

**Equations différentielles linéaires aux coefficients constants.
Système de n équations d'ordre 1.**

$$\frac{d\mathbf{x}}{dt} = A\mathbf{x}$$

où $\mathbf{x}(t) \in K^n$, $A \in M_n(K)$, $K = \mathbb{R}$ ou \mathbb{C} . Une solution est une fonction $\varphi : I \rightarrow K^n$ définie sur un intervalle I et vérifiant $\frac{d}{dt}\varphi(t) = A\varphi(t)$.

Propriétés générales.

1. L'ensemble des solutions est un espace vectoriel sur K (conséquence de la linéarité de l'équation). [On verra que sa dimension est n .]

2. Si $\varphi(t)$ est une solution et $c \in \mathbb{R}$, alors $\varphi(t+c)$ l'est aussi (conséquence du fait que A est à coefficients constants).

3. *Complexification.* Soit A une matrice réelle et $\mathbf{z}(t)$ une solution complexe: $\mathbf{z}' = A\mathbf{z}$, ($\mathbf{z}(t) \in \mathbb{C}^n$). Alors la partie réelle $\mathbf{x} = \text{Re}\mathbf{z}$ et la partie imaginaire $\mathbf{y} = \text{Im}\mathbf{z}$ de la solution complexe sont des solutions réelles.

Il est donc utile de chercher dès le début des solutions complexes.

4. Chaque vecteur propre v de A , $Av = \lambda v$, engendre une solution "exponentielle": $\varphi(t) = e^{\lambda t}v$. Si A est diagonalisable, une base de vecteurs propres donne n solutions de $x' = Ax$ linéairement indépendantes (et toute autre solution sera leur combinaison linéaire).

5. *Changement de base.* Par un changement linéaire des variables, $x = Py$, le système différentiel $x' = Ax$ est transformé en $y' = By$ avec $B = P^{-1}AP$. Pour simplifier le système on cherche à réduire la matrice A à une forme "simple".

Si A est diagonalisable, $B = \text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$, le système $y' = By$ est scindé (séparation des variables complète): $y'_1 = \lambda_1 y_1, \dots, y'_n = \lambda_n y_n$. Toutes ses solutions sont donnés par $y_1(t) = c_1 e^{\lambda_1 t}, \dots, y_n(t) = c_n e^{\lambda_n t}$. [Ici $c_i = y_i(0)$.]

Si A n'est pas diagonalisable, on peut la ramener à la forme de Jordan (sur \mathbb{C}); dans ce cas le système se décompose en sous-systèmes indépendants dans chaque bloc de Jordan (séparation des variables partielle).

Dans un bloc de Jordan de dimension k on a le système

$$y'_1 = \lambda y_1, y'_2 = \lambda y_2 + y_1, \dots, y'_k = \lambda y_k + y_{k-1}.$$

La solution générale est $y_1(t) = c_1 e^{\lambda t}, y_2(t) = (c_1 t + c_2) e^{\lambda t}, \dots, y_k(t) = (c_1 t^{k-1} + c_2 t^{k-2} + \dots + c_k) e^{\lambda t}$. [Ici $c_i = y_i(0)$.]

Conclusion: pour tout $y_0 \in \mathbb{C}^n$ il existe une solution unique $y(t)$ définie sur \mathbb{R} vérifiant la condition initiale $y(0) = y_0$. En revenant au système $x' = Ax$, on a :

6. Théorème d'existence et d'unicité. Pour tout $x_0 \in K^n$ il existe une solution unique $x(t)$ définie sur \mathbb{R} à valeurs dans K^n vérifiant la condition initiale $x(0) = x_0$.

Corollaire. L'espace vectoriel S des solutions de l'équation $x' = Ax$ définies sur \mathbb{R} est de dimension n . Pour tout $t_0 \in \mathbb{R}$ l'application $S \rightarrow K^n$ qui à une solution φ fait correspondre sa valeur $\varphi(t_0)$ est un isomorphisme. Les conditions suivantes sont équivalentes:

- 1) $(\varphi_1, \dots, \varphi_n)$ est une base de S ;
- 2) Pour un t_0 , $(\varphi_1(t_0), \dots, \varphi_n(t_0))$ est une base de K^n ;
- 3) Pour tout t , $(\varphi_1(t), \dots, \varphi_n(t))$ est une base de K^n .

