est centre d'une boule ouverte non vide incluse dans U , i.e.

$$\forall x \in U, \exists r > 0, B(x, r) \subset U.$$

On dit qu'une partie de X est fermée si son complémentaire est ouvert.

Exercice I.3.1. Préciser dans les cas suivants si $A \subset X$ vu comme partie de l'espace métrique X (muni dans les exemples de la distance euclidienne canonique) est un ouvert, un fermé, ou ni l'un ni l'autre.

$$A_1 = \{0\} \subset \mathbb{R}, A_2 = [0, 1] \subset \mathbb{R}, A_3 = [0, 1[\subset \mathbb{R}, A_4 = [0, +\infty[\subset \mathbb{R}, A_5 = \mathbb{Q} \subset \mathbb{R},$$

$$A_6 = \bigcup_{n=1}^{+\infty}]n, n+1/n[\subset \mathbb{R}, A_7 = \bigcup_{n=1}^{+\infty} [n, n+1/n] \subset \mathbb{R},$$

$$A_8 =]0, 1[\times]0, 1[\subset \mathbb{R}^2, A_9 =]0, 1[\times]0, 1[\times \{0\} \subset \mathbb{R}^3, A_{10} = \mathbb{N} \times \mathbb{R} \subset \mathbb{R}^2.$$

Proposition I.3.2. (\bullet) Soit (X, d) un espace métrique.

L'ensemble vide et X sont à la fois fermés et ouverts.

Toute union d'ouverts est un ouvert, et toute intersection finie d'ouverts est un ouvert.

Toute intersection de fermés est fermée, et toute union finie de fermés est fermée.

Démonstration. L'ensemble vide est un ouvert par définition, et X est lui-même ouvert car toutes les boules sont dans X .

Soit $(U_i)_{i \in I}$ une famille d'ouverts, et U leur union. Tout $x \in U$ est dans l'un des U_i , il existe donc une boule $B(x, r) \subset U_i \subset \bigcup U_j$.

Soient maintenant U_1, U_2, \dots, U_N des ouverts de X . Pour x dans l'intersection, pour tout i il existe $r_i > 0$ tel que $B(x, r_i) \subset U_i$. Si l'on prend $r = \min(r_i)$ (qui est bien strictement positif car la famille est finie), alors $B(x, r)$ est dans l'intersection des U_i .

Les propriétés sur les fermés se déduisent des propriétés sur les ouverts par complémentarité. Par exemple, pour toute collection (F_i) d'ouverts, si l'on note $U_i = F_i^c$ le complémentaire de F_i (qui est un ouvert par définition), on a

$$\bigcap_{i \in I} F_i = \bigcap_{i \in I} U_i^c = \left(\bigcup_{i \in I} U_i \right)^c.$$

Une union finie de fermés se ramène de la même manière à une intersection finie d'ouverts. □

Exercice I.3.2. On se place sur \mathbb{R} muni de la distance usuelle. Montrer qu'une intersection infinie d'ouverts peut ne pas être ouverte, et qu'une union infinie de fermés peut ne pas être fermée.

6. Cette précision n'est pas à strictement parler nécessaire, car l'ensemble vide vérifie automatiquement toute condition du type : "Pour tout x dans \emptyset, \dots ".

Remarque I.3.3. (Vers la topologie générale)

Les propriétés de la proposition précédente permettent de définir ce que l'on appelle une topologie (voir section A.2.3, page 138), dans un cadre général (sans recourir à la notion de métrique). Elles sont utilisées comme définition d'une famille d'ouverts, qui définit une topologie générale sur un ensemble. Dans le présent contexte des espaces métriques, la proposition précédente permet donc de s'assurer que la définition I.3.1 correspond bien à une topologie au sens général.

Remarque I.3.4. (Très importante, et un peu délicate)

Il est important de garder à l'esprit que, pour une métrique donnée, les caractéristiques topologiques d'un ensemble ne sont pas intrinsèques, mais dépendent de l'espace topologique dans lequel il est inclus. Ainsi on dira que l'intervalle $I = [0, 1]$ n'est pas ouvert, en considérant implicitement qu'il est considéré comme sous-ensemble de \mathbb{R} muni de la topologie usuelle. Toute boule centrée en 1 contient des réels strictement supérieurs à 1, ce qui exclut que I soit ouvert. Si l'on considère en revanche que l'univers se réduit à I lui-même, considéré comme un espace à part entière (que l'on pourrait donc noter X dans l'esprit de ce qui précède), alors $I = X = [0, 1]$ est bien un ouvert, puisque les réels strictement supérieurs à 1 considérés ci-dessus ne sont "pas dans le paysage". Noter qu'il est aussi fermé, conformément à la première assertion de la proposition I.3.2.

Du fait qu'une union d'ouverts est un ouvert, et qu'une intersection de fermés est fermée, on peut définir les notions de plus grand ouvert contenu dans un ensemble (intérieur), et de plus petit fermé qui contienne un ensemble (adhérence).

Définition I.3.5. (Intérieur, adhérence, frontière (•))

Soit (X, d) un espace métrique, et A une partie de X .

On appelle *adhérence* de A , et l'on note \bar{A} , le plus petit fermé contenant A , i.e. l'intersection de tous les fermés qui contiennent A .

On appelle *intérieur* de A , et l'on note $\overset{\circ}{A}$, le plus grand ouvert contenu dans A , i.e. l'union de tous les ouverts que A contient.

On appelle *frontière* de A l'ensemble $\partial A = \bar{A} \setminus \overset{\circ}{A} = \bar{A} \cap (\overset{\circ}{A})^c$.

On appelle *voisinage* d'un point x toute partie de X qui contient un ouvert contenant x .

Exercice I.3.3. (•) a) Montrer qu'un ouvert est un ensemble qui s'identifie à son intérieur, et qu'un fermé est un ensemble qui s'identifie à son adhérence.

b) Comment caractériser un ensemble qui s'identifie à sa frontière ?

Exercice I.3.4. (•) On se place dans \mathbb{R}^2 muni de la distance euclidienne. Préciser \bar{A} , $\overset{\circ}{A}$ et ∂A dans les cas suivants :

$$\begin{aligned} a) A &= \{x_1, \dots, x_N\} & b) A &= B(0, 1) & c) A &= \{(x, y) \in \mathbb{R}^2, y \geq 0\} \\ d) A &= \{(1/n, 0), n = 1, 2, \dots\} & e) A &= \{(t, \sin(1/t)), t \in]0, +\infty[\}. \end{aligned}$$

Remarque I.3.6. L'appellation la plus conforme à l'intuition commune est celle de frontière. Si l'on considère par exemple la zone occupée par un pays, la frontière topologique correspond bien à la frontière administrative, constituée de lignes marquant la séparation avec un pays voisin, à laquelle se rajoutent les bords naturels du pays (côtes). Dans ce cadre, conformément à l'intuition, la frontière est *petite* par rapport à l'objet lui-même, on serait tenté de dire qu'elle ne "pèse rien"⁷. On prendra cependant garde au fait que, si l'on sort du cadre de domaines réguliers comme des pays sur une carte, certains ensembles ont une frontière beaucoup plus "grosse" qu'eux-mêmes. On se reportera par exemple à l'exercice I.3.5, qui établit que l'ensemble des

7. Mathématiquement (voir chapitre sur la théorie de la mesure et de l'intégration), on pourra établir qu'un domaine régulier est de mesure strictement positive, alors que sa frontière est de mesure nulle. Pour revenir au contexte géographique, ces considérations expriment de façon abstraite le fait que, si l'on prend au hasard un point en Europe, il y a peu de chance qu'il se trouve sur la frontière entre deux pays : on dira qu'il s'agit *presque sûrement* d'un point intérieur à l'un des pays.

rationnels, qui est négligeable, admet pour frontière l'ensemble des réels⁸.

Le terme *ouvert* évoque le fait qu'un objet ne contienne aucun point de sa frontière, il est en quelque sorte directement exposé au monde extérieur, par opposition à un fermé qui contient sa frontière, et se trouve en quelque sorte *délimité*.

