

E un \mathbb{R} -espace de dimension finie, U un ouvert de E , F un \mathbb{R} -espace de dimension finie.

I) Différentiabilité

1) Définition, premières propriétés

Déf: $f: U \rightarrow F$ est différentiable en $a \in U$ si il existe $L \in \mathcal{L}(E, F)$ tel que $f(a+h) = f(a) + L(h) + o(\|h\|)$.

En application L est appelée différentielle de f en a et notée $df(a)$.

Ex: Pour $E=F=\mathbb{R}$, différentiable \Leftrightarrow dérivable.

Prop: $\lambda \in \mathbb{R}$, $f: U \rightarrow F$, $a \in U$. Si f est différentiable en a alors λf est différentiable en a et $d(\lambda f)(a) = \lambda df(a)$.

* $f, g: U \rightarrow F$, $a \in U$. Si f et g sont différentiables en a alors $f+g$ est différentiable en a et $d(f+g)(a) = df(a) + dg(a)$.

* $f: U \rightarrow F$, $a \in U$, $g: U' \rightarrow G$ avec G \mathbb{R} -espace de dimension finie et U' ouvert de F tq. $f(U) \subset U'$. Si f est différentiable en a et g est différentiable en $f(a)$ alors $g \circ f$ est différentiable en a et $d(g \circ f)(a)$

$$= dg(f(a)) \circ df(a).$$

* f différentiable en $a \Rightarrow f$ continue en a .

Prop/Déf: Soit $f: U \subset \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ différentiable en $a \in U$. Si \mathbb{R}^n est muni d'un produit scalaire, il existe un unique vecteur réel noté $\operatorname{grad} f(a)$ tel que $\forall h \in \mathbb{R}^n$, $df(a).h = (\operatorname{grad} f(a), h)$.

2) Dérivées partielles

Déf: $f: U \rightarrow F$ dérivable en $a \in U$ selon $h \in E$ si $t \mapsto f(a+th)$ est dérivable en 0; sa dérivée est appelée dérivée directionnelle en a selon h et notée $d_h f(a)$.

* h est un vecteur de la base canonique de E , la dérivée directionnelle est appelée dérivée partielle selon i ; et notée $\frac{\partial f}{\partial x_i}(a)$.

Prop: Si f est différentiable en a alors les dérivées directionnelles existent dans toutes les directions et on a $d_h f(a) = df(a).h$.

Ex: La réciproque est fausse : soit $f: \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}$ $\begin{cases} (x,y) \mapsto \frac{xy^2}{x+y^2} & \text{sur } \mathbb{R}^2 \setminus \{(0,0)\} \\ 0 & \text{à }(0,0) \end{cases}$

$d_{(0,1)} f(0) = d_{(1,0)} f(0) = 0$, mais $d_{(1,1)} f(0) = \frac{1}{2} \neq d_{(0,1)} f(0) + d_{(1,0)} f(0)$.

Déf: Soit $f = \begin{pmatrix} f_1 \\ f_2 \end{pmatrix}: U \rightarrow \mathbb{R}^2$ différentiable en a . La matrice

jacobienne de f en a est la matrice $J_f(a) = \left(\frac{\partial f_i}{\partial x_j}(a) \right)_{1 \leq i \leq 2, 1 \leq j \leq n}$ (matrice de $df(a)$ dans la base canonique).

3) Inégalité des accroissements finis

Th: Soit $[a; b] \subset U$. Si f est différentiable sur U et $\exists M > 0$ tel que $\|df(x)\| \leq M \forall x \in [a; b]$ alors $\|f(b) - f(a)\| \leq M|b-a|$

Prop: $f: U \rightarrow F$ est dite de classe C^1 si elle est différentiable en tt pt de U et $x \mapsto df(x)$ est continue de U dans $\mathcal{L}(E, F)$.