7. Structure des solutions. En réduisant la matrice A à la forme de Jordan, on déduit que toute composante d'une solution *complexe* est une combinaison linéaire de fonctions $t^p e^{\lambda t}$, où λ est une valeur propre de A et $p < l_\lambda$; ici où l_λ est la dimension maximal des blocs de Jordan associés à λ (qui est égale à la multiplicité de λ dans le polynôme minimal de A).

Toute composante d'une solution *réelle* est donc une combinaison linéaire de termes $t^p e^{\lambda t}$ (pour les valeurs propres λ réelles) et $t^p e^{\alpha t} \cos(\beta t)$ et $t^p e^{\alpha t} \sin(\beta t)$, (pour les valeurs propres λ complexes, où $\lambda = \alpha + i\beta$), et $p < l_\lambda$.

8. Proposition. *Comportement asymptotique des solutions.* Les propriétés suivantes sont équivalentes:

- 1) Pour toute solution φ on a $\varphi(t) \rightarrow 0$ quand $t \rightarrow \infty$.
- 2) Toutes les valeurs propres de A ont une partie réelle négative.

9. Equation scalaire d'ordre n .

$$\frac{d^n}{dt^n} x + a_{n-1} \frac{d^{n-1}}{dt^{n-1}} x + \dots + a_1 \frac{d}{dt} x + a_0 x = 0(*)$$

A l'équation (*) on peut associer un système différentiel équivalent d'ordre 1 en introduisant de nouvelles inconnues: $x_1 = x$, $x_2 = x'$, $x_n = x^{(n-1)}$. Le système s'écrit $x'_1 = x_2$, ..., $x'_{n-1} = x_n$, $x'_n = -(a_0 x_1 + \dots + a_{n-1} x_n)$, donc $\mathbf{x}' = A\mathbf{x}$ où $\mathbf{x} = (x, x', x'', \dots, x^{(n-1)})$ et A est la matrice compagnon:

$a_{i,i+1} = 1$, $a_{n,j} = -a_{j-1}$ et les autres éléments de A sont nuls.

On sait que le polynôme caractéristique de A est

$$p_A(z) = (-1)^n (z^n + a_{n-1} z^{n-1} + \dots + a_1 z + a_0),$$

et on sait que le polynôme minimal est égal (au signe près) au polynôme caractéristique; donc pour chaque valeur propre il y a un seul bloc de Jordan (les espaces propres sont tous de dimension 1). On en déduit:

10. Proposition. Soit $p_A(z) = (-1)^n(z - \lambda_1)^{m_1} \dots (z - \lambda_k)^{m_k}$. Les fonctions $t^{p_j} e^{\lambda_j t}$, où $j = 1, \dots, k$ et $0 \leq p_j < m_j$ forment une base (complexe) des solutions de l'équation (*).

Toute solution s'écrit donc comme $\sum_1^k q_j(t) e^{\lambda_j t}$, où $q_j(t)$ sont des polynômes, $\deg(q_j) < m_j$.

Si les coefficients a_0, \dots, a_{n-1} sont réels, une base des solutions réelles est donnée par les fonctions $t^{p_j} e^{\lambda_j t}$ (pour les λ_j réelles) et $t^{p_j} e^{\alpha_j t} \cos(\beta_j t)$ et $t^{p_j} e^{\alpha_j t} \sin(\beta_j t)$ (pour les λ_j complexes, où $\lambda_j = \alpha_j + i\beta_j$) et $0 \leq p_j < m_j$.

En vu de ce résultat, on n'a pas besoin de passer par la matrice, mais on peut traiter l'équation (*) directement (on démontre directement le lemme suivant):

Lemme. λ est une racine du polynôme caractéristique

$x^d - a_1 x^{d-1} - \dots - a_{d-1} x - a_d$ de multiplicité m si et seulement si les "monômes" $e^{\lambda t}, t e^{\lambda t}, \dots, t^{m-1} e^{\lambda t}$ vérifient l'équation différentielle (*).