Remarque I.3.7. Il peut sembler étonnant que ces notions puissent être pertinentes dans une démarche de modélisation du réel, puisque ce qui distingue par exemple un ouvert de son adhérence consiste en des points qui sont infiniment proches (en deçà de toute longueur mesurable en pratique) de l'objet lui-même. Elles sont pourtant d'une importance considérable. On pourra penser par exemple à la modélisation d'un matériau déformable qui occupe une certaine zone de l'espace physique. On choisira de représenter cette zone par un ouvert⁹, souvent noté Ω (on parle de *domaine*). Ainsi, chaque point x de Ω est entouré d'une petite zone située à l'intérieur de l'objet modélisé, ce qui permet d'écrire l'équilibre des forces en x à partir des propriétés constitutives du matériau. On obtient ainsi une équation aux dérivées partielles qui a du sens en tout point de (l'ouvert) Ω . La frontière correspond à l'interface avec le monde extérieur (l'air libre, ou un autre matériau). Sur cette frontière l'équation constitutive du matériau n'est pas valide, mais on prescrit l'équilibre de l'interface qui impliquera les lois constitutives de part et d'autre, et on parlera de *condition aux limites* si l'extérieur est un milieu simple (comme du vide), ou de *conditions d'interface* s'il s'agit d'une zone de contact entre deux matériaux.

Remarque I.3.8. Dans l'esprit de la remarque précédente, on ne s'autorise à parler de la dérivée en un point x d'une fonction définie sur un sous-ensemble A de \mathbb{R} que lorsque x appartient à l'intérieur de cet ensemble. Pour que la dérivée puisse être définie en tout point de A , il est nécessaire que A soit ouvert. De la même manière, comme précisé dans le chapitre V, on ne pourra définir la différentielle d'une fonction définie sur $A \subset \mathbb{R}^d$ qu'en un point x *intérieur* à A . Il est en effet essentiel dans la définition de la dérivée ou de la différentielle que l'on puisse effectuer des petites variations, *dans toutes les directions*, autour du point considéré en restant dans l'ensemble sur lequel la fonction est définie.

Exercice I.3.5. (•) Montrer que \mathbb{Q} , comme partie de l'espace métrique \mathbb{R} (muni de sa distance usuelle), est d'intérieur vide, d'adhérence et de frontière \mathbb{R} . En quel(s) sens peut-on dire que la frontière de cet ensemble est "beaucoup plus grosse" que l'ensemble lui-même ?

Définition I.3.9. (Densité (•))

Soit (X, d) un espace métrique, et A une partie de X . On dit que A est *dense* dans X si $\overline{A} = X$, autrement dit si, pour tout $x \in X$, tout $\varepsilon > 0$, la boule $B(x, \varepsilon)$ contient au moins un élément de A .

Définition I.3.10. (Séparabilité)

On dit que (X, d) est *séparable* s'il contient un ensemble dénombrable dense.

Nous terminons cette section par quelques propriétés de \mathbb{R} , et de sa version *achevée* $\overline{\mathbb{R}} = \mathbb{R} \cup \{+\infty\} \cup \{-\infty\} = [-\infty, +\infty]$.

Proposition I.3.11. L'ensemble $\mathbb{D} \subset \mathbb{R}$ des nombres décimaux et l'ensemble \mathbb{Q} des nombres rationnels sont denses dans \mathbb{R} .

Proposition I.3.12. Les ouverts de \mathbb{R} sont les réunions dénombrables d'intervalles ouverts.

Démonstration. Soit $U \subset \mathbb{R}$ un ouvert. Pour $x \in U$, on introduit

$$b_x = \sup \{y \geq x, [x, y] \subset U\}$$

Comme U est ouvert, il contient un intervalle du type $[x - \varepsilon, x + \varepsilon]$, avec $\varepsilon > 0$, on a donc $b_x \geq x + \varepsilon > x$.

8. Un pays construit de la sorte risquerait de consacrer l'essentiel de son budget à entretenir ses douaniers et ses gardes-côtes.

9. Ce choix est d'une certaine manière arbitraire, ou simplement justifié par ce qui suit. La question de savoir s'il est licite ou pas de considérer qu'un objet physique contienne sa frontière ou pas dépend du contexte de la modélisation.

Si b_x est fini, b_x ne peut pas être dans U , sinon $[x, b + \varepsilon]$ serait dans U pour ε assez petit, et b_x serait battu. L'intervalle $[x, b_x[$ est donc dans U , et b_x ne l'est pas (qu'il soit infini ou fini). De la même manière on construit un intervalle $]a_x, x]$ dans U , avec $a_x \notin U$. L'intervalle $I_x =]a_x, b_x[$ est donc dans U , qui s'écrit ainsi comme réunion de ces intervalles¹⁰.

Par densité de \mathbb{Q} dans \mathbb{R} , chacun de ces intervalles contient un rationnel. On peut donc construire une injection de cette famille d'intervalle dans \mathbb{Q} , la famille est donc dénombrable. \square

La droite réelle achevée (••)

Dans certains contextes, en particulier en théorie de l'intégration, il est pertinent de compléter \mathbb{R} par des valeurs "aux bouts" :

Définition I.3.13. (Droite réelle achevée)

On appelle *droite réelle achevée*, et l'on note $\overline{\mathbb{R}}$, l'ensemble $\mathbb{R} \cup \{-\infty\} \cup \{+\infty\}$, muni de la relation d'ordre canonique sur \mathbb{R} complétée par

$$-\infty < a < +\infty$$

pour tout $a \in \mathbb{R}$.

Proposition I.3.14. On peut munir $\overline{\mathbb{R}}$ d'une métrique

$$d(x, y) = |\arctan(y) - \arctan(x)|,$$

avec la convention $\arctan(\pm\infty) = \pm\pi/2$. Cette métrique induit une topologie sur $\overline{\mathbb{R}}$ telle que tout ouvert est soit un ouvert de \mathbb{R} soit du type $U \cup]a, +\infty]$, $U \cup [-\infty, b[$, ou $U \cup]a, +\infty] \cup [-\infty, b[$.

Démonstration. Le fait que $d(\cdot, \cdot)$ soit une distance se vérifie sans difficulté. On reprend maintenant l'argument utilisé dans la démonstration de la proposition I.3.12. Cette approche permet de décomposer tout ouvert U en une réunion dénombrables d'intervalles ouverts¹¹, la seule différence ici étant que l'un de ces intervalles peut être du type $]a, +\infty]$ ou $[-\infty, b[$. Cette décomposition assure la propriété annoncée.

Soit maintenant U un ouvert de $\overline{\mathbb{R}}$. Si U ne contient ni $+\infty$ ni $-\infty$, alors c'est aussi un ouvert de \mathbb{R} . S'il contient par exemple $+\infty$, alors il contient une boule $B(+\infty, \eta)$, avec $\eta > 0$. \square

Exercice I.3.6. (•) Quel est le diamètre de $\overline{\mathbb{R}}$ muni de la métrique définie ci-dessus ? Quelle est la boule ouverte de centre 0 et de rayon $\pi/2$? La boule ouverte de centre 1 et de rayon $\pi/2$?

Exercice I.3.7. (•) Donner un autre exemple de métrique sur $\overline{\mathbb{R}}$ conduisant à la même topologie.

I.4 Suites

Définition I.4.1. (Suite (•))

Une suite dans un ensemble X est une collection de points de X (non nécessairement distincts) indexée par les entiers. Plus formellement, on peut voir une suite comme une application de \mathbb{N} dans X . On note dans ce contexte x_n l'image de n par cette application.

Définition I.4.2. (Suite convergente (•))

Soit (X, d) un espace métrique. On dit que la suite $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ converge vers ℓ si la distance de x_n à ℓ peut être rendue arbitrairement petite pour n assez grand :

$$\forall \varepsilon, \exists N, \forall n \geq N, d(x_n, \ell) < \varepsilon.$$

10. Ces intervalles sont les classes d'équivalence de la relation \mathcal{R} d'équivalence (voir définition A.1.4, page 126, définie par $x \mathcal{R} y$ si $[x, y] \subset U$ (ou $[y, x] \subset U$ si $y < x$).

11. On appelle ces ouverts les *composantes connexes* de U .

Proposition I.4.3. (Unicité de la limite (•))

Une suite convergente ne peut converger que vers une seule limite.

Démonstration. Soient ℓ et ℓ' deux limites de la suite (x_n) . Pour tout ε , il existe N et N' tels que, pour tout $n \geq \max(N, N')$, $d(x_n, \ell) < \varepsilon$ et $d(x_n, \ell') < \varepsilon$. On a donc, en prenant $n = \max(N, N')$,

$$0 \leq d(\ell, \ell') \leq d(\ell, x_n) + d(x_n, \ell') < 2\varepsilon.$$

On a donc $d(\ell, \ell') = 0$, d'où $\ell = \ell'$. □

Définition I.4.4. (Valeur d'adhérence (•))

Soit (X, d) un espace métrique et $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ une suite de points de X . On dit que x est valeur d'adhérence pour la suite s'il existe une suite extraite qui converge vers x , i.e. s'il existe une application φ strictement croissante de \mathbb{N} dans \mathbb{N} telle que la suite $(x_{\varphi(n)})$ converge vers x .