Contre-ex: $f(x) = x^2 \sin\left(\frac{1}{x}\right)$ sur $\mathbb{R} \setminus \{0\}$ et 0 en 0; dérivable partout, dérivée non continue en 0.

Th: $f: U \rightarrow F$ est de classe C^1 si elle admet des dérivées partielles

$\frac{\partial f}{\partial x_i}$ en tt point de U et ces dérivées partielles sont continues.

II) Inversion locale, fonctions implicites

1) Inversion locale

Déf: Soit V un ouvert de F , $f: U \rightarrow V$ est un C^1 -diffeomorphisme si f est bijective et f et f^{-1} sont C^1 .

Ex: $\mathbb{R}^3 \rightarrow \mathbb{R}^3$ est un homéomorphisme de \mathbb{R} dans \mathbb{R} mais pas un C^1 -diffeomorphisme.

Prop: Soit $f: U \rightarrow V$ bijective différentiable en tout pt de U : f C^1 -difféomorphisme $\Leftrightarrow \forall a \in U$, $df(a) \in \operatorname{Isom}(E, F)$.

Th (Inversion locale): Soit $f: U \rightarrow E$ \mathcal{C}^1 , soit $a \in U$ tel que $df(a) \in \text{Isom}(E, F)$.

Alors il existe un voisinage ouvert V de a et un voisinage ouvert W de $f(a)$ tel que f soit un \mathcal{C}^1 -difféomorphisme de V dans W .

Application: Injectivité de l'exponentielle de $M_n(\mathbb{C})$ dans $G_n(\mathbb{C})$. [DEVS]

Th (Chgt de coordonnées): f_1, \dots, f_m des fonctions de classe \mathcal{C}^1 sur un voisinage Ω d'un point $a \in \mathbb{R}^n$. Les relations $x_i = f_i(z_1, \dots, z_n)$ définissent un chgt de coordonnées sur un voisinage de a si le jacobien $Jf(a)$ est inversible.

Th (Inversion globale): Soit $f: U \rightarrow E$ de classe \mathcal{C}^1 . Si f est injective sur U et $\forall x \in U$, $Jf(x)$ est inversible, alors $f(U)$ est un ouvert de E et f un \mathcal{C}^1 -difféomorphisme de U dans $f(U)$.

Th (Hadamard-Lévy): Soit $f: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^m$ \mathcal{C}^1 . On a équivalence entre:
 * f est un difféomorphisme de \mathbb{R}^n sur \mathbb{R}^m
 * f est propre (l'image de tout compact est compact) et $\forall u \in \mathbb{R}^m$, $Jf^{-1}(u)$ est inversible.

2) Fonctions implicites

Th (fonction implicite): Soit U' un ouvert de $E \times F$, (a, b) un pt. de U' , $f: (x, y) \mapsto f(x, y)$ une application \mathcal{C}^1 de U dans F tel que $f(a, b) = 0$ et $J_y f(a, b)$ la matrice jacobienne formée des dérivées partielles selon y est inversible.

Alors l'équation $f(x, y) = 0$ peut être résolue localement par rapport à une variable y : il existe V un voisinage ouvert de a dans \mathbb{R}^n , W un voisinage ouvert de b dans \mathbb{R}^m avec $V \times W \subset U'$ et $\varphi: V \rightarrow W$

de classe \mathcal{C}^1 , unique, telle que
 $x \in V, y \in W$ et $f(x, y) = 0 \Leftrightarrow x \in V$ et $y = \varphi(x)$.

(F Annexe).

φ est appelée fonction implicite définie par f sur un voisinage de (a, b) .

Def: Soit $V \subset \mathbb{R}^n$, $a \in V$, $d \in \mathbb{N}$. V est lisse en a de dim d si $\exists F$ un difféomorphisme d'un voisinage ouvert U de a dans \mathbb{R}^n sur $F(U)$ voisinage ouvert de 0 dans \mathbb{R}^d qui transforme V en un d de dim d , i.e. $F(V \cap U) = V' \cap F(U)$, $V' = \mathbb{R}^d \times \{0\} \subset \mathbb{R}^n$. V est une sous-variété de dim d de \mathbb{R}^n si V est lisse en chacun de ses points.