Démarche à suivre: pour résoudre l'équation scalaire (*) avec la condition initiale $x(0) = c_1, x'(0) = c_2, \dots, x^{(n-1)}(0) = c_n$ il faut

1) résoudre l'équation caractéristique $z^n + a_{n-1} z^{n-1} + \dots + a_1 z + a_0$ qui se déduit directement de l'équation différentielle (sans passer par la matrice);

2) écrire la solution comme une combinaison linéaire des solutions de base explicitées dans la Proposition 10 avec des coefficients indéterminés et calculer les coefficients afin de satisfaire les conditions initiales (cela revient à résoudre un système d'équations linéaires).

Exponentielle d'une matrice.

1. Proposition. Soit $A \in M_n(\mathbb{C})$. La série

$$e^A = \sum_0^{\infty} \frac{A^n}{n!}$$

converge (absolument). La somme de la série

$$e^{tA} = \sum_0^{\infty} \frac{t^n}{n!} A^n$$

et dérivable par rapport à t et

$$\frac{d}{dt}e^{tA} = Ae^{tA}$$

2. Corollaire Pour $v \in K^n$ la solution φ_v de l'équation $x' = Ax$ vérifiant la condition initiale $\varphi_v(0) = v$ est donnée par $\varphi_v(t) = e^{tA}v$.

3. Proposition.

1. e^{tA} est l'unique solution de l'équation différentielle matricielle $\frac{d}{dt}U(t) = AU(t)$ vérifiant la condition initiale $U(0) = Id$.

2. On a $e^{(t+s)A} = e^{tA}e^{sA}$: la famille $\{e^{tA}\}$ est un "groupe à un paramètre". En particulier, e^{tA} est inversible et $(e^{tA})^{-1} = e^{-tA}$.

3. *Changement de base:* $e^{P^{-1}AP} = P^{-1}e^AP$.

Cas diagonalisable: si $A = \text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$, $e^A = \text{diag}(e^{\lambda_1}, \dots, e^{\lambda_n})$.

Donc pour calculer l'exponentielle il faut passer à une base adaptée.

8. Lemme. Si $AB + BA$, on a $e^{A+B} = e^Ae^B$.

(En particulier, $(e^A)^{-1} = e^{-A}$).

Cas général. Soit $A = \mathcal{D} + \mathcal{N}$ la décomposition de Dunford (ou de Jordan) et $\mathcal{N}^{l+1} = 0$. Alors

$$e^{tA} = e^{t\mathcal{D}+t\mathcal{N}} = e^{t\mathcal{D}}(I + t\mathcal{N} + t^2\mathcal{N}^2/2! + \dots + t^l\mathcal{N}^l/l!)$$

Utilisation des projecteurs spectraux. Rappelons que $\mathcal{D} = \sum_{i=1}^k \lambda_i \Pi_i$, où Π_i est le projecteur spectral sur le sous-espace caractéristique associé à λ_i , et $\mathcal{N} = A - \mathcal{D}$. Alors

$$e^{t\mathcal{D}} = \sum_{i=1}^k e^{\lambda_i t} \Pi_i$$

On en déduit la structure des éléments de e^{tA} en tant que fonctions de t .

Remarque. Les colonnes de e^{tA} sont les solutions du système $x' = Ax$ vérifiant les conditions initiales particulières: sa j -ème colonne ψ_j vérifie $\psi_j(0) = e_j$, le j -ème vecteur canonique.

En fait, e^{tA} contient autant d'information que n'importe quelle base des solutions:

9. Lemme. Soit $(\varphi_1, \dots, \varphi_n)$ une base des solutions de l'équation $x' = Ax$. Soit $\Phi(t)$ la matrice dont les colonnes sont $(\varphi_1, \dots, \varphi_n)$. Alors $e^{tA} = \Phi(t)\Phi(0)^{-1}$.

10. Lemme. a) Soit $(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$ les valeurs propres de A . Alors $(e^{\lambda_1}, \dots, e^{\lambda_n})$ sont les valeurs propres de e^A .
b) $\det(e^A) = e^{\text{tr}(A)}$.
(La démonstration passe par la trigonalisation.)

11. L'exponentielle et la méthode d'Euler.

Proposition. $e^A = \lim_{n \rightarrow \infty} (I + A/n)^n$.