Proposition I.4.5. (••) Soit $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ une suite de points de l'espace métrique X . Le point x est valeur d'adhérence pour la suite si et seulement si, pour tout $\varepsilon > 0$, l'ensemble $\{n \in \mathbb{N}, x_n \in B(x, \varepsilon)\}$ est infini.

Démonstration. Si x est valeur d'adhérence, on peut extraire une sous-suite $(x_{\varphi(n)})$ qui converge vers x . L'ensemble

$$\{n \in \mathbb{N}, x_{\varphi(n)} \in B(x, \varepsilon)\}$$

est infini par définition de la convergence d'une suite.

Réciproquement, on prend $\varepsilon = 1$. Comme l'ensemble $\{n \in \mathbb{N}, x_n \in B(x, 1)\}$ est infini, il est non vide, et on peut considérer k_1 son plus petit élément. On continue ensuite avec $\varepsilon = 1/2$, auquel on associe k_2 le plus petit élément de $\{n \in \mathbb{N}, x_n \in B(x, 1/2)\}$ strictement supérieur à k_1 . On construit ainsi une suite extraite (x_{k_n}) telle que $d(x_{k_n}, x) < 1/2^n$, donc qui converge vers x . □

Proposition I.4.6. (Caractérisations séquentielles)

Soit (X, d) un espace métrique, et A une partie de X . On a les équivalences :

1. Un point $x \in X$ est dans l'adhérence de A si et seulement si x est limite d'une suite de points (non nécessairement distincts, il peut s'agir de la suite constante égale à x) de A .
2. Un point $x \in A$ est dans l'intérieur de A si et seulement si toute suite convergeant vers x est dans A au delà d'un certain rang.
3. A est fermé si et seulement si, pour toute suite de points de A qui converge dans X , la limite est dans A .

Démonstration. 1. Soit x dans l'adhérence de A . Si x est dans A , il est limite de la suite constante égale à x . Si $x \notin A$, pour tout $n \in \mathbb{N}$, la boule $B(x, 1/n)$ rencontre nécessairement A en un point x_n . Si tel n'était pas le cas, alors $\bar{A} \setminus B(x, 1/n) = \bar{A} \cap B(x, 1/n)^c$ serait un fermé qui contient A , strictement plus petit que \bar{A} , ce qui est absurde. La suite (x_n) de points de A ainsi construite converge vers x par construction. Soit maintenant $x \notin \bar{A}$, il est dans son complémentaire, qui est un ouvert d'intersection vide avec A , il existe donc une boule ouverte $B(x, \varepsilon)$ qui ne contient aucun élément de A . Le point x ne peut donc être limite d'une suite de points de A .

2. Soit (x_n) une suite qui converge vers $x \in \overset{\circ}{A}$. Il existe $r > 0$ tel que $B(x, r) \subset A$. Par convergence de la suite, il existe N tel que, pour tout $n \geq N$, on a $d(x, x_n) < r$. On a donc $x_n \in B(x, r) \subset A$ pour tout $n \geq N$. Réciproquement, si $x \in A$ n'est pas dans l'intérieur de A , pour tout $n > 0$, $B(x, 1/n)$ n'est pas incluse dans A , il existe donc $x_n \in B(x, 1/n) \cap A^c$. Cette suite converge vers x , mais ne rencontre pas A .

3. Soit $A \subset X$ fermé. Tout point de A^c , qui est ouvert, est dans une boule de rayon ε qui ne contient aucun élément de A , il ne peut donc être limite d'une suite de points de A . Réciproquement, si A n'est pas fermé, A^c n'est pas ouvert, il contient donc un élément x tel que pour tout ε , $B(x, \varepsilon)$ contient un élément qui n'est

pas dans A^c , i.e. qui est dans A . On peut donc ainsi construire une suite de points de A qui converge vers $x \notin A$. □

I.5 Complétude

La notion de complétude abordée dans cette section joue un rôle essentiel en analyse, pour montrer en particulier des résultats d'existence à toutes sortes de problèmes. Dans des espaces dits *complets*, au sens précisé ci-dessous, on dispose d'un critère de convergence d'une suite qui *n'utilise pas la limite elle-même* (contrairement à la définition I.4.2), mais seulement les termes de la suite.

Définition I.5.1. (Suite de Cauchy)

Soit (X, d) un espace métrique. On dit que la suite (x_n) de points de X est de Cauchy si la quantité $d(x_p, x_q)$ peut être rendue arbitrairement petite pour p et q assez grands :

$$\forall \varepsilon > 0, \exists N, \forall p, q \geq N, d(x_p, x_q) < \varepsilon.$$

Proposition I.5.2. Toute suite convergente est de Cauchy.

Démonstration. Si une suite (x_n) converge vers une limite x , $d(x_n, x)$ peut être rendu arbitrairement petit pour n assez grand. Il en est donc de même pour

$$d(x_p, x_q) \leq d(x_p, x) + d(x, x_q),$$

d'où le caractère de Cauchy de la suite. □

Exercice I.5.1. (•) Soit X un espace métrique, et (x_n) une suite de Cauchy qui ne prend qu'un nombre fini de valeurs. Montrer que la suite est nécessairement constante au delà d'un certain rang.

Exercice I.5.2. (•) Soit X un espace métrique, et (x_n) une suite de Cauchy. On note X_N l'ensemble des termes de la suite au delà du rang N :

$$X_N = \{x_n, n \geq N\}.$$

Montrer que la suite (x_n) est de Cauchy si et seulement si le diamètre de X_N tend vers 0 quand N tend vers $+\infty$.

Définition I.5.3. (Espace métrique complet (•))

On dit que (X, d) est complet si toute suite de Cauchy dans X converge vers un élément de X .

Proposition I.5.4. (•) Soit (X, d) un espace métrique complet. Une partie A de X est complète si et seulement si elle est fermée.

Démonstration. Si $A \subset X$ n'est pas fermée, il existe d'après la proposition I.4.6, page 19, une suite (x_n) de points de A qui converge vers $x \notin A$. Cette suite est de Cauchy (proposition I.5.2 ci-dessus), non convergente dans A , qui ne saurait donc être complet.

Si maintenant $A \subset X$ est fermée, toute suite de Cauchy dans A et de Cauchy dans X , elle converge donc vers $x \in X$. Cette limite est dans A , toujours d'après la proposition I.4.6. □

Proposition I.5.5. (••) Soit $d \geq 1$ un entier. Pour tout $p \in [1, +\infty]$, l'espace \mathbb{R}^d muni de la norme $\|\cdot\|_p$ (voir proposition I.2.8 page 12), est complet.

Démonstration. La voie à suivre pour montrer la complétude de \mathbb{R} dépend de la manière dont on a construit l'ensemble des réels. On se reportera à la proposition A.1.34 pour une démonstration dans le cadre d'une

construction basée sur l'écriture décimale (section A.1.4). Si l'on considère maintenant une suite de Cauchy $(x^n) = (x_k^n)_{1 \leq k \leq d}$ dans \mathbb{R}^d , la suite associée à l'une quelconque des composantes est aussi de Cauchy dans \mathbb{R} , donc converge vers une valeur x_k^∞ . On en déduit la convergence de (x^n) vers $(x^\infty) = (x_k^\infty)_{1 \leq k \leq d}$. \square

Exercice I.5.3. (•) Montrer que l'ensemble \mathbb{D} des nombres décimaux, muni de la distance canonique $d(x, y) = |y - x|$, n'est pas complet.

I.6 Compacité

La notion de compacité est essentielle en analyse, elle est en particulier à l'origine de l'essentiel des résultats d'existence de solution à des équations issues de la physique. Nous avons privilégié la définition la plus générale, qui pourrait s'appliquer à des espaces non métriques, car elle est basée sur la notion de recouvrement par des ouverts, notion très féconde également au cœur de la définition de la mesure extérieure de Lebesgue qui sera introduite dans la partie sur la théorie de la mesure. Dans le cas d'un espace métrique, la compacité peut se caractériser à l'aide de suites : un ensemble est compact si, de toute suite, on peut en extraire une sous-suite qui converge dans l'ensemble. Le lecteur désireux d'aller au plus simple pourra considérer que cette caractérisation est la définition première, en gardant à l'esprit qu'il en existe une formulation équivalente (et plus générale, puisqu'elle s'applique à des espaces topologique non métriques) basée sur le recouvrement par des ouverts. L'équivalence entre les deux formulations fait l'objet du théorème I.6.2 ci-après, dit de Bolzano-Weierstrass, dont on pourra admettre le résultat.