Def: Soit $V \subset \mathbb{R}^n$, $a \in V$, $v \in \mathbb{R}^n$ est tangent en a à V si $\exists y: I \rightarrow R$ dérivable avec I un intervalle ouvert contenant 0 telle que $y(I) \subset V$, $y(0) = a$ et $y'(0) = v$.

Th: Si V est lisse en a de dim d , ses vecteurs tangents en a forment un d de dim d appelé espace vectoriel tangent en a à V .

Th (sous-variétés): Soient $V \subset \mathbb{R}^n$, $a \in V$, $d \in \mathbb{N}$. On a équivalence entre:

- V est lisse en a de dim d .
- $\exists U'$ ouv. ouvert de a dans \mathbb{R}^n et $m-d$ tel que $f: U' \rightarrow \mathbb{R}^{m-d}$ tel que $x \in V \cap U' \Leftrightarrow (x, 0) \in f^{-1}(0)$ et $df_x(f_x), \dots, df_{x, m-d}(x)$ sont indépendantes.
- $\exists U'$ ouv. ouvert de a , U'' ouv. ouvert de (a_1, \dots, a_d) de \mathbb{R}^d et $m-d$ tel que $g: U'' \rightarrow \mathbb{R}^{m-d}$ tel que $x \in V \cap U' \Leftrightarrow \begin{cases} (x_1, \dots, x_d) \in U'' \\ x_{d+1} = g_1(x_1, \dots, x_d) \\ \vdots \\ x_m = g_{m-d}(x_1, \dots, x_d) \end{cases}$

- $\exists U$ ouv. ouvert de a de \mathbb{R}^n , Ω ouv. ouvert de 0 de \mathbb{R}^d et m tel que $\varphi_i: \Omega \rightarrow \mathbb{R}^{m-d}$ telles que $\varphi: u = (u_1, \dots, u_d) \mapsto (\varphi_1(u_1), \dots, \varphi_m(u_d))$

soit un homéomorphisme de U sur $V \cap U$ avec $\alpha = \phi(\beta)$ et telle que $d\phi(\beta)$ soit injective.

III) Dérivées d'ordre supérieur

On définit les dérivées partielles en un pt a des composantes $\frac{\partial f}{\partial x_i}(a)$

$$\text{Lorsqu'elles existent : } \frac{\partial^2 f}{\partial x_i \partial x_j}(a) = \frac{\partial}{\partial x_i} \left(\frac{\partial f}{\partial x_j}(a) \right).$$

On dit que f est 2 fois différentiable en a si $x \mapsto Df(x)$ est différentiable en a . On note $D^2 f(a) = D(Df)(a)$ la différentielle seconde.

Déf: Soit $f: U \subset \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ 2 fois différentiable. On appelle matrice hessienne de f la matrice $D^2 f(a) = \left(\frac{\partial^2 f}{\partial x_i \partial x_j}(a) \right)_{1 \leq i, j \leq n}$

Th (Schwarz). $U \subset \mathbb{R}^n$, $f: U \rightarrow \mathbb{R}$ deux fois différentiables.

$$\text{Alors } \frac{\partial^2 f}{\partial x_i \partial x_j}(a) = \frac{\partial^2 f}{\partial x_j \partial x_i}(a), \text{ pour } 1 \leq i, j \leq n.$$

Rq: La hessienne est symétrique d'après le théorème de Schwarz.

Rq: On définit les dérivées d'ordre supérieur par récurrence.

$\forall k \geq 1$, $D^k f(a)$ est une application de $(\mathbb{R}^n)^k$ dans \mathbb{R} .

Déf: f est de classe C^k si f admet des dérivées partielles continues à tout ordre $\leq k$. f est C^∞ si f est C^k pour tout k .

Formules de Taylor

Th (Taylor - Young): Si f est k fois différentiable en $a \in U$ on a $f(a+h) = f(a) + Df(a)h + \dots + \frac{1}{k!} D^k f(a). (h)^k + o(|h|^k)$ en 0 dans \mathbb{R}^n .

Th (Taylor reste intégral): Si f est C^{k+1} sur U et $[a; a+h] \subset U$,

$$\text{on a } f(a+h) = f(a) + Df(a)h + \dots + \frac{1}{k!} D^k f(a)h^k + \int_0^1 \frac{(1-t)^k}{k!} D^{k+1} f(a+t)(h)^{k+1} dt$$

Appl: Lemme de Morse [DEV].

IV) Problèmes d'extrema

Sat: Pour $C \subset E$, $f: E \rightarrow \mathbb{R}$, chercher inf $\{f(x), x \in C\}$

Prop (Condition nécessaire de minimalité): si $f: C \rightarrow \mathbb{R}$ admet un minimum local en $x^* \in C$ et est différentiable en x^* alors $Df(x^*) = 0$.

Ex: $x \mapsto x^3$: $f'(0) = 0$ mais 0 \neq minimum local.

Prop (condition de minimalité locale du second ordre):

Sur un ouvert de E , $x^* \in E$, $f: C \rightarrow \mathbb{R}$ deux fois différentiable en x^* .

$\exists \epsilon$ $Df(x^*) = 0$ alors :

- x^* min. local de $f \Rightarrow D^2 f(x^*) \text{ pos.}$

- $D^2 f(x^*) \text{ stff. pos} \Rightarrow x^*$ min. local strict de f .

Ex: $x \mapsto x^4$: 0 min. local de f mais $f''(0) = 0$, pas de positivité stricte.

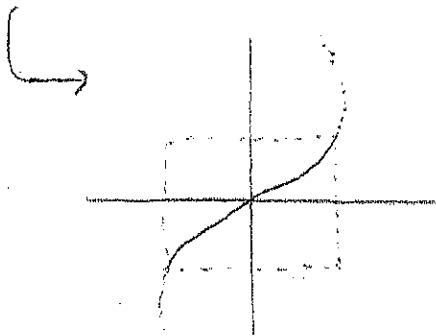
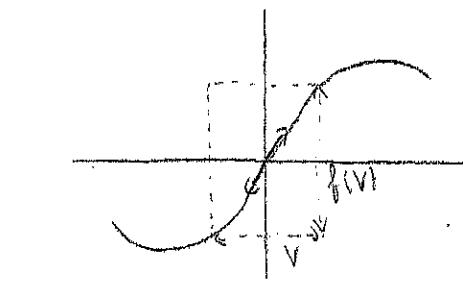
Th (Extrema loci): Soient $f: g_1, \dots, g_n \in C^1(U, \mathbb{R})$, on pose $\Gamma = \{x \in U / \forall i \in \{1, \dots, n\}, g_i(x) = 0\}$.

Si $f|_\Gamma$ admet un extrémum relatif en $a \in \Gamma$ et $(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$ est une famille libre alors $\exists \lambda_1, \dots, \lambda_n$ tels que $Df(a) = \sum \lambda_i dg_i(a)$.

Appl: Diagonalisation des endomorphismes symétriques.

Inversion locale :