Définition I.6.1. (Espace métrique compact (•))

Soit (X, d) un espace métrique, et K une partie de X (qui peut être X lui-même). On dit que K est *compact* s'il vérifie la propriété de *Borel-Lebesgue* : de tout recouvrement de K par des ouverts on peut extraire un recouvrement fini :

$$K \subset \bigcup_{i \in I} U_i, \quad U_i \text{ ouvert } \forall i \in I \implies \exists J \subset I, \quad J \text{ fini, tel que } K \subset \bigcup_{i \in J} U_i.$$

Exercice I.6.1. (Compacts de \mathbb{R} (•))

- Montrer que ni \mathbb{R} (muni de sa métrique usuelle $d(x, y) = |y - x|$), ni $]0, 1[\subset \mathbb{R}$, ne sont compacts.
- Montrer que tout ensemble fini d'un espace métrique est compact.
- Montrer que l'ensemble des termes d'une suite strictement réelle décroissante vers 0 n'est pas compact. Montrer que si l'on rajoute à cet ensemble la limite 0, alors l'ensemble est compact.

Exercice I.6.2. Montrer que la droite réelle achevée $\overline{\mathbb{R}} = [-\infty, +\infty]$ muni de la métrique définie par la proposition I.3.14, page 18, est *compacte*.

Dans le cas des espaces métriques, on peut caractériser la compacité de façon séquentielle.

Théorème I.6.2. (Bolzano – Weierstrass (••))

Soit (X, d) un espace métrique, et $K \subset X$. L'ensemble K est compact (définition I.6.1) si et seulement si de toute suite de points de K on peut extraire une sous-suite qui converge vers un élément de K .

Démonstration. (•••) On suppose K compact au sens de la définition I.6.1. On considère une suite (x_n) d'éléments de K . Si cette suite n'admet aucune valeur d'adhérence, c'est-à-dire que l'on ne peut en extraire aucune sous-suite convergente, alors (d'après la proposition I.4.5) pour tout $y \in K$ il existe $r_y > 0$ tel que $B(y, r_y)$ ne contienne qu'un nombre fini de termes de la suite, plus précisément un nombre fini d'indices n tels que x_n est dans cette boule. La réunion de ces boules ouvertes recouvre K par construction, on peut donc en extraire un recouvrement fini :

$$K \subset \bigcup_{i \in J} B(y_i, r_i), \quad J \text{ fini.}$$

Le nombre total d'indices concernés est donc fini, car inférieur à la somme (finie) des cardinaux des indices affectés à chaque boule, ce qui est absurde.

Réciproquement, on suppose maintenant K séquentiellement compact, et l'on considère un recouvrement de K par des ouverts

$$K \subset \bigcup_{i \in I} U_i.$$

La démonstration se fait en trois étapes.

1) On montre dans un premier temps l'existence d'un $\rho > 0$ tel que, pour tout $x \in K$, il existe $i \in I$ tel que $B(x, \rho) \subset U_i$. Si tel n'est pas le cas, pour tout n , il existe $x_n \in K$ tel que $B(x_n, 1/n)$ n'est dans aucun des U_i . On peut extraire une sous-suite $(x_{\varphi(n)})$ qui converge vers $x \in K$ par compacité séquentielle de K . La limite x est dans un ouvert U_{i_0} . Il existe ε tel que $B(x, \varepsilon) \subset U_{i_0}$. Par convergence de $x_{\varphi(n)}$ vers x , il existe N tel que, pour tout $n \geq N$, $d(x_{\varphi(n)}, x) < \varepsilon/2$. On choisit maintenant n tel que $1/\varphi(n) < \varepsilon/2$. La boule $B(x_{\varphi(n)}, \varepsilon/2)$ est alors incluse dans U_{i_0} , ce qui contredit l'hypothèse initiale.

2) Montrons maintenant que K peut être recouvert par une collection finie de boules de rayon ρ . On raisonne une nouvelle fois par l'absurde. Si la propriété n'est pas vraie, on prend $x_1 \in X$ arbitraire. Comme $B(x_1, \rho)$ ne recouvre pas K , il existe $x_2 \in K \setminus B(x_1, \rho)$. Comme $B(x_1, \rho) \cup B(x_2, \rho)$ ne recouvre toujours pas K , il existe $x_3 \in K \setminus (B(x_1, \rho) \cup B(x_2, \rho))$. On construit ainsi par récurrence une suite (x_n) telle que tous les termes sont distants deux à deux d'au moins $\rho > 0$, on ne peut donc pas en extraire une sous-suite convergente, ce qui contredit la compacité séquentielle.

3) D'après le 2, il existe une collection finie de points x_1, \dots, x_N telles que

$$K \subset \bigcup_{n=1}^N B(x_n, \rho).$$

Comme chacune de ces boules $B(x_n, \rho)$ est dans l'un des ouverts U_{i_n} , on a bien un sous-recouvrement fini de K par les ouverts U_{i_n} , $n = 1, \dots, N$. \square

Proposition I.6.3. Tout compact K d'un espace métrique X est fermé.

Démonstration. On utilise la caractérisation séquentielle du caractère fermé (proposition I.4.6) : si K est fermé, pour toute suite d'éléments de K qui converge dans X , la limite est dans K . On considère donc une telle suite. Si K est compact, on peut en extraire une sous-suite qui converge dans K , et la limite de la suite de départ s'identifie à la limite cette suite extraite. La limite est donc dans K , d'où le caractère fermé de K . \square

Exercice I.6.3. Montrer qu'une partie finie d'un espace métrique est toujours compacte.

Exercice I.6.4. Montrer que l'intersection de deux compacts est compacte.

Exercice I.6.5. Montrer que tout fermé inclus dans un compact d'un espace métrique est compact.

Théorème I.6.4. (Heine – Borel ou Borel – Lebesgue)

Les compacts de \mathbb{R}^d (pour toute norme $\|\cdot\|_p$, avec $1 \leq p \leq +\infty$) sont les fermés bornés.

Démonstration. Soit K un compact de \mathbb{R}^d . Si K n'est pas borné, on peut construire une suite d'éléments de K dont la norme tend vers $+\infty$. Il est de façon évidente impossible d'extraire d'une telle suite une sous-suite convergente, K est donc nécessairement borné. La proposition I.6.3 ci-dessus assure par ailleurs que K est fermé.

Réciproquement, il s'agit de montrer que tout fermé borné de \mathbb{R}^d est compact. On considère d'abord le cas $d = 1$. Soit K un fermé borné de \mathbb{R} , et (x_n) une suite d'éléments de K . On suppose pour simplifier les notations que K est inclus dans l'intervalle $[0, 1]$. Au moins l'un des deux intervalles $[0, 1/2]$ et $]1/2, 1]$ contient une infinité de termes. On considère un tel sous-intervalle, et l'on choisit un terme de la suite, x_{n_1} ,

qui en fait partie. On subdivise en deux ce sous-intervalle, pour obtenir deux sous-intervalles de longueur $1/4$ dont l'un au moins contient une infinité de termes. On en prend un point x_{n_2} , avec $n_2 > n_1$. On construit ainsi par récurrence une suite extraite (x_{n_k}) , qui vérifie pour $p < q$,

$$|x_{n_q} - x_{n_p}| \leq \frac{1}{2^p},$$

elle est donc de Cauchy, donc converge dans \mathbb{R} (voir proposition A.1.34). Comme K est fermé, la limite est dans K (voir proposition I.4.6). On a donc pu extraire une sous suite qui converge dans K , ce qui assure sa compacité.