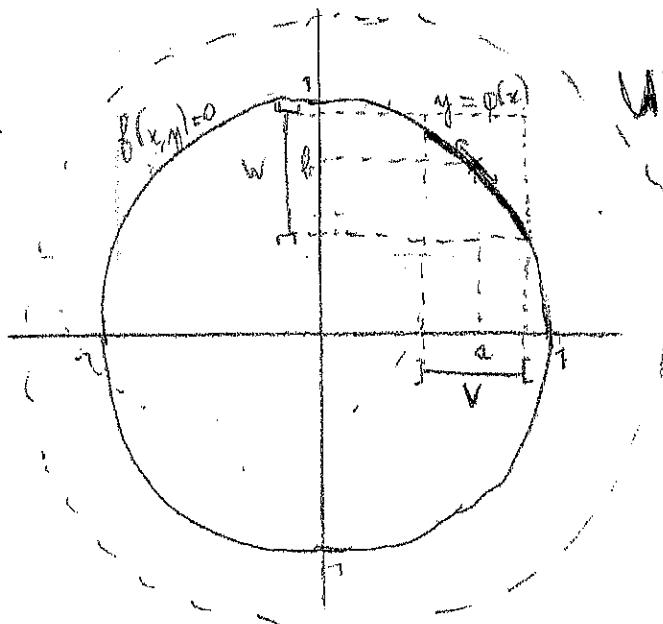
$x \mapsto \sin x$ au voisin. de 0



Ext^o implicite

$f: \mathbb{R} \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$

$$(x, y) \mapsto x^2 + y^2 - 1$$



Réf:

[RON] ROUVIERE, petit guide de calcul différentiel

[GOU] GOURDON, Analyse

[D-AJ] BECK.MALICK.FEYRE, Objectif Aggrégation

Lemme de Morse

Théorème: Soit $f: V \rightarrow \mathbb{R}$ une fonction de classe C^3 sur un ouvert V de \mathbb{R}^n contenant 0.

On suppose que $Df(0) = 0$ et $D^2 f(0)$ est une forme quadratique non dégénérée de signature $(p, n-p)$.

Alors il existe deux voisinages V et W de 0 dans \mathbb{R}^n et $\varphi: V \rightarrow W$ un C^1 -diffeomorphisme tel que $\varphi(0) = 0$ et pour tout $x \in V$, si on note $\varphi(x) = (x_1, \dots, x_m)$:

$$f(x) - f(0) = x_1^2 + \dots + x_p^2 - x_{p+1}^2 - \dots - x_m^2$$

On commence par montrer le lemme suivant.

Lemme: Soit S l'ensemble des matrices symétriques réelles de taille m .

Soit $A_0 \in S$, inversible.

Alors il existe un voisinage V de A_0 dans S et une application Ψ de classe C^2 de V dans $M_n(\mathbb{R})$ tels que $\forall A \in V, A = t \Psi(A) A_0 \Psi(A)^t$.

Preuve: On considère l'application suivante:

$$\Psi: M_n(\mathbb{R}) \rightarrow S$$

$$M \mapsto tMA_0M$$

Ψ est polynomiale, donc de classe C^2 .

En munissant $M_n(\mathbb{R})$ d'une norme subordonnée, on a pour $\| \cdot \|$ sur $M_n(\mathbb{R})$:

$$\begin{aligned}\Psi(I_m + H) - \Psi(I_m) &= t^* HA_0 + A_0 H + t^* H A_0 H \\ &= t^*(A_0 H) + A_0 H + H t^* E(H)\end{aligned}$$

où $E(H) \xrightarrow[H \rightarrow 0]{} 0$

On a donc

$$D\Psi(I_m)(H) = t^*(A_0 H) + A_0 H.$$

Cette application est clairement surjective, car:
 $\forall A \in S, A = D\Psi(I_m)\left(\frac{1}{2}A_0^{-1}A\right)$.
de plus, $\text{Ker}(D\Psi(I_m)) = \{H \in M_n(R) \mid A_0 H$
est antisymétrique}.

Or, $M_n(R) = S \oplus \{M \mid M \text{ antisymétrique}\}$.

On pose $F := \{H \in M_n(R) \mid A_0 H \in S\}$.

On a donc:

$$M_n(R) = F \oplus \text{Ker}(D\Psi(I_m))$$

Si l'on note Ψ la restriction de Ψ à F ,
on a $\text{Ker}(D\Psi(I_m)) = \text{Ker}(D\Psi(I_m)) \cap F$
 $= \{0\}$
donc $D\Psi(I_m)$ est bijective.