Dans le cas $d > 1$, on peut mettre en œuvre une approche analogue, en décomposant à chaque étape un cube de côté $1/2^k$ en 2^d cubes de côté $1/2^{k+1}$. On peut aussi appliquer ce qui précède à la première coordonnée, en extrayant une sous-suite convergente, puis passer à la seconde coordonnée en extrayant une sous-suite à cette première sous-suite, et continuer jusqu'à la d -ème coordonnée. \square

Remarque I.6.5. Le dictionnaire de l'Académie Française décrit comme compact un “objet dont les constituants sont serrés les uns contre les autres, pour former un substrat condensé”¹². La définition mathématique dépasse largement cette acception commune, comme le suggère l'exercice I.6.1, en particulier du fait qu'un ensemble fini de points est compact. Pour s'en faire une idée intuitive, il est plus aisé d'identifier les propriétés qui font qu'un ensemble n'est *pas* compact. En premier lieu, comme l'indique la proposition I.6.3, la non compacité peut venir d'un défaut de fermeture : on peut extraire une sous-suite convergente, mais la limite n'est pas dans l'ensemble. Cela peut être corrigé en rajoutant les limites possibles de suites de l'ensemble, en considérant simplement l'adhérence de l'ensemble de départ (un tel ensemble dont l'adhérence est compacte est appelé *relativement compact*). Il y a des causes plus essentielles de non compacité. En premier lieu le caractère non borné de l'ensemble. L'ensemble \mathbb{N} des entiers naturel dans \mathbb{R} est bien fermé, mais de façon évidente non compact, car non borné (on peut recouvrir \mathbb{N} par des boules de rayon suffisamment petit pour que chaque boule ne contienne qu'un entier, il est alors évidemment impossible d'extraire un recouvrement fini). La dernière cause de non-compacité est plus profonde et moins facile à appréhender, elle porte sur le cœur de l'objet lui-même, ou plutôt de la nature de l'espace sous-jacent auquel il appartient. Dans un espace vectoriel normé de *dimension infinie*, on peut vérifier par exemple que la boule unité fermée, qui est bien fermée et bornée, n'est *pas compacte*. Considérons à titre d'exemple l'espace des polynômes¹³ muni de la norme définie comme le maximum des valeurs absolues des coefficients. La boule unité fermée de cet espace vectoriel normé de dimension est un fermé borné. Or la suite (X^n) est telle que la distance entre deux termes est égal à 1, on ne peut donc en extraire aucune sous suite convergente.

I.7 Applications entre espaces métriques

Définition I.7.1. (Application continue entre espaces métriques)

Une application f de (X, d) dans (X', d') est dite continue en x si $d'(f(x), f(y))$ peut être rendu arbitrairement petit pour tout y suffisamment proche de x , c'est-à-dire :

$$\forall \varepsilon > 0, \exists \eta > 0, \forall y \in X, d(x, y) < \eta \implies d'(f(x), f(y)) < \varepsilon.$$

On peut exprimer ce qui précède de façon séquentielle : pour toute suite (x_n) de X qui converge vers x , la suite $(f(x_n))$ des images converge vers $f(x)$.

On dit que F est continue sur X si elle est continue en tout point de X .

Cette définition est équivalente à une autre, plus abstraite, qui présente l'avantage de pouvoir s'appliquer à des espaces topologiques généraux (sans métrique). L'équivalence, dans le cas métrique, entre les deux, fait l'objet de la proposition suivante.

¹². Le terme est souvent utilisé à propos de *foibles compactes*.

¹³. On peut assimiler cet espace à l'espace F des suite finies (a_n) (qui s'annulent au-delà d'un certain rang), muni de la norme ℓ^∞ qui correspond au maximum des valeur absolue des termes.

Proposition I.7.2. (Continuité d'une application, caractérisation générale (•••))

Une application f de (X, d) dans (X', d') est continue si et seulement si l'image réciproque par f de tout ouvert de X' est un ouvert de X . De la même manière, une application f de (X, d) dans (X', d') est continue si et seulement si l'image réciproque par f de tout fermé de X' est un fermé de X .

Démonstration. Soit f une application de (X, d) dans (X', d') , continue au sens de la définition I.7.1 ci-dessus. On considère un ouvert U' de X' . Si $f^{-1}(U')$ est vide, il est ouvert. S'il n'est pas vide, pour tout x dans cette image réciproque, $f(x) = x' \in U'$ par définition de l'image réciproque. Comme U' est ouvert, il contient une boule $B(x', \varepsilon)$. Par continuité de f en x , il existe η tel que, pour tout y à distance de x inférieure à η , la distance de $f(y)$ à x' est inférieure à ε , ce qui signifie exactement $f(B(x, \eta)) \subset B(x', \varepsilon) \subset U'$. On a donc $B(x, \eta) \subset f^{-1}(U')$, d'où $f^{-1}(U')$ ouvert.

Montrons la réciproque. Soit f une application telle que l'image réciproque de tout ouvert de l'espace d'arrivée est un ouvert de l'espace de départ. Soit $x \in X$, et $\varepsilon > 0$. L'image réciproque de $B(f(x), \varepsilon)$ est un ouvert, donc son image réciproque est un ouvert contenant x . Il existe donc $\eta > 0$ tel que $B(x, \eta) \subset f^{-1}(B(f(x), \varepsilon))$, c'est-à-dire $f(B(x, \eta)) \subset B(f(x), \varepsilon)$.

Pour la caractérisation par les images réciproques de fermés, on utilise le fait que tout fermé F' de X' s'écrit $F' = U'^c$, où U' est ouvert. On a donc

$$f^{-1}(F') = f^{-1}(U'^c) = (f^{-1}(U'))^c,$$

qui est fermé si et seulement si $f^{-1}(U)$ est ouvert. □

Exercice I.7.1. Montrer que l'image (directe) d'un ouvert par une application continue peut ne pas être ouverte, de même que l'image d'un fermé peut ne pas être fermée.

Proposition I.7.3. (Image d'un compact par une application continue (•))

Soit f une application de (X, d) dans (X', d') . Si f est continue, alors l'image d'un compact de X est compacte dans X' .

Démonstration. Soit K un compact de X . Une suite de $f(K)$ s'écrit $(f(x_n))$, avec $x_n \in K$ pour tout n . Comme K est compact, cette suite admet une sous-suite (x_{n_k}) qui converge vers $x \in K$, et la continuité de f assure que $f(x_{n_k})$ converge vers $f(x) \in f(K)$, d'où la compacité de $f(K)$. □

Proposition I.7.4. (•) Soit f une fonction définie d'un compact K de (X, d) à valeurs dans \mathbb{R} , continue sur K . Alors f est bornée, et atteint ses bornes sur K .

Démonstration. L'image du compact K par f étant un compact de \mathbb{R} d'après la proposition I.7.3, il est borné (proposition I.6.4), la fonction f est donc majorée et minorée sur K . Notons M sa borne supérieure. Par définition il existe (x_n) dans K telle que

$$f(x_n) \rightarrow M = \sup_K f.$$

La suite maximisante (x_n) n'est pas nécessairement convergente, mais comme K est compact, on peut en extraire une sous-suite $(x_{\varphi(n)})$ qui converge vers $x \in K$. On a, par continuité de l'application, $f(x) = \lim f(x_{\varphi(n)}) = M$, la borne supérieure est donc atteinte. On montre de la même manière que la borne inférieure est atteinte. □

Corollaire I.7.5. (•) Soit f une fonction continue d'un fermé borné $K \subset \mathbb{R}^d$, à valeurs dans \mathbb{R} . Alors f est bornée, et atteint ses bornes.

Exercice I.7.2. (•)

- a) Soit f une fonction continue de \mathbb{R}^d dans \mathbb{R} . Montrer qu'elle est bornée sur tout ensemble borné de \mathbb{R}^d .
- b) Montrer qu'une fonction définie d'un borné B de \mathbb{R}^d , continue, peut ne pas être bornée sur B .

Définition I.7.6. (Uniforme continuité)

Soit f une application de (X, d) dans (X', d') . On dit que f est uniformément continue sur X si

$$\forall \varepsilon > 0, \exists \eta > 0, \forall x, y \in X, d(x, y) < \eta \implies d'(f(x), f(y)) < \varepsilon.$$

Théorème I.7.7. (Heine (••))

Soient (X, d) et (X', d') deux espaces métriques, et f une application continue d'un compact $K \subset X$ dans X' . Alors f est uniformément continue.