Ainsi, par théorème d'inversion locale,
il existe un voisinage ouvert V de I_m ,
que l'on peut quitter à les intersecter
supposés inclus dans l'ouvert $GL_n(R)$,
tel que Ψ réalise un C^1 -diffeomorphisme
entre V et $V := \Psi(V)$.

V est un voisinage (ouvert) de $A_0 = \Psi(I_m)$ dans
 S et: $\forall A \in V, A = t^* \Psi^{-1}(A) A_0 \Psi^{-1}(A)$.

D'où le résultat en considérant $\Phi = \Psi^{-1}$.

Preuve du théorème:

La formule de Taylor avec reste intégral à l'ordre 1 s'écrit, au voisinage de 0,

$$\begin{aligned} f(x) - f(0) &= Df(0)(x) + \int_0^1 (1-t) D^2 f(tx)(x) dt \\ &= \int_0^1 (1-t) D^2 f(tx)(x) dt \end{aligned}$$

On identifie la forme quadratique (pour $x \neq 0$) $Q(x) = \int_0^1 (1-t) D^2 f(tx) dt$ à la matrice symétrique associée, et x à son vecteur colonne, de sorte que $f(x) = f(0) + {}^t x Q(x) x$.

Comme f est de classe C^2 , par théorème de dérivation sous le signe intégrale, Q est une fonction de classe C^1 de x .

On a $Q(0) = \frac{1}{2} D^2 f(0)$, donc par hypothèse $Q(0)$ est une matrice symétrique inversible.

D'après le lemme, il existe un voisinage V de 0 et une application Ψ de classe C^1 sur $Q(V)$ à valeurs dans $GL(\mathbb{R})$ telle que :

$$Q(x) = {}^t (\Psi(x)) Q(0) (\Psi(x)), \quad \forall x \in V.$$

On note $M = \Psi Q$.

Comme $Q(0)$ a la même signature que $D^2 f(0)$, à savoir $(q, m-p)$, le théorème de réduction des formes quadratiques sur \mathbb{R} affirme qu'il existe $P \in GL(n(\mathbb{R}))$, telle que $\forall x \in \mathbb{R}^n$,

$${}^t x M {}^t P Q(0) P x = m_1^2 + \dots + m_p^2 - m_{p+1}^2 - \dots - m_n^2$$

$$\begin{aligned} \text{On obtient : } f(x) - f(0) &= {}^t(P^{-1}M(x)x) {}^tPQ(0) P(P^{-1}M(x)x) \\ &= u_1^2 + \dots + u_p^2 - M_{pp} = -u^2 \end{aligned}$$

avec $u = P^{-1}M(x)x$.

La fonction $\varphi : x \mapsto P^{-1}M(x)x$ est de classe C^1 , et vérifie $\varphi(0) = 0$.

On souhaite montrer que c'est un C^1 -difféomorphisme entre deux voisinages de 0.

Pour cela, on remarque que
 $D\varphi(0) = P^{-1}M(0)$

$$\text{En effet, } \varphi(h) - \varphi(0) = P^{-1}M(0) \cdot h = P^{-1}(M(h) - M(0)) \cdot h = o(h).$$

Ainsi, $D\varphi(0) \in GL_n(\mathbb{R})$.

On conclut par théorème d'inversion locale

□

Source :

Rouvière, petit guide du calcul différentiel

Surjectivité de l'exponentielle

Lemme: Soit $A \in M_n(\mathbb{C})$. Alors $\exp(A) \in \mathbb{C}[A]$.

Preuve: On a $\exp(A) = \lim_{n \rightarrow +\infty} P_n(A)$,

avec $P_n = \sum_{k=0}^n \frac{1}{k!} X^k \in \mathbb{C}[X]$. Or, $\mathbb{C}[A]$ est un

sous-espace vectoriel de $M_n(\mathbb{C})$, donc de dimension finie, et donc en particulier fermé.