Démonstration. On raisonne par contradiction. Si f n'est pas uniformément continue, il existe $\varepsilon > 0$ tel que, pour tout $\eta > 0$, il existe x et y tels que $d(x, y) < \eta$, et $d'(f(x), f(y)) \geq \varepsilon$. On prend $\eta = 1/n$, et l'on construit ainsi une suite (x_n, y_n) dans $X \times X$ telle que

$$d(x_n, y_n) < \eta, \quad d'(f(y_n), f(x_n)) \geq \varepsilon.$$

Par compacité de K on peut extraire de x_n une suite qui converge vers $x \in K$. On note toujours x_n la suite extraite (et par y_n la suite associée). On a

$$d(y_n, x) \leq d(y_n, x_n) + d(x_n, x),$$

qui tend vers 0 quand n tend vers $+\infty$. Par ailleurs, f étant continue en x , $f(x_n)$ tend vers $f(x)$, et l'on a

$$d(f(y_n), f(x)) \geq |d(f(y_n), f(x_n)) - d(f(x_n), f(x))|,$$

qui ne peut pas tendre vers 0 du fait que $d(f(y_n), f(x_n)) \geq \varepsilon$ et $d(f(x_n), f(x)) \rightarrow 0$. On a donc contradiction avec la continuité de f en x . □

Définition I.7.8. (Application lipschitzienne)

Une application de (X, d) dans (X', d') est dite lipschitzienne s'il existe $k \in \mathbb{R}_+$ tel que

$$d'(f(x), f(y)) \leq k d(x, y).$$

Exercice I.7.3. (Distance à une partie)

Soit (X, d) un espace métrique, $K \subset X$ non vide. Montrer que l'application qui à $x \in X$ associe sa distance à K (voir définition I.2.3) est une application 1-lipschitzienne.

I.8 Compléments

I.8.1 Théorème de point fixe de Banach

Définition I.8.1. (Application contractante(•))

On dit qu'une application T de (X, d) dans lui-même est *contractante* s'il existe $\kappa \in [0, 1[$ tel que

$$d(T(x), T(y)) \leq \kappa d(x, y) \quad \forall x, y \in X.$$

Théorème I.8.2. (Théorème de point fixe de Banach (••))

Soit (X, d) un espace métrique complet et T une application de (X, d) dans lui-même, contractante. Elle admet alors un *point fixe* unique, c'est-à-dire qu'il existe un unique x dans X tel que $T(x) = x$.

Démonstration. L'unicité est immédiate : si x et y sont points fixes, on a

$$d(x, y) = d(T(x), T(y)) \leq \kappa d(x, y).$$

Comme $0 < \kappa < 1$, ça n'est possible que si $x = y$.

Pour l'existence, on considère un élément x_0 arbitraire de X , et l'on construit la suite des itérés par T :

$$x_n = T(x_{n-1}) = T^n(x_0) = \underbrace{T \circ T \circ \cdots \circ T}_{n \text{ fois}}(x_0).$$

On a

$$d(x_{n+1}, x_n) = d(T(x_n), T(x_{n-1})) \leq \kappa d(x_n, x_{n-1}) \leq \cdots \leq \kappa^n d(x_1, x_0).$$

On a donc, pour tous $p < q$,

$$\begin{aligned} d(x_p, x_q) &\leq d(x_p, x_{p+1}) + d(x_{p+1}, x_{p+2}) + \cdots + d(x_{q-1}, x_q) \\ &\leq (\kappa^p + \cdots + \kappa^{q-1}) d(x_1, x_0) \end{aligned}$$

qui tend vers 0 car la série $\sum \kappa^n$ est convergente. La suite (x_n) est donc de Cauchy, et converge vers un certain $x \in X$ car X est complet. Comme $d(x_{n+1}, x_n) = d(T(x_n), x_n)$ tend vers 0, on obtient en faisant tendre n vers $+\infty$, $d(T(x), x) = 0$, d'où $T(x) = x$. \square

I.8.2 Compléments sur les e.v.n. de dimension finie

Cette section est consacrée à une étude plus poussée des espaces vectoriels normés de dimension finie, qui se ramène à l'étude des espaces \mathbb{R}^n , pour n entier supérieur ou égal à 1. On rappelle la définition des normes usuelles sur \mathbb{R}^d (introduites dans la proposition I.2.8, page 12) :

$$\|x\|_p = \left(\sum_{k=1}^n |x_k|^p \right)^{1/p} \quad \text{pour } p \in [1, +\infty[,$$

ainsi que

$$\|x\|_\infty = \max_{1 \leq k \leq n} |x_k|.$$

Exercice I.8.1. (•) Proposer d'autres normes sur \mathbb{R}^n , en argumentant l'intérêt que l'on pourrait avoir à définir des normes qui sortent de la gamme de prêt-à-porter décrite ci-dessus.

Lemme I.8.3. Toute application linéaire de $(\mathbb{R}^n, \|\cdot\|_\infty)$ dans $(\mathbb{R}^m, \|\cdot\|)$ (où $\|\cdot\|$ est une norme quelconque sur \mathbb{R}^m) est continue.

Démonstration. On écrit pour cela la décomposition d'un élément x de \mathbb{R}^n dans la base canonique, et l'on estime la norme de $F(x)$:

$$\left\| F \left(\sum_{i=1}^d x_i e_i \right) \right\| = \left\| \sum_{i=1}^d x_i F(e_i) \right\| \leq \sum_{i=1}^d |x_i| \|F(e_i)\| \leq M \max |x_i| = M \|x\|_\infty ,$$

où $M = \sum \|F(e_i)\|$. On a donc continuité de F car $F(x+h) = F(x) + F(h)$, et $\|F(h)\|$ peut être contrôlé par $\|h\|_\infty$ d'après ce qui précède. \square

Théorème I.8.4. (Équivalence des normes en dimension finie)

Toutes les normes sur \mathbb{R}^n sont équivalentes, c'est à dire que, pour toutes ¹⁴ normes $\|\cdot\|_\alpha$ et $\|\cdot\|_\beta$ sur \mathbb{R}^n , il existe deux constantes $M > m > 0$ telles que

$$m \|x\|_\alpha \leq \|x\|_\beta \leq M \|x\|_\alpha .$$

14. Malgré la notation, on peut envisager des normes qui diffèrent des normes p définies précédemment.

Démonstration. Nous allons montrer que toutes les normes sont équivalentes à la norme $\|\cdot\|_\infty$, ce qui établira l'équivalence de toutes les normes entre elles. On considère l'application identité de \mathbb{R}^n dans \mathbb{R}^n , en munissant l'espace de départ de la norme $\|\cdot\|_\infty$, et l'espace d'arrivée d'une norme quelconque $\|\cdot\|$. D'après ce qui précède il existe une constante M telle que $\|x\| \leq M \|x\|_\infty$.

On considère maintenant la fonction qui à x dans $(\mathbb{R}^n, \|\cdot\|_\infty)$ associe $\|x\|$. Cette application est continue car (voir exercice I.2.4)

$$\| \|x+h\| - \|x\| \| \leq \|h\| \leq M \|h\|_\infty.$$

Comme la sphère unité S de \mathbb{R}^n est compacte (proposition I.6.4), cette fonction continue atteint ses bornes sur S (proposition I.7.4, page 24), en particulier son infimum $m \geq 0$. Il existe donc un x_0 , de norme ∞ égale à 1, tel que $\|x_0\| = m$. Comme x_0 est non nul, on a $m > 0$, et ainsi, pour tout x non nul,

$$\left\| \frac{x}{\|x\|_\infty} \right\| \geq m > 0 \implies m \|x\|_\infty \leq \|x\|.$$

On a donc montré

$$m \|x\|_\infty \leq \|x\| \leq M \|x\|_\infty,$$

c'est-à-dire que les normes $\|\cdot\|_\infty$ et $\|\cdot\|$ sont équivalentes. Toutes les normes sont donc équivalentes à une même norme $\|\cdot\|_\infty$, elles sont donc équivalentes entre elles. \square

Proposition I.8.5. On munit \mathbb{R}^n et \mathbb{R}^m de normes $\|\cdot\|_\alpha$ et $\|\cdot\|_\beta$, respectivement. Alors toute application F linéaire de \mathbb{R}^n dans \mathbb{R}^m est continue, et il existe une constante $C \geq 0$ telle que, pour tout $x \in \mathbb{R}^n$,

$$\|Fx\|_\beta \leq C \|x\|_\alpha.$$

Démonstration. Cette propriété a fait l'objet du lemme I.8.3, dans le cas où la norme sur l'espace de départ est la norme $\|\cdot\|_\infty$. Elle est donc vraie pour toute autre norme sur l'espace de départ d'après l'équivalence des normes qui vient d'être établie. \square

Le choix d'une norme¹⁵ sur \mathbb{R}^n et \mathbb{R}^m induit canoniquement une norme sur l'espace vectoriel des applications linéaires de \mathbb{R}^n vers \mathbb{R}^m .