Donc $\exp(A) \in \mathbb{C}[A]$.

Proposition: Soit $A \in \mathrm{GL}_n(\mathbb{C})$. Il existe

$P \in \mathbb{C}[X]$ tel que $A = \exp(P(A))$.

Cela implique la surjectivité de
 $\exp: M_n(\mathbb{C}) \rightarrow \mathrm{GL}_n(\mathbb{C})$

Preuve: D'après le lemme, \exp induit une application (que l'on notera \exp) de $\mathbb{C}[A]$ dans $\mathbb{C}[A]^*$.

C'est un morphisme de groupes de $(\mathbb{C}[A], +)$ dans $(\mathbb{C}[A]^*, \times)$.

Nous allons montrer que $\exp(\mathbb{C}[A])$ est un ouvert fermé du connexe $\mathbb{C}[A]^*$.

$\forall H \in \mathbb{C}[A]$, $\exp(0+H) = \exp(0) + H + o(\|H\|)$,

donc $\mathrm{D}\exp(0) = \mathrm{Id} \in \mathrm{GL}_n(\mathbb{C})$.

Comme \exp est de classe \mathcal{C}^1 sur $\mathbb{C}[A]$, on peut appliquer le théorème d'inversion locale.

Il existe donc un voisinage ouvert U de 0 dans $\mathbb{C}[A]$ et un voisinage ouvert V de $\exp(0) = I_n$ dans $((\mathbb{C}[A])^*$ tels que \exp soit un C^1 -diffeomorphisme de U dans V .

- On montre que $\exp(\mathbb{C}[A])$ est ouvert dans $\mathbb{C}[A]^*$:

Soit $M \in \exp(\mathbb{C}[A])$. $I_n \in V$ donc $M \in MV$ et $MV \subseteq \exp(\mathbb{C}[A])$ (car \exp est un morphisme).
 MV est l'image réciproque de V par l'application continue $N \in \mathbb{C}(A) \mapsto M^{-1}N$.
 MV est donc un ouvert, donc un voisinage ouvert de M dans $\exp(\mathbb{C}[A])$.
 Donc $\exp(\mathbb{C}[A])$ est un ouvert dans $((\mathbb{C}[A])^*$.

- On montre que $\exp(\mathbb{C}[A])$ est fermé dans $\mathbb{C}[A]^*$:

Soit $M \in (\mathbb{C}[A])^*$. Si $M \in \exp((\mathbb{C}[A])^*)^c$, alors $MV \subseteq \exp((\mathbb{C}[A])^*)^c$.

On peut donc écrire :

$$\exp((\mathbb{C}[A])^*)^c = \bigcup_{M \in \exp((\mathbb{C}[A])^*)^c} MV$$

C'est une union d'ouverts, donc $\exp((\mathbb{C}[A])^*)^c$ est ouvert, donc $\exp((\mathbb{C}[A])^*)$ est fermé dans $\mathbb{C}[A]^*$.

- On montre que $(\mathbb{C}[A])^*$ est connexe.

Soient $M, N \in (\mathbb{C}[A])^*$. Soit $P = \det(KM + (-\lambda)N)$,

$\lambda \in \mathbb{C}[X]$. On note $S_2 = \mathbb{C} \setminus Z(P)$.

$Z(P)$ est fini, alors S_2 est connexe par arcs, et contient 0 et 1 , puisque $\det(M), \det(N) \neq 0$.

Soit donc $\delta: [0,1] \rightarrow \Omega$ un chemin continu reliant 0 à 1 dans Ω .

$$\tilde{\gamma}: [0,1] \rightarrow ([A])^X$$

$$t \mapsto \delta(t)M + (1-\delta(t))N$$

est bien définie et réalise un chemin continu de M à N dans $([A])^X$.

Ainsi, $\exp([A]) = ([A])^X$, ce qui donne le résultat voulu.

□

Source : Zavidovique, Un cours de maths