Proposition I.8.6. (Norme d'opérateur)

On note $\mathcal{L}(\mathbb{R}^n, \mathbb{R}^m)$ (ou simplement $\mathcal{L}(\mathbb{R}^n)$ si $m = n$) l'espace des applications linéaires de \mathbb{R}^n dans \mathbb{R}^m . On note¹⁶ Fx l'image par F d'un élément x de \mathbb{R}^n . Pour tout $p \in [1, +\infty]$, l'application

$$F \in \mathcal{L}(\mathbb{R}^n, \mathbb{R}^m) \longmapsto \|F\|_p = \sup_{x \neq 0} \frac{\|Fx\|_p}{\|x\|_p} = \sup_{\|x\|_p=1} \|Fx\|_p$$

définit une norme sur $\mathcal{L}(\mathbb{R}^n, \mathbb{R}^m)$, et l'on a, pour tout $x \in \mathbb{R}^n$,

$$\|Fx\|_p \leq \|F\|_p \|x\|_p.$$

On dit que cette norme d'opérateur est *subordonnée* à la norme p . Les normes ainsi définies sont compatibles avec le produit de composition, au sens suivant : pour tous $F \in \mathcal{L}(\mathbb{R}^p, \mathbb{R}^m)$, $G \in \mathcal{L}(\mathbb{R}^n, \mathbb{R}^p)$

$$\|F \circ G\|_p \leq \|F\|_p \|G\|_p.$$

Dans le cas où l'on considère la norme euclidienne (cas $p = 2$), on omettra parfois l'indice, pour noter simplement $\|F\|$.

¹⁵. Il peut s'agir de normes différentes, même si nous privilégierons ici le cas de normes de même type.

¹⁶. Cette notation Fx plutôt que $F(x)$ (qui peut aussi être utilisée) rappelle que l'on peut représenter F par une matrice, et donc l'image d'un élément de \mathbb{R}^n par un produit matrice-vecteur.

Démonstration. La propriété de séparation est immédiate, $\|F\|_p$ ne pouvant être nulle que si F est identiquement nulle. L'homogénéité résulte elle aussi directement de l'homogénéité de la norme p pour les vecteurs. Pour l'inégalité, on remarque que $\|F\|_p$ est le sup sur la sphère unité de $\|Fx\|_p$. Or on a, pour tous F_1, F_2 dans $\mathcal{L}(\mathbb{R}^n, \mathbb{R}^m)$, tout x de norme unitaire,

$$\sup_{\|x\|_p=1} (\|F_1x + F_2x\|_p) \leq \sup_{\|x\|_p=1} (\|F_1x\|_p + \|F_2x\|_p) \leq \sup_{\|x\|_p=1} \|F_1x\|_p + \sup_{\|x\|_p=1} \|F_2x\|_p.$$

D'après la définition-même, on a $\|Fx\|_p / \|x\|_p \leq \|F\|_p$ pour tout x non nul, dont on déduit immédiatement $\|Fx\|_p \leq \|x\|_p \|F\|_p$.

Pour la composée d'applications, on écrit

$$\|F \circ G\|_p = \sup_{x \neq 0} \frac{\|F(G(x))\|_p}{\|x\|_p} \leq \sup_{x \neq 0} \frac{\|F\|_p \|G(x)\|_p}{\|x\|_p} = \|F\|_p \|G\|_p,$$

ce qui termine la preuve. □

Remarque I.8.7. Nous avons défini les normes d'opérateurs en munissant les espaces de départ et d'arrivée d'une même norme, mais on peut bien sûr étendre cette approche au cas où l'on choisit des normes différentes, en notant alors $\|F\|_{p,q}$ la norme subordonnée (p pour l'espace de départ, q pour l'espace d'arrivée).

Exercice I.8.2. Montrer que toutes les normes d'opérateurs que l'on peut définir selon les principes décrits ci-dessus à partir de normes sur \mathbb{R}^n et \mathbb{R}^m sont équivalentes entre elles.

Quelques mots sur les espaces de dimension infinie.

Le cas de la dimension infinie, qui correspond par exemple aux espace de fonctions définies sur un domaine de \mathbb{R}^d , est beaucoup plus délicat. On se reportera au chapitre IV, page 65, pour un aperçu de ce domaine à part entière des mathématiques. Disons simplement ici que toutes les propriétés présentées ci-dessus, qui utilisent de façon essentielle le caractère compact des fermés bornés, ne sont plus vraies. De fait, la boule unité fermée d'un espace vectoriel normé de dimension infinie n'est jamais compacte. On peut avoir sur un même espace des normes qui ne sont pas équivalentes entre elles. L'espace peut être complet pour une norme, pas pour une autre. Une application linéaire peut ne pas être continue¹⁷.

17. Précisons tout de même que la construction d'une telle application linéaire non continue entre espaces complets nécessite l'axiome du choix : on ne rencontrera pas beaucoup de tels objets dans la nature.

I.9 Exercices

Exercice I.9.1. (Suite décroissante d'ensembles (•))

- a) Donner un exemple de suite $(U_i)_{i \in \mathbb{N}}$ décroissante d'ouverts de \mathbb{R} , c'est-à-dire telle que $U_{i+1} \subset U_i$ pour tout i , qui soit telle que l'intersection des U_i est vide.
- b) Donner un exemple de suite $(F_i)_{i \in \mathbb{N}}$ décroissante de fermés de \mathbb{R} , c'est-à-dire telle que $F_{i+1} \subset F_i$ pour tout i , qui soit telle que l'intersection des F_i est vide.

Exercice I.9.2. (Distance de Hamming)

On considère l'ensemble $H_N = \{0, 1\}^N$ des N -uplets de 0 ou de 1 (ensemble des mots de N bits).

- 1) On définit $d(x, y)$ comme le nombre de positions où les bits de x et y diffèrent, i.e.

$$x = (x_0 \dots, x_{N-1}), y = (y_0 \dots, y_{N-1}), d(x, y) = \sum_{n=0}^{N-1} |x_n - y_n|.$$

Montrer que l'on définit ainsi une distance (appelée distance de *Hamming*), qui fait de H_N un espace *discret*. Quel est le diamètre de H_N ?

- 2) Soit $x \in X$ et $r \in \mathbb{R}_+$. Donner le cardinal de la sphère de centre x et de rayon $r \geq 0$, en fonction de r .

Exercice I.9.3. (Distances ultramétriques (•••))

On considère l'ensemble $H_N = \{0, 1\}^N$ des N -uplets de 0 ou de 1 (ensemble des mots de N -bits).

Pour $x = (x_1 \dots, x_N)$ et $y = (y_1 \dots, y_N) \neq x$, on note k le plus petit indice tel que les bits de x et y diffèrent, i.e.

$$k = \min \{k, x_k \neq y_k\},$$

et l'on définit $\delta(x, y) = 2^{-k}$. On pose $\delta(x, x) = 0$.

- 1) Montrer que $\delta(\cdot, \cdot)$ est une distance sur H_N , et que cette distance est *ultramétrique*, c'est à dire qu'elle vérifie l'inégalité triangulaire renforcée

$$d(x, z) \leq \max(d(x, y), d(y, z)).$$

- 2) Montrer que tout point d'une boule est centre de cette boule (on se gardera d'essayer de faire un dessin...).

- 3) Quel est le diamètre de H_N pour cette distance ?

- 4) a) Décrire la sphère de centre $0 = (0, 0, \dots, 0)$ et de rayon $r \in [0, 1]$, selon la valeur de r , et plus généralement la sphère de centre $x = (x_1 \dots, x_N)$ et de rayon $r \in [0, 1]$.

- b) Soient $x \in X$ et $r \in \mathbb{R}_+$. Donner le cardinal de la boule fermée de rayon x et de rayon r , en fonction de r .

- 5) Étendre l'approche précédente à l'ensemble $H_\infty = \{0, 1\}^\mathbb{N}$ des suites infinies de 0 ou 1.

- 6) Donner des exemples de contextes dans lesquels une distance ultramétrique apparaît naturellement.

Exercice I.9.4. (••) Soit (X, d) un espace métrique, et $A \subset X$. Montrer que l'intérieur de A est égal au complémentaire de l'adhérence du complémentaire de A .

Exercice I.9.5. (•) Soit (X, d) un espace métrique, et A une partie de X . La distance d'un point x à l'ensemble est notée $d(x, A)$ (voir définition I.2.3 de la distance à un ensemble). Montrer

$$\bar{A} = \{x \in X, d(x, A) = 0\}, \quad \overset{\circ}{A} = \{x \in X, d(x, A^c) > 0\},$$

$$\partial A = \{x \in X, d(x, A) = d(x, A^c) = 0\}.$$

Exercice I.9.6. (••) On se place sur $X = \mathbb{R}^2$ muni de la distance euclidienne.

- a) Donner un exemple de partie $A \subset \mathbb{R}^2$ telle que la distance de x est atteinte pour certains points, et pas pour d'autres.

b) Donner un exemple de partie A , et d'un point $x \in \mathbb{R}^2$, tels que la distance de x à A est atteinte en plusieurs points.

c) (Cellules de Voronoï)

On considère la situation où A est une collection finie de points : $A = \{x_i\}_{1 \leq i \leq N}$. On appelle A_i l'ensemble des points qui sont strictement plus près de x_i que des autres x_j , autrement dit les points x tels que la distance de x à A est atteinte en x_i , et en x_i seulement. Décrire les A_i , appelées cellules de Voronoï dans les cas suivants

(i) Les x_i sont tous situés sur le premier axe de coordonnées.

(ii) Les x_i sont équidistribués sur le cercle unité.

Dans le cas général de points distribués de façon quelconque, faire un dessin de ces cellules de Voronoï.

d) (*) Pourquoi parle-t-on de téléphone *cellulaire* pour désigner un téléphone portable ?

Exercice I.9.7. (•)

a) Donner un exemple de suite réelle telle que $|x_{n+1} - x_n|$ tend vers 0, mais qui ne converge pas dans \mathbb{R} .

b) Proposer une procédure pour construire une telle suite, qui soit telle que l'ensemble de ses termes soit de plus *dense* dans \mathbb{R} .

Exercice I.9.8. (Suite décroissante de compacts (•))

Soit $(K_n)_{n \in \mathbb{N}}$ décroissante de compacts non vides d'un espace métrique X . Montrer que l'intersection des K_n est non vide.

Exercice I.9.9. (••)

Soit F un fermé non vide de \mathbb{R}^d . Montrer que la distance de tout x à F (définition I.2.3, page 11)) est atteinte.

Exercice I.9.10. (Distance de Hausdorff (•••))

Soit (X, d) un espace métrique. On note \mathcal{K} l'ensemble des parties *compactes* de X . Pour tous K_1, K_2 dans \mathcal{K} , on définit la quantité

$$d_H(K_1, K_2) = \max \left(\sup_{x_1 \in K_1} d(x_1, K_2), \sup_{x_2 \in K_2} d(x_2, K_1) \right).$$

a) Montrer que les sup dans l'expression ci-dessus sont en fait des max, et que $d_H(\cdot, \cdot)$ définit une distance sur \mathcal{K} .

b) Explorer la possibilité de définir une telle quantité afférentes à deux ensembles si l'on ne se restreint pas à des compacts.

c) Donner l'expression de la distance d'un compact K à sa frontière ∂K pour les formes géométriques suivantes de \mathbb{R}^2 (muni de la distance euclidienne standard) : cercle, segment, disque, carré, rectangle, triangle, ellipse.

d) Expliquer comment cette notion peut être utilisée pour *métriser* l'ensemble des fonctions continues de l'intervalle $[0, 1]$ dans \mathbb{R} , et vérifier que la distance ainsi construite diffère de celle issue la norme de la convergence uniforme définie par $d_\infty(f, g) = \max_{[0, 1]} |f(x) - g(x)|$.

e) (•••) Montrer que si X est complet, alors l'espace métrique (\mathcal{K}, d_H) l'est aussi.

Exercice I.9.11. (••) Soit (X, d) un espace métrique, et A une partie non vide de X . La distance d'un point x de X à A est définie (voir définition I.2.3) comme l'infimum des distances de x à a , pour a parcourant A .

Montrer que l'application $d(\cdot, A)$ de X dans \mathbb{R}_+ qui à x associe $d(x, A)$ est 1 - *lipschitzienne*, c'est à dire que

$$|d(x, A) - d(y, A)| \leq d(x, y).$$

Exercice I.9.12. On se place sur \mathbb{R}^2 . Analyser le problème consistant à minimiser $\|x\|_1$ sur un demi plan (on pourra faire un dessin).

Généraliser

Exercice I.9.13. (●●●) a) Pourquoi a-t-on exclu le cas $p \in [0, 1[$ dans la définition des normes p ? Qu'advient-il de la quantité

$$C_P(x) = \sum_{k=1}^d |x_k|^p$$

quand, pour un $x \in \mathbb{R}^d$ donné, on fait tendre p vers 0? On notera $C_0(x)$ cette limite

b) Quel peut être l'intérêt de considérer de telles expressions pour p petit?

Exercice I.9.14. (●●) Préciser les valeurs des constantes d'équivalences optimales entre la norme ∞ et les différentes normes p , pour $p \in [1, +\infty[$.

Qu'advient-il de ces constantes lorsque la dimension n de l'espace tend vers $+\infty$?

Exercice I.9.15. (★) La direction d'une école d'ingénieurs prestigieuse décide facétieusement de changer sa procédure de calcul des moyennes, en la remplaçant par (on désigne par x_1, \dots, x_n les notes d'un élève)

$$m_p = \frac{1}{n^{1/p}} \|x\|_p,$$

pour un certain $p \in]1, +\infty]$.

a) Justifiez le fait qu'il s'agit bien d'une moyenne, et expliquer pourquoi l'on peut s'attendre à ce que les élèves se réjouissent à première vue de cette nouvelle.

b) S'agissant d'un concours, seul le classement est véritablement important. Dans cette optique, expliquer pourquoi certains compétiteurs puissent se sentir lésés, d'autres au contraire avantagés, en précisant les profils de ces deux types d'élèves.

Exercice I.9.16. (●●) Soit f une fonction continue de \mathbb{R}^n dans \mathbb{R} .

a) Montrer que si l'on a

$$\lim_{\|x\| \rightarrow +\infty} f(x) = +\infty$$

alors l'image réciproque par f de tout compact est un compact.

b) Montrer réciproquement que si l'image réciproque par f de tout compact est un compact, alors $|f(x)|$ tend vers $+\infty$ quand $\|x\|$ tend vers $+\infty$.

c)(●●●) Montrer que, si $n \geq 2$, alors la conclusion de la question précédente peut être précisée : $f(x)$ converge vers $+\infty$ quand $\|x\|$ tend vers $+\infty$, ou $f(x)$ converge vers $-\infty$ quand $\|x\|$ tend vers $+\infty$. Qu'en est-il du cas $n = 1$?

d) Soit f une fonction continue qui vérifie la propriété du a) (on dit que f est *coercive*, ou parfois dans certains contextes que f est *propre*). Montrer que f est minorée sur \mathbb{R}^n , et qu'elle atteint son minimum.

Exercice I.9.17. (●●) Donner un exemple d'application de \mathbb{R}_+ dans \mathbb{R}_+ qui vérifie $|T(x) - T(y)| < |x - y|$ pour tous $x \neq y$, mais qui n'est pas contractante.

Exercice I.9.18. (●●) Soit (X, d) un espace métrique complet et T une application de (X, d) dans lui-même. On suppose qu'il existe $p \in \mathbb{N}$ tel que

$$T^p = \underbrace{T \circ T \circ \dots \circ T}_p \text{ fois}$$

soit contractante. Montrer que T admet un unique point fixe.

Exercice I.9.19. (●)

- a) Quelle est la norme (subordonnée à la norme euclidienne) d'une application de \mathbb{R}^n dans lui-même représentée dans la base orthonormée canonique de \mathbb{R}^n par une matrice diagonale $A = \text{diag}(a_1, \dots, a_n)$?
- b) Quelle est la norme d'une application représentée dans la base orthonormée canonique de \mathbb{R}^n par une matrice A symétrique ?

Exercice I.9.20. (•)

On considère l'espace vectoriel des suites bornées

$$\ell^\infty = \{u = (u_n) \in \mathbb{R}^{\mathbb{N}}, \sup |u_n| < +\infty\} ,$$

muni de la norme de la convergence uniforme $\|u\| = \sup |u_n|$.

Montrer que cet espace est complet, et que sa boule unité fermée n'est pas compacte